格林日鑫月熠货币市场基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:格林基金管理有限公司

基金托管人:国泰海通证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 债券回购融资情况 45
7.3 基金投资组合平均剩余期限 45
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 47
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 47
7.8 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 48
7.9 投资组合报告附注 48
§8 基金份额持有人信息 49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 50
§9 开放式基金份额变动 51

§10 重大事件揭示 51
10.1 基金份额持有人大会决议 51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51
10.4 基金投资策略的改变 52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 53
10.9 其他重大事件 53
§11 影响投资者决策的其他重要信息 54
11.1 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 54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 55
§12 备查文件目录 55
12.1 备查文件目录 55
12.2 存放地点 55
12.3 查阅方式 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	格林日鑫月熠货币市场基金	
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	
基金管理人	格林基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	523,920,845.79份	
基金合同存续期	不定期	
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	55,015,348.47份	468,905,497.32份

2.2 基金产品说明

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	本基金的投资将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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	格林基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	王悦青	帅芳
	联系电话	010-50890737	021-38677947
	电子邮箱	wangyueqing@china-greenfund.com	tgrxp@tg.gtht.com
客户服务电话		4001000501	021-38917599-5
传真		010-50890775	021-50872603
注册地址		北京市朝阳区景华南街5号远洋光华国际C座15层（电梯层18层）02、03、05、06单元	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		北京市朝阳区景华南街5号18层（实际楼层15层）1802、1803、1805、1806	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码		100020	200041
法定代表人		高永红	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.china-greenfund.com/
基金中期报告置备地点	北京市朝阳区景华南街5号18层（实际楼层15层）1802、1803、1805、1806

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	格林基金管理有限公司	北京市朝阳区景华南街5号18层（实际楼层15层）1802、1803、1805、1806

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年01月01日-2026年06月30日)	
	格林货币A	格林货币B
本期已实现收益	253,769.82	2,786,905.68
本期利润	253,769.82	2,786,905.68
本期净值收益率	0.3958%	0.5156%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年06月30日)	
期末基金资产净值	55,015,348.47	468,905,497.32
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年06月30日)	
累计净值收益率	19.5918%	22.1912%

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

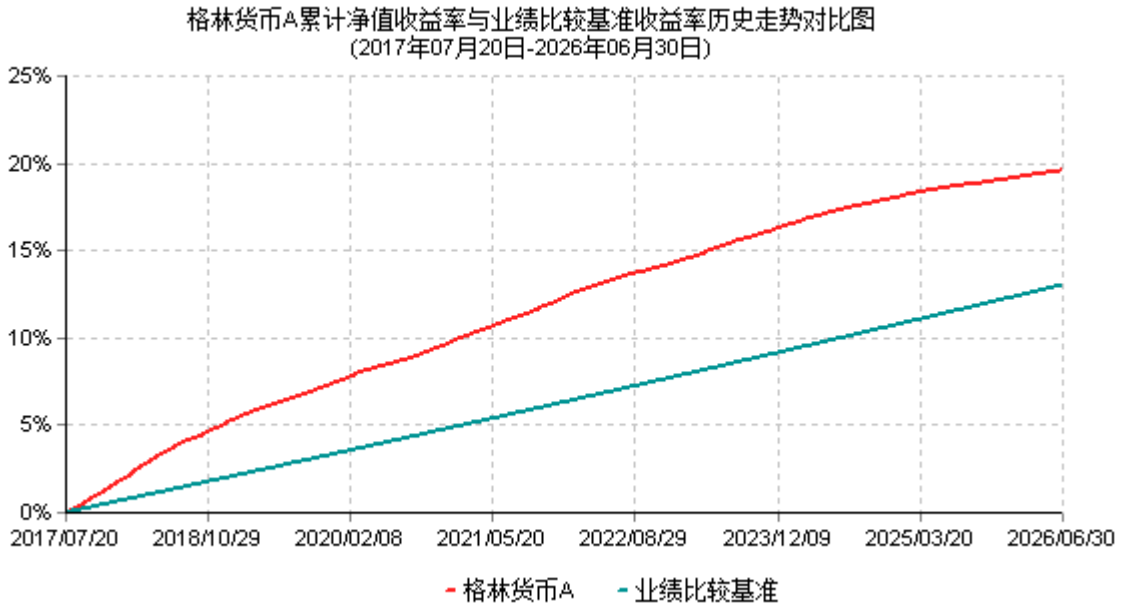
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.1958%	0.0006%	0.3418%	0.0000%	-0.1460%	0.0006%
过去六个月	0.3958%	0.0007%	0.6810%	0.0000%	-0.2852%	0.0007%
过去一年	0.7840%	0.0014%	1.3781%	0.0000%	-0.5941%	0.0014%
过去三年	3.6459%	0.0024%	4.1955%	0.0000%	-0.5496%	0.0024%
过去五年	7.7540%	0.0038%	7.0872%	0.0000%	0.6668%	0.0038%
过去七年	12.4241%	0.0036%	10.0633%	0.0000%	2.3608%	0.0036%
自基金合同生效起至今	19.5918%	0.0042%	13.0373%	0.0000%	6.5545%	0.0042%

