

# 景顺长城景益货币市场基金 2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 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 10 月 25 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 10 月 24 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 7 月 1 日起至 2017 年 9 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	852,300,576.13 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	433,595,281.37 份	418,705,294.76 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7月1日—2017年9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	2,967,918.53	4,346,993.86
2. 本期利润	2,967,918.53	4,346,993.86
3. 期末基金资产净值	433,595,281.37	418,705,294.76

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	0.9103%	0.0036%	0.3403%	0.0000%	0.5700%	0.0036%

注：本基金的收益分配方式为按日结转份额。

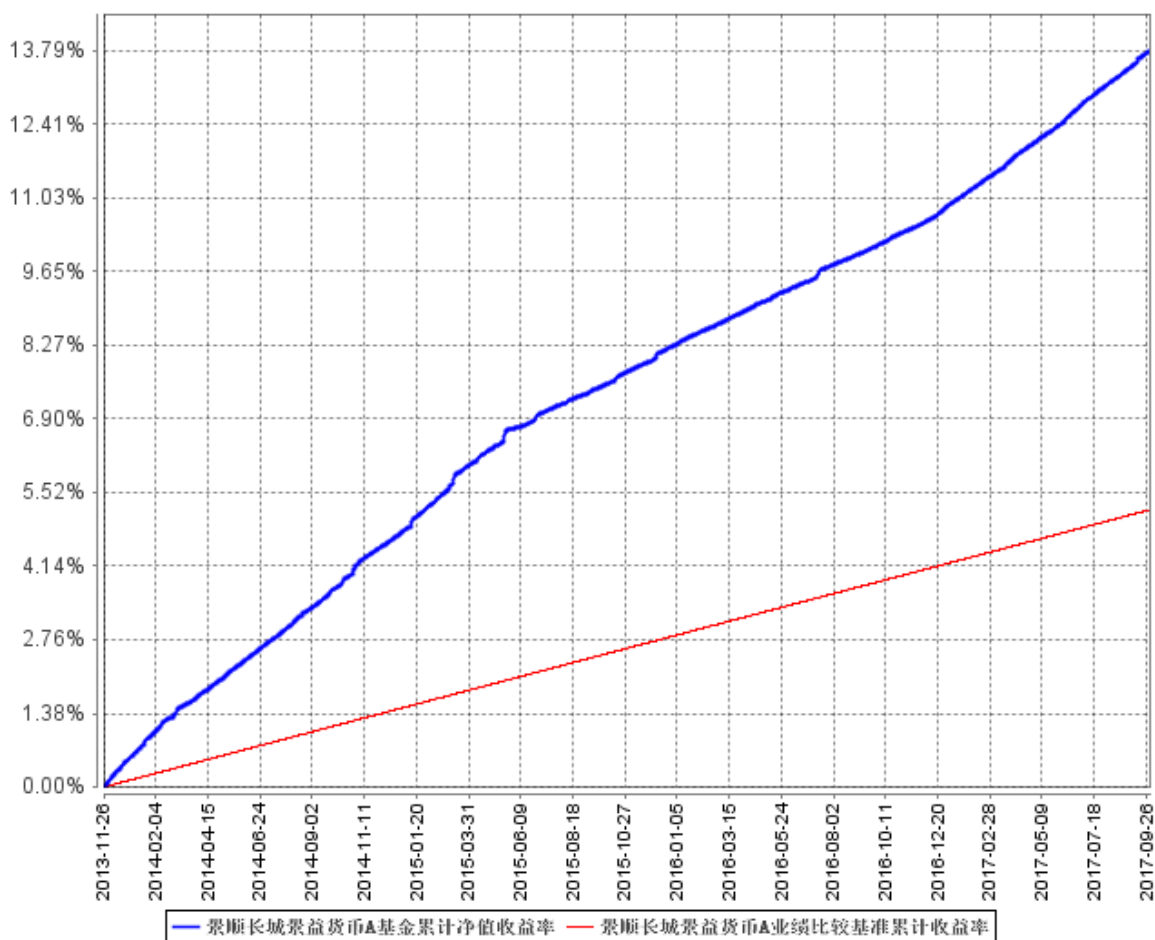
###### 景顺长城景益货币 B

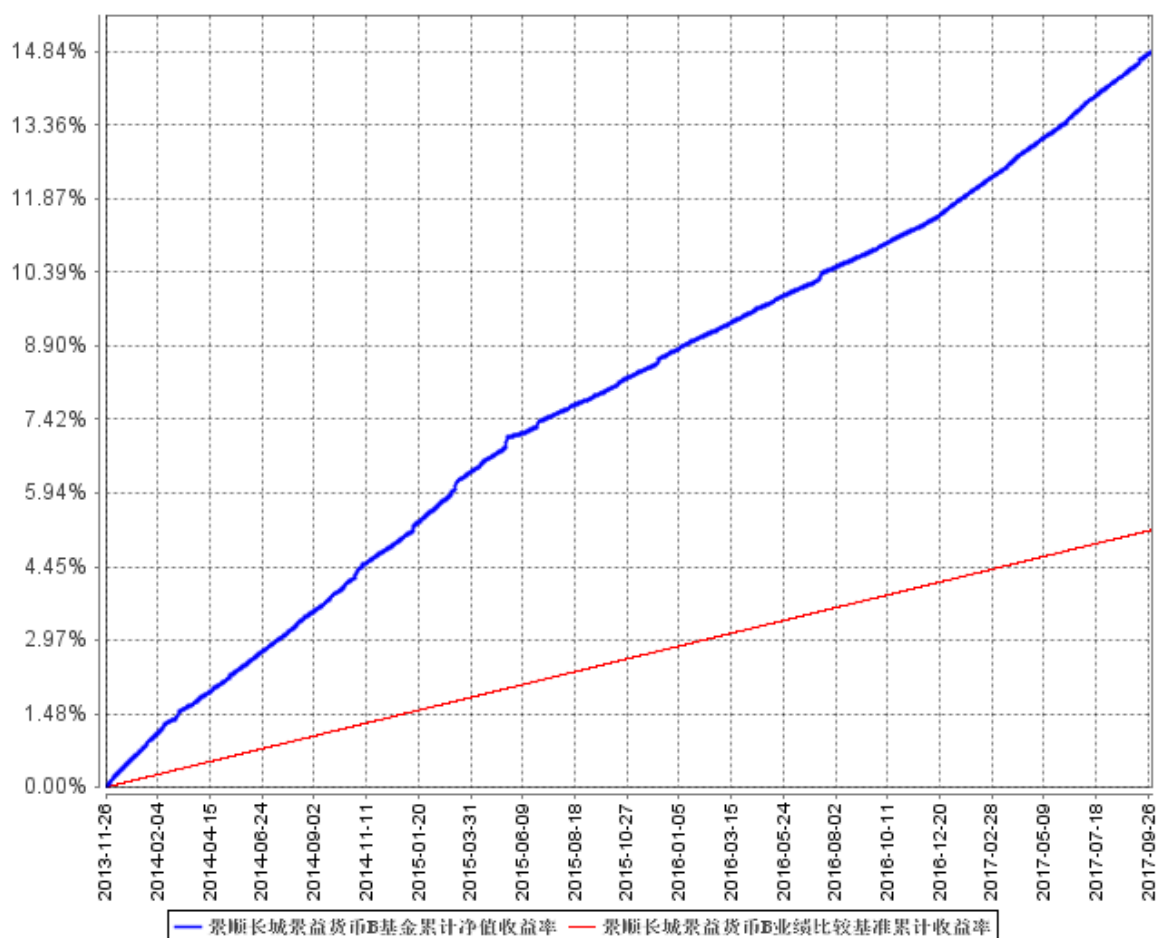
