(上接 C141 版)

联系人:叶见云
客户服务电话:0755-86575665
公司网址:www.caiho.cn
(83)洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司
住所:山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 701 室
办公地址:北京市西城区西什库大街 31 号院九思文创园 5 号楼 501 室
法定代表人:杨雅琴
联系人:邢智
客户服务电话:400-8189-598
公司网址:www.hongtaiwealth.com
(84)深圳盈信基金销售有限公司
住所:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1(811-812)
办公地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1
法定代表人:苗宏升
联系人:王清臣
客户服务电话:4007-903-688
公司网址:www.fundying.com
(85)玄元保险代理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室
法定代表人:马永谙
联系人:卢亚博
客户服务电话:021-50701053
公司网址: http://www.xyinsure.com:7100/kfit_xybx/
(86)阳光人寿保险股份有限公司
住所:海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层
办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层
法定代表人:李科
联系人:王超
客户服务电话:400-88-95510
公司网址: http://life.sinosig.com/
(87)北京钱景基金销售有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街中关村金融大厦 10 层
法定代表人:赵荣春
联系人:魏争
客户服务电话:400-893-6885
公司网址:www.niuji.net
(88)浦领基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
办公地址:上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 69 层
法定代表人:聂婉君
联系人:徐微
客户服务电话:400-086-0286
公司网址:www.prolinkwm.com
(89)众惠基金销售有限公司
住所:贵州省贵阳市观山湖区长岭北路贵阳国际金融中心二期商务区第 C4 栋 30 层 1 号
办公地址:贵州省贵阳市云岩区北京路 9 号君派大厦 16 楼
法定代表人:程雷
联系人:兰显勋
客户服务电话:400-839—1818
公司网址:www.hyzhfund.com
(90)北京中天嘉华基金销售有限公司(暂停申购、定投、转换及赎回业务)
住所:北京市石景山区八大处高科技园区内 6-C 号地 3 号楼 2 层 205 室
办公地址:北京市朝阳区农展南里 13 号瑞辰大厦 315 室
法定代表人:潘鸿
联系人:刘兴颖
客户服务电话:400-111-5800
公司网址:www.jhlc.cn
(91)宜信普泽(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区西大望路 1 号 9 层公寓 1008
办公地址:北京市朝阳区西大望路 1 号 2 号楼 9 层 1008
法定代表人:戎兵
联系人:魏晨
客户服务电话:400-6099-200
公司网址:www.yixinfund.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售基金,并在基金管理人网站公示。
(二)基金登记机构
名称:格林基金管理有限公司
住所:北京市朝阳区东三环中路 5 号楼 47 层 04、05、06 号
办公地址:北京市朝阳区东三环中路 5 号楼财富金融中心 47 层(电梯层 58 层)04、05、06 号
法定代表人:高永红
电话:4001000501
传真:010-50890775
联系人:周铁晨
(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称:北京市同硕律师事务所
住所:北京市丰台区芳城园一区 17 号日月天地 A 座 1103 室
办公地址:北京市丰台区芳城园一区 17 号日月天地 A 座 1103 室
负责人:林化灯
经办律师:林化灯、孙钦良
电话:13910979735
传真:010-58075700
联系人:林化灯
(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
办公地址:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
法定代表人:李丹
经办注册会计师:薛竞、张勇
电话:010-23238888
传真:021-23238800
联系人:张勇
四、基金的名称
本基金名称:格林日鑫月熠货币市场基金。
五、基金的类型
本基金类型:契约型开放式基金。
六、基金份额的类别设置
(一)基金份额的类别
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。
(二)基金份额类别的限制

份额类别	A 类份额	B 类份额
首次单笔申购最低金额	网上直销系统、代销机构:0.01 元 直销柜台:50,000.00 元	1,000,000.00 元
追加单笔申购最低金额	网上直销系统、代销机构:0.01 元 直销柜台:1,000.00 元	网上直销系统、代销机构:100.00 元 直销柜台:1,000.00 元
单笔赎回最低份额	0.01 份	0.01 份
基金账户最低基金份额余额	0.01 份	1,000,000.00 份
年销售服务费率	0.25%	0.01%

