

格林日鑫月熠货币市场基金 2017 年第 4 季度报告

2017-12-31

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：2018-01-19

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 2018 年 1 月 17 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 2017 年 10 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

项目	数值
基金简称	格林日鑫月熠货币
场内简称	
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	2017-07-20
报告期末基金份额总额	1,584,901,326.2
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	本基金是证券投资基金中的高流动性、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、混合型基金和债券型基金。
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 2 级基金的基金简称	格林货币 A 格林货币 B
下属 2 级基金的场内简称	
下属 2 级基金的交易代码	004865 004866
报告期末下属 2 级基金的份	4,574,015.68 1,580,327,310.5

额总额

单位：人民币

项目	主基金(元)	格林货币 A(元)	格林货币 B(元)
		2017-10-01 - 2017-12-31	2017-10-01 - 2017-12-31
本期已实现收益		214,478.89	10,351,083.7
本期利润		214,478.89	10,351,083.7
期末基金资产净值		4,574,015.68	1,580,327,310.5

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。

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

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
	-%	-%	-%	-%	-%	-
	-%	-%	-%	-%	-%	-

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 A

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	0.9783 %	0.0015 %	0.3456 %	0.0000 %	0.6327 %	0.0015

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 B

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	1.0417 %	0.0015 %	0.3456 %	0.0000 %	0.6961 %	0.0015

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

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



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



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		
曹晋文	基金经理	2017-07-26	-	12	曹晋文先生，中国人民大学统计学硕士。12年证券从业经历，获得注册会计师资格证书。先后就职于中国人寿资产、信诚人寿保险、民生加银基金。现任格林基金固定收益部副总监。
宋东旭	基金经理	2017-07-20	-	5	宋东旭先生，中央财经大学数理金融学士，Rutgers 金融数学硕士。5年证券从业经历，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。

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。

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。

公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），制定了《格林基金管理有限公司异常交易监控与报告办法》。基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，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

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。

四季度经济增长强劲，失业率维持低位，制造业持续回暖，经济复苏情况良好。报告期内在经济基本面稳定和CPI走势相对温和的情况下，央行货币政策稳健偏紧。总体来看，债市受金融监管及交易情绪影响经历了大幅调整。资金面阶段性紧张，资金波动利率中枢继续走高。进入12月后由于跨年MPA考核及银行业监管加强等因素大行融出减少，另叠加央行净回笼，使得跨年资金始终保持紧张的局面，以股份制银行同业存单、14D中期逆回购为代表的短期收益率持续走高。

报告期内资产配置上，本基金主要投资于同业存单、同业存款，并于季末择机进行了短融和逆回购的投资。期限搭配以及杠杆水平合适，组合整体的流动性较好。展望2018年一季度，预计经济数据继续稳中向好。央行操作方面，预计2018年一季度资金面仍将保持紧平衡格局，定向降准和临时准备金会给予资本市场带来一定的流动性利好。货币市场利率将保持稳定。本基金仍将继续做好流动性管理工作，结合我们对市场的判断，把握货币市场价格波动节奏配置优质资产。

截至 2017 年 12 月 31 日，格林货币 A 本报告期份额净值收益率为 0.9783%；格林货币 B 本报告期份额净值收益率为 1.0417%。同期业绩比较基准收益率为 0.3456%，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）。

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。

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	856,185,015.66	54.0
	其中：债券	856,185,015.66	54.0
	资产支持证券	-	
2	买入返售金融资产	395,197,252.79	24.9
	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	260,941,144.07	16.4
4	其他各项资产	73,043,844.32	4.6
5	合计	1,585,367,256.84	100.0

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	7.0
	其中：买断式回购融资	-	
2	报告期末债券回购融资余额	0	
	其中：买断式回购融资	0	

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

注：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%。

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	3
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	6
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	3

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：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。

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	65.92	
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0	
2	30 天(含)—60 天	9.44	
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0	
3	60 天(含)—90 天	22.54	
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0	
4	90 天(含)—120 天	0.63	
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0	
5	120 天(含)—397 天(含)	0	
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	
	合计	98.53	

报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：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。

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	49,912,067.56	3.1
2	央行票据	-	
3	金融债券	39,995,435.89	2.5
	其中:政策性金融债	39,995,435.89	2.5
4	企业债券	-	
5	企业短期融资券	70,284,002.64	4.4
6	中期票据	-	
7	同业存单	695,993,509.57	43.9
8	其他	-	
9	合计	856,185,015.66	54.0
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	