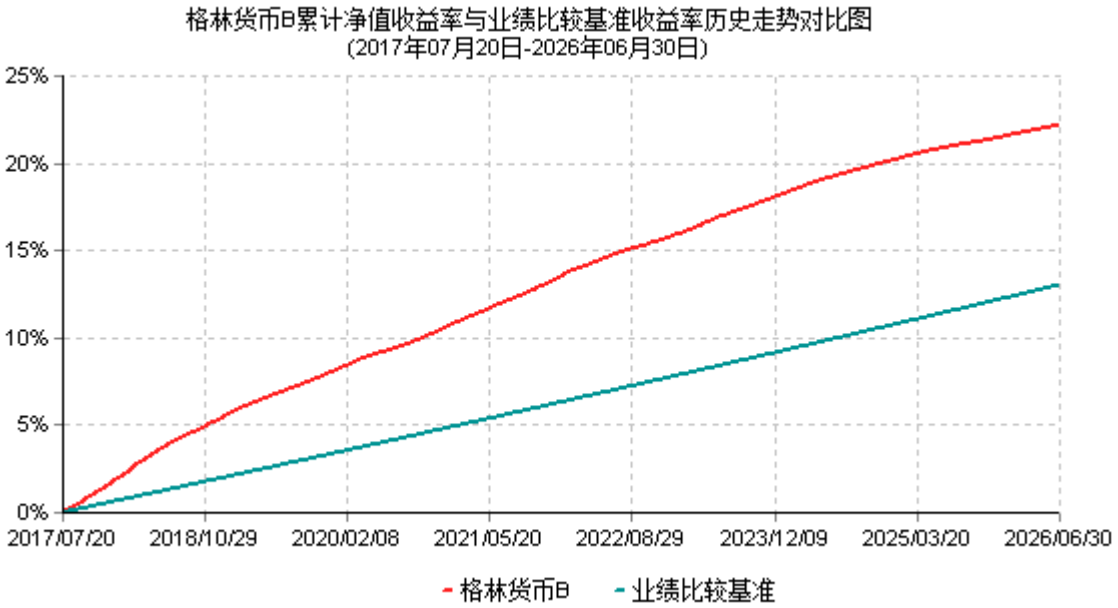
格林货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	0.2558%	0.0006%	0.3418%	0.0000%	-0.0860%	0.0006%
过去六个月	0.5156%	0.0007%	0.6810%	0.0000%	-0.1654%	0.0007%
过去一年	1.0266%	0.0014%	1.3781%	0.0000%	-0.3515%	0.0014%
过去三年	4.3963%	0.0024%	4.1955%	0.0000%	0.2008%	0.0024%
过去五年	9.0566%	0.0038%	7.0872%	0.0000%	1.9694%	0.0038%
过去七年	14.3335%	0.0036%	10.0633%	0.0000%	4.2702%	0.0036%
自基金合同生效起至今	22.1912%	0.0042%	13.0373%	0.0000%	9.1539%	0.0042%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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