(三)基金份额的自动升降级
本基金 A 类和 B 类基金份额通过各销售机构的销售网点进行公开发售,办理申购、赎回等业务。不同份额类别之间不得互相转换。
本基金暂不开展基金份额的自动升降级业务。
(四)基金管理人可以在不违反法律法规的情况下,增加新的基金份额类别,或者调整现有基金份额类别设置及各类别的数额限制、相关规则,或者停止现有基金份额类别的销售等,并在更新的招募说明书或相关公告中披露。
七、基金的投资目标
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。
八、基金的投资方向
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。
九、基金的投资策略
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。
1、整体资产配置策略
整体资产配置策略主要体现在:
1)根据宏观经济走势、货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断;
2)根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。
(1)利率分析通过对各种宏观经济指标、资金市场供求状况等因素的观察分析,预测政府宏观经济政策取向和资金市场供求变化趋势,以此为依据预测金融市场利率变化趋势。
(2)平均剩余期限调整
在对利率变动趋势做出充分评估的基础上,合理运用量化模型,动态调整投资组合平均剩余期限。具体而言,在预期市场利率水平将会出现上升时,适度缩短投资组合的平均剩余期限;在预期市场利率水平将下降时,适度延长投资组合的平均剩余期限。
2、类属配置策略
类属配置指在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业债券以及现金等投资品种之间的投资比例。本基金通过对各类别金融工具政策倾向、信用等级、收益率水平、供求关系、流动性等因素的研究判断,挖掘不同类别金融工具的结构性投资价值,制定并调整类属配置,形成合理组合以实现稳定的投资收益。
3、个券选择策略
选择个券时,本基金将找出收益率出现明显偏高的券种,并客观分析收益率出现偏高的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券种价格出现低估,本基金将对此类低估品种进行重点关注。此外,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限阶段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。
4、套利策略
套利操作策略主要包括两个方面:
(1)跨市场套利。短期资金市场有交易所市场和银行间市场构成,由于其中的投资群体、交易方式等要素不同,使得两个市场的资金面、短期利率期限结构、流动性都存在着一定的差别。本基金将在充分论证套利机会可行性的基础上,寻找合理的介入时机,进行跨市场套利操作,以期获得安全的超额收益。
(2)跨品种套利。由于投资群体存在一定的差异性,对期限相近的交易品种同样可能因为存在流动性、税收等市场因素的影响出现内在价值明显偏离的情况。本基金将在保证高流动性的基础上进行跨品种套利操作,以期获得安全的超额收益。
5、流动性管理策略
本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。基金管理人将在遵循流动性优先的原则下,综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、持有高流动性债券品种、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。同时,基金管理人将密切关注投资者大额申购和赎回的需求变化,根据投资者的流动性需求提前做好资金准备。
6、资产支持证券的投资策略
在有效控制风险的前提下,本基金对资产支持证券侧重于对基础资产质量及未来现金流的分析,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级并密切跟踪评级变化,采用分散投资方式以降低流动性风险。
十、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)
通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。
如果今后法律法规发生变化,或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。
十一、基金的风险收益特征
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。
十二、基金的投资组合报告
以下内容摘自本基金 2020 年第 1 季度报告,本投资组合报告所载数据截至 2020 年 3 月 31 日,本报告中所列财务数据未经审计。
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	159,178,158.71	26.58
	其中:债券	159,178,158.71	26.58
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	215,100,558.55	35.91
	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	224,132,771.45	37.42
4	其他资产	522,500.12	0.09
5	合计	598,933,988.83	100.00

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	-	11.60
	其中:买断式回购融资	-	-
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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2020-02-04	25.09	因基金巨额赎回导致	2020-02-06
2	2020-02-05	27.08	因基金巨额赎回导致	2020-02-06

3、基金投资组合平均剩余期限
(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	28
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

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。
(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	80.06	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	3.33	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	3.32	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.67	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	11.60	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.98	-

