

**格林日鑫月熠货币市场基金**

**2019 年第 4 季度报告**

**2019 年 12 月 31 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 01 月 17 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 .....	7
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 .....	11
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 报告期末按公允价值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 .....	12
§6 开放式基金份额变动 .....	16
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 .....	16
§8 影响投资者决策的其他重要信息 .....	16
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 .....	16
8.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	17
§9 备查文件目录 .....	17
9.1 备查文件目录 .....	17
9.2 存放地点 .....	18
9.3 查阅方式 .....	18

**§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1月16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2019年10月1日起至2019年12月31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	1,073,433,187.61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	15,411,909.46份	1,058,021,278.15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(2019年10月01日 - 2019年12月31日)	
	格林货币A	格林货币B
1.本期已实现收益	90,780.30	3,744,584.06
2.本期利润	90,780.30	3,744,584.06
3.期末基金资产净值	15,411,909.46	1,058,021,278.15

注：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 本报告期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	0.5630%	0.0018%	0.3456%	0.0000%	0.2174%	0.0018%

###### 格林货币B净值表现

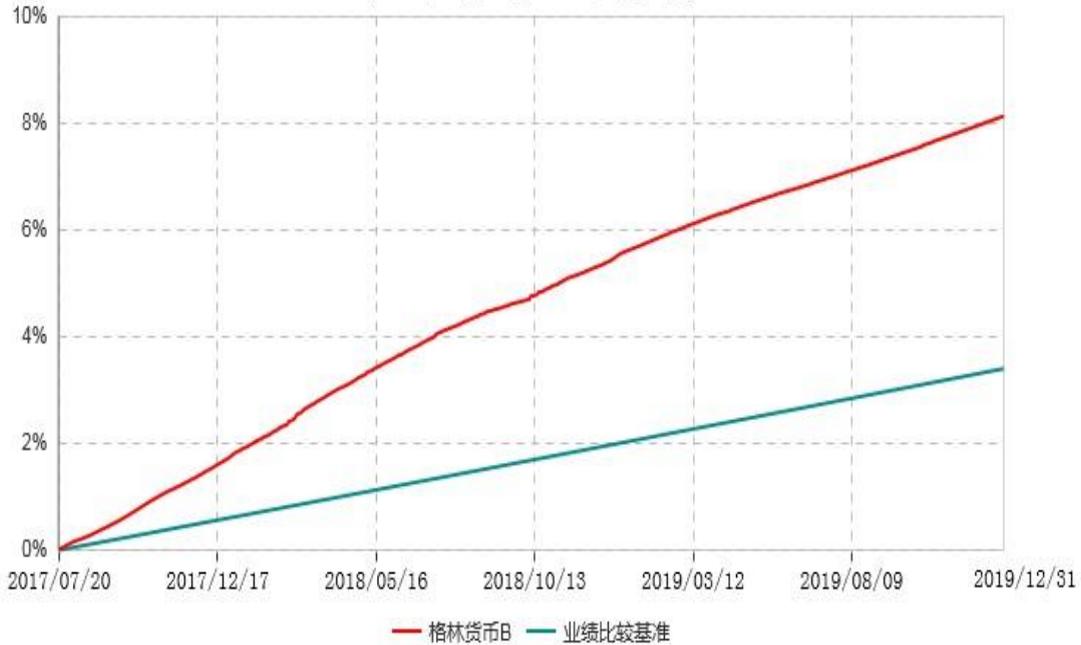
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6239%	0.0018%	0.3456%	0.0000%	0.2783%	0.0018%

### 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



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  
(2017年07月20日-2019年12月31日)



## §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		
宋东旭	本基金基金经理、格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理、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	2017-07-20	-	7	宋东旭先生，中央财经大学数理金融学士，Rutgers金融数学硕士。曾供职于摩根大通首席投资办公室，负责固定收益类资产的投资。现任格林基金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，未直接或通过与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

