

**格林日鑫月熠货币市场基金**

**2020 年第 3 季度报告**

**2020 年 09 月 30 日**

**基金管理人:格林基金管理有限公司**

**基金托管人:国泰君安证券股份有限公司**

**报告送出日期:2020 年 10 月 28 日**

## 目录

§1 重要提示 .....	3
§2 基金产品概况 .....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现 .....	4
3.1 主要财务指标 .....	4
3.2 基金净值表现 .....	4
§4 管理人报告 .....	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 .....	6
4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明 .....	7
4.3 公平交易专项说明 .....	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 .....	8
4.5 报告期内基金的业绩表现 .....	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 .....	8
§5 投资组合报告 .....	8
5.1 报告期末基金资产组合情况 .....	8
5.2 报告期债券回购融资情况 .....	9
5.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	9
5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	10
5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	10
5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....	10
5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	11
5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 .....	11
5.9 投资组合报告附注 .....	11
§6 开放式基金份额变动 .....	17
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 .....	18
§8 影响投资者决策的其他重要信息 .....	18
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	18
8.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	19
§9 备查文件目录 .....	19
9.1 备查文件目录 .....	19
9.2 存放地点 .....	20
9.3 查阅方式 .....	20

**§1 重要提示**

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年10月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年7月1日起至2020年9月30日止。

**§2 基金产品概况**

基金简称	格林货币	
基金主代码	004865	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年07月20日	
报告期末基金份额总额	1,207,280,270.19份	
投资目标	在严格控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的稳定增值。	
投资策略	以保证资产的安全性和流动性为基本原则，力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变动等因素充分评估的基础上，科学预计未来利率走势，择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具，进行积极的投资组合管理。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	格林基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	格林货币A	格林货币B

下属分级基金的交易代码	004865	004866
报告期末下属分级基金的份额总额	17,766,330.94份	1,189,513,939.25份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年07月01日 - 2020年09月30日)	
	格林货币A	格林货币B
1.本期已实现收益	89,729.13	4,459,852.79
2.本期利润	89,729.13	4,459,852.79
3.期末基金资产净值	17,766,330.94	1,189,513,939.25

- 1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。
- 3、本基金按日结转份额。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

###### 格林货币A净值表现

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4784%	0.0017%	0.3456%	0.0000%	0.1328%	0.0017%
过去六个月	0.8857%	0.0019%	0.6886%	0.0000%	0.1971%	0.0019%
过去一年	2.0477%	0.0029%	1.3819%	0.0000%	0.6658%	0.0029%
过去三年	8.3572%	0.0042%	4.1955%	0.0000%	4.1617%	0.0042%
自基金合同 生效起至今	9.1077%	0.0041%	4.4812%	0.0000%	4.6265%	0.0041%

###### 格林货币B净值表现

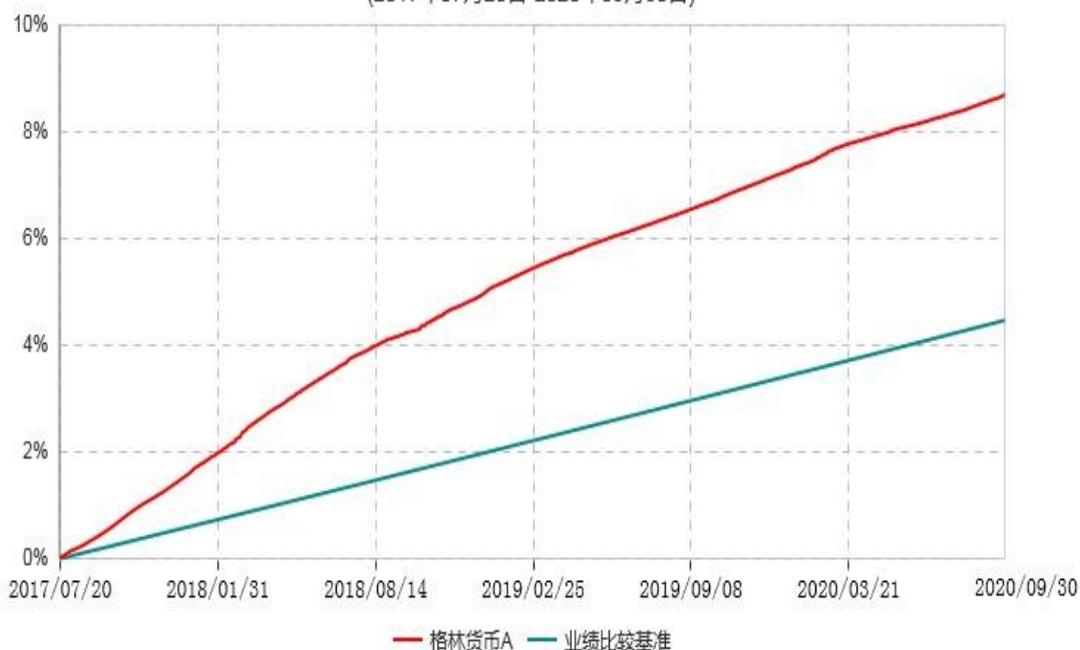
阶段	净值收益率	净值收益率	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	0.5392%	0.0017%	0.3456%	0.0000%	0.1936%	0.0017%
过去六个月	1.0082%	0.0019%	0.6886%	0.0000%	0.3196%	0.0019%
过去一年	2.2935%	0.0029%	1.3819%	0.0000%	0.9116%	0.0029%
过去三年	9.1446%	0.0042%	4.1955%	0.0000%	4.9491%	0.0042%
自基金合同生效起至今	9.9506%	0.0041%	4.4812%	0.0000%	5.4694%	0.0041%