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超过 240 天的情况。
5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,069,761.80	5.02
6	中期票据	-	-
7	同业存单	129,108,396.91	21.57
8	其他	-	-
9	合计	159,178,158.71	26.59
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	111910423	19 兴业银行 CD423	300,000	29,572,700.49	4.94
2	012000208	20 大同煤矿 SCP003	200,000	20,069,681.40	3.35
3	111907055	19 招商银行 CD055	200,000	19,976,857.13	3.34
4	111912108	19 北京银行 CD108	200,000	19,953,738.93	3.33
5	111911236	19 平安银行 CD236	200,000	19,930,802.73	3.33
6	111903210	19 农业银行 CD210	200,000	19,881,091.71	3.32
7	012000043	20 大同煤矿 SCP001	100,000	10,000,080.40	1.67
8	111917066	19 光大银行 CD066	100,000	9,919,710.98	1.66
9	111915406	19 民生银行 CD406	100,000	9,873,494.94	1.65

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	0.1580%
报告期内偏离度的最低值	0.0416%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0870%

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。
8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。
9、投资组合报告附注
(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。
(2)19 兴业银行 CD423(代码:111910423)为本基金前十大持仓债券之一。2019 年 9 月 3 日,中国人民银行北京营业管理部对兴业银行北京分行未按照规定履行客户身份识别义务、与身份不明的客户进行交易等违规行为,合计处以罚款 145 万元。2019 年 9 月 30 日,中国银行保险监督管理委员会无锡监管分局对兴业银行无锡分行贷款资金被挪用等违规行为,处以罚款 65 万元。2019 年 10 月 8 日,中国银行保险监督管理委员会北京监管局对兴业银行北京分行违规向房地产企业提供融资等违规行为,责令改正,并处以罚款 600 万元。2019 年 10 月 15 日,中国银行保险监督管理委员会辽宁监管局对兴业银行沈阳分行严重违反审慎经营规则办理票据业务的违规行为,处以罚款 2250 万元。2019 年 11 月 19 日,中国人民银行武汉分行对兴业银行武汉分行违反清算管理规定、银行卡收单业务管理办法等相关规定的违规行为,予以警告,没收违法所得 3,004,949.91 元,并处罚款 1,263,605.69 元。2019 年 11 月 22 日,中国银行保险监督管理委员会河北监管局对兴业银行石家庄分行违规办理同业投资业务等违规行为,处以罚款 50 万元。2019 年 12 月 9 日,中国银行保险监督管理委员会台州监管分局对兴业银行台州分行贷款用途监控不严等违规行为,处以罚款 30 万元。2020 年 1 月 13 日,国家计算机病毒应急处理中心对"兴业银行"(版本 5.0.4)App"未向用户明示申请的全部隐私权限,涉嫌隐私不合规"的情况,认定为违法 App。2020 年 1 月 14 日,中国银行保险监督管理委员会十堰监管分局对兴业银行十堰分行办理贷款业务"存贷挂钩"的违规行为,处以罚款 25 万元。2020 年 2 月 24 日,中国人民银行大连市中心支行对兴业银行大连分行违反《征信业管理条例》相关规定的违规行为,处以罚款 16 万元。2020 年 2 月 27 日,中国银行保险监督管理委员会广东监管局对兴业银行广州分行三方买入返售业务严重违反审慎经营规则的违规行为,处以罚款 100 万元。
