

格林日鑫月熠货币市场基金

2020 年第 4 季度报告

2020 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:2021 年 01 月 22 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合规守信情况说明.....	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.....	14
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	14
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	15
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.....	15
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	15
§9 备查文件目录.....	15
9.1 备查文件目录.....	15
9.2 存放地点.....	16
9.3 查阅方式.....	16

§ 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2021年1月21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10月1日起至2020年10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	930,591,461.01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	16,557,310.53份	914,034,150.48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10月01日 - 2020年12月31日)	
	格林货币A	格林货币B
1. 本期已实现收益	103,196.37	6,223,156.96
2. 本期利润	103,196.37	6,223,156.96
3. 期末基金资产净值	16,557,310.53	914,034,150.48

- 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	0.5977%	0.0023%	0.3456%	0.0000%	0.2521%	0.0023%
过去六个月	1.0790%	0.0021%	0.6924%	0.0000%	0.3866%	0.0021%
过去一年	2.0830%	0.0030%	1.3819%	0.0000%	0.7011%	0.0030%
过去三年	7.9488%	0.0041%	4.1956%	0.0000%	3.7532%	0.0041%
自基金合同生效起至今	9.7599%	0.0040%	4.8423%	0.0000%	4.9176%	0.0040%

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	0.6585%	0.0023%	0.3456%	0.0000%	0.3129%	0.0023%
过去六个月	1.2012%	0.0021%	0.6924%	0.0000%	0.5088%	0.0021%
过去一年	2.3287%	0.0030%	1.3819%	0.0000%	0.9468%	0.0030%
过去三年	8.7306%	0.0041%	4.1956%	0.0000%	4.5350%	0.0041%
自基金合同生效起至今	10.6746%	0.0040%	4.8423%	0.0000%	5.8323%	0.0040%

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12月31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、格林泓安63个月定期开放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

	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、格林中短债债券型证券投资基金基金经理			易员；曾任九州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合规守信情况说明

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

2020年第四季度央行继续保持了稳健的货币政策，不但保持了货币供应量的总闸门同时又在结构方面精准滴灌，加大了对小微企业，科技企业等国家重点发展的领域的支持力度，充分体现货币政策的灵活性、精准性。同时第四季度我国经济生产活动也处在快速恢复的通道，货币政策也逐步从上半年的疫情中的宽松态势逐步转为正常态势，居民消费活动不断修复，大宗商品价格持续走高，经济内生动能不断走高。

第四季度在债券信用风险事件发生后，市场又一些恐慌的情绪，资金利率迅速攀升，企业发债受阻，但央行迅速通过公开市场操作和MLF的等工具将市场利率引导至政策利率附近，市场情绪得到修复。货币组合在第四季度仍以稳健为主基调，重点配置了一些高评级信用债券和银行存单，抓住了资金市场利率波动的机会，迅速调整组合结构，适当增加杠杆，在保证流动性的同时，为组合增厚了收益。

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0.5977%，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0.6585%，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	637,941,677.49	65.96
	其中：债券	637,941,677.49	65.96
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	324,327,311.49	33.54
	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	1,940,863.85	0.20
4	其他资产	2,888,217.60	0.30
5	合计	967,098,070.43	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	-	12.65
	其中：买断式回购融资	-	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	35,999,862.00	3.87
	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	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

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	65.14	3.87
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	8.57	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	13.90	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	9.62	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
5	120天(含)—397天(含)	6.39	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.63	3.87

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,194,048.53	5.39
	其中：政策性金融债	50,194,048.53	5.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	169,994,671.42	18.27
6	中期票据	-	-
7	同业存单	417,752,957.54	44.89
8	其他	-	-
9	合计	637,941,677.49	68.55
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	012002518	20海尔智家SCP001	500,000	50,003,908.67	5.37
2	072000252	20天风证券CP006	500,000	50,000,608.95	5.37
3	112015486	20民生银行CD486	500,000	49,912,059.53	5.36
4	112010041	20兴业银行CD041	500,000	49,907,177.70	5.36
5	112003082	20农业银行CD082	500,000	49,858,091.44	5.36
6	180208	18国开08	300,000	30,113,396.80	3.24
7	012004233	20福州城投SCP008	300,000	29,991,180.87	3.22
8	112011261	20平安银行CD261	300,000	29,957,279.71	3.22

9	112071253	20上海农商银行CD139	300,000	29,914,377.79	3.21
10	112086932	20广州银行CD043	300,000	29,848,628.70	3.21

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	0.0365%
报告期内偏离度的最低值	-0.0754%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0330%

