

格林日鑫月熠货币市场基金

2023年第2季度报告

2023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

报告送出日期:2023年07月21日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期债券回购融资情况	8
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	9
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	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	13
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	13
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	13
§9 备查文件目录	14
9.1 备查文件目录	14
9.2 存放地点	14
9.3 查阅方式	14

§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基金合同约定，于2023年7月20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2023年4月1日起至2023年6月30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	969,385,138.09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	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。	
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	110,827,171.27份	858,557,966.82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(2023年04月01日 - 2023年06月30日)	
	格林货币A	格林货币B
1.本期已实现收益	808,746.32	1,995,120.73
2.本期利润	808,746.32	1,995,120.73
3.期末基金资产净值	110,827,171.27	858,557,966.82

- 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	0.5027%	0.0073%	0.3418%	0.0000%	0.1609%	0.0073%
过去六个月	0.9515%	0.0057%	0.6810%	0.0000%	0.2705%	0.0057%
过去一年	1.7397%	0.0046%	1.3781%	0.0000%	0.3616%	0.0046%
过去三年	6.2591%	0.0044%	4.1916%	0.0000%	2.0675%	0.0044%
过去五年	11.2966%	0.0041%	7.0872%	0.0000%	4.2094%	0.0041%
自基金合同生效起至今	15.3849%	0.0044%	8.4857%	0.0000%	6.8992%	0.0044%

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	0.5636%	0.0073%	0.3418%	0.0000%	0.2218%	0.0073%
过去六个月	1.0722%	0.0057%	0.6810%	0.0000%	0.3912%	0.0057%
过去一年	1.9850%	0.0046%	1.3781%	0.0000%	0.6069%	0.0046%
过去三年	7.0268%	0.0044%	4.1916%	0.0000%	2.8352%	0.0044%
过去五年	12.6431%	0.0041%	7.0872%	0.0000%	5.5559%	0.0041%
自基金合同生效起至今	17.0455%	0.0044%	8.4857%	0.0000%	8.5598%	0.0044%

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-2023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-2023年06月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高洁	本基金基金经理	2020-12-02	-	10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5月加入格林基金，曾任固定收益部基金经理助理，现任基金经理。2020年12月2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2日至今，担任格林中短债债券型证券投资

					基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------

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

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》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》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

2023年第二季度，银行间流动性保持稳定偏宽松状态，资金利率平稳，央行在关键时点都较好地对冲了一些季节性因素或是某些潜在的波动，银行间的资金利率在银行和非银机构、质押信用债和质押利率债等方面呈现结构性的不同，大概率与市场的风险偏好等有关。4月、5月期间，信用利差由于机构配置意愿较强，信用债供给同比偏弱，以及市场资金利率较低等众多因素影响下继续压缩，但进入6月在资金季节性紧张、同时市场预期有变化，信用利差有稍许扩大，但整体受到基本面和资金面的双重作用，基本稳定。

本基金在第二季度运作平稳，主要以配置利率债和银行存单为主，根据市场利率的变化参与了部分波段交易，为组合增厚了一些收益。本基金始终坚持以维护投资者利益为首要投资目标，同时积极发掘市场机会，努力为组合增厚收益。

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0.5027%，同期业绩比较基准收益率为0.3418%；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0.5636%，同期业绩比较基准收益率为0.3418%。

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	583,493,587.38	57.39
	其中：债券	583,493,587.38	57.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	379,261,051.22	37.30
	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	2,089,875.79	0.21
4	其他资产	51,917,139.65	5.11
5	合计	1,016,761,654.04	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	-	10.46
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	47,002,104.42	4.85
	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%。

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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	72
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

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	58.73	4.85
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	13.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	8.23	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.09	-
4	90天(含)—120天	3.07	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	16.79	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.01	4.85

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,100,982.00	3.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	97,376,416.56	10.05
	其中：政策性金融债	97,376,416.56	10.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,786,899.91	10.40
6	中期票据	31,331,032.07	3.23
7	同业存单	323,898,256.84	33.41
8	其他	-	-
9	合计	583,493,587.38	60.19
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,010,950.61	3.10