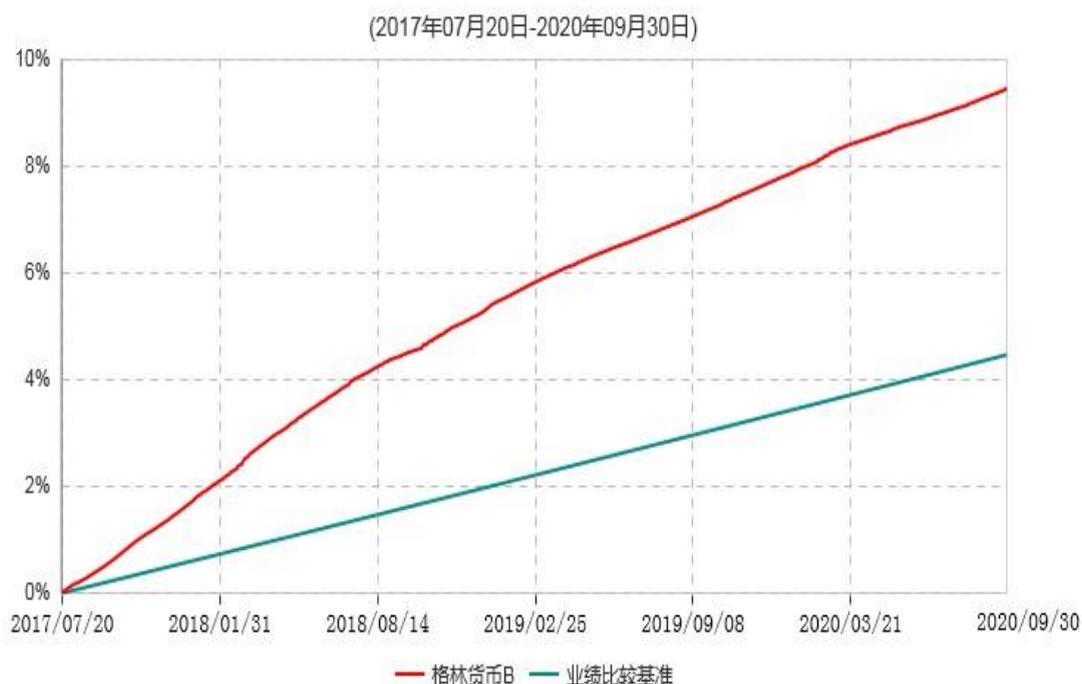
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

格林货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年07月20日-2020年09月30日)