20 大同煤矿 SCP003(代码:012000208)、20 大同煤矿 SCP001(代码:012000043)为本基金前十大持仓债券之二。2019 年 8 月 26 日,国家税务总局大同市税务局稽查局对大同煤矿取得不符合规定的发票的违法行为,处以罚款 3000 元。2019 年 12 月 23 日,忻州煤矿安全监察局对大同煤矿集团忻州同舟煤业有限公司"截止 2019 年 11 月底,矿井累计原煤产量为 333 万吨,超过矿井核定生产能力的 110%"的违规行为,责令停产整顿,罚款人民币 100 万元,暂扣安全生产许可证。2019 年 12 月 31 日,忻州煤矿安全监察局对大同煤矿集团同生同基煤业有限公司"12 月 24 日中班,5122 综采工作面员工刘勇无采煤机特种作业操作证操作采煤机作业"的违规行为,处以罚款 3 万元。
19 招商银行 CD055(代码:111907055)为本基金前十大持仓债券之一。2019 年 7 月 8 日,全国银行间同业拆借中心对招商银行因交易员操作失误导致在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09%的异常利率交易的情况,进行了通报批评。2019 年 7 月 18 日,中国银行保险监督管理委员会上海监管局对招商银行信用卡中心未遵守总授信额度管理制度的违规行为,责令改正,并处以罚款 20 万元。2019 年 8 月 27 日,中国银行保险监督管理委员会金华监管分局对招商银行金华义乌支行办理无真实贸易背景的银行承兑汇票等违规行为,处以罚款 75 万元。2019 年 12 月 12 日,中国银行保险监督管理委员会山西监管局对招商银行太原分行发放未办理网签合同且楼盘未封顶的个人住房按揭贷款的违规行为,责令改正,并处以罚款 30 万元。2019 年 12 月 26 日,中国银行保险监督管理委员会消保局认定招商银行存在"在整改期间实质违规扩大了业务范围"、"推荐下载钱端 App 等违规推介行为"的情况。2019 年 12 月 26 日,中国银行保险监督管理委员会襄阳监管分局对招商银行襄阳分行贷款受托支付不及时的违规行为,处以罚款 25 万元。2019 年 12 月 27 日,中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对招商银行杭州分行个人贷款管理不审慎等违规行为,处以罚款 135 万元。2019 年 12 月 30 日,中国银行保险监督管理委员会常州监管分局对招商银行常州分行贷款用途监管不严等违规行为,处以罚款 65 万元。2020 年 1 月 15 日,中国人民银行西安分行对招商银行西安分行超期向人民银行报送账户开立、撤销资料的违规行为,给予警告,并处以罚款 13.5 万元。
19 北京银行 CD108(代码:111912108)为本基金前十大持仓债券之一。2019 年 5 月 16 日,中国银行保险监督管理委员会绍兴监管分局对北京银行绍兴分行虚增存贷款等违规行为,处以罚款 146 万元。2019 年 9 月 3 日,中国银行保险监督管理委员会北京监管局对北京银行个人消费贷款被挪用于支付购房首付款或投资股权等违规行为,责令改正,并处以罚款 110 万元。2019 年 9 月 25 日,中国银行保险监督管理委员会北京监管局对北京银行员工大额消费贷款违规行为长期未有效整改等违规行为,责令改正,并处以罚款 100 万元。
19 平安银行 CD236(代码:111911277)为本基金前十大持仓债券之一。2019 年 4 月 10 日,中国银行保险监督管理委员会河北监管局对平安银行石家庄分行未经批准设立分支机构等违规行为,处以罚款 200 万元。2019 年 4 月 24 日,中国人民银行温州市中心支行对平安银行温州分行为非法平台提供支付服务等违反有关清算管理规定的行为,给予警告,没收违法所得人民 1,691,174.82 元,并处罚款 5,376,880.63 元;对利用内部过渡户办理客户备付金互转的行为,处以罚款 3 万元;对为单位商户设置个人账户作为收单账户的行为,给予警告,并处以罚款 30 万元。2019 年 7 月 8 日,全国银行间同业拆借中心对平安银行因交易员操作失误导致在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09%的异常利率交易的情况,进行了通报批评。2019 年 8 月 20 日,中国人民银行杭州中心支行对平安银行杭州城西支行未执行有关清算管理规定的违规行为,给予警告,没收违法所得 3663.4 元,并处以罚款 60 万元。2019 年 9 月 27 日,中国银行保险监督管理委员会金华监管分局对平安银行义务分行信贷资金用于支付购房首付款等违规行为,处以罚款 50 万元。