

# 景顺长城景益货币市场基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 4 月 24 日

## § 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 21 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 1 月 1 日起至 2017 年 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	景顺长城景益货币
场内简称	无
基金主代码	000380
交易代码	000380
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 26 日
报告期末基金份额总额	953,608,728.03 份
投资目标	本基金在保持基金资产安全性和高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，实现基金的安全稳定回报。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的合理预判，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，综合分析宏观经济指标，包括全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、利率水平和市场预期、通货膨胀率、货币供应量等，对短期利率走势进行综合判断，同时分析央行公开市场操作、主流资金的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场资金互动等，并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。预期市场利率水平上升，适度缩短投资组合的平均剩余期限，以降低组合下跌风险；预期市场利率水平下降，适度延长投资组合的平均剩余期限，以分享债券价格上升的收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。

风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的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	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城景益货币 A	景顺长城景益货币 B
下属分级基金的交易代码	000380	000381
报告期末下属分级基金的份额总额	323,252,717.07 份	630,356,010.96 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（2017年1月1日—2017年3月31日）	
	景顺长城景益货币 A	景顺长城景益货币 B
1. 本期已实现收益	2,547,303.30	4,249,420.37
2. 本期利润	2,547,303.30	4,249,420.37
3. 期末基金资产净值	323,252,717.07	630,356,010.96

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、上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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