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	111709506	17 浦发银行 CD506	1,500,000	148,392,054.81	9.3
2	111710362	17 兴业银行 CD362	500,000	49,883,279.5	3.1
3	111708348	17 中信银行 CD348	500,000	49,883,270.8	3.1
4	111720249	17 广发银行 CD249	500,000	49,737,920.13	3.1
5	111710683	17 兴业银行 CD683	500,000	49,383,489.19	3.1
6	150201	15 国开 01	400,000	39,995,435.89	2.5
7	179947	17 贴现国债 47	400,000	39,946,392.54	2.5
8	111719221	17 恒丰银行 CD221	400,000	39,915,271.73	2.5
9	111708213	17 中信银行 CD213	300,000	29,958,273.87	1.8
10	111717145	17 光大银行 CD145	300,000	29,953,205.32	1.8

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	
报告期内偏离度的最高值	0.0158
报告期内偏离度的最低值	-0.0376
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0148

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
----	------	-----	----	-----

注：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。

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
----	------	-----	----	-----

注：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。

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券
说明

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例	原因	调整期
----	------	-----------------	----	-----

受到调查以及处罚情况

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

其他资产构成

单位：人民币

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	49,290,171.7
3	应收利息	5,144,772.5
4	应收申购款	18,608,900.0
5	其他应收款	
6	待摊费用	
8	其他	
9	合计	73,043,844.3

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。

单位：1

项目	格林日鑫月熠货币	格林货币 A	格林货币 B
报告期期初基金份额总额		96,501,572.54	1,551,378,960.2
报告期期间总申购份额		4,364,668.17	1,893,206,202.4
报告期期间基金总赎回份额		96,292,225.03	1,864,257,852.1
报告期期末基金份额总额	1,584,901,326.23	4,574,015.68	1,580,327,310.5

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。

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	2017-10-12	-3,000,000.00	-3,000,000.00	0.000
2	赎回	2017-11-14	-2,000,000.00	-2,000,000.00	0.000
3	赎回	2017-11-30	-3,000,000.00	-3,000,000.00	0.000
4	赎回	2017-12-14	-3,600,000.00	-3,600,000.00	0.000
5	分红再投	2017-12-31	699,225.54	699,225.54	0.000
合计			-10,900,774.46	-10,900,774.46	

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。

项目	持有份额总数	持有份额占基金 总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金 总份额比例	发起份额承 持有期限
基金管理人固有资金		-%		-%	
基金管理人高级管理人员		-%		-%	
基金经理等人员		-%		-%	
基金管理人股东		-%		-%	
其他		-%		-%	
合计		-%		-%	

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	20171009-20171123	300,493.97	1,400,948.99	301,894.92	0.00	0.00
	2	20171127-20171214	115,170.69	51,178.42	0.00	166,349.11	10.50
	3	20171128-20171128	100,721.93	100,816.13	100,886.21	100,651.85	6.35
	4	20171215-20171228	0.00	300,501.43	0.00	300,501.43	18.97
个人	-	-	-	-	-	-	-

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。

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。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。

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。

- 9.1.1 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；
- 9.1.2 《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》；
- 9.1.3 《格林日鑫月熠货币市场基金托管协议》；
- 9.1.4 法律意见书；
- 9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 9.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 9.1.7 中国证监会要求的其他文件。

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。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。

其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	49,290,171.78
3	应收利息	5,144,772.54
4	应收申购款	18,608,900.00
5	其他应收款	0
6	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,043,844.32

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。

单位：份

项目	格林日鑫月熠货币	格林货币 A	格林货币 B
报告期期初基金份额总额		96,501,572.54	1,551,378,960.20
报告期期间总申购份额		4,364,668.17	1,893,206,202.48
报告期期间基金总赎回份额		96,292,225.03	1,864,257,852.13
报告期期末基金份额总额	1,584,901,326.23	4,574,015.68	1,580,327,310.55

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。

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	2017-10-12	-3,000,000.00	-3,000,000.00	0.0000
2	赎回	2017-11-14	-2,000,000.00	-2,000,000.00	0.0000
3	赎回	2017-11-30	-3,000,000.00	-3,000,000.00	0.0000
4	赎回	2017-12-14	-3,600,000.00	-3,600,000.00	0.0000
5	分红再投	2017-12-31	699,225.54	699,225.54	0.0000
合计			-10,900,774.46	-10,900,774.46	

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。

项目	持有份额总数	持有份额占基金 总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金 总份额比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有 资金		-%		-%	
基金管理人高级 管理人员		-%		-%	
基金经理等人员		-%		-%	
基金管理人股东		-%		-%	
其他		-%		-%	
合计		-%		-%	

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	20171009-20171123	300,493,9 72.82	1,400,948 .99	301,894,9 21.81	0.00	0.00 %
	2	20171127-20171214	115,170,6 97.10	51,178,42 9.65	0.00	166,349,1 26.75	10.50 %
	3	20171128-20171128	100,721,9 37.72	100,816,1 34.34	100,886,2 21.68	100,651,8 50.38	6.35 %
	4	20171215-20171228	0.00	300,501,4 33.01	0.00	300,501,4 33.01	18.97 %
个人	-	-	-	-	-	-	-

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。

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。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。