2019 年 11 月 15 日,中国银行保险监督管理委员会北京监管局对平安银行北京分行个人贷款业务借贷搭售严重违反审慎经营规则的违规行为,责令改正,并处以罚款 50 万元。2019 年 12 月 11 日和 12 日,中国银行保险监督管理委员会大连监管局对平安银行大连分行贷后管理未及时发现贷款资金未按约定用途使用、经营性物业贷款贷前调查未尽职、贷前调查不尽职等违规行为,合计处以罚款 110 万元。2019 年 12 月 19 日,中国银行保险监督管理委员会江苏监管局对平安银行南京分行存在存贷款挂钩等违规行为,处以罚款 70 万元。2020 年 1 月 3 日,中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对平安银行杭州分行流动资金贷款贷前调查不尽职的违规行为,处以罚款 50 万元。2020 年 1 月 20 日,中国银行保险监督管理委员会深圳监管局对平安银行汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成等违规行为,处以罚款 720 万元。2020 年 2 月 28 日,中国银行保险监督管理委员会北京监管局对平安银行北京分行信贷人员代销保险激励约束机制不健全等违规行为,责令改正,并处以罚款 100 万元。
19 农业银行 CD210(代码:111903210)为本基金前十大持仓债券之一。2019 年 6 月 24 日,中国银行保险监督管理委员会温州监管分局对农业银行温州分行营业场所销售行为不合规的违规行为,处以罚款 35 万元。2019 年 8 月 2 日,中国银行保险监督管理委员会深圳监管局对农业银行深圳市分行因经营性物业贷款被借款人关联房地产开发企业挪用等违规行为,处以罚款 80 万元。2019 年 10 月 29 日,中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对农业银行浙江省分行贷款管理不审慎等违规行为,没收违法所得 5.4 万元,并处以罚款 311.2 万元,合计 316.6 万元。2019 年 12 月 9 日,中国银行保险监督管理委员会台州监管分局对农业银行台州分行个人住房按揭贷款业务严重不审慎的违规行为,处以罚款 30 万元。2019 年 12 月 10 日,中国银行保险监督管理委员会江西监管局对农业银行江西省分行办理国内信用证业务浮利分费等违规行为,处以罚款 120 万元;对农业银行南昌分行变相超越权限审批贷款的违规行为,处以罚款 25 万元。2019 年 12 月 27 日,中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对农业银行宁波市分行向环保不达标企业发放贷款等违规行为,处以罚款 240 万元。2020 年 1 月 7 日,中国银行保险监督管理委员会滨州监管分局对农业银行滨州分行"低风险业务"未纳入统一授信等违规行为,处以罚款 40 万元。2020 年 1 月 9 日,中国银行保险监督管理委员会呼伦贝尔监管分局对农业银行牙克石市支行未严格执行重要岗位人员轮岗内控管理制度的违规行为,处以罚款 30 万元。2020 年 1 月 19 日,国家税务总局北京市海淀区税务局对农业银行未按照规定期限办理纳税申报和报送纳税资料的违法行为,处以罚款 50 元。2020 年 3 月 17 日,中国银行保险监督管理委员会青海监管局对农业银行西宁市城西支行向提供虚假资料的信用卡申请人发卡等违规行为,处以罚款 30 万元;对贷款"三查"严重不尽职等违规行为,处以罚款 50 万元。2020 年 3 月 18 日,中国银行保险监督管理委员会对农业银行代理人保寿险保险业务,存在销售行为可回溯制度执行不到位等违规行为,对农业银行总行、农业银行安阳县支行、农业银行巩义市支行、农业银行平顶山湛河支行分别处以罚款人民币 50 万元。
19 光大银行 CD066(代码:111917066)为本基金前十大持仓债券之一。2019 年 4 月 10 日,中国银行保险监督管理委员会吉林监管局对光大银行长春汽车厂支行办理无真实贸易背景银行承兑汇票业务的违规行为,处以罚款 40 万元。2019 年 6 月 24 日,中国银行保险监督管理委员会云南监管局对光大银行昆明分行办理无真实贸易背景的国内信用证业务等违规行为,处以罚款 40 万元。2019 年 7 月 17 日,中国银行保险监督管理委员会对光大银行大连庄河支行信贷管理未尽职等违规行为,处以罚款 50 万元;对光大银行软件园支行"贷款三查"不到位等违规行为,处以罚款 50 万元。2019 年 8 月 16 日,中国银行保险监督管理委员会江西监管局对光大银行南昌分行以赠送实物方式销售理财产品的违规行为,处以罚款 20 万元。