2019年第四季度，债市整体属于震荡行情。10月份，受经济数据边际回升、猪肉价格推动通胀及通胀预期、市场预期的LPR未做调整、中美贸易战出现阶段性缓和等因素的影响，收益率在10月份出现了快速的上行。11、12月份，债市依旧面临较多的扰动因素，政府加大逆周期调节力度，基本面逐步出现弱势企稳迹象，但受资金面宽松及

市场配置力量的驱动，收益率有所下行。以10年国债为例，收益率先上后下，由10月初的3.14%上行至3.3%，然后回落至3.13%，基本收平。

组合操作上，本基金主要投资于同业存单、存款和回购，同时在年末增加了短融及逆回购的配置，组合久期平均维持在中高水平。展望2020年，基金管理人认为当前中国仍处于实体经济杠杆提升乏力，金融体系风险偏好整体下降的情况当中。政府降低实体经济融资成本的初衷不变，MLF 和 OMO 下调等货币政策性工具还将发挥作用，利率下行是长期趋势。但是当前受制于通胀、地方债供给、政府逆周期调节下基本面出现回暖迹象等因素影响，债市短期或处于震荡格局，继续在变化中寻求结构性机会。下一阶段，本基金仍将继续做好流动性管理工作，结合基金管理人对市场的判断，优化组合结构，把握货币市场价格波动节奏，力争提升组合收益。

#### 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0.5630%，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0.6239%，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	666,953,509.10	62.11
	其中：债券	666,953,509.10	62.11
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	360,920,917.46	33.61
	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	43,948,241.15	4.09
4	其他资产	2,063,836.09	0.19
5	合计	1,073,886,503.80	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	-	4.47
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

### 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	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

### 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	50.76	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
2	30天(含)—60天	25.09	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	11.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	3.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	9.17	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.85	-

#### 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	49,881,325.70	4.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,000,079.08	0.93
	其中：政策性金融债	10,000,079.08	0.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,240,958.67	9.34
6	中期票据	-	-
7	同业存单	506,831,145.65	47.22
8	其他	-	-
9	合计	666,953,509.10	62.13

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	111910068	19兴业银行CD068	500,000	49,803,804.92	4.64
2	111909418	19浦发银行CD418	400,000	39,829,673.02	3.71
3	111916364	19上海银行CD364	300,000	29,987,109.79	2.79
4	111976681	19成都银行CD266	300,000	29,958,119.69	2.79
5	111918041	19华夏银行CD041	300,000	29,923,962.63	2.79
6	199949	19贴现国债49	300,000	29,905,779.21	2.79
7	111915064	19民生银行CD064	300,000	29,878,196.47	2.78
8	111918483	19华夏银行CD483	300,000	29,839,634.05	2.78
9	111910124	19兴业银行CD124	300,000	29,817,021.68	2.78
10	111911277	19平安银行CD277	300,000	29,808,209.09	2.78

### 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	0.0379%
报告期内偏离度的最低值	-0.0150%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0085%

#### 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 报告期末按公允价值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 19 兴业银行CD068( 代码 :111910068 )、19兴业银行CD124( 代码 :111910124 )** 为本基金前十大持仓债券之二。2019年3月25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安华支行流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，责令改正，并处以30万元罚款。2019年9月3日，中国人民银行北京营业管理部对兴业银行北京分行未按照规定履行客户身份识别义务、与身份不明的客户进行交易等违规行为，合计处以罚款145万元。2019年9月30日，中国银行保险监督管理委员会无锡监管分局对兴业银行无锡分行贷款资金被挪用等违规行为，处以罚款65万元。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。

19浦发银行CD418 ( 代码 : 111909418 ) 为本基金前十大持仓债券之一。2019年2月21日，中国银行保险监督管理委员会山东监管局对浦发银行淄博分行信贷资金用于承接不良或逾期贷款等违规行为，处以罚款55万元。2019年3月12日，中国人民银行上海分行对浦发银行闵行支行违规支付业务规定的违规行为，没收违法所得1,786,386.60元，并处以1,786,386.60元罚款。2019年3月12日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局对浦发银行大连分行滚动开立无真实性贸易背景银行承兑汇票的违规行为，处以罚款50万元。2019年6月24日，中国银行保险监督管理委员会对浦发银行对成都分行授