###### 景顺长城景益货币 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	0.8243%	0.0023%	0.3329%	0.0000%	0.4914%	0.0023%

注：本基金的收益分配方式为按日结转份额。

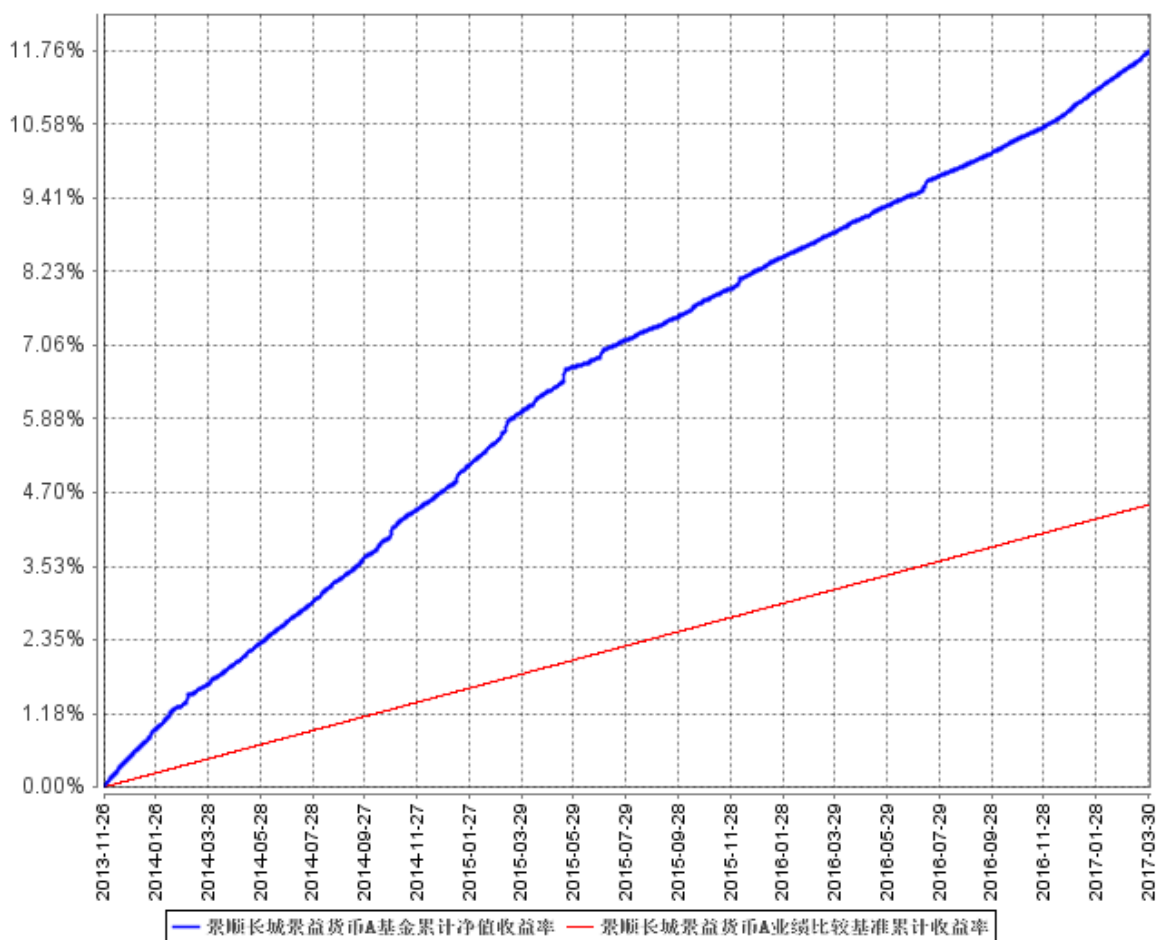
###### 景顺长城景益货币 B

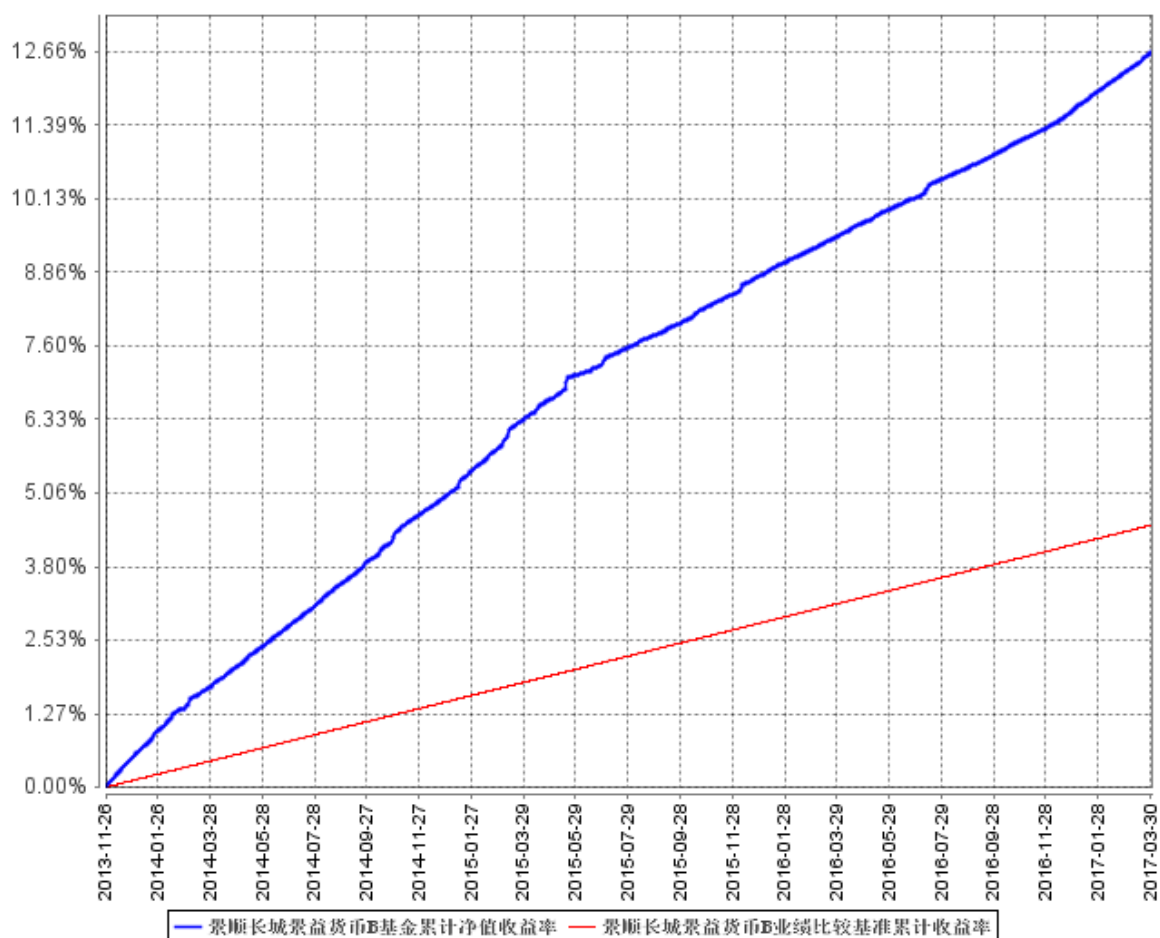
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个	0.8846%	0.0023%	0.3329%	0.0000%	0.5517%	0.0023%