2019 年 9 月 23 日,中国银行保险监督管理委员会大庆监管分局对光大银行大庆分行内控管理失效等违规行为,处以罚款 150 万元;对内控管理制度执行不严等违规行为,处以罚款 120 万元。2019 年 12 月 19 日,中国银行保险监督管理委员会江苏监管局对光大银行南京分行票据业务严重违反审慎经营规则的违规行为,处以罚款 40 万元。2019 年 12 月 20 日,中国银行保险监督管理委员会无锡监管分局对光大银行无锡分行统一授信管理不到位的违规行为,处以罚款 40 万元。2019 年 12 月 24 日,中国银行保险监督管理委员会天津监管局对光大银行天津分行以信贷资金办理定期存单、存单质押贷款的违规行为,处以罚款 50 万元。2019 年 12 月 25 日,中国银行保险监督管理委员会泰州监管分局对光大银行泰州分行贷后管理严重违反审慎经营规则的违规行为,处以罚款 50 万元。2019 年 12 月 27 日,中国银行保险监督管理委员会对光大银行授信审批不审慎等违规行为,处以罚款 180 万元。2019 年 12 月 30 日,中国银行保险监督管理委员会贵州监管局对光大银行贵阳分行以贷转存、虚增存款等违规行为,处以罚款 50 万元。2020 年 1 月 9 日,中国银行保险监督管理委员会嘉兴监管分局对光大银行嘉兴分行虚增存贷款的违规行为,处以罚款 60 万元。2020 年 2 月 10 日,中国人民银行对光大银行未按规定履行客户身份识别业务等违规行为,处以罚款 1820 万元。2020 年 2 月 17 日,中国银行保险监督管理委员会黑龙江监管局对光大银行黑龙江分行开展二手房网上资金托管业务违反审慎经营规则的违规行为,处以罚款 50 万元。2020 年 3 月 20 日,中国银行保险监督管理委员会金华监管分局对光阴和金华分行员工违规保管经客户签章但关键条款空白的合同等重要资料的违规行为,处以罚款 25 万元。
19 民生银行 CD406(代码:111911236)为本基金前十大持仓债券之一。2019 年 4 月 2 日,中国银行保险监督管理委员会大连监管局对民生银行大连分行小微联保授信业务贷前调查不尽职的违规行为,处以罚款 50 万元;对民生银行贷后管理不到位、银行承兑汇票保证金来源审查不严格等违规行为,处以罚款 50 万元;对民生银行以贷收贷、掩盖资产真实质量等违规行为,处以罚款 100 万元;对民生银行大连分行部分信贷资金回流本行作银行承兑汇票保证金等违规行为,处以罚款 50 万元;对民生银行贷后管理不到位等违规行为,处以罚款 100 万元。2019 年 4 月 10 日,中国银行保险监督管理委员会重庆监管局对民生银行重庆分行内控管理不严导致信贷资金违规流入房地产企业等违规行为,处以罚款 90 万元。2019 年 6 月 6 日,中国银行保险监督管理委员会山西监管局对民生银行太原分行贷款用途不合规等违规行为,责令改正,并处以罚款 480 万元。2019 年 7 月 17 日,中国银行保险监督管理委员会青岛监管局对民生银行青岛分行以贷转存等违规行为,没收违法所得 434023.96 元,并处以罚款 100 万元。2019 年 7 月 17 日,国家外汇管理局黑龙江省分局对民生银行哈尔滨分行为企业办理内保外贷业务未做到尽职审查的违规行为,没收违法所得 285,484.50 元人民币,并处以 90 万元人民币的罚款;对为企业办理货物贸易退汇收入未入待核查账户的违规行为,给予警告,并处以 7 万元人民币的罚款。2019 年 12 月 4 月,中国银行保险监督管理委员会北京监管局对民生银行同业票据业务管理失控等违规行为,责令改正,并处以罚款 700 万元。2019 年 12 月 23 日,中国银行保险监督管理委员会临沂监管分局对民生银行临沂分行违反房地产信贷政策等违规行为,处以罚款 180 万元。2020 年 2 月 10 日,中国人民银行对民生银行未按规定履行客户身份识别义务等违规行为,处以罚款 2360 万元。2020 年 1 月 13 日,国家计算机病毒应急处理中心对"民生银行"(版本 5.12)App"未向用户明示申请的全部隐私权限,涉嫌隐私不合规"的情况,认定为违法 App。
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。
(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	356,097.41
4	应收申购款	166,402.71
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	522,500.12