§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为格林基金管理有限公司，于2016年10月8日正式获得中国证监会批准设立，批复文号为：证监许可〔2016〕2266号《关于核准设立格林基金管理有限公司的批复》。2016年11月1日，公司完成工商行政注册，取得《营业执照》。2016年11月16日，取得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。格林基金股东为河南省安融房地产开发有限公司，注册资本为人民币21500万元整，注册地为北京市朝阳区景华南街5号18层（实际楼层15层）1802、1803、1805、1806。经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2026年6月30日，格林基金管理有限公司共管理35只公募基金，分别为格林日鑫月熠货币市场基金、格林伯元灵活配置混合型证券投资基金、格林泓鑫纯债债券型证券投资基金、格林伯锐灵活配置混合型证券投资基金、格林创新成长混合型证券投资基金、格林泓泰三个月定期开放债券型证券投资基金、格林泓裕一年定期开放债券型证券投资基金、格林泓远纯债债券型证券投资基金、格林泓利增强债券型证券投资基金、格林稳健价值灵活配置混合型证券投资基金、格林中短债债券型证券投资基金、格林泓安63个月定期开放债券型证券投资基金、格林泓景债券型证券投资基金、格林鑫悦一年持有期混合型证券投资基金、格林研究优选混合型证券投资基金、格林新兴产业混合型证券投资基金、格林泓皓纯债债券型证券投资基金、格林高股息优选混合型证券投资基金、格林聚鑫增强债券型证券投资基金、格林碳中和主题混合型证券投资基金、格林泓旭利

率债债券型证券投资基金、格林聚享增强债券型证券投资基金、格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金、格林泓盛一年定期开放债券型发起式证券投资基金、格林聚合增强债券型证券投资基金、格林泓盈利率债债券型证券投资基金、格林港股通臻选混合型证券投资基金、格林宏观回报混合型证券投资基金、格林聚利增强一个月持有期债券型证券投资基金、格林中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、格林泓卓利率债债券型证券投资基金、格林30天滚动持有债券型证券投资基金、格林60天持有期债券型证券投资基金、格林科技成长混合型证券投资基金、格林上证科创板综合指数增强型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高洁	本基金的基金经理、固定收益部联席总监	2020-12-02	-	14年	高洁女士，美国旧金山大学金融分析硕士。曾任吉林银行金融市场部债券交易员，民生银行直销银行事业部基金类产品经理，中英益利资产管理股份有限公司固定收益部投资经理。2020年05月加入格林基金，曾任固定收益部基金经理助理、固定收益二部副总监，现任固定收益部联席总监、基金经理。2020年12月02日至今，担任格林日鑫月熠货币市场基金基金经理；2020年12月02日至今，担任格林中短债债券型证券投资基金基金经理；2024年01月11日至今，担任格林泓裕一年定期开放债券型证券投资基金

					基金经理；2024年08月13日至2025年09月25日，担任格林30天滚动持有债券型证券投资基金基金经理；2024年9月20日至今，担任格林中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理；2025年05月06日至今，担任格林60天持有期债券型证券投资基金基金经理；2025年08月01日，担任格林泓盛一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2025年09月25日至今，担任格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》和其他有关法律法规的规定，以及本基金《基金合同》约定，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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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（包括当日内、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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年国内宏观经济呈现总量温和偏弱、结构性分化特征，外需保持韧性，内需修复节奏平缓，地产持续拖累，通胀维持温和区间，不存在明显通胀约束。货币政策维持“适度宽松、削峰填谷”基调，流动性整体合理充裕，但呈现明显阶段性波动。

一季度资金环境相对宽松，DR007多数时段运行在政策利率下方；进入二季度，税期扰动、政府债券逐步放量发行，央行灵活调整公开市场操作，短期逆回购阶段性净回笼，引导资金利率向1.40%政策利率中枢回归。6月中下旬缴税叠加同业存单供给上行，短端利率震荡抬升，资金分层现象阶段性加剧。整体来看，货币市场呈现“一季度偏松、二季度边际收敛”格局，短端波动加大，票息机会阶段性显现。

本产品严格控制流动性风险与信用风险，组合以高评级同业存单、高资质短期融资券为核心底仓，优先配置国有大行、股份行同业存单，严控主体资质，规避弱区域机构发行的债券。组合整体保持较高流动性，同时密切跟踪市场资金变化，根据市场资金变化调整资产结构，寻求配置交易等多元化收益，报告期内组合稳健运行。

