

格林日鑫月熠货币市场基金

2018 年半年度报告

2018 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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 24 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

1.2 目录	
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	21
6.4 报表附注	22

§7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 债券回购融资情况	53
7.3 基金投资组合平均剩余期限	54
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	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 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	56
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	57
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	57
7.9 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	61
§9 开放式基金份额变动	61
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	64
10.9 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70

12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§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	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	631,373,858.29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	51,633,005.35份	579,740,852.94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	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。

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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙会	王健
	联系电话	010-50890709	021-38676252
	电子邮箱	sunhui@china-greenfund.com	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		4001000501	95521
传真		010-50890725	021-38677819
注册地址		北京市朝阳区光华路22号 3层309	中国（上海）自由贸易试验区 商城路618号
办公地址		北京市西城区金融大街27号投 资广场B座2003、2005、200 7	上海市浦东新区银城中路6 8号32层
邮政编码		100033	200120
法定代表人		高永红	杨德红

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
----------------	------

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.china-greenfund.com/
基金半年度报告备置地点	北京市西城区金融大街27号投资广场B座2003、2005、2007

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	北京市西城区金融大街27号投资广场B座2003、2005、2007

§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(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	格林货币A	格林货币B
本期已实现收益	1,318,835.88	20,257,970.33
本期利润	1,318,835.88	20,257,970.33
本期净值收益率	1.9628%	2.0831%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末基金资产净值	51,633,005.35	579,740,852.94
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(2018年06月30日)	
累计净值收益率	3.6734%	3.9083%

注：1、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，由于货币市场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。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3、本基金合同生效日为2017年7月20日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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 一个月	0.2910%	0.0033%	0.1126%	0.0000%	0.1784%	0.0033%
过去 三个月	0.9100%	0.0032%	0.3418%	0.0000%	0.5682%	0.0032%
过去 六个月	1.9628%	0.0052%	0.6810%	0.0000%	1.2818%	0.0052%
自基金 合同生 效起至 今	3.6734%	0.0040%	1.3059%	0.0000%	2.3675%	0.0040%

格林货币B

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 一个月	0.3109%	0.0034%	0.1126%	0.0000%	0.1983%	0.0034%
过去 三个月	0.9711%	0.0032%	0.3418%	0.0000%	0.6293%	0.0032%
过去 六个月	2.0831%	0.0052%	0.6810%	0.0000%	1.4021%	0.0052%
自基金 合同生 效起至 今	3.9083%	0.0039%	1.3059%	0.0000%	2.6024%	0.0039%

注：本基金收益分配按日结转份额，业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。

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

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-2018年06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

(2017年07月20日-2018年06月30日)



§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1亿元整，注册地为中国北京朝阳区。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2018年6月30日，格林基金管理有限公司共管理两只公募基金，格林日鑫月熠货币市场基金和格林伯元灵活配置混合型证券投资基金。

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		
曹晋文	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	2017-07 -26	-	13	曹晋文先生，中国人民大学统计学硕士。13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	本基金基 金经理	2017-07 -20	-	6	宋东旭先生，中央财经大学数理金融学士，Rutgers金融数学

					硕士。6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。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 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》、《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 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、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

国内经济方面，2018年上半年GDP增速6.8%，其中二季度为6.7%，略低于市场预期。CPI走势相对平稳，食品仍是主要拖累。在油价上涨的影响下，PPI出现一定反弹，但是总体上仍然处在相对合理的水平。总体来看内外部压力下，基建投资走弱、净出口拖累扩大，虽然6月份消费小幅反弹但可持续性存疑。经济增长或持续面临下行压力。

政策方面，在经济下行的压力下，央行连续降准，货币政策逐步转向宽松。两次降准共释放流动性约2万亿，其中包括9000亿的MLF置换及约7000亿定向支持“债转股”和小微企业融资。总体来看资金面较为宽松，资金波动利率中枢保持在较低水平。