格林货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张晓圆	本基金基金经理、格林泓鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、格林泓泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、格林泓裕一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、格林泓远纯债债券型证券投资基金基金经理、格林泓利增强债券型证券投资基金基金经理	2020-06-12	-	7	张晓圆女士，天津财经大学硕士。曾任渤海证券固定收益总部承销项目经理、综合质控部副经理、交易一部副经理、投资交易部副经理，先后从事债券承销、投资交易等工作。2018年5月加入格林基金，曾任专户投资经理，现任格林基金固定收益部基金经理。
杜钧天	本基金基金经理、格林泓裕一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、格林泓远	2020-09-14	-	6	杜钧天先生，先后在川财证券固定收益部、资产管理部担任债券交易员；曾任九州

	纯债债券型证券投资基金基金经理、格林泓泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理				证券固收投顾部债券投资经理、赣州银行金融市场部中级债券交易员。2018年加入格林基金，曾任特定客户资产管理部投资经理、固定收益部基金经理助理，现任固定收益部基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期和离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

报告期内，基金管理人利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗（包括当日、3日内、5日内）对基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020年第三季度我国抗疫工作取得的成就在全世界范围内有目共睹，在党和政府的正确领导下疫情在我国基本得到控制，但其他国家疫情二次爆发的风险仍大，地缘政治冲突升级，外部不稳定因素增加。第二季度是国债地方债的发行高峰，伴随着政府债券融资的下拨、创新直达实体的政策工具的实施，基建投资的资金端将得到有效改善，第三、四季度基建投资将维持在较高强度。从国内经济基本面来看，交通运输、住宿餐饮、互联网相关产业等持续维持较高景气度，居民消费意愿的增强和商务活动规模的恢复意味着经济内生动能显著增强。

纵观第三季度，资金利率基本符合政策利率，虽然在个别时点市场机构感受到资金紧张的氛围，但央行均通过各种灵活适度的货币政策快速得将资金面调整到政策目标附近，组合的资产配置主要集中在利率债，银行存单和回购，适度的增加杠杆，抓住了资金市场利率的波动机会，优化组合结构，在保证流动性的基础上提升了组合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内该类基金份额净值收益率为0.4784%，同期业绩比较基准收益率为0.3456%；截至报告期末格林货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内该类基金份额净值收益率为0.5392%，同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	744,209,905.74	61.62
	其中：债券	744,209,905.74	61.62

	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	458,850,883.29	37.99
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,591,047.63	0.13
4	其他资产	3,157,773.61	0.26
5	合计	1,207,809,610.27	100.00

## 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	9.23
	其中：买断式回购融资	-	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	-	0.00
	其中：买断式回购融资	-	0.00

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	58.00	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的	0.00	-

	浮动利率债		
2	30天(含)—60天	14.87	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)—90天	3.29	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)—120天	7.20	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	0.00	-
5	120天(含)—397天(含)	16.42	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	0.00	-
	合计	99.78	0.00

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限超过240天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,900,317.24	0.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,243,375.64	8.30
	其中：政策性金融债	100,243,375.64	8.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	59,987,568.01	4.97
6	中期票据	-	-
7	同业存单	577,078,644.85	47.80
8	其他	-	-
9	合计	744,209,905.74	61.64
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160403	16农发03	500,000	50,064,163.65	4.15
2	112021274	20渤海银行CD274	500,000	49,970,518.69	4.14
3	111905149	19建设银行CD149	500,000	49,950,495.12	4.14
4	111914181	19江苏银行CD181	500,000	49,935,560.38	4.14
5	112004035	20中国银行CD035	500,000	49,925,551.84	4.14
6	112010300	20兴业银行CD300	500,000	49,881,219.63	4.13
7	112016176	20上海银行CD176	500,000	49,871,375.38	4.13
8	112006159	20交通银行CD159	500,000	49,858,834.66	4.13
9	112003082	20农业银行CD082	500,000	49,506,981.09	4.10
10	200401	20农发01	300,000	29,988,396.30	2.48

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0054%
报告期内偏离度的最低值	-0.0602%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0299%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价或折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

**5.9.2** 20渤海银行CD274（代码：112021274）为本基金前十大持仓债券之一。2019年10月30日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对渤海银行上海分行对某同业资金违规投向“四证”不全的房地产项目合规性审查未尽职责等违规行为，责令改正，并处以罚款250万；对渤海银行上海同济支行票据承兑业务贸易背景真实性审查严重不审慎的违规行为，责令改正，处以罚款50万元。2019年12月4日，中国银行保险监督管理委员会陕西监管局对渤海银行西安分行贷款资金违规挪用等违规行为，处以罚款25万元；对违规开展理财投资业务等违规行为，处以罚款35万元。2019年12月31日，中国人民银行杭州中心支行对渤海银行杭州分行金融统计存在错误等违规行为，合计处以罚款163.2万元。2020年6月22日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对渤海银行北京分行同业投资业务严重违反审慎经营规则的违规行为，责令改正，并处以罚款50万元。