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

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	112284349	22宁波银行C D212	750,000	74,840,356.29	7.72
2	112322003	23邮储银行C D003	600,000	59,989,392.16	6.19
3	210202	21国开02	500,000	50,944,713.61	5.26
4	112205127	22建设银行C D127	500,000	49,911,635.58	5.15
5	112218194	22华夏银行C D194	500,000	49,810,107.52	5.14
6	112210331	22兴业银行C D331	500,000	49,596,645.42	5.12
7	220214	22国开14	300,000	30,010,950.61	3.10
8	112204041	22中国银行C D041	300,000	29,782,182.88	3.07
9	019694	23国债01	229,000	23,142,745.30	2.39

10	101800779	18陕投集团M TN005	200,000	20,905,616.85	2.16
----	-----------	------------------	---------	---------------	------

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	0.0964%
报告期内偏离度的最低值	0.0287%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0534%

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司2022年09月08日因柜面业务内控管理不到位，被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款人民币25万元，相关文号：甬银保监罚决字〔2022〕60号；2023年01月09日因违规开展异地互联网贷款业务、互联网贷款业务整改不到位等事由，被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款人民币220万元，相关文号：甬银保监罚决字〔2023〕1号。

兴业银行股份有限公司2022年09月09日因债券承销业务严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会罚款人民币150万元，相关文号：银保监罚决字〔2022〕41号；2022年09月28日因理财业务存在违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会罚款人民币450万元，相关文号：银保监罚决字〔2022〕50号。

中国建设银行股份有限公司2022年09月09日因个人经营贷款“三查”不到位等事由，被中国银行保险监督管理委员会罚款人民币260万元，相关文号：银保监罚决字〔2022〕44号；2022年09月30日因理财业务存在违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会

罚款人民币200万元，相关文号：银保监罚决字〔2022〕51号；2023年02月16日因公司治理和内部控制制度与监管规定不符等事由，被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得并处罚款7341.5626万元，相关文号：银保监罚决字〔2023〕10号。

中国银行股份有限公司2022年12月29日因内控管理及员工行为管理不到位，被中国银行保险监督管理委员会重庆监管局罚款人民币50万元，相关文号：渝银保监罚决字〔2022〕45号；2023年02月16日因小微企业贷款风险分类不准确等事由，被中国银行保险监督管理委员会罚款人民币1600万元，相关文号：银保监罚决字〔2023〕5号。

中国邮政储蓄银行股份有限公司2023年07月07日因违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或者资金等事由，被中国人民银行警告，罚款人民币3186万元，相关文号：银罚决字〔2023〕39号。

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,926.67
2	应收证券清算款	8,091,707.70
3	应收利息	-
4	应收申购款	43,776,505.28
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	51,917,139.65

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	130,704,389.26	683,897,962.32
报告期期间基金总申购份额	335,000,033.81	1,228,863,845.56
报告期期间基金总赎回份额	354,877,251.80	1,054,203,841.06
报告期期末基金份额总额	110,827,171.27	858,557,966.82

报告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	申购	2023-04-07	6,000,000.00	6,000,000.00	-
2	申购	2023-04-11	3,000,000.00	3,000,000.00	-
4	申购	2023-05-09	4,000,000.00	4,000,000.00	-
5	赎回	2023-05-17	-2,000,000.00	-2,000,000.00	-
6	赎回	2023-05-24	-1,500,000.00	-1,500,000.00	-
7	申购	2023-06-07	1,000,000.00	1,000,000.00	-
8	申购	2023-06-09	1,500,000.00	1,500,000.00	-
9	赎回	2023-06-15	-6,100,000.00	-6,100,000.00	-
10	红利再投	2023-06-30	114,640.42	114,640.42	-
合计			6,014,640.42	6,014,640.42	

注：本基金的收益分配按日结转份额，列示在“分红再投”项下一并披露。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	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	20230607 - 20230628	-	200,169,819.46	200,169,819.46	-	-

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。

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

2023年07月21日