市场层面，上半年中，债券市场情绪受到国际局势、贸易摩擦等外部事件影响产生波动，且投资者对经济转弱与政策放松的预期也多次出现反复。在上述因素的综合影响下，债市收益率呈现波动下行走势。10年国债收益率从年初的3.9%左右下降至3.5%左右，下行幅度接近40BP。对于信用债，金融强监管下再融资不畅带来的外部现金流收缩导致违约升温，机构的风险偏好降低，中低等级信用债需求减少，信用利差走阔。

组合操作上，主要投资于同业存单、同业存款及短融，并于季末择机加配了逆回购的投资。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年下半年，预计经济增速大概率平缓回落。关注下半年货币政策和宏观审慎政策可能出台的结构性融资困难的政策，以及潜在的财政支出增加的可能性。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。

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1.000元,本报告期内该类基金份额净值收益率为1.9628%,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1.000元,本报告期内该类基金份额净值收益率为2.0831%,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

宏观经济方面,预计2018下半年名义GDP同比增速可能继续回落,企业利润增速或将随之下滑;出口方面受贸易战影响,特朗普中期选举之前难以看到改善迹象;房地产受到棚改政策收紧等一系列政策调控,或对经济构成一定拖累;地方政府平台融资能力受限,基建投资增速预计继续回落;物价方面预计CPI继续处于温和区间,PPI受下游需求回落以及基数抬升,同比增速可能下行。

政策方面,宏观政策已经开始微调:一是提高银行表内额度,鼓励商业银行更多贷款,改善实体经济流动性;二是改善债券市场情绪,促进企业进行直接融资;三是通过财政政策和产业政策等引导,切实改善融资主体的资质,提高银行的风险偏好。货币政策可能继续调整,保持流动性合理充裕。

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,基金份额净值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,委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验。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1.000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1,318,835.88元，实际分配金额1,318,835.88元，B类份额累计应分配利润20,257,970.33元，实际分配20,257,970.33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

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

§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，国泰君安证券股份有限公司（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《中华人民共和国证券投资基金法》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，完全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《中华人民共和国证券投资基金法》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、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，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 托管人对本半年度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、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	120,235,093.98	260,941,144.07
结算备付金		2,272,727.27	0.00
存出保证金		-	0.00
交易性金融资产	6.4.7.2	372,068,312.58	856,185,015.66
其中：股票投资		0.00	0.00
基金投资		0.00	0.00
债券投资		372,068,312.58	856,185,015.66

资产支持证券投资		0.00	0.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	0.00	0.00
买入返售金融资产	6.4.7.4	192,066,768.11	395,197,252.79
应收证券清算款		22,647.97	49,290,171.78
应收利息	6.4.7.5	3,024,800.50	5,144,772.54
应收股利		0.00	0.00
应收申购款		111,932.39	18,608,900.00
递延所得税资产		0.00	0.00
其他资产	6.4.7.6	0.00	0.00
资产总计		689,802,282.80	1,585,367,256.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		0.00	0.00
交易性金融负债		0.00	0.00
衍生金融负债	6.4.7.3	0.00	0.00
卖出回购金融资产款		58,015,770.99	0.00
应付证券清算款		0.00	0.00
应付赎回款		0.00	0.00
应付管理人报酬		197,079.86	200,026.37
应付托管费		39,415.96	40,005.28
应付销售服务费		17,843.21	7,794.62
应付交易费用	6.4.7.7	38,039.26	49,104.34

应交税费		6,603.40	0.00
应付利息		15,411.68	0.00
应付利润		0.00	0.00
递延所得税负债		0.00	0.00
其他负债	6.4.7.8	98,260.15	169,000.00
负债合计		58,428,424.51	465,930.61
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	631,373,858.29	1,584,901,326.23
未分配利润	6.4.7.10	0.00	0.00
所有者权益合计		631,373,858.29	1,584,901,326.23
负债和所有者权益总计		689,802,282.80	1,585,367,256.84

注：1、报告截止日2018年6月30日，格林日鑫月熠货币A基金份额净值1.000元，基金份额总额51,633,005.35份；格林日鑫月熠货币B基金份额净值1.000元，基金份额总额579,740,852.94份。格林日鑫月熠货币基金份额总额合计为631,373,858.29份。

2、本基金合同生效日为2017年7月20日。

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：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期（2018年01月01日至 2018年06月30日）
一、收入		24,818,509.25
1.利息收入		23,376,508.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,783,092.64