信业务及整改情况严重失察等违规行为，处以罚款130万元。2019年6月26日，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对浦发银行昆明分行违规通过存贷易业务进行返利吸存等违规行为，处以罚款270万元，并没收违法所得7.296万元。2019年6月28日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对浦发银行宁波分行住房按揭贷款管理不规范的违规行为，处以罚款50万元。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浦发银行北京分行信贷资金转存定期存单并用于开立银行承兑汇票等违规行为，责令改正，并处以罚款290万元。2019年10月16日，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对浦发银行杭州分行用印管理不审慎等违规行为，处以罚款160万元。2019年12月3日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对浦发银行信用卡中心信用卡催收外包管理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上海银行CD188( 代码 :111916188 )、19上海银行CD285( 代码 :111916285 ) 为本基金前十大持仓债券之二。2019年3月20日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行静安支行未按规定进行贷款支付管理、未采取有效措施控制贷款资金使用的违规行为，责令改正，并处罚款共计100万元。2019年3月20日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行杨浦支行未采取有效方式对贷款资金使用情况进行跟踪检查的违规行为，责令改正，并处罚款50万元。2019年6月28日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对上海银行宁波分行违反信贷政策等违规行为，处以罚款60万元。2019年8月2日，中国银行保险监督管理委员会深圳监管局对上海银行深圳分行以贷款资金转存存单等违规行为，没收违法所得55755元，并处以罚款50万元。2019年8月12日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行浦东分行违规滚动签发部分银行承兑汇票，虚增资产负债规模等违规行为，责令改正，并处以罚款100万元。2019年8月15日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行市北分行授信管理严重不审慎等违规行为，责令改正，并处以罚款250万元。2019年9月5日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对上海银行北京分行大额信贷资金被违规挪用于质押且押品管理存在漏洞等违规行为，责令改正，并处以罚款80万元。2019年9月16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分行采用不正当手段吸收存款的违规行为，处以罚款55万元。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。

19华夏银行CD041( 代码 :111918041 )、19华夏银行CD483( 代码 :111918483 ) 为本基金前十大持仓债券之二。2019年3月12日，中国银行保险监督管理委员会大连监

管局对华夏银行大连分行银行承兑汇票的保证金来源审核不够严格等违规行为，处以罚款50万元。2019年3月26日，中国银行保险监督管理委员会嘉兴监管分局对华夏银行嘉兴分行流动资金贷款挪用于缴纳土地拍卖保证金、出让金等违规行为，处以罚款85万元。2019年6月28日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对华夏银行宁波分行流动资金额度测算存在数据编造等违规行为，处以罚款230万元。2019年9月30日，中国银行保险监督管理委员会宁夏监管局对华夏银行银川分行贷款五级分类不准确等违规行为，处以罚款60万元。2019年10月9日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局对华夏银行大连分行内控管理不严格等违规行为，处以罚款50万元。2019年10月25日，中国银行保险监督管理委员会广东监管局对华夏银行广州分行向关系人发放信用贷款等违规行为，没收违法所得7524元，并处以罚款130万元。2019年12月12日，中国银行保险监督管理委员会山西监管局对华夏银行太原分行贷前调查不尽职等违规行为，责令改正，并处以罚款60万元。2019年12月23日，中国银行保险监督管理委员会天津监管局对华夏银行天津分行违规发放流动资金贷款等违规行为，处以罚款100万元。