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个	0.9713%	0.0036%	0.3403%	0.0000%	0.6310%	0.0036%

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 24 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品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。投资组合银行间债券交易虽然存在临近交易日同向交易行为，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 3 季度债市收益率整体呈现高位震荡走势，协调监管政策落地后，基本面重回市场视野，周期品价格和资金利率成为重要影响因素。7 月债券市场收益率曲线震荡为主。主因 2 季度经济数据出炉超市场预期。除去食品价格和油价扰动，核心通胀依然高位。周期品在行政持续去产能推动下卷土重来，7 月 CRB 工业原料现货指数和南华工业品价格指数均显著上涨。8 月传

统宽松月份反而出现了季节性紧张。受资金面偏紧及大宗商品价格上涨影响，8 月份债券市场走势偏弱，利率债收益率震荡上行。9 月周期品期货价格进入调整，基本面有回落趋势，但市场受到季末底资金面收紧影响，收益率仍然维持高位盘整。等待基本面回落的持续性和资金面的放松。利率债供给较 2 季度有所放量，主要来自特别国债到期续发和地方政府债发行。信用债供给放量，需求有所好转。截至 9 月 30 日，10 年期国债和 10 年期国开债收益率分别为 3.61% 和 4.19%，分别较 6 月末上行 4.5BP 和下行 1BP。3 年 AAA 中票和 5 年期 AA+ 企业债收益率分别为 4.60% 和 4.97%，较 6 月末分别上行 15BP 和 0BP。