4.4.2 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1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.3958%，同期业绩比较基准收益率为0.6810%；截至报告期末格林货币B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.5156%，同期业绩比较基准收益率为0.6810%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内经济延续温和弱修复格局，货币政策基调维持稳健适度宽松。央行将继续运用MLF、买断式逆回购等中长期工具对冲政府债供给压力，常规逆回购灵活调节短期资金。三季度政府债迎来供给高峰，税期、债券缴款将持续带来阶段性资金扰动，

DR007围绕政策利率震荡、波动放大将成为常态。需要关注，美联储9月议息仍保留加息可能性，构成国内流动性边际外部约束。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金资产净值、各类基金份额的每万份基金已实现收益和7日年化收益率等结果由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本基金管理人设立估值委员会，成员由公司高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、监察稽核部门等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金自基金合同生效之日起每个开放日将实现的基金净收益（或净损失）分配给基金份额持有人，参与下一日基金收益分配，并结转到投资者基金账户，使基金份额净值始终保持1.0000元。本基金收益分配方式为红利再投资。本基金本报告期内A类份额累计应分配利润253,769.82元，实际分配金额253,769.82元，B类份额累计应分配利润2,786,905.68元，实际分配2,786,905.68元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续20个工作日基金份额持有人不满200人或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰海通证券股份有限公司（以下称"本托管人"）在格林日鑫月熠货币市场基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、利润分配等情况进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：格林日鑫月熠货币市场基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	169,903,793.66	8,621,777.92
结算备付金		-	919,111.35
存出保证金		-	16,210.24
交易性金融资产	6.4.7.2	183,832,154.93	245,426,278.64
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		183,832,154.93	245,426,278.64
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	170,408,602.16	191,005,511.93
应收清算款		-	43,012,104.79

应收股利		-	-
应收申购款		-	1,023.53
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		524,144,550.75	489,002,018.40
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		97,262.00	159,078.33
应付托管费		19,452.39	31,815.68
应付销售服务费		16,100.86	18,525.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,131.50	3.83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	88,758.21	199,238.75
负债合计		223,704.96	408,661.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	523,920,845.79	488,593,356.66
未分配利润	6.4.7.7	-	-
净资产合计		523,920,845.79	488,593,356.66
负债和净资产总计		524,144,550.75	489,002,018.40

注：报告截止日2026年6月30日，格林货币A基金份额净值1.0000元，基金份额总额55,015,348.47份；格林货币B基金份额净值1.0000元，基金份额总额468,905,497.32份。格林日鑫月熠货币市场基金份额总额合计为523,920,845.79份。

6.2 利润表

会计主体：格林日鑫月熠货币市场基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
一、营业总收入		4,356,462.54	3,017,072.00
1.利息收入		2,509,867.83	1,319,193.70
其中：存款利息收入	6.4.7.8	1,435,157.43	255,837.44
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,074,710.40	1,063,356.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,846,594.71	1,697,878.30
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.9	1,846,594.71	1,697,878.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.10	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.11	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-	-
减：二、营业总支出		1,315,787.04	884,236.66
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	907,069.06	532,492.02
2.托管费	6.4.10.2.2	181,413.83	106,498.39
3.销售服务费	6.4.10.2.3	106,861.09	125,824.69
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		35,516.32	18,995.51
其中：卖出回购金融资产支出		35,516.32	18,995.51
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		1,118.76	3.19
8.其他费用	6.4.7.14	83,807.98	100,422.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,040,675.50	2,132,835.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,040,675.50	2,132,835.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,040,675.50	2,132,835.34

6.3 净资产变动表

会计主体：格林日鑫月熠货币市场基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	488,593,356.66	-	488,593,356.66
二、本期期初净资	488,593,356.66	-	488,593,356.66

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	35,327,489.13	-	35,327,489.13
（一）、综合收益总额	-	3,040,675.50	3,040,675.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	35,327,489.13	-	35,327,489.13
其中：1.基金申购款	4,956,419,079.22	-	4,956,419,079.22
2.基金赎回款	-4,921,091,590.09	-	-4,921,091,590.09
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-3,040,675.50	-3,040,675.50
四、本期期末净资产	523,920,845.79	-	523,920,845.79
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	287,260,400.63	-	287,260,400.63
二、本期期初净资产	287,260,400.63	-	287,260,400.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,497,888.82	-	17,497,888.82
（一）、综合收益总额	-	2,132,835.34	2,132,835.34