月						
---	--	--	--	--	--	--

注：本基金的收益分配方式为按日结转份额。

### 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





注：本基金的建仓期为自 2013 年 11 月 26 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到投资组合比例的要求。

## §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		
袁媛	本基金的基金经理	2014 年 4 月 4 日	-	10 年	经济学硕士。曾任职于齐鲁证券北四环营业部，也曾担任中航证券证券投资部投资经理、安信证券资产管理部投资主办等职务。2013 年 7 月加入本公司，担任固定收益部资深研究员；自 2014 年 4 月起担任基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定

聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城景益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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与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的 5% 的交易共有 3 次，为公司旗下管理的量化基金及指数增强基金根据基金合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间临近交易日虽然存在同向交易和反向交易行为，但结合交易时机和交易价差分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1 季度经济基本面数据显示经济活力仍然强劲。在内需平稳、外需回暖之下，1-2 月 PMI 继续保持扩张，大型企业 PMI 继续引领扩张，中、小型企业则相对落后。1-2 月 CPI 先高后底，主要由于春节错位以及食品价格明显下滑导致，但非食品价格上涨依然强劲。1-2 月 PPI 继续冲高至本轮回升最高点。2017 年政府工作报告将 2017 年 GDP 增速目标调整为 6.5% 左右，M2 增速下调到 12%，中性偏紧的货币政策得到进一步确认；汇率政策继续保持稳定；赤字率为 3%，财政

政策依然维持积极的基调；供给侧改革加速推进。春节后开市首日及 3 月 16 日央行两次提高 7 天期、14 天、28 天期逆回购操作中标利率。同时 SLF、MLF 操作利率也上调。国际方面，美联储在 3 月议息会议后宣布上调联邦基金利率 25BP，同时维持 2017 年加息三次的预测不变。欧元区和英国的经济和通胀指标也逐步回升，法国大选中间派独立竞选人领先导致市场担忧情绪缓解。

1 季度债券市场整体呈现先扬后抑走势，收益率区间震荡。年初受资金面宽松及配置需求推动，收益率小幅下行，中下旬因临近春节资金面趋紧，加上节前央行上调 MLF 利率加剧了市场忧虑情绪，收益率明显上行。节后开市首日央行继续货币政策从紧，全面上调 7 天、14 天、28 天逆回购利率和 SLF 隔夜、7 天、1 月利率。带来收益率有所调整。2 月经济基本面显示经济活力仍然强劲。然而，市场对经济的中期走势仍有分歧，因此债券市场并没有做出过多负面反馈。3 月上旬在 2 月制造业 PMI 指数及进口数据超预期，联储加息预期大幅提升，MPA 考核要求升级传闻影响下，债市长短端均上行。随着基本上美联储第三次加息 25BP 落地。中国央行政策跟随，再度上调公开市场逆回购各期限利率、SLF 和 MLF 利率。美联储加息预期和短期经济数据利空同时兑现，债市出现抢跑行情，长债收益率下行，短债收益率受资金面走紧影响出现上行。总体来看，1 季度收益率上行为主。10 年期国债和国开债收益率分别上行 27BP、38BP 至 3.28% 和 4.06%，信用债表现弱于利率债，信用利差走扩。