19建设银行CD149（代码：111905149）为本基金前十大持仓债券之一。2019年11月4日，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对建设银行杭州经济技术开发区支行贷款管理不到位等违规行为，处以罚款50万元。2019年11月15日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对建设银行北京通州分行小微企业贷款借贷搭建严重违反审慎经营规则的违规行为，责令改正，并处以罚款30万元；对建设银行北京中关村分行小微企业贷款转嫁成本严重违反审慎经营规则的违规行为，责令改正，并处以罚款30万元。2019年12月9日，中国银行保险监督管理委员会荆州监管分局对建设银行荆州分行在棚改项目贷款管理中存在浮利分费问题的违规行为，处以罚款50万元。2019年12月27日，中国银行保险监督管理委员会对建设银行用于风险缓释的保证金管理存在漏洞等违规行为，合计处以罚款80万元。2019年12月31日，中国人民银行杭州中心支行对建设银行杭州分行未按规定履行客户身份识别义务等违规行为，合计处以罚款400万元。2020年2月27日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对建设银行北京市分行个别业务部门监督检查职能履行严重不到位等违规行为，责令改正，并处以罚款200万元。2020年3月19日，中国人民银行宁德市中心支行对建设银行宁德分行境内大中小企业贷款统计中企业规模划型有误等违规行为，处以罚款67万元。2020年3月31日，中国银行保险监督管理委员会山西监管局对建设银行太原分行违规发放住房贷款的违规行为，处以罚款35万元。2020年4月20日，中国银行保险监督管理委员会对建设银行资金交易信息漏

报严重等违规行为，合计处以罚款230万元。2020年5月11日，中国人民银行南宁中心支行对建设银行广西壮族自治区分行虚报涉农贷款专项统计数据等违规行为，予以警告，并处以罚款58万元。2020年6月4日，中国银行保险监督管理委员会山西监管局对建设银行太原分行贷前调查不尽职等违规行为，责令改正，合计处以罚款45万元。2020年6月29日，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局对建设银行青岛四方支行未严格执行受托支付规定等违规行为，处以罚款100万元。2020年7月13日，中国银行保险监督管理委员会对建设银行内控管理不到位等违规行为，合计处以罚款3920万元；中国人民银行大连市中心支行对建设银行大连市分行未按规定保存客户身份资料和交易记录等违规行为，处以罚款95万元。2020年7月21日，中国银行保险监督管理委员会吴忠监管分局贷后管理不尽职等违规行为，处以罚款35万元。2020年8月13日，中国银行保险监督管理委员会吉林监管局对建设银行吉林省分行违规转嫁经营成本的违规行为，处以罚款50万元。

19江苏银行CD181（代码：111914181）为本基金前十大持仓债券之一。2019年10月16日，中国银行保险监督管理委员会徐州监管分局对江苏银行徐州分行个人消费贷款贷后监督不力等违规行为，处以罚款70万元。2019年12月27日，中国银行保险监督管理委员会宿迁监管分局对江苏银行宿迁分行违规虚增存贷规模等违规行为，处以罚款85万元。2020年6月30日，中国银行保险监督管理委员会对江苏银行徐州分行信贷资金用途管理不到位等违规行为，处以罚款60万元。