债券利息收入		11,246,552.41
资产支持证券利息收入		0.00
买入返售金融资产收入		5,346,863.46
其他利息收入		0.00
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,442,000.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	0.00
基金投资收益	6.4.7.13	0.00
债券投资收益	6.4.7.14	1,442,000.74
资产支持证券投资收益		0.00
贵金属投资收益		0.00
衍生工具收益		0.00
股利收益		0.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	0.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	0.00
减：二、费用		3,241,703.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,588,667.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	317,733.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	134,098.11
4. 交易费用	6.4.7.17	0.00
5. 利息支出		1,086,223.05
其中：卖出回购金融资产支出		1,086,223.05
6. 税金及附加		6,845.39
7. 其他费用	6.4.7.18	108,135.15

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,576,806.21
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,576,806.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：格林日鑫月熠货币市场基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,584,901,326.23	0.00	1,584,901,326.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	21,576,806.21	21,576,806.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-953,527,467.94	0.00	-953,527,467.94
其中：1.基金申购款	2,655,218,182.90	-	2,655,218,182.90
2.基金赎回款	-3,608,745,650.84	-	-3,608,745,650.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	0.00	-21,576,806.21	-21,576,806.21

(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	631,373,858.29	0.00	631,373,858.29

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《关于准予格林日鑫月熠货币市场基金注册的批复》核准,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,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安”)。

本基金根据投资者认购、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,并分开公布每万份基金已实现收益、七日年化收益率。首次认购最低金额为0.01元,追加认购的最低金额为0.01元,年销售服务费率为

0.25%的，称为A类基金份额；首次认购最低金额为1,000,000.00元，追加认购的最低金额为100.00元，年销售服务费率为0.01%的，称为B类基金份额。若A类基金份额持有人单个基金账户在单个销售机构保留的基金份额达到或超过100万份时，本基金的登记机构自动将持有人的该部分A类基金份额升级为B类基金份额；若B类基金份额持有人单个基金账户在单个销售机构保留的基金份额低于100万份时，本基金的登记机构自动将持有人的该部分B类基金份额降级为A类基金份额。

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，本基金的投资范围为现金，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。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)。

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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则以及附注所述的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作规定的要求，真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况及自2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金财务报表的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本财务报表涵盖期间为2018年1月1日至2018年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。本基金编制财务报表采用的货币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。

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。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。当基金资产净值与按影子价格计算的基金资产净值之间的偏离度的绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产净值。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整

对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一日估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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认列。上述申购和赎回分别包括A类与B类基金份额之间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。

6.4.4.8 损益平准金

不适用。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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认列。上述申购和赎回分别包括A类与B类基金份额之间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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率逐日确认。

根据《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》的规定，本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.06%的年费率逐日确认。

根据《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》的规定，本基金实行销售服务费分级收费方式。本基金A类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提，本基金B类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值0.01%的年费率逐日计提。对于因账户基金份额达到100万份而由A类升级为B类的基金份额，年基金销售服务费率应自其达到B类条件的开放日后的下一工作日起享受B类基金份额的费率。对于因账户基金份额降至100万份以下而由B类降级为A类的基金份额，年销售服务费率应自其降级后的下一工作日起适用A类基金份额的费率。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采用红利再投资分红方式，投资者可通过赎回基金份额方式获取现金红利收益。本基金每日进行基金收益公告，以基金已实现收益为基准，为投资者每日计算收益并分配(该收益将会确认为

实收基金，参与下一日的收益分配)。当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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，本基金确定以下类别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：

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发〔2014〕24号)，本基金自2017年7月20日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的影子价格，采用第三方估值机构提供的价格进行估值。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号文《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[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]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)以发行基金方式募集资金，不属于营业税/增值税征收范围，不征收营业税/增值税。

(b)基金买卖债券的投资收益暂免征收营业税/增值税和企业所得税。

(c)对基金取得的债券的利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

(d)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日
----	----------------

活期存款	235,093.98
定期存款	120,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	60,000,000.00
存款期限3个月以上	60,000,000.00
其他存款	0.00
合计	120,235,093.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2018年06月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	0.00	0.0000
	银行间市场	372,068,312.58	372,482,800.00	414,487.42	0.0656
	合计	372,068,312.58	372,482,800.00	414,487.42	0.0656
资产支持证券		-	-	-	-