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	17,497,888.82	-	17,497,888.82
其中：1.基金申购款	3,267,636,993.18	-	3,267,636,993.18
2.基金赎回款	-3,250,139,104.36	-	-3,250,139,104.36
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-2,132,835.34	-2,132,835.34
四、本期期末净资产	304,758,289.45	-	304,758,289.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

高永红	马文杰	窦文静
———————	———————	———————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

格林日鑫月熠货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2017〕934号文注册，由格林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,100,640,514.94元，业经天健会计师事务所（特殊普通合伙）天健验〔2017〕1-31号予以验证。经向中国证监会备案，《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》于2017年7月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,100,675,838.91份基金份额，其中认购资金利息折合35,323.97份基金份额。本基金的基金管理人为格林基金管理有限公司，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司（根据2025年4月8日发布的《关于格林日鑫月熠货币市场基金基金托管人信息变更并修改基金合同等法律文件的公告 》，自

2025年4月8日起，本基金的托管人公司名称由“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”）。

根据《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》和《格林日鑫月熠货币市场基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据投资者申购本基金的金额，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额类别。本基金将设 A 类和 B 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，并分别公布每万份基金已实现收益、七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人格林基金管理有限公司于2026年8月28日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年1月1日至2026年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2026年1月1日至2026年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净

资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00元固定份额

净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每日以红利再投资方式集中支付累计收益。

6.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪

港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	169,903,793.66
等于：本金	169,862,949.65
加：应计利息	40,844.01
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	169,903,793.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	183,832,154.93	183,927,886.99	95,732.06	0.0183
	合计	183,832,154.93	183,927,886.99	95,732.06	0.0183
资产支持证券		-	-	-	-
合计		183,832,154.93	183,927,886.99	95,732.06	0.0183

注: 1.偏离金额＝影子定价－摊余成本；

2.偏离度＝偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,001,908.22	-
银行间市场	150,406,693.94	-
合计	170,408,602.16	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	14,550.23
其中：交易所市场	-
银行间市场	14,550.23
应付利息	-
预提费用	74,207.98
合计	88,758.21

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 格林货币A

金额单位：人民币元

项目 (格林货币A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	68,707,372.80	68,707,372.80
本期申购	337,662,417.38	337,662,417.38
本期赎回（以“-”号填列）	-351,354,441.71	-351,354,441.71
本期末	55,015,348.47	55,015,348.47

6.4.7.6.2 格林货币B

金额单位：人民币元

项目 (格林货币B)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	419,885,983.86	419,885,983.86
本期申购	4,618,756,661.84	4,618,756,661.84
本期赎回（以“-”号填列）	-4,569,737,148.38	-4,569,737,148.38
本期末	468,905,497.32	468,905,497.32

注: 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 格林货币A

单位：人民币元

项目 (格林货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	253,769.82	-	253,769.82
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-253,769.82	-	-253,769.82
本期末	-	-	-

6.4.7.7.2 格林货币B

单位：人民币元

项目 (格林货币B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,786,905.68	-	2,786,905.68
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,786,905.68	-	-2,786,905.68
本期末	-	-	-

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	1,434,695.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	451.33
其他	11.00
合计	1,435,157.43

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间，未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

6.4.7.9 债券投资收益

6.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	1,766,982.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	79,612.07
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,846,594.71

6.4.7.9.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,008,066,236.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,006,102,740.68

减：应计利息总额	1,883,734.11
减：交易费用	150.00
买卖债券差价收入	79,612.07

6.4.7.10 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.11 股利收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

6.4.7.12 公允价值变动收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无公允价值变动收益。

6.4.7.13 其他收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	7,643.98
信息披露费	57,564.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	83,807.98

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
格林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	907,069.06	532,492.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	260,612.10	125,418.04

应支付基金管理人的净管理费	646,456.96	407,073.98

注:1.支付基金管理人格林基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理费＝前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	181,413.83	106,498.39