20中国银行CD035（代码：112004035）为本基金前十大持仓债券之一。2019年10月17日，中国银行保险监督管理委员会吉林监管局对中国银行吉林省分行违规融入同业资金等违规行为，处以罚款2900万元；中国银行保险监督管理委员会吉林监管分局对中国银行吉林市分行违规融入同业资金等违规行为，处以罚款2250万元。2019年11月29日，国家外汇管理局唐山市中心支局对中国银行唐山分行通过电子银行渠道为境内个人办理境外炒股和投资原油资金汇出的违规行为，责令改正，并处以罚款22万元。2019年12月11日，中国人民银行铜陵市中心支行对中国银行铜陵分行未按规定履行客户身份识别义务的违规行为，处以罚款21万元。2019年12月26日，中国人民银行烟台市中心支行对中国银行烟台分行超期未报送账户开立、撤销资料的违规行为，给予警告，并处以罚款9万元。2019年12月27日，中国人民银行白城市中心支行对中国银行白城分行违反支付结算业务规定的违规行为，处以罚款10万元。2020年1月15日，中国银行保险监督管理委员会锡林郭勒监管分局对中国银行锡林浩特分行未按规定报送案件信息的违规行为，处以罚款30万元。2020年4月20日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行

理财产品数量漏报等违法违规行为，合计处以罚款270万元。2020年5月19日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行"原油宝"事件，在前期调查的基础上，已启动立案调查程序。2020年5月26日，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局对中国银行即墨分行授信管理不到位的违规行为，处以罚款30万元。2020年6月30日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对中国银行宁波市分行房地产调控政策落实不到位等违规行为，处以罚款90万元。2020年8月3日，中国银行保险监督管理委员会吉林监管局对中国银行吉林省分行信用卡专向分期付款业务未有效落实授信担保条件的违规行为，处以罚款20万元；对中国银行长春金城支行签发银行承兑汇票调查环节严重不审慎的违规行为，处以罚款20万元。2020年8月7日，中国人民银行合肥中心支行对中国银行淮北分行存在账户归属错误等违规行为，予以警告，并处以罚款37万元。2020年9月4日，中国银行保险监督管理委员会河南监管局对中国银行河南省分行个人住房贷款调查审查严重不审慎的违规行为，处以罚款40万元。

20兴业银行CD300（代码：112010300）为本基金前十大持仓债券之一。2019年10月8日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对兴业银行北京分行违规向房地产企业提供融资等违规行为，责令改正，并处以罚款600万元。2019年10月15日，中国银行保险监督管理委员会辽宁监管局对兴业银行沈阳分行严重违反审慎经营规则办理票据业务的违规行为，处以罚款2250万元。2019年11月19日，中国人民银行武汉分行对兴业银行武汉分行违反清算管理规定、银行卡收单业务管理办法等相关规定的违规行为，予以警告，没收违法所得3,004,949.91元，并处罚款1,263,605.69元。2019年11月22日，中国银行保险监督管理委员会河北监管局对兴业银行石家庄分行违规办理同业投资业务等违规行为，处以罚款50万元。2019年12月9日，中国银行保险监督管理委员会台州监管分局对兴业银行台州分行贷款用途监控不严等违规行为，处以罚款30万元。2020年1月13日，国家计算机病毒应急处理中心对"兴业银行"（版本5.0.4）App"未向用户明示申请的全部隐私权限，涉嫌隐私不合规"的情况，认定为违法App。2020年1月14日，中国银行保险监督管理委员会十堰监管分局对兴业银行十堰分行办理贷款业务"存贷挂钩"的违规行为，处以罚款25万元。2020年2月24日，中国人民银行大连市中心支行对兴业银行大连分行违反《征信业管理条例》相关规定的违规行为，处以罚款16万元。2020年2月27日，中国银行保险监督管理委员会广东监管局对兴业银行广州分行三方买入返售业务严重违反审慎经营规则的违规行为，处以罚款100万元。2020年4月26日，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对兴业银行杭州分行受托支付审核不到位等违规行为，处以罚款40万元。2020年5月15日，中国银行间市场交易商协会对兴业

银行"作为债务融资工具主承销商,在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中,中标承销费率远低于市场正常水平,预估承销费收入远低于其业务开展平均成本"的行为,予以警告,并责令整改。2020年6月9日,中国人民银行福州中心支行对兴业银行三明分行为非法交易平台提供条码支付服务等违规行为,给予警告,没收违法所得560,855.28元,并处以罚款3,204,376.54元。2020年6月19日,中国银行保险监督管理委员会烟台监管分局对兴业银行烟台分行票据业务贸易背景审查不尽职等违规行为,处以罚款60万元。2020年6月30日,中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对兴业银行宁波分行开发贷款管理不审慎等违规行为,处以罚款50万元。2020年7月17日,中国人民银行上海分行对兴业银行上海分行未执行金融统计制度等违规行为,予以警告,并处以罚款123.5万元。2020年7月28日,中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行上海分行部分同业投资资金违规用于股权投资等违规行为,责令改正,并处以罚款450万元。2020年8月31日,中国银行保险监督管理委员会福建监管局对兴业银行同业投资用途不合规等违规行为,没收违法所得6,361,807.97元,并合计处以罚款15,961,807.97元。2020年9月4日,中国人民银行福州中心支行对兴业银行为无证机构提供转接清算服务等违规行为,予以警告,没收违法所得10,875,088.15元,并处以罚款13,824,431.23元。