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民生银行CD486（代码：112015486）为本基金前十大持仓债券之一。2020年1月13日，国家计算机病毒应急处理中心对“民生银行”（版本5.12）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2月10日，中国人民银行对民生银行未按规定履行客户身份识别义务等违规行为，处以罚款2360万元。2020年7月14日，中国银行保险监督管理委员会对民生银行为“四证”不全的房地产项目提供融资等违规行为，没收违法所得296.47万元，并处以罚款10486.47万元。2020年2月26日，中国银保监会广东监管局对中国民生银行股份有限公司广州分行个人消费贷款、个人经营性贷款贷前调查和贷后管理不尽职的违规行为，处以50万元罚款。2020年4月7日，青海银保监局中国民生银行股份有限公司西宁分行贷后检查流于形式，信贷资金回流借款人并被挪用等违规行为，处以45万元罚款。2020年7月22日，宁波银保监局对中国民生银行股份有限公司宁波分行保理业务办理不规范的违规行为，处以25万元

罚款，并责令该分行对相关直接责任人给予纪律处分。2020年7月14日，中国银行保险监督管理委员会对中国民生银行股份有限公司违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资等违规行为，没收违法所得296.47万元，罚款10486.47万元，罚没合计10782.94万元。2020年9月9日，中国银行保险监督管理委员会四川监管局对中国民生银行股份有限公司成都分行转嫁经营成本，由客户支付押品评估费的违规行为，处以10万元罚款。2020年11月3日，内蒙古银保监局对民生银行股份有限公司呼和浩特分行未严格落实信贷档案管理规定导致信贷档案缺失的违规行为，处以20万元罚款。

20兴业银行CD041（代码：112010041）为本基金前十大持仓债券之一。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。2020年11月17日，北京银保监局对兴业银行北京分行保理业务严重违反审慎经营规则的违规行为，责令兴业银行北京分行改正，并处以30万元罚款的行政处罚。2020年12月29日，湖北银保监局对兴业银行股份有限公司武汉分行发放虚假个人住房按揭贷款的违规行为，处以50万元罚款。

20农业银行CD082（代码：112003082）为本基金前十大持仓债券之一。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。2020年9月4日，中国银保监会淮北监管分局对中国农业银行股份有限公司淮北分行向借款人转嫁费用的违规行为，处以30万元罚款。2020年10月19日，中国银行保险监督管理委员会贵州监管局对中国农业银行股份有限公司贵阳分行贷前调查严重不尽职等违规行为，处以50万元罚款。2020年11月27日，中国银保监会佛山监管分局对中国农业银行股份有限公司佛山分行贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，处以40万元罚款。2020年12月7日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）的违规行为，没收违法所得49.59万元和罚款148.77万元，罚没金额合计198.36万元。

20平安银行CD261（代码：112011261）为本基金前十大持仓债券之一。2020年1月20日，中国银保监会深圳监管局对平安银行股份有限公司汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成等违规行为，处以720万元罚款。2020年3月19日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对平安银行股份有限公司上海市东支行在一定期间内未在营业场所公示金融许可证的违规行为，责令限期改正，给予警告。2020年10月16日，宁波银保监局对平安银行股份有限公司宁波分行员工行为管理薄弱、贷款调查审查不尽职、借贷搭售、贷款资金用途管控不到位、信用证贸易背景审核不严等违规行为，合计罚款人民币160万元，并责令该分行对相关直接责任人员给予纪律处分。2020年12月23

日，安徽银保监局对中国平安银行股份有限公司合肥分行借贷搭售保险产品的违规行为，处以35万元罚款。

18国开08（代码：180208）为本基金前十大持仓债券之一。2020年12月25日，中国银保监会浙江监管局对国家开发银行浙江省分行违规新增业务的违规行为，处以25万元罚款。2020年12月25日，中国银行保险监督管理委员会对国家开发银行违规的政府购买服务项目提供融资等违规行为，处以4880万元罚款。

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	20,073.06
2	应收证券清算款	122,814.11
3	应收利息	2,741,139.42
4	应收申购款	4,191.01
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	2,888,217.60

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	17,766,330.94	1,189,513,939.25
报告期期间基金总申购份额	5,127,307.47	583,266,914.50
报告期期间基金总赎回份额	6,336,327.88	858,746,703.27
报告期期末基金份额总额	16,557,310.53	914,034,150.48

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	2020-10-23	-1,380,000.00	-1,380,000.00	0

2	红利再投	2020-12-31	2,320.99	2,320.99	0
合计			-1,377,679.01	-1,377,679.01	

注：本基金的收益分配按日结转份额，列示在“红利再投”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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20201001-20201231	200,712,312.20	1,320,548.39	0.00	202,032,860.59	21.71%
	2	20201001-20201231	201,537,334.39	1,325,976.45	0.00	202,863,310.84	21.80%

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

2021年01月22日