注:支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.06%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.06%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	格林货币A	格林货币B	合计
格林基金管理有限公司	1,145.00	2,101.53	3,246.53
国泰海通证券股份有限公司	2,595.67	0.81	2,596.48
合计	3,740.67	2,102.34	5,843.01
获得销售	上年度可比期间		

服务费的各关联方名称	2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	格林货币A	格林货币B	合计
格林基金管理有限公司	900.91	5,954.22	6,855.13
国泰海通证券股份有限公司	3,321.34	0.00	3,321.34
合计	4,222.25	5,954.22	10,176.47

注：本基金A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算公式为：日销售服务费＝前一日对应类别基金资产净值×约定年费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

格林货币A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

格林货币B

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	6,518.18	513,257.23
报告期间申购/买入总份额	22.11	54,349,665.18
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	6,540.29	54,856,437.05
报告期末持有的基金份额	-	6,485.36
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

本报告期内基金管理人持有的格林货币B类基金期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券股份有限公司	81,679,724.68	1,079,626.70	3,158,495.43	99,976.35

注:本基金托管户的银行存款由基金托管人国泰海通证券股份有限公司存放在交通银行上海交银大厦支行，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

格林货币A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
253,769.82	-	-	253,769.82	-

格林货币B

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
2,786,905.68	-	-	2,786,905.68	-

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是货币市场基金，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。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控

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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责审议公司风险管理工作的总体原则、方针和政策；审议公司的风险管理体系和风险管理制度；检查公司内部风险管理制度的执行情况，组织评价公司内控状况；组织检查及评价公司经营活动中的风险和相关控制措施的有效性；对公司重要创新业务及创新产品进行风险评估和风险决策；审议公司重大自由资产的配置和重大关联交易；检查公司财务状况及信息披露；听取基金业务负责人定期报告，评估公司合规管理和风险管理工作；定期向董事会报告公司经营活动中的风险管理状况；提议聘请或更换外部审计机构。在公司经理层下设风险管理委员会，主要负责组织、落实、商议公司风险管理工作，在经理层授权范围内协助经理层工作，出具相应的工作报告和专业意见，供经理层决策参考。在业务操作层面，公司监察稽核部为风险管理委员会的日常工作机构，根据风险管理委员会的要求，组织准备相关材料，做好相关工作，负责对公司基金运作、内部管理、系统实施和合法合规情况进行内部监督。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析相结合的风险管理方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人国泰海通证券股份有限公司开立于交通银行股份有限公司的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资、同业存单投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	50,197,104.84	-
合计	50,197,104.84	-

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告，以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	133,635,050.09	218,340,014.15
合计	133,635,050.09	218,340,014.15

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额

赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过60天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过"影子定价"对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2026年06月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	169,903,793.66	-	-	-	-	169,903,793.66
交易性金融资产	139,379,181.79	44,452,973.14	-	-	-	183,832,154.93
买入返售金融资产	170,408,602.16	-	-	-	-	170,408,602.16
资产总计	479,691,577.61	44,452,973.14	-	-	-	524,144,550.75
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	97,262.00	97,262.00
应付托	-	-	-	-	19,452.39	19,452.39

管费						
应付销售服务费	-	-	-	-	16,100.86	16,100.86
应交税费	-	-	-	-	2,131.50	2,131.50
其他负债	-	-	-	-	88,758.21	88,758.21
负债总计	-	-	-	-	223,704.96	223,704.96
利率敏感度缺口	479,691,577.61	44,452,973.14	-	-	-223,704.96	523,920,845.79
上年度末2025年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	8,621,777.92	-	-	-	-	8,621,777.92
结算备付金	919,111.35	-	-	-	-	919,111.35
存出保证金	16,210.24	-	-	-	-	16,210.24
交易性金融资产	230,555,222.95	14,871,055.69	-	-	-	245,426,278.64
买入返售金融资产	191,005,511.93	-	-	-	-	191,005,511.93
应收清算款	-	-	-	-	43,012,104.79	43,012,104.79
应收申购款	-	-	-	-	1,023.53	1,023.53
资产总计	431,117,834.39	14,871,055.69	-	-	43,013,128.32	489,002,018.40
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	159,078.33	159,078.33
应付托管费	-	-	-	-	31,815.68	31,815.68

