

# 景顺长城景益货币市场基金 2017 年第 2 季度报告

2017 年 6 月 30 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 7 月 20 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 7 月 19 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 4 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 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	929,772,253.39 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	355,402,511.20 份	574,369,742.19 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4月1日—2017年6月30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	2,861,703.22	6,920,298.66
2. 本期利润	2,861,703.22	6,920,298.66
3. 期末基金资产净值	355,402,511.20	574,369,742.19

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	0.8930%	0.0037%	0.3366%	0.0000%	0.5564%	0.0037%

注：本基金的收益分配方式为按日结转份额。

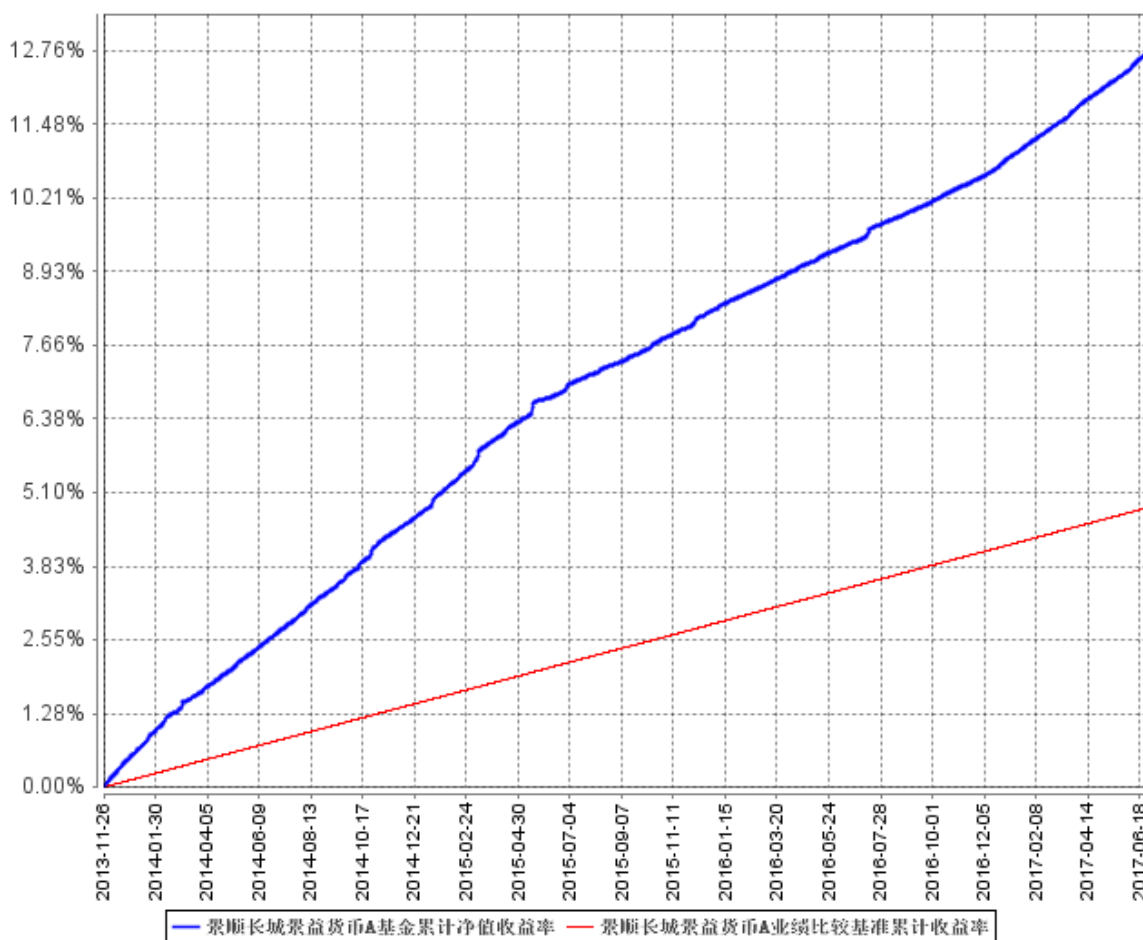
###### 景顺长城景益货币 B

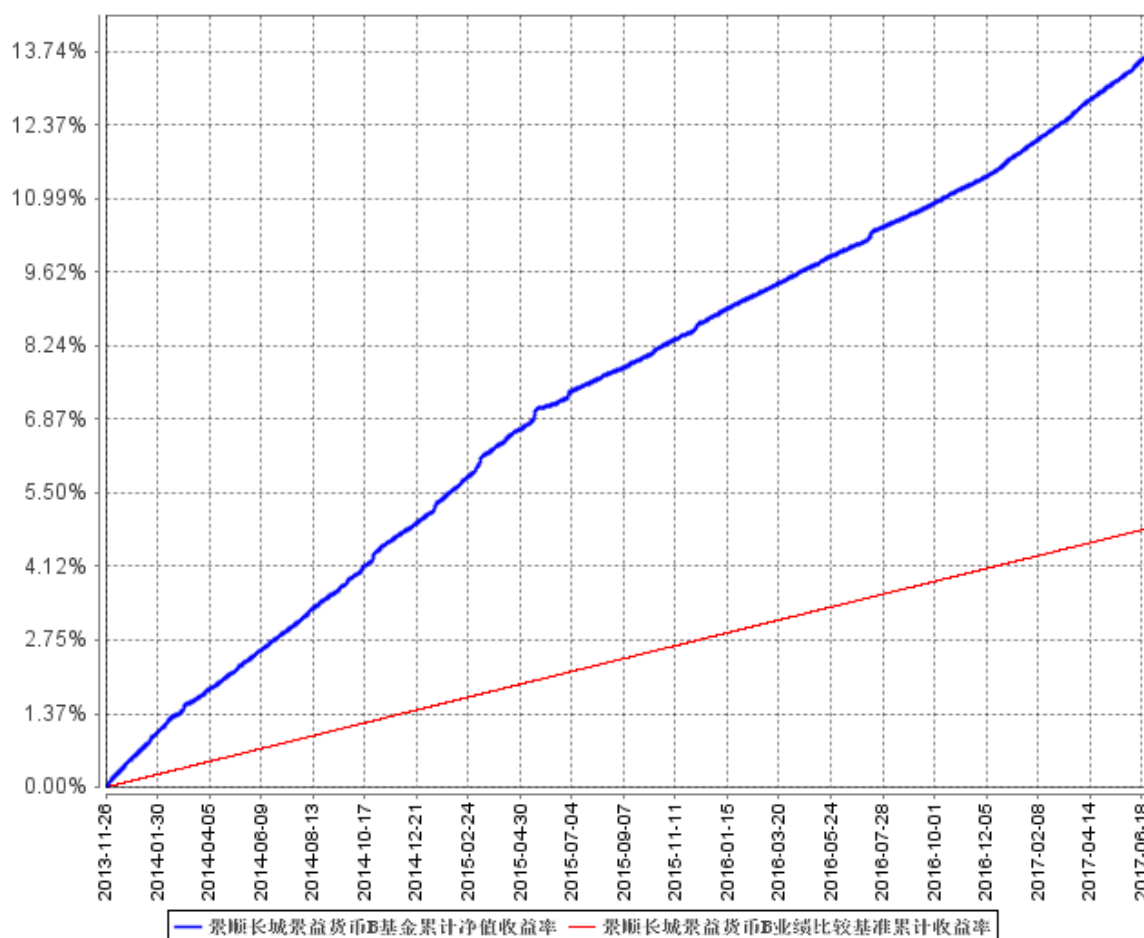
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个	0.9533%	0.0037%	0.3366%	0.0000%	0.6167%	0.0037%

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 2 次，为公司旗下三只指数基金因指数成份股调整而发生的反向交易以及量化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，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

2017 年 2 季度债市继续调整，跌幅较 1 季度缩小。收益率整体呈现震荡向上走势，市场对基本面反应较为钝化，监管政策成为主要影响因素。具体来看，2 季度下跌主要归在 4 月和 5 月，6 月债市已经出现明显回暖。4 月债市单边走熊，主要受监管政策收紧的影响，债券各期限收益率均有所上行。银监会连续发文直指表外理财和同业监管，间或有银监会对各大银行的现场检查，市场谨慎情绪浓重，债市出现大幅调整。5 月债券市场收益率曲线继续平坦化上移。上旬