1 季度货币政策坚持稳健中性。春节后开市首日及 3 月 16 日央行两次提高 7 天期、14 天、28 天期逆回购操作中标利率。同时 SLF、MLF 操作利率也上调。美联储在 3 月议息会议后宣布上调联邦基金利率 25BP，叠加 1 季度 MPA 考核影响，资金面在 3 月剧烈波动，利率阶段性飙升。本基金根据基金规模变化动态调整短融、回购、存单的配置比例。趁季末因素发酵资金面时点进行回购并选取季末利率走高时点择机投资部分协议存款。

1 季度看经济的增长动能依然来自于房地产和基建。制造业投资回升动能相对缓慢，工业品价格见顶后上游企业主动补库存趋于放缓，房地产投资的持续性对于经济至关重要。短期看房地产景气度较高、销量和价格持续回升。随着限购加码实施，短期核心城市的成交将回落，非核心地区的销量增长转化为投资的受制于总库存和总投资金额，所以房地产投资难以维持去年增速，预计将逐步回落。消费端由于汽车销量下滑表现低迷，而居民去年加杠杆后过度透支消费，今年消费需求预计继续维持低增长。

在美联储宣布加息后，央行紧随提高公开市场操作利率，其市场引导意义十分强烈，表明了央行去金融杠杆和抑制资产泡沫的决心。短期在无通胀压力之下，央行上调存贷款基准利率的概率不大。预计央行将跟随美国加息频率继续上调公开市场利率，全年货币政策继续中性偏紧。

短期来看，1 季度企业盈利得到改善是预料之中，通胀处于低位，无风险收益率暂时无大幅上行风险；以价格带动需求的补库存在近期大宗商品价格高位震荡背景下可能有所减弱，2 季度 PPI 可能出现全年高点。对于债市来讲，2 季度随着 PPI 触顶回落，经济增速也将回落，货币政策未进入实质性“加息周期”，资金利率水平度过 3 月底考核将会稍微缓和。3 月美国加息后，市场和美联储均预计 2017 年加息三次。短期特朗普预期消退，6 月加息预期有所降低。下半年美联储加息节奏掣肘央行货币政策。2 季度可能是年内难得的政策真空期。在基本面数据无更多利空背景下，存在结构性交易机会。

但制约债市调整的因素并无根本改变。银行同业理财去杠杆仍在进行，货币政策基调仍维持中性。基本面和政策面将对债市形成较长时间的压制。包括固定资产投资的政治周期现象因素对经济拉动的不确定性影响。海外市场的不确定性包括市场关注的全球流动性拐点问题，对 17 年中国经济走势的影响将更为显著。MPA 考核对资金面的冲击每季度都会如约到来，货币政策从紧带来后续资金面仍会波动。强监管背景下债市无趋势性下行机会。主要来自于预期差的交易机会需要谨慎参与。信用债由于信用利差反应并不充分，低等级信用债仍面临信用利差走扩风险，维持择优选择中高等级配置的观点。久期方面，短久期品种收益率不低，可维持组合短久期等待更好配置机会。

展望 2017 年，货币市场将持续波动，央行将以多元化货币政策工具（公开市场与 SLF、MLF 相结合）维稳市场资金面。短期政策重点仍在去金融杠杆，利率中枢受货币政策预期改变、美联储加息冲击等因素影响阶段性抬升。需警惕央行中性态度下对冲滞后引起的持续超预期紧张风险。货币基金今年将继续关注流动性管理。密切关注汇率变化及宏观层面因素（MPA 考核等）对资金面的影响，并及时对组合进行灵活调整，注重保持组合的流动性和适度的组合久期。本基金将强化投资风险控制，在保持基金良好流动性的同时提高静态收益，同时积极灵活把握市场波段操作。平衡配置同业存款和债券投资，保持合理流动性资产配置，细致管理现金流，以控制利率风险和应对组合规模波动。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2017 年 1 季度，景益货币 A 净值收益率为 0.8243%，业绩比较基准收益率为 0.3329%；