应付销售服务费	-	-	-	-	18,525.15	18,525.15
应交税费	-	-	-	-	3.83	3.83
其他负债	-	-	-	-	199,238.75	199,238.75
负债总计	-	-	-	-	408,661.74	408,661.74
利率敏感度缺口	431,117,834.39	14,871,055.69	-	-	42,604,466.58	488,593,356.66

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末及上年度末，在影子价格监控机制有效的前提下，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会发生重大变动。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	183,832,154.93	245,426,278.64
第三层次	-	-
合计	183,832,154.93	245,426,278.64

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	183,832,154.93	35.07

	其中：债券	183,832,154.93	35.07
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	170,408,602.16	32.51
	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	169,903,793.66	32.42
4	其他各项资产	-	0.00
5	合计	524,144,550.75	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.03	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	40
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	13

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。

7.3.2 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	72.10	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.05	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	3.62	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	13.23	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.00	-

7.4 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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,197,104.84	9.58

6	中期票据	-	-
7	同业存单	133,635,050.09	25.51
8	其他	-	-
9	合计	183,832,154.93	35.09
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	042680104	26平安租赁CP001	300,000	30,116,347.92	5.75
2	012680688	26象屿SCP003	200,000	20,080,756.92	3.83
3	112515192	25民生银行CD192	200,000	19,967,638.65	3.81
4	112506159	25交通银行CD159	100,000	9,997,352.46	1.91
5	112505296	25建设银行CD296	100,000	9,994,254.61	1.91
6	112503242	25农业银行CD242	100,000	9,988,298.82	1.91
7	112695348	26天津银行CD083	100,000	9,982,961.11	1.91
8	112519324	25恒丰银行CD324	90,000	8,990,405.40	1.72
9	112599264	25徽商银行CD117	85,000	8,497,436.85	1.62
10	112694607	26成都农商银行CD021	85,000	8,402,077.99	1.60

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0406%
报告期内偏离度的最低值	0.0006%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0136%

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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中：

中国民生银行股份有限公司因系统使用管控不到位、基础软件版本管理不足、生产运维管理不严等原因，2025年9月12日被国家金融监督管理总局罚款590万元；因相关贷款、票据、同业等业务管理不审慎、监管数据报送不合规等原因，2025年10月31日被国家金融监督管理总局罚款5865万元。

交通银行股份有限公司因违反账户管理规定、违反清算管理规定、违反特约商户实名制管理规定等原因，2025年12月19日被中国人民银行警告、没收违法所得23.982116万元、罚款6783.43万元，相关文号：银罚决字[2025]96号；因灾备恢复能力建设不足、重要信息系统应急管理不足等原因，2026年6月5日被国家金融监督管理总局罚款80万元。

中国建设银行股份有限公司因个别信息系统开发测试不充分、信息科技外包管理存在不足等原因，2025年9月12日被国家金融监督管理总局罚款290万元；因违反账户管理规定、违反特约商户管理规定、违反人民币流通管理规定等原因，2026年2月12日被中国人民银行警告、没收违法所得55.097567万元、罚款4295.51万元，相关文号：银罚决字[2026]5号；因重要信息系统投产变更风险管控不到位、重要信息系统应急管理不足等原因，2026年6月5日被国家金融监督管理总局罚款70万元。

中国农业银行股份有限公司相关产品销售、服务收费不合规、信贷资金流向管理不审慎等原因，2025年10月31日被国家金融监督管理总局罚款2720万元。

天津银行股份有限公司因违反金融统计管理规定，2025年12月26日被中国人民银行天津市分行罚款35万元，相关文号：津银罚决字[2025]9号；因贷款“三查”不尽职、员工管理不到位及员工从事违法活动、未按规定报送案件信息等原因，2026年5月29日被

国家金融监督管理总局天津监管局罚款90万元；因重要信息系统对外服务异常事件应报未报，2026年6月4日被国家金融监督管理总局天津监管局罚款20万元。

恒丰银行股份有限公司因相关贷款、票据、理财等业务管理不审慎、监管数据报送不合规等原因，2025年9月12日被国家金融监督管理总局罚款6150万元。

徽商银行股份有限公司因违反金融统计相关规定，2025年9月19日被中国人民银行安徽省分行罚款20万元，相关文号：皖银罚决字[2025]19号；因贷款产品管理不审慎、贷款三查不到位等原因，2025年10月24日被国家金融监督管理总局安徽监管局罚款240万元；因违规发放贷款、贷后管理不到位、信用卡业务管理不到位等原因，2025年12月5日被国家金融监督管理总局安徽监管局罚款150万元；因财务顾问业务管理不到位、异地业务不合规，2025年12月5日被国家金融监督管理总局安徽监管局罚款665万元。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未发生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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	-