受监管收紧及资金面偏紧影响，10 年国债收益率最高上行至 3.69%。此后经济数据走弱，监管力度有所缓和，市场情绪好转，债市进入区间震荡格局。进入 6 月，PPI 数据出现连续回落，市场大多坚持宏观经济已经开始从高点缓慢回落的判断。监管政策密集出台后进入协调监管阶段，银监会放宽自查报告提交时限有助于缓和 market 情绪，M2 数据创历史新低，带来中旬机构做多热情。美联储如期加息，央行不跟随美联储步伐，维稳市场流动性的态度也较为明显。市场做多热情爆发，长久期利率债下行超过 20BP。

2 季度信用利差先上后下，高等级信用利差上行动力不足。2 季度 5 年 AA+ 中票信用利差下行 7BP，AA 级上行 19BP。与 1 季度相比，2 季度信用利差上行的幅度缩窄，高等级品种信用利差基本无变化。信用利差的扩大也集中在 4 月和 5 月，投资级信用债信用利差仍以流动性溢价主导。

资金面上来看，2 季度初银监会加大对同业业务监管力度，货币市场被流动性紧张预期笼罩，货币市场利率持续攀升。随后央行持续进行巨量 MLF 投放稳定预期，2 季度资金面好于预期，跨季平稳度过。具体来看，4 月银监会政策密集出台，同时叠加缴税因素月底资金面略微收紧。5 月传统缴税月份，央行于中旬放出巨量 MLF 强力维稳对冲。6 月初央行再度投放巨量 MLF 稳定跨季预期，短端货币市场利率在触顶 5% 后即大幅回落。全季来看，季内长短端利率裂口持续走扩，5 月 6 月资金面好于预期，未出现大幅波动情况，而美联储于 6 月宣布提高联邦基金基准利率 25bp，央行综合内外部环境后并未跟随提高公开市场操作利率。报告期内组合秉承追求安全的超额回报的原则，债市趋势性拐点未现，但央行 2 季度强力维稳下判断短端收益率 6 月触顶，选取短端收益率高点适当拉长久期，配置上以同业存款和同业存单为主，在同业存单的选择上，选取高评级流动性较好券种，根据基金规模变化动态调整短融、回购、存单的配置比例。

2 季度中国国内出口依然向好，消费平稳，投资边际有走弱尚在预计范围内，基本面平稳过渡。从工业企业利润上看，本来经济复苏企业盈利改善依然有韧性。但产成品库存已开始筑顶回落表明本轮补库存已经基本完成，工业生产有向下压力。叠加金融去杠杆导致实体经济融资利率抬升，预计至 4 季度经济将面临下行压力。

2017 年房地产在政策导向和贷款实际利率上升的影响下销售数据开始下滑，但棚改货币化支持下三四线城市销售较好。在房地产调控及金融去杠杆的重压下，表内和表外对房地产相关融资开始收缩。未来房地产投资增速将继续下滑。全年来看资金约束将导致基建增速前高后低，未来短期内基础设施投资仍有较强增长动能，下半年可能继续托底经济，缓冲房地产投资面临的潜在压力。整体看居民去年加杠杆后，在收入增速没有明显提升的情况下，今年全年消费整体平稳，增长依然偏弱。2017 年以来全球出口导向型经济体出口增速强劲反弹，预计今年出口对整体经

济将转为正贡献。

6 月末时点之后央行货币政策大概率继续净回笼，整体货币环境依然维持中性。美联储 6 月份加息落地，缩表已在路上，整体预计依然为渐进式，对于金融市场的影响相对平缓。欧洲方面表达退出 QE 的可能性，至今年年底全球主要央行或均转为收缩。预计央行未来仍将可能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。

本次债券调整因素来源于 2016 年下半年经济短周期回升，央行货币政策转向，金融监管加码。相比 2013 年钱荒，金融去杠杆政策将导致债券调整幅度和时间或更长。债市核心依然在货币政策和监管，货币政策和监管的总基调不变，市场短期迎来喘息机会。先行数据显示基本面在 2 季度开始回落，叠加严格的金融监管政策，表外融资收缩将增加经济下行压力，对债券市场形成基本面支撑。央行关键时点呵护流动性，但海外收紧背景下大幅宽松难现，债券市场趋势性行情还需等待，可增加波段操作。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。