20上海银行CD176(代码:112016176)为本基金前十大持仓债券之一。2019年11月2日,中国人民银行上海分行对上海银行违反支付业务规定的违规行为,没收违法所得1,762,787.61元,并处以罚款1,762,787.61元。2019年12月31日,中国银行保险监督管理委员会江苏监管局对上海银行南京新街口支行个人贷款用途管控不严的违规行为,处以罚款30万元。2020年4月15日,中国银行保险监督管理委员会盐城监管分局对上海银行盐城分行流动资金贷款业务经营不审慎等违规行为,处以罚款60万元。2020年4月20日,中国人民银行成都分行对上海银行成都分行虚报、瞒报金融统计数据等违规行为,处以罚款93.6万元。2020年8月14日,中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行并购贷款管理严重违反审慎经营规则等违规行为,责令改正,没收违法所得27.155092万元,并处以罚款1625万元。

20交通银行CD159(代码:112006159)为本基金前十大持仓债券之一。2019年10月23日,中国银行保险监督管理委员会宿迁监管分局对交通银行宿迁分行贷款"三查"不尽职等违规行为,处以罚款30万元。2019年12月23日,中国银行保险监督管理委员会海南监管局对交通银行海南省分行贵金属业务内部控制严重违反审慎经营规则的违规行为,处以罚款200万元;对交通银行三亚分行贵金属业务内部控制严重违反审慎经

营规则的违规行为，处以罚款50万元。2019年12月27日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行授信审批不审慎等违规行为，合计处以罚款150万元。2019年12月31日，中国人民银行杭州中心支行对交通银行浙江省分行金融统计存在错误等违规行为，合计处以罚款234.1万元。2020年4月15日，中国银行保险监督管理委员会衢州监管分局贷款管理不审慎等违规行为，处以罚款125万元。2020年4月20日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行理财产品数量漏报等违法违规行为，合计处以罚款260万元。2020年4月23日，中国银行保险监督管理委员会锡林郭勒监管分局对交通银行锡林郭勒分行贷款管理履职不尽责的违规行为，处以罚款40万元。2020年4月30日，中国银行保险监督管理委员会苏州监管分局对交通银行苏州分行房地产开发贷款管理严重不审慎的违规行为，处以罚款45万元。2020年7月28日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对交通银行太平洋信用卡中心未对某客户个人信息尽安全保护义务等违规行为，责令改正，并处以罚款100万元。2020年7月30日，中国人民银行哈尔滨中心支行对交通银行黑龙江省分行未按规定履行客户身份识别义务等违规行为，给予警告，并处以罚款50万元。2020年8月3日，中国银行保险监督管理委员会吉林监管局对交通银行长春亚泰支行办理无真实贸易背景票据业务的违规行为，处以罚款30万元。

20农业银行CD082（代码：112003082）为本基金前十大持仓债券之一。2019年10月29日，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对农业银行浙江省分行贷款管理不审慎等违规行为，没收违法所得5.4万元，并处以罚款311.2万元，合计316.6万元。2019年12月9日，中国银行保险监督管理委员会台州监管分局对农业银行台州分行个人住房按揭贷款业务严重不审慎的违规行为，处以罚款30万元。2019年12月10日，中国银行保险监督管理委员会江西监管局对农业银行江西省分行办理国内信用证业务浮利分费等违规行为，处以罚款120万元；对农业银行南昌分行变相超越权限审批贷款的违规行为，处以罚款25万元。2019年12月27日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对农业银行宁波市分行向环保不达标企业发放贷款等违规行为，处以罚款240万元。2020年1月7日，中国银行保险监督管理委员会滨州监管分局对农业银行滨州分行“低风险业务”未纳入统一授信等违规行为，处以罚款40万元。2020年1月9日，中国银行保险监督管理委员会呼伦贝尔监管分局对农业银行牙克石市支行未严格执行重要岗位人员轮岗内控管理制度的违规行为，处以罚款30万元。2020年1月19日，国家税务总局北京市海淀区税务局对农业银行未按照规定期限办理纳税申报和报送纳税资料的违法行为，处以罚款50元。2020年3月17日，中国银行保险监督管理委员会青海监管局对农业银行西宁市城西支行向提供虚假资料的信用卡申请人发卡等违规行为，处以罚款30万元；对贷款