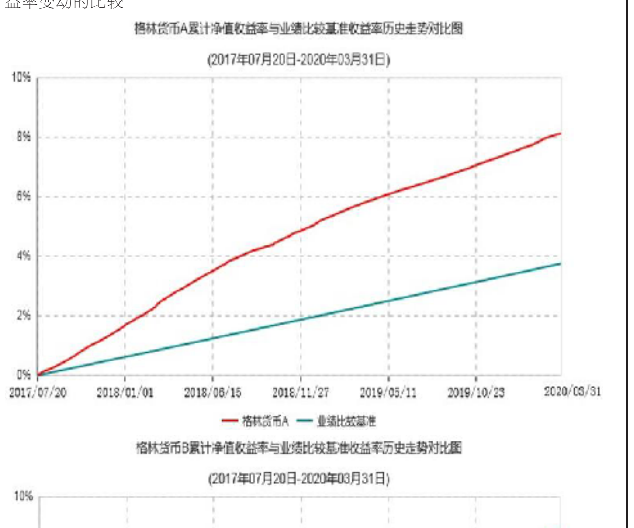
(4)投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。
十三、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
1.基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
格林货币 A

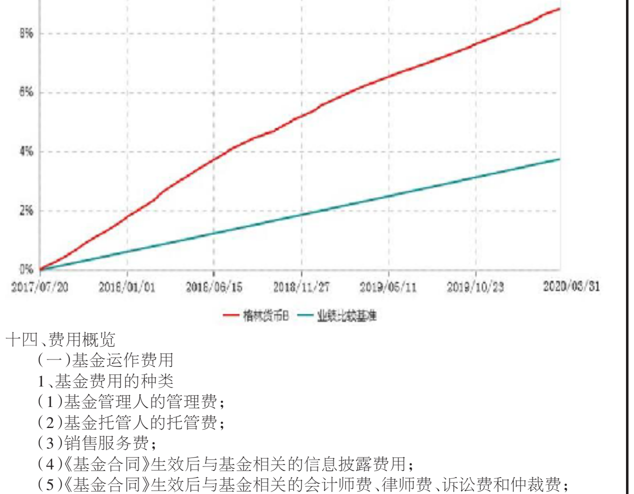
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017 年 7 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日	1.6777%	0.0017%	0.6207%	0.0000%	1.0570%	0.0017%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	3.4379%	0.0055%	1.3781%	0.0000%	2.0598%	0.0055%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2.2316%	0.0015%	1.3781%	0.0000%	0.8535%	0.0015%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 31 日	0.5855%	0.0046%	0.3418%	0.0000%	0.2437%	0.0046%
自基金合同生效日至 2020 年 3 月 31 日	8.1499%	0.0042%	3.7666%	0.0000%	4.3832%	0.0042%