资金面上来看，3 季度央行继续削峰填谷，主要以公开市场逆回购与 MLF 操作向市场供应基础货币，态度中性。全季资金面受缴税因素影响较多，呈现波动，但在央行公开市场操作对冲下整体平稳。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，在资金面趋紧时选取短端收益率高点以 3 月品种的同业存款和同业存单为主进行配置。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。

展望后市，新一轮财政整顿以及加强金融监管成为常态，预计未来经济可能面临回落压力，但韧性较强。全年名义增速高点已经确认，整体看基本面 3 季度开始走弱，经济数据近期有所回落。基本面拐点已经确认，但下行幅度有限。投资方面来看，受资金约束影响基建增速可能不及上半年；房地产增速在长效机制效应下销售将会持续走弱、低库存和土地购置面积回升的背景下预计仍维持一定韧性，较为平稳；制造业小幅回稳，预计需求端平稳走弱，调整幅度不会太大。CPI 数据超预期，但由于基数原因预计年内通胀压力较小；PPI 在需求走弱的背景下将呈现出回落的趋势，对工业企业利润的增长形成一定压制，考虑到冬季环保限产和供给侧改革因素，预计环比回落幅度不会太大。预计下半年工业企业利润增速会有所回落，但回落幅度也相对有限。往 4 季度看，需要等待需求的连续走弱来证伪供给侧的涨价逻辑。汇率方面，人民币汇率呈现双向波动，币值呈现更加稳定，对资产价格阶段性负面影响降低。

海外基本面看，美国经济数据喜忧参半，2 季度 GDP 超预期，8 月通胀略微走高，非农就业数据低于预期。美联储 9 月议息会议表态偏鹰，“缩表”于 10 月启动略超市场预期，12 月加息概率上升，带动美债收益率和美元走高。欧洲央行利率决议仍保持谨慎基调，计划在“必要时”维持 QE 计划至今年 12 月份以后，年底或边际收紧。海外货币政策收紧趋势较明显，美国缩表欧洲宽松退出，将一定程度上制约国内货币政策放松空间。

资金面上，超储率偏低的背景下，未来资金面走势很大程度上仍由央行公开市场操作决定。在稳健中性的货币政策态度下，央行预计将继续削峰填谷保持流动性的不松不紧。在即将到来的

十月份仍要留意缴税可能引起的资金面波动风险。总体看，去杠杆进程中趋势性机会仍未出现，未来短端利率预计将继续震荡。

政策面上，未来预计央行货币政策继续维持中性态度，若四季度经济数据出现持续下行，边际上可能会略有宽松，但趋势性宽松出现的可能性不大。去金融体系杠杆取得一定成效后，去杠杆重点逐步转化为去实体经济杠杆。而监管方面，四季度出台政策的可能性较大，重点可能在统一资产管理业务的标准规制，强化实质性和穿透式监管，不过在维护国家金融稳定的考虑下，未来监管政策的出台方式将更加温和，同时随着政策出台的速度减缓，监管对市场的冲击将更趋弱化。9月下旬的远期定向降准政策目的是支持实体经济，并不意味“全面宽松周期”开启，更多是结构性调整。但也意味着货币政策不再更加从紧。

展望后市，稳健中性的货币政策以及去杠杆延续，金融监管后期更多会以协调监管的方式进行。在去杠杆背景及银行超储率低位的条件下，资金面易紧难松的局面较难改变。市场对监管政策、货币政策的预期与基本面预期将持续纠结。在货币政策未转向及基本面确认回落之前收益率预计将维持高位震荡。利率债在当前位置具有配置价值，顶部相对明确，但经济韧性强、海外收紧背景下大幅宽松难现等因素使趋势性下行机会还需等待。先行数据显示基本面开始回落，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，未来基本面变化需要关注。市场已出现多次交易抢跑行情，未来可能还会出现，上有顶下有底的走势适合在悲观情绪酝酿时介入交易。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。

组合投资在短久期、低杠杆的基础上，逐步寻找投资机会，择机进行组合调整，控制债券回撤风险。密切关注各项宏观经济数据、政策调整和市场资金面情况，保持对组合的信用风险和流动性风险的关注。等待债券市场调整后的配置机会。关注利率债的交易机会。努力为投资人创造长期收益。

监管层对流动性风险更加关注，先后颁布《货币市场基金监督管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规以加强对流动性风险的监管。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呈现阶段性波动。需警惕央行中性态度下对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 3 季度，景益货币 A 净值收益率为 0.9103%，业绩比较基准收益率为 0.3403%；