19民生银行CD064（代码：111915064）为本基金前十大持仓债券之一。2019年3月1日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对民生银行北京分行流动资金贷款严重违反审慎经营规则的违规行为，责令改正，并处以80万元罚款。2019年4月2日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局对民生银行大连分行小微联保授信业务贷前调查不尽职的违规行为，处以罚款50万元；对民生银行贷后管理不到位、银行承兑汇票保证金来源审查不严格等违规行为，处以罚款50万元；对民生银行以贷收贷、掩盖资产真实质量等违规行为，处以罚款100万元；对民生银行大连分行部分信贷资金回流本行作银行承兑汇票保证金等违规行为，处以罚款50万元；对民生银行贷后管理不到位等违规行为，处以罚款100万元。2019年4月10日，中国银行保险监督管理委员会重庆监管局对民生银行重庆分行内控管理不严导致信贷资金违规流入房地产企业等违规行为，处以罚款90万元。2019年6月6日，中国银行保险监督管理委员会山西监管局对民生银行太原分行贷款用途不合规等违规行为，责令改正，并处以罚款480万元。2019年7月17日，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局对民生银行青岛分行以贷转存等违规行为，没收违法所得434023.96元，并处以罚款100万元。2019年7月17日，国家外汇管理局黑龙江省分局对民生银行哈尔滨分行为企业办理内保外贷业务未做到尽职审查的违规行为，没收违法所得285,484.50元人民币，并处以90万元人民币的罚款；对为企业办理货物贸易退汇收入未入待核查账户的违规行为，给予警告，并处以7万元人民币的罚款。2019年12月4日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对民生银行同业票据业务管

理失控等违规行为，责令改正，并处以罚款700万元。2019年12月23日，中国银行保险监督管理委员会临沂监管分局对民生银行临沂分行违反房地产信贷政策等违规行为，处以罚款180万元。

19平安银行CD277（代码：111911277）为本基金前十大持仓债券之一。2019年年月26日，中国银行保险监督管理委员会湖北监管局对平安银行武汉分行违规向关系人发放信用贷款的违规行为，没收违法所得133853.19元，并处以罚款50万元。2019年3月25日，中国银行保险监督管理委员会天津监管局对平安银行天津分行发放固定资产贷款未执行受托支付等违规行为，处以罚款130万元。2019年4月10日，中国银行保险监督管理委员会河北监管局对平安银行石家庄分行未经批准设立分支机构等违规行为，处以罚款200万元。2019年4月24日，中国人民银行温州市中心支行对平安银行温州分行为非法平台提供支付服务等等违反有关清算管理规定的行为，给予警告，没收违法所得人民币1,691,174.82元，并处罚款5,376,880.63元；对利用内部过渡户办理客户备付金互转的行为，处以罚款3万元；对为单位商户设置个人账户作为收单账户的行为，给予警告，并处以罚款30万元。2019年8月20日，中国人民银行杭州中心支行对平安银行杭州城西支行未执行有关清算管理规定的违规行为，给予警告，没收违法所得3663.4元，并处以罚款60万元。2019年9月27日，中国银行保险监督管理委员会金华监管分局对平安银行义务分行信贷资金用于支付购房首付款等违规行为，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平安银行北京分行个人贷款业务借贷搭售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。2019年12月11日和12日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局对平安银行大连分行贷后管理未及时发现贷款资金未按约定用途使用、经营性物业贷款贷前调查未尽职、贷前调查未尽职等违规行为，合计处以罚款110万元。2019年12月19日，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局对平安银行南京分行存在存贷款挂钩等违规行为，处以罚款70万元。

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	3,059.32
2	应收证券清算款	26,915.07

3	应收利息	2,030,861.69
4	应收申购款	3,000.01
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	2,063,836.09

#### 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	15,920,713.90	726,149,508.07
报告期期间基金总申购份额	4,560,854.75	1,438,057,670.62
报告期期间基金总赎回份额	5,069,659.19	1,106,185,900.54
报告期期末基金份额总额	15,411,909.46	1,058,021,278.15

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	赎回	2019-10-24	-1,000,000.00	-1,000,000.00	0.00
2	红利再投	2019-12-31	5,111.00	5,111.00	0.00
合计			-994,889.00	-994,889.00	

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	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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

别							
机 构	1	20191217 - 20 191231	50,032,174. 15	300,590,444.0 5	-	350,622,618.2 0	32.66%
	2	20191115 - 20 191216 , 20191 224 - 2019122 4	-	156,431,982.3 7	156,431,982.3 7	-	0.00%
产品特有风险							
<p>1、净值大幅波动的风险</p> <p>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。因此该机构投资者大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。</p> <p>2、出现巨额赎回的风险</p> <p>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。</p> <p>3、基金规模过小的风险</p> <p>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。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。</p>							

## 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01月17日