格林货币 B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
2017 年 7 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日	1.7879%	0.0017%	0.6207%	0.0000%	1.1672%	0.0017%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	3.6857%	0.0055%	1.3781%	0.0000%	2.3076%	0.0055%
2019 年 1 月 1 日 2019 年 12 月 31 日	2.4792%	0.0015%	1.3781	0.0000	1.1011%	0.0015%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 31 日	0.6446%	0.0046%	0.3418%	0.0000%	0.3028%	0.0046%
自基金合同生效日至 2020 年 3 月 31 日	8.8531%	0.0042%	3.7666%	0.0000%	5.0865%	0.0042%

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





十四、费用概览
(一)基金运作费用
1、基金费用的种类
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)销售服务费;
(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
(5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
(6)基金份额持有人大会费用;
(7)基金的证券交易费用;
(8)基金的银行汇划费用;
(9)基金的账户开户费用、账户维护费用;
(10)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
(1)基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.30%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人按照双方约定的方式于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。
(2)基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.06%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.06%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。
(3)基金销售服务费
本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%,对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其确认降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%,对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其确认升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。各类别基金份额的基金销售服务费计提的计算公式具体如下:
H=E×该类基金份额年销售服务费率÷当年天数
H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费
E 为前一日该类基金份额的基金资产净值
基金销售服务费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。
销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。
上述"1、基金费用的种类中第(4)-(10)项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
(二)与基金销售有关的费用
1、申购费与赎回费
(1)除法律法规另有规定或基金合同另有约定外,本基金不收取申购费用和赎回费用。
(2)在满足相关流动性风险管理要求的前提下,当基金持有的现金、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低于 5%且偏离度为负时,为确保基金平稳运作,避免诱发系统性风险,基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用,并将上述赎回费用全额计入基金资产,基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。当本基金前 10 名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%,且本基金投资组合中现金、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低于 10%且偏离度为负时,基金管理人应当对当日单个基金份额持有人超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用,并将上述赎回费用全额计入基金财产。
(3)本基金的申购、赎回价格为每份基金单位 1.00 元。投资人申购所得的份额等于申购金额除以 1.00 元,赎回所得的金额等于赎回份额乘以 1.00 元。法律法规另有规定的,从其规定。
(4)本基金通过每日计算收益并分配的方式,使基金份额净值保持在 1.00 元。
2、申购份额与赎回金额的计算及处理方式
(1)本基金申购份额的计算:
采用"金额申购"方式,申购价格为每份基金份额净值 1.00 元,申购份额的计算公式:
申购份额=申购金额/1.00
申购的有效份额按实际确认的申购金额除以 1.00 元确定,计算结果保留到小数点后 2 位,小数点后 2 位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。
例一:某投资人在 T 日投资 10,000.00 元申购本基金 A 类基金份额,则其可得 A 类基金份额的申购份额计算如下:
申购份额=10,000.00/1.00=10,000.00 份
即:该投资人投资 10,000.00 元申购本基金 A 类基金份额,其可得到 10,000.00 份 A 类基金份额。
(2)本基金赎回金额的计算:
采用"份额赎回"方式,赎回价格为每份基金份额净值 1.00 元。赎回金额的计算公式如下:
赎回金额=赎回份额×1.00 元
赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位,小数点后 2 位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。
例二:假定某投资者在 T 日赎回 10,000.00 份 B 类基金份额(不考虑升降级的影响),则赎回金额的计算如下:
赎回金额=10,000.00×1.00=10,000.00 元
即投资者赎回 10,000.00 份 B 类基金份额,则可得到 10,000.00 元赎回金额。
3、基金转换费用
基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。
十五、对招募说明书更新部分的说明
格林日鑫月熠货币市场基金招募说明书(更新)依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他法律法规的要求,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:
1、更新了"重要提示"中的相关内容。
2、更新了"三、基金管理人"中的相关内容。
3、更新了"四、基金托管人" 中的相关内容。
4、更新了"五、相关服务机构"中的相关内容。
5、更新了"十、基金的投资"中的相关内容。
6、更新了"十一、基金的业绩"中的相关内容。
7、更新了"二十三、其他应披露事项"中的相关内容。

格林基金管理有限公司
2020 年 6 月 16 日