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

本基金本报告期末持有衍生金融资产/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2018年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	80,000,000.00	-
银行间市场	112,066,768.11	-
合计	192,066,768.11	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日
应收活期存款利息	223.27
应收定期存款利息	554,874.89
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,022.70
应收债券利息	2,326,426.85
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	142,252.79
应收申购款利息	0.00
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.00
合计	3,024,800.50

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	0.00
银行间市场应付交易费用	38,039.26
合计	38,039.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	0.00
应付赎回费	0.00
预提费用	98,260.15
合计	98,260.15

6.4.7.9 实收基金**6.4.7.9.1 格林货币A**

金额单位：人民币元

项目 (格林货币A)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	4,574,015.68	4,574,015.68
本期申购	408,475,625.01	408,475,625.01

本期赎回（以“-”号填列）	-361,416,635.34	-361,416,635.34
本期末	51,633,005.35	51,633,005.35

6.4.7.9.2 格林货币B

金额单位：人民币元

项目 (格林货币B)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,580,327,310.55	1,580,327,310.55
本期申购	2,246,742,557.89	2,246,742,557.89
本期赎回（以“-”号填列）	-3,247,329,015.50	-3,247,329,015.50
本期末	579,740,852.94	579,740,852.94

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 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	-	-	-
本期利润	1,318,835.88	-	1,318,835.88
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	-1,318,835.88	-	-1,318,835.88

本期末	-	-	-
-----	---	---	---

6.4.7.10.2 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	-	-	-
本期利润	20,257,970.33	-	20,257,970.33
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	-20,257,970.33	-	-20,257,970.33
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	113,989.33
定期存款利息收入	6,636,566.01
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	32,537.30
其他	0.00
合计	6,783,092.64

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益**6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,442,000.74
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	1,442,000.74

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,466,961,397.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,447,593,204.75

减：应收利息总额	17,926,191.81
买卖债券差价收入	1,442,000.74

6.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
信息披露费	49,588.57
审计费用	39,671.58
账户维护费	18,000.00
其他	875.00
合计	108,135.15

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

截至本基金本报告披露日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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（“格林基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金托管人

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

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

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
	2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,588,667.83
其中：支付销售机构的客户维护费	165,125.77

注：1.支付基金管理人格林基金的管理人报酬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：

日管理人报酬 = 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
	2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	317,733.51

注：支付基金托管人国泰君安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		
	2018年01月01日至2018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	1,665.19	40,466.81	42,132.00
合计	1,665.19	40,466.81	42,132.00

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。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%。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，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自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 2018年01月01日至2018年06月30日
基金合同生效日（2017年07月20日）持有的基金份额	-
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 2018年01月01日至2018年06月30日
基金合同生效日（2017年07月20日）持有的基金份额	30,000,000.00
报告期初持有的基金份额	62,573,143.74
报告期间申购/买入总份额	2,646,215.91
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	59,300,000.00

报告期末持有的基金份额	5,919,359.65
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.02%

注：本报告期内(2018年1月1日至2018年6月30日)基金管理人持有的格林货币B类基金期间申购/买入总份额含红利发放份额。

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

份额单位：份

格林货币B

关联方名称	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
国泰君安	73,279,872.82	12.64%	166,349,126.75	10.53%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
国泰君安	235,093.98	113,989.33

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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

无。

6.4.11 利润分配情况--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
1,318,835.88	-	-	1,318,835.88	-

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
20,257,970.33	-	-	20,257,970.33	-

6.4.12 期末（2018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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额58,015,770.99元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量 (张)	期末估值总额
11181024 1	18兴业银行CD24 1	2018-07-0 2	99.37	200,000	19,874,758.03
11182011 9	18广发银行CD11 9	2018-07-0 2	99.27	200,000	19,853,430.64
11181711 9	18光大银行CD11 9	2018-07-0 2	99.20	192,000	19,045,926.83
合计				592,000	58,774,115.50