2017 年 1 季度，景益货币 B 净值收益率为 0.8846%，业绩比较基准收益率为 0.3329%。



#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §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	169,656,599.66	17.74
	其中：债券	169,656,599.66	17.74
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	318,837,700.26	33.34
	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	453,743,064.15	47.45
4	其他资产	14,048,397.03	1.47
5	合计	956,285,761.10	100.00

注：银行存款和结算备付金其中包含定期存款 451,000,000.00 元。

#### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.77	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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基金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

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	31

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	33
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	12

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内，本货币基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 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	66.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	11.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	18.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	2.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	98.81	-

### 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

本报告期内，本货币基金投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,935,238.50	5.24
	其中：政策性金融债	49,935,238.50	5.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	79,978,131.34	8.39
6	中期票据	-	-

7	同业存单	39,743,229.82	4.17
8	其他	-	-
9	合计	169,656,599.66	17.79
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 5.6 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	011698832	16 中电投 SCP016	300,000	29,990,265.60	3.14
2	011698439	16 国电 SCP005	200,000	19,994,501.04	2.10
3	011698761	16 东航股 SCP016	200,000	19,994,195.13	2.10
4	160211	16 国开 11	200,000	19,988,416.77	2.10
5	160419	16 农发 19	200,000	19,947,664.86	2.09
6	111711051	17 平安银行 CD051	200,000	19,909,170.14	2.09
7	111708063	17 中信银行 CD063	200,000	19,834,059.68	2.08
8	011698234	16 宁沪高 SCP006	100,000	9,999,169.57	1.05
9	160414	16 农发 14	100,000	9,999,156.87	1.05

### 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	0.0219%
报告期内偏离度的最低值	-0.0056%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0091%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内，本货币基金未发生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

本报告期内，本货币基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 5.8 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。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值为 1.0000 元。

### 5.9.2

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.9.3 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	2,291,110.07
4	应收申购款	11,757,286.96
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	14,048,397.03

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城景益货币 A	景顺长城景益货币 B
报告期期初基金份额总额	806,281,916.68	1,433,595,029.33
报告期期间基金总申购份额	351,758,543.37	951,823,245.63
报告期期间基金总赎回份额	834,787,742.98	1,755,062,264.00
报告期期末基金份额总额	323,252,717.07	630,356,010.96

注：总申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额，总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

### §7 基金管理人运用自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	申赎	2017年1月9日	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00%
2	红利再投	2017年1月11日	8,039.44	8,039.44	0.00%
3	红利再投	2017年1月12日	8,027.62	8,027.62	0.00%
4	红利再投	2017年1月13日	15,752.09	15,752.09	0.00%
5	红利再投	2017年1月16日	24,532.19	24,532.19	0.00%
6	红利再投	2017年1月17日	8,503.32	8,503.32	0.00%
7	红利再投	2017年1月18日	8,049.32	8,049.32	0.00%
8	红利再投	2017年1月19日	10,753.32	10,753.32	0.00%
9	红利再投	2017年1月20日	8,429.36	8,429.36	0.00%
10	红利再投	2017年1月23日	32,414.77	32,414.77	0.00%
11	申赎	2017年1月23日	50,000,000.00	-50,000,000.00	0.00%
12	红利再投	2017年1月24日	9,212.42	9,212.42	0.00%
13	红利再投	2017年1月25日	5,384.34	5,384.34	0.00%
14	红利再投	2017年1月26日	4,479.58	4,479.58	0.00%
15	红利再投	2017年2月3日	38,151.06	38,151.06	0.00%
16	红利再投	2017年2月6日	14,442.11	14,442.11	0.00%
17	红利再投	2017年2月7日	4,521.17	4,521.17	0.00%
18	红利再投	2017年2月8日	4,535.80	4,535.80	0.00%
19	红利再投	2017年2月9日	4,565.50	4,565.50	0.00%