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人户数(户)		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
格林货币A	17,771	3,095.79	131,255.82	0.24%	54,884,092.65	99.76%
格林货币B	125	3,751,243.98	459,191,264.04	97.93%	9,714,233.28	2.07%
合计	17,896	29,275.86	459,322,519.86	87.67%	64,598,325.93	12.33%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	基金类机构	60,006,845.78	11.45%
2	其他机构	30,711,552.12	5.86%
3	基金类机构	30,184,157.73	5.76%
4	基金类机构	28,410,653.55	5.42%
5	券商类机构	20,002,281.92	3.82%
6	基金类机构	19,014,984.13	3.63%
7	基金类机构	18,514,589.81	3.53%
8	基金类机构	14,179,376.24	2.71%
9	基金类机构	10,094,657.58	1.93%
10	基金类机构	10,094,657.53	1.93%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	格林货币A	398,948.50	0.73%
	格林货币B	45,310.06	0.01%
	合计	444,258.56	0.08%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	格林货币A	10~50
	格林货币B	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	格林货币A	0~10
	格林货币B	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	格林货币A	格林货币B
基金合同生效日(2017年07月20日)基金份额总额	120,207.81	1,100,555,631.10
本报告期期初基金份额总额	68,707,372.80	419,885,983.86
本报告期基金总申购份额	337,662,417.38	4,618,756,661.84
减：本报告期基金总赎回份额	351,354,441.71	4,569,737,148.38
本报告期期末基金份额总额	55,015,348.47	468,905,497.32

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，2026年1月29日王悦青出任基金管理人督察长，基金管理人总经理高永红不再兼任督察长职务。

本报告期内，基金托管人的托管业务部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期未发生涉及基金托管人托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚的情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受到调查或处罚的情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

2、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基 金

交易单元的选择标准如下：

（1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的 需要；

（3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行 业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分 析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报 告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好 的服务和支持。

3、基金交易单元的选择程序如下：

（1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

（2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源	-	-	238,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内每个交易日，偏离度绝对值均未超过0.5%

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	2025年第4季度报告	公司网站、资本市场电子化信息披露平台	2026-01-21
2	2026年"春节"假期前暂停部分代销机构大额申购、定期定额投资与转换转入业务的公告	公司网站、资本市场电子化信息披露平台、证券日报	2026-02-11
3	2025年年度报告	公司网站、资本市场电子化信息披露平台	2026-03-30

4	2026年"清明"假期前暂停部分代销机构大额申购、定期定额投资与转换转入业务的公告	公司网站、资本市场电子化信息披露平台、证券日报	2026-04-01
5	2026年第1季度报告	公司网站、资本市场电子化信息披露平台	2026-04-21
6	2026年"劳动节"假期前暂停部分代销机构大额申购、定期定额投资与转换转入业务公告	公司网站、资本市场电子化信息披露平台、证券日报	2025-04-29
7	基金经理恢复履行职责的公告	公司网站、资本市场电子化信息披露平台、证券日报	2026-05-07
8	暂停部分销售机构办理旗下货币基金相关销售业务的公告	公司网站、资本市场电子化信息披露平台、证券日报	2026-05-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20260122 - 20260202	-	483,158,872.53	483,158,872.53	-	-
	2	20260303 - 20260325	-	483,158,872.53	483,158,872.53	-	-
	3	20260310 - 20260312	-	347,414,237.77	347,414,237.77	-	-

产品特有风险

1、净值大幅波动的风险

由于本基金每万份基金份额的日已实现收益的计算精确到小数点后第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，有可能导致每万份基金份额的日已实现收益大幅波动，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。当连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，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。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5000万元情形的，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5000万元情形。

11.2 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。

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的住所。

12.3 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

二〇二六年八月三十一日