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末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 risk 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 risk 管理工作；定期向董事会报告公司经营活动中的 risk 管理状况；提议聘请或更换外部审计机构。在公司经理层下设立 risk 管理委员会，主要负责组织、落实、商议公司 risk 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，公司监察稽核部作为公司的合规管理部门，根据公司和督察长的要求，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 risk 管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的 risk 管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的 risk 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 risk 产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断 risk 损失的严重程度和出现同类 risk 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 risk 量化指标、模型，日常的量化报告，确定 risk 损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种 risk 进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将 risk 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 risk。

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托管人国泰君安的托管账户；其他定期存款存放在兴业银行

股份有限公司、中国光大银行、中国民生银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、厦门国际银行股份有限公司和盛京银行股份有限公司，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的债券，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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	9,999,384.21	-
A-1以下	-	-
未评级	64,152,315.58	70,284,002.64
合计	74,151,699.79	70,284,002.64

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 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	257,933,186.74	659,993,509.57
合计	257,933,186.74	659,993,509.57

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

于本期末（2018年6月30日），本基金未持有除国债、政策性金融债及央行票据以外的按长期信用评级的债券投资。

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2018年6月30日，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(所有者权益)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。

6.4.13.4 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 2018年06月30 日	1年以内	1-5 年	5年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	120,235,093.98	-	-	-	120,235,093.98
结算备付金	2,272,727.27	-	-	-	2,272,727.27
交易性金融资 产	372,068,312.58	-	-	-	372,068,312.58
买入返售金融	192,066,768.11	-	-	-	192,066,768.11

资产					
应收证券清算款	-	-	-	22,647.97	22,647.97
应收利息	-	-	-	3,024,800.50	3,024,800.50
应收申购款	-	-	-	111,932.39	111,932.39
资产总计	686,642,901.94	0.00	0.00	3,159,380.86	689,802,282.80
负债					
卖出回购金融资产款	58,015,770.99	-	-	-	58,015,770.99
应付管理人报酬	-	-	-	197,079.86	197,079.86
应付托管费	-	-	-	39,415.96	39,415.96
应付销售服务费	-	-	-	17,843.21	17,843.21
应付交易费用	-	-	-	38,039.26	38,039.26
应交税费	-	-	-	6,603.40	6,603.40
应付利息	-	-	-	15,411.68	15,411.68
其他负债	-	-	-	98,260.15	98,260.15
负债总计	58,015,770.99	0.00	0.00	412,653.52	58,428,424.51
利率敏感度缺口	628,627,130.95	-	-	2,746,727.34	631,373,858.29
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	260,941,144.07	-	-	-	260,941,144.07
交易性金融资产	856,185,015.66	-	-	-	856,185,015.66
买入返售金融资产	395,197,252.79	-	-	-	395,197,252.79
应收证券清算款	-	-	-	49,290,171.78	49,290,171.78
应收利息	-	-	-	5,144,772.54	5,144,772.54
应收申购款	-	-	-	18,608,900.00	18,608,900.00
资产总计	1,512,323,412.52	0.00	0.00	73,043,844.32	1,585,367,256.84
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	200,026.37	200,026.37
应付托管费	-	-	-	40,005.28	40,005.28
应付销售服务费	-	-	-	7,794.62	7,794.62
应付交易费用	-	-	-	49,104.34	49,104.34
其他负债	-	-	-	169,000.00	169,000.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	465,930.61	465,930.61
利率敏感度缺口	1,512,323,412.52	-	-	72,577,913.71	1,584,901,326.23

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外,其他市场变量保持不变;		
假设	测算市场利率变动25bp对期末基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率上升25bp	-13,837,088.15	-19,973,701.41
	市场利率下降25bp	15,935,175.93	21,722,815.19

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,未持有权益类证券,因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比	公允价值	占基金资产净值比

		例(%)		例(%)
交易性金融资产-股票投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-债券投资	372,068,312.58	58.93	856,185,015.66	54.02
交易性金融资产-贵金属投资	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融资产-权证投资	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	372,068,312.58	58.93	856,185,015.66	54.02