20	红利再投	2017 年 2 月 10 日	4,446.09	4,446.09	0.00%
21	红利再投	2017 年 2 月 13 日	13,790.26	13,790.26	0.00%
22	申赎	2017 年 2 月 13 日	5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
23	红利再投	2017 年 2 月 14 日	4,648.77	4,648.77	0.00%
24	红利再投	2017 年 2 月 15 日	4,121.70	4,121.70	0.00%
25	红利再投	2017 年 2 月 16 日	4,169.22	4,169.22	0.00%
26	红利再投	2017 年 2 月 17 日	4,283.23	4,283.23	0.00%
27	红利再投	2017 年 2 月 20 日	13,181.31	13,181.31	0.00%
28	红利再投	2017 年 2 月 21 日	4,276.73	4,276.73	0.00%
29	红利再投	2017 年 2 月 22 日	4,428.06	4,428.06	0.00%
30	红利再投	2017 年 2 月 23 日	4,655.07	4,655.07	0.00%
31	红利再投	2017 年 2 月 24 日	4,652.29	4,652.29	0.00%
32	红利再投	2017 年 2 月 27 日	12,461.85	12,461.85	0.00%
33	红利再投	2017 年 2 月 28 日	3,987.68	3,987.68	0.00%
34	红利再投	2017 年 3 月 1 日	4,579.11	4,579.11	0.00%
35	红利再投	2017 年 3 月 2 日	4,156.22	4,156.22	0.00%
36	红利再投	2017 年 3 月 3 日	4,153.94	4,153.94	0.00%
37	红利再投	2017 年 3 月 6 日	12,412.21	12,412.21	0.00%
38	红利再投	2017 年 3 月 7 日	4,019.55	4,019.55	0.00%
39	申赎	2017 年 3 月 7 日	15,000,000.00	-15,000,000.00	0.00%
40	红利再投	2017 年 3 月 8 日	3,910.79	3,910.79	0.00%
41	红利再投	2017 年 3 月 9 日	2,612.27	2,612.27	0.00%

42	红利再投	2017 年 3 月 10 日	2,557.80	2,557.80	0.00%
43	红利再投	2017 年 3 月 13 日	7,648.38	7,648.38	0.00%
44	红利再投	2017 年 3 月 14 日	2,563.11	2,563.11	0.00%
45	红利再投	2017 年 3 月 15 日	2,534.72	2,534.72	0.00%
46	红利再投	2017 年 3 月 16 日	2,580.10	2,580.10	0.00%
47	红利再投	2017 年 3 月 17 日	2,759.85	2,759.85	0.00%
48	红利再投	2017 年 3 月 20 日	8,626.58	8,626.58	0.00%
49	红利再投	2017 年 3 月 21 日	2,862.73	2,862.73	0.00%
50	红利再投	2017 年 3 月 22 日	3,026.42	3,026.42	0.00%
51	红利再投	2017 年 3 月 23 日	8,475.72	8,475.72	0.00%
52	红利再投	2017 年 3 月 24 日	3,362.75	3,362.75	0.00%
53	红利再投	2017 年 3 月 27 日	10,036.78	10,036.78	0.00%
54	红利再投	2017 年 3 月 28 日	2,950.22	2,950.22	0.00%
55	红利再投	2017 年 3 月 29 日	3,720.58	3,720.58	0.00%
56	红利再投	2017 年 3 月 30 日	3,635.05	3,635.05	0.00%
57	红利再投	2017 年 3 月 31 日	3,675.51	3,675.51	0.00%
合计			170,399,756.06	30,399,756.06	

注：基金管理人本期运用固有资金投资本基金均为本基金的 B 类基金份额。

## §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

机构	1	20170328——20170331	3,382.56	200,072,628.49	-	200,076,011.05	20.98
	2	20170331——20170331	-	200,000,000.00	-	200,000,000.00	20.97
	3	20170119——20170330	1,174,807.76	279,160,447.47	106,077,332.41	174,257,922.82	18.27

#### 产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

##### 1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

##### 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- (2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景益货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景益货币市场基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景益货币市场基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景益货币市场基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。



## 9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

## 9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2017 年 4 月 24 日