展望 2017 下半年，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 2 季度，景益货币 A 净值收益率为 0.8930%，业绩比较基准收益率为 0.3366%；

2017 年 2 季度，景益货币 B 净值收益率为 0.9533%，业绩比较基准收益率为 0.3366%。

#### 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	119,806,873.95	12.82
	其中：债券	119,806,873.95	12.82
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	321,721,042.59	34.43
	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	488,849,636.54	52.32
4	其他资产	4,008,304.55	0.43
5	合计	934,385,857.63	100.00

注：银行存款和结算备付金其中包含定期存款 487,000,000.00 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	0.66	
	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	38
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	38
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

### 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	59.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	11.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	27.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	1.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.07	-

### 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	49,921,698.62	5.37
	其中：政策性金融债	49,921,698.62	5.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,021,832.79	5.38
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,863,342.54	2.14
8	其他	-	-
9	合计	119,806,873.95	12.89
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	011759001	17 国电 SCP001	300,000	30,036,865.74	3.23
2	160419	16 农发 19	300,000	29,982,016.80	3.22
3	011753039	17 苏交通 SCP014	200,000	19,984,967.05	2.15
4	111711209	17 平安银行 CD209	200,000	19,863,342.54	2.14
5	100408	10 农发 08	100,000	10,001,634.87	1.08
6	170204	17 国开 04	100,000	9,938,046.95	1.07

**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	0.0427%
报告期内偏离度的最低值	-0.0027%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0189%

**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	2,998,424.13
4	应收申购款	1,009,880.42
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,008,304.55

## 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	323,252,717.07	630,356,010.96
报告期期间基金总申购份额	385,559,314.31	1,198,104,112.42
报告期期间基金总赎回份额	353,409,520.18	1,254,090,381.19
报告期期末基金份额总额	355,402,511.20	574,369,742.19

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	红利再投	2017年4月5日	19,727.30	19,727.30	0.00%
2	红利再投	2017年4月6日	3,475.64	3,475.64	0.00%
3	红利再投	2017年4月7日	3,438.76	3,438.76	0.00%
4	红利再投	2017年4月10日	8,829.26	8,829.26	0.00%
5	红利再投	2017年4月11日	2,958.22	2,958.22	0.00%
6	申赎	2017年4月11日	130,000,000.00	130,000,000.00	0.00%
7	红利再投	2017年4月12日	15,338.49	15,338.49	0.00%
8	红利再投	2017年4月13日	14,622.80	14,622.80	0.00%