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日，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中属于第二层次的余额为372,068,312.58元，无属于第一层次或第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3)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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月10日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(3)除公允价值和增值税外，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	372,068,312.58	53.94
	其中：债券	372,068,312.58	53.94
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	192,066,768.11	27.84
	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	122,507,821.25	17.76
4	其他各项资产	3,159,380.86	0.46
5	合计	689,802,282.80	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		6.52
	其中：买断式回购融资		0.00
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	58,015,770.99	9.19
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00

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。

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	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	20

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	59.96	9.19
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)—60天	20.53	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	15.77	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	6.28	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)	6.22	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
合计		108.76	9.19

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,984,274.06	1.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,999,151.99	4.75
	其中：政策性金融债	29,999,151.99	4.75
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	74,151,699.79	11.74
6	中期票据	-	-
7	同业存单	257,933,186.74	40.85
8	其他	-	-
9	合计	372,068,312.58	58.93
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111809148	18浦发银行CD148	300,000	29,817,132.52	4.72
2	111895833	18宁波银行CD066	300,000	29,641,442.95	4.69
3	111807089	18招商银行CD089	300,000	29,283,548.17	4.64
4	011800492	18大唐集SCP004	200,000	20,040,873.35	3.17
5	011758104	17中航资本SCP003	200,000	20,038,244.43	3.17
6	170207	17国开07	200,000	19,998,677.71	3.17
7	11178057	17中原银行CD160	200,000	19,990,184.12	3.17

	0				
8	11181406 2	18江苏银行CD062	200,000	19,962,220.83	3.16
9	11180911 7	18浦发银行CD117	200,000	19,956,875.46	3.16
10	11180914 0	18浦发银行CD140	200,000	19,899,529.12	3.15

7.7 “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	0.1822%
报告期内偏离度的最低值	-0.0077%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0563%

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 18 浦发银行 CD148 (代码 : 111809148)、18 浦发银行 CD117 (代码 : 111809117) 和 18 浦发银行 CD140 (代码 : 111809140) 为本基金前十大持仓证券之三。2018 年 1 月 18 日,四川银监局对浦发银行成都分行内控管理严重失效、授信管理违规、违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为,处以人民币 46175 万元的罚款。2018 年 2 月 12 日,中国银监会对浦发银行通过资管计划投资分行协议存款虚增一般存款、提供不实说明材料、不配合调查取证等严重违反审慎经营规则的违规行为,罚款 5845 万元,没收违法所得 10.927 万元,罚没合计 5855.927 万元。

18 招商银行 CD089 (代码 : 111807089) 为本基金前十大持仓证券之一。2018 年 2 月 12 日,中国银监会对招商银行违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本等严重违反审慎经营规则的违规行为,罚款 6570 万元,没收违法所得 3.024 万元,罚没合计 6573.024 万元。

17 中原银行 CD160 (代码 : 111780570) 为本基金前十大持仓证券之一。2018 年 2 月 9 日,河南银监局对中原银行郑州花园路支行信贷资金违规流入股市的违规行为处以 50 万元的罚款,对中原银行通过"双买断"的同业投资模式进行监管套利的违规行为处以 40 万元的罚款,对中原银行郑州分行个人综合消费贷款被挪用于"购房首付"、违规向借款人发放虚假按揭贷款、调查审查失职、虚增存贷款的违规行为处以 90 万元的罚款。

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。

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	应收证券清算款	22,647.97
3	应收利息	3,024,800.50
4	应收申购款	111,932.39
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,159,380.86

7.9.4 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。

§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	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			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	10,506	4,914.62	9,835,721.40	19.0 5%	41,797,283.95	80.9 5%
格林 货币B	30	19,324,695.10	572,348,460.4 5	98.7 2%	7,392,392.49	1.28%
合计	10,536	59,925.39	582,184,181.8 5	92.2 1%	49,189,676.44	7.79%

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	其他机构	103,417,356.74	16.38%
2	基金类机构	102,771,085.05	16.28%
3	券商类机构	73,279,872.82	11.61%
4	保险类机构	52,656,794.70	8.34%
5	信托类机构	30,107,674.81	4.77%
6	基金类机构	30,003,394.79	4.75%
7	信托类机构	25,011,350.66	3.96%
8	其他机构	20,670,652.97	3.27%
9	基金类机构	20,075,444.38	3.18%
10	券商类机构	20,020,473.94	3.17%