"三查"严重不尽职等违规行为，处以罚款50万元。2020年3月18日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行代理人保寿险保险业务，存在销售行为可回溯制度执行不到位等违规行为，对农业银行总行、农业银行安阳县支行、农业银行巩义市支行、农业银行平顶山湛河支行分别处以罚款人民币50万元。2020年4月20日，中国银行保险监督管理委员会金华监管分局对农业银行金华分行信贷资金被挪用于支付购买土地款项等违规行为，处以罚款145万元。2020年4月22日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行"两会一层"境外机构管理履职不到位等违规行为，合计处以罚款200万元；对资金交易信息漏报严重等违规行为，合计处以罚款230万元。2020年6月1日，中国人民银行福州中心支行对农业银行莆田分行未按规定履行客户身份识别义务的违规行为，处以罚款131万元。2020年7月13日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行向管理人发放信用贷款等违规行为，没收违法所得55.3万元，并处以罚款5260.3万元。2020年8月19日，中国银行保险监督管理委员会海南监管局对农业银行海南省分行监督检查不尽职等违规行为，处以罚款120万元。2020年8月21日，中国银行保险监督管理委员会六安监管分局对农业银行六安分行存在浮利分费的行为等违规行为，处以罚款60万元。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,388.86
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,094,061.18
4	应收申购款	49,323.57
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	3,157,773.61

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

	格林货币A	格林货币B
报告期期初基金份额总额	21,108,141.45	534,821,488.33
报告期期间基金总申购份额	12,168,499.07	1,645,050,424.10
报告期期间基金总赎回份额	15,510,309.58	990,357,973.18
报告期期末基金份额总额	17,766,330.94	1,189,513,939.25

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2020-07-17	11,800,000.00	11,800,000.00	0
2	赎回	2020-07-24	-1,500,000.00	-1,500,000.00	0
3	赎回	2020-08-06	-200,000.00	-200,000.00	0
4	赎回	2020-08-14	-700,000.00	-700,000.00	0
5	赎回	2020-08-20	-300,000.00	-300,000.00	0
6	赎回	2020-08-25	-1,200,000.00	-1,200,000.00	0
7	赎回	2020-09-02	-550,000.00	-550,000.00	0
8	赎回	2020-09-15	-4,300,000.00	-4,300,000.00	0
9	赎回	2020-09-25	-1,200,000.00	-1,200,000.00	0
10	赎回	2020-09-30	-500,000.00	-500,000.00	0
11	红利再投	2020-09-30	34,391.85	34,391.85	0
合计			1,384,391.85	1,384,391.85	

注：本基金的收益分配按日结转份额，列示在“分红再投”项下一并披露。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间					
机 构	1	20200701- 20200803	200,470,814. 04	201,778,832. 55	0.00	402,249,646. 59	33.32%
	2	20200810- 20200930	200,470,814. 04	201,778,832. 55	0.00	402,249,646. 59	33.32%
	3	20200810- 20200811	0.00	455,808,289. 47	300,000,000. 00	155,808,289. 47	12.91%

## 产品特有风险

## 1、净值大幅波动的风险

由于本基金万份收益的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该机构投资者在开放日大额赎回时，有可能导致基金净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。

## 2、出现巨额赎回的风险

该机构投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。其他投资者的赎回申请也可能同时面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。

## 3、基金规模过小的风险

根据基金合同的约定，基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。该机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5,000万元情形。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## §9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予格林日鑫月熠货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》；
- 3、《格林日鑫月熠货币市场基金托管协议》；
- 4、《格林日鑫月熠货币市场基金招募说明书》及其更新；

- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

格林基金管理有限公司

2020年10月28日