9	红利再投	2017 年 4 月 14 日	14,073.04	14,073.04	0.00%
10	红利再投	2017 年 4 月 17 日	45,360.40	45,360.40	0.00%
11	申赎	2017 年 4 月 17 日	20,000,000.00	-20,000,000.00	0.00%
12	红利再投	2017 年 4 月 18 日	12,216.19	12,216.19	0.00%
13	红利再投	2017 年 4 月 19 日	12,386.99	12,386.99	0.00%
14	红利再投	2017 年 4 月 20 日	12,681.10	12,681.10	0.00%
15	红利再投	2017 年 4 月 21 日	12,492.93	12,492.93	0.00%
16	红利再投	2017 年 4 月 24 日	38,912.66	38,912.66	0.00%
17	红利再投	2017 年 4 月 25 日	13,012.53	13,012.53	0.00%
18	红利再投	2017 年 4 月 26 日	12,450.38	12,450.38	0.00%
19	申赎	2017 年 4 月 26 日	5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
20	红利再投	2017 年 4 月 27 日	12,930.75	12,930.75	0.00%
21	红利再投	2017 年 4 月 28 日	13,094.83	13,094.83	0.00%
22	红利再投	2017 年 5 月 2 日	53,466.97	53,466.97	0.00%
23	红利再投	2017 年 5 月 3 日	12,081.56	12,081.56	0.00%
24	红利再投	2017 年 5 月 4 日	12,042.89	12,042.89	0.00%
25	红利再投	2017 年 5 月 5 日	12,449.29	12,449.29	0.00%
26	红利再投	2017 年 5 月 8 日	45,627.40	45,627.40	0.00%
27	红利再投	2017 年 5 月 9 日	12,231.31	12,231.31	0.00%
28	红利再投	2017 年 5 月 10 日	12,307.31	12,307.31	0.00%
29	红利再投	2017 年 5 月 11 日	12,321.65	12,321.65	0.00%
30	红利再投	2017 年 5 月 12 日	12,235.32	12,235.32	0.00%
31	红利再投	2017 年 5 月 15 日	36,785.16	36,785.16	0.00%
32	红利再投	2017 年 5 月 16 日	12,095.30	12,095.30	0.00%
33	红利再投	2017 年 5 月 17 日	12,136.33	12,136.33	0.00%
34	红利再投	2017 年 5 月 18 日	12,261.58	12,261.58	0.00%
35	红利再投	2017 年 5 月 19 日	12,259.08	12,259.08	0.00%
36	红利再投	2017 年 5 月 22 日	37,119.42	37,119.42	0.00%
37	红利再投	2017 年 5 月 23 日	12,333.62	12,333.62	0.00%
38	红利再投	2017 年 5 月 24 日	12,537.25	12,537.25	0.00%
39	红利再投	2017 年 5 月 25 日	12,632.18	12,632.18	0.00%
40	申赎	2017 年 5 月 25 日	5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
41	红利再投	2017 年 5 月 26 日	11,317.41	11,317.41	0.00%
42	红利再投	2017 年 5 月 31 日	63,640.88	63,640.88	0.00%
43	红利再投	2017 年 6 月 1 日	12,635.00	12,635.00	0.00%
44	红利再投	2017 年 6 月 2 日	12,644.01	12,644.01	0.00%
45	红利再投	2017 年 6 月 5 日	37,509.17	37,509.17	0.00%
46	红利再投	2017 年 6 月 6 日	12,535.67	12,535.67	0.00%
47	红利再投	2017 年 6 月 7 日	12,432.10	12,432.10	0.00%
48	申赎	2017 年 6 月 7 日	20,000,000.00	-20,000,000.00	0.00%

49	红利再投	2017 年 6 月 8 日	10,433.37	10,433.37	0.00%
50	申赎	2017 年 6 月 8 日	10,000,000.00	-10,000,000.00	0.00%
51	红利再投	2017 年 6 月 9 日	9,352.46	9,352.46	0.00%
52	红利再投	2017 年 6 月 12 日	58,181.59	58,181.59	0.00%
53	红利再投	2017 年 6 月 13 日	10,010.33	10,010.33	0.00%
54	红利再投	2017 年 6 月 14 日	9,455.28	9,455.28	0.00%
55	红利再投	2017 年 6 月 15 日	10,078.37	10,078.37	0.00%
56	红利再投	2017 年 6 月 16 日	10,325.74	10,325.74	0.00%
57	红利再投	2017 年 6 月 19 日	48,358.87	48,358.87	0.00%
58	红利再投	2017 年 6 月 20 日	10,272.15	10,272.15	0.00%
59	红利再投	2017 年 6 月 21 日	10,854.92	10,854.92	0.00%
60	红利再投	2017 年 6 月 22 日	11,072.40	11,072.40	0.00%
61	红利再投	2017 年 6 月 23 日	9,330.07	9,330.07	0.00%
62	红利再投	2017 年 6 月 26 日	32,428.22	32,428.22	0.00%
63	红利再投	2017 年 6 月 27 日	10,564.51	10,564.51	0.00%
64	红利再投	2017 年 6 月 28 日	13,664.19	13,664.19	0.00%
65	申赎	2017 年 6 月 28 日	3,000,000.00	-3,000,000.00	0.00%
66	红利再投	2017 年 6 月 29 日	17,277.98	17,277.98	0.00%
67	红利再投	2017 年 6 月 30 日	11,470.58	11,470.58	0.00%
合计			194,068,771.16	68,068,771.16	

注：基金管理人本期运用自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	份额占比
机构	1	20170503--20170630	174,257,922.82	47,883,709.73	13,132,114.56	209,009,517.99	22.48%
	2	20170406--20170630	200,076,011.05	1,909,175.40	-	201,985,186.45	21.72%
	3	20170406--20170406	200,000,000.00	565,639.00	200,565,639.01	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
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 7 月 20 日