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	1,244,790.56	2.41%
	格林货币B	1,543,646.62	0.27%
	合计	2,788,437.18	0.44%

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	0~10
	格林货币B	>100
	合计	>100
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	4,574,015.68	1,580,327,310.55
本报告期基金总申购份额	408,475,625.01	2,246,742,557.89
减：本报告期基金总赎回份额	361,416,635.34	3,247,329,015.50
本报告期期末基金份额总额	51,633,005.35	579,740,852.94

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基金份额持有人大会。

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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2018年2月13日，基金管理人发布公告，增聘张兴先生担任格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

2018年3月2日，基金管理人发布公告，解聘李雪梅女士担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管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

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	-	-	4,966,900,000.00	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	格林基金管理有限公司关于格林日鑫月熠货币市场基金增加销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-01-05
2	格林日鑫月熠货币市场基金2017年第4季度报告	《证券日报》、管理人网站	2018-01-19
3	格林基金管理有限公司关于增加乾道金融信息服务（北京）有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-01-30
4	格林基金管理有限公司关于	《证券日报》、管理人网站	2018-01-30

	参加大泰金石基金销售有限公司费率优惠活动的公告		
5	格林基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-02-05
6	格林基金管理有限公司关于参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-02-09
7	格林日鑫月熠货币市场基金 2018年春节前暂停申购业务的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-02-12
8	格林基金管理有限公司关于增加北京晟视天下投资管理有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-02-22
9	格林基金管理有限公司关于增加申银万国期货有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-03-05
10	格林基金管理有限公司关于格林日鑫月熠货币市场基金修改基金合同、托管协议及招募说明书等法律文件的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-03-08
11	格林日鑫月熠货币市场基金	《证券日报》、管理人网站	2018-03-08

	基金合同		
12	格林日鑫月熠货币市场基金 托管协议	《证券日报》、管理人网站	2018-03-08
13	格林日鑫月熠货币市场基金 招募说明书(更新)(2018 年第1号)	《证券日报》、管理人网站	2018-03-08
14	格林日鑫月熠货币市场基金 招募说明书(更新)摘要(2 018年第1号)	《证券日报》、管理人网站	2018-03-08
15	格林日鑫月熠货币市场基金 2017年年度报告	《证券日报》、管理人网站	2018-03-28
16	格林日鑫月熠货币市场基金 2017年年度报告摘要	《证券日报》、管理人网站	2018-03-28
17	格林基金管理有限公司关于 增加北京蛋卷基金销售有限 公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-04-02
18	格林日鑫月熠货币市场基金 2018年清明前暂停申购业 务的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-04-02
19	格林基金管理有限公司关于 参加北京蛋卷基金销售有限 公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-04-02
20	格林基金管理有限公司关于 增加天津市凤凰财富基金销 售有限公司为销售机构的公	《证券日报》、管理人网站	2018-04-18

	告		
21	格林基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-04-19
22	格林基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-04-20
23	格林日鑫月熠货币市场基金 2018 年第 1 季度报告	《证券日报》、管理人网站	2018-04-20
24	格林日鑫月熠货币市场基金 2018 年劳动节假期前暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-04-25
25	格林基金管理有限公司关于增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-04-27
26	格林基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-05-09
27	格林基金管理有限公司关于参加中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-05-21
28	格林基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-06-15

29	格林基金管理有限公司关于参加武汉市伯嘉基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-06-15
30	格林基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-06-19
31	格林基金管理有限公司关于参加和耕传承基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-06-19
32	格林基金管理有限公司关于增加天津国美基金销售有限公司为销售机构的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-06-27
33	格林基金管理有限公司关于参加天津国美基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-06-27
34	格林基金管理有限公司关于参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、管理人网站	2018-06-30

§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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

别		超过20%的时间区间					
机构	1	20180104-20180201	300,501,433.01	2,915,923.73	200,000,000.00	103,417,356.74	16.38%
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>							

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和/或基金托管人的住所。

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

二〇一八年八月二十四日