2017 年 3 季度，景益货币 B 净值收益率为 0.9713%，业绩比较基准收益率为 0.3403%。

#### 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	269,544,901.44	31.32
	其中：债券	269,544,901.44	31.32
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	248,477,852.72	28.87
	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	337,790,188.90	39.25
4	其他资产	4,896,370.55	0.57
5	合计	860,709,313.61	100.00

注：银行存款和结算备付金其中包含定期存款 333,000,000 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	0.26	
	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	55
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	30

#### 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	43.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	44.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	8.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	3.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.41	-

#### 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	49,922,326.27	5.86
	其中：政策性金融债	49,922,326.27	5.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	170,057,876.09	19.95
6	中期票据	-	-
7	同业存单	49,564,699.08	5.82
8	其他	-	-
9	合计	269,544,901.44	31.63
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	011756028	17 中电投 SCP014	500,000	50,084,555.49	5.88
2	111705081	17 建设银行 CD081	500,000	49,564,699.08	5.82
3	011758088	17 长电 SCP003	400,000	40,001,041.75	4.69
4	170401	17 农发 01	400,000	39,962,131.94	4.69
5	011760016	17 国电 SCP002	300,000	30,008,812.87	3.52
6	011759056	17 苏交通 SCP019BC	300,000	30,000,095.43	3.52
7	011751088	17 华电 SCP013	200,000	19,963,370.55	2.34
8	170204	17 国开 04	100,000	9,960,194.33	1.17

### 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	0.0718%
报告期内偏离度的最低值	0.0096%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0376%

#### 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	3,477,866.55
4	应收申购款	1,418,504.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,896,370.55

### 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	355,402,511.20	574,369,742.19
报告期期间基金总申购份额	543,861,907.91	370,717,756.88
报告期期间基金总赎回份额	465,669,137.74	526,382,204.31

报告期期末基金份额总额	433,595,281.37	418,705,294.76
-------------	----------------	----------------

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7月3日	36,152.73	36,152.73	0.00%
2	红利再投	2017年7月4日	11,881.28	11,881.28	0.00%
3	红利再投	2017年7月5日	11,459.26	11,459.26	0.00%
4	红利再投	2017年7月6日	11,152.10	11,152.10	0.00%
5	红利再投	2017年7月7日	10,770.44	10,770.44	0.00%
6	红利再投	2017年7月10日	31,963.94	31,963.94	0.00%
7	红利再投	2017年7月11日	9,994.88	9,994.88	0.00%
8	红利再投	2017年7月12日	9,601.35	9,601.35	0.00%
9	红利再投	2017年7月13日	9,635.44	9,635.44	0.00%
10	申赎	2017年7月13日	20,000,000.00	-20,000,000.00	0.00%
11	红利再投	2017年7月14日	7,723.77	7,723.77	0.00%
12	红利再投	2017年7月17日	22,737.63	22,737.63	0.00%
13	红利再投	2017年7月18日	7,547.25	7,547.25	0.00%
14	红利再投	2017年7月19日	7,680.10	7,680.10	0.00%
15	红利再投	2017年7月20日	7,958.58	7,958.58	0.00%
16	红利再投	2017年7月21日	8,069.52	8,069.52	0.00%
17	红利再投	2017年7月24日	24,373.74	24,373.74	0.00%
18	红利再投	2017年7月25日	8,177.19	8,177.19	0.00%
19	红利再投	2017年7月26日	7,613.54	7,613.54	0.00%
20	红利再投	2017年7月	7,967.02	7,967.02	0.00%

		27 日			
21	申赎	2017 年 7 月 27 日	12,000,000.00	-12,000,000.00	0.00%
22	红利再投	2017 年 7 月 28 日	6,733.94	6,733.94	0.00%
23	红利再投	2017 年 7 月 31 日	20,603.30	20,603.30	0.00%
24	红利再投	2017 年 8 月 1 日	6,921.45	6,921.45	0.00%
25	红利再投	2017 年 8 月 2 日	6,909.16	6,909.16	0.00%
26	红利再投	2017 年 8 月 3 日	6,883.61	6,883.61	0.00%
27	红利再投	2017 年 8 月 4 日	6,730.71	6,730.71	0.00%
28	红利再投	2017 年 8 月 7 日	19,695.19	19,695.19	0.00%
29	红利再投	2017 年 8 月 8 日	6,400.92	6,400.92	0.00%
30	红利再投	2017 年 8 月 9 日	6,158.01	6,158.01	0.00%
31	红利再投	2017 年 8 月 10 日	6,156.52	6,156.52	0.00%
32	红利再投	2017 年 8 月 11 日	6,167.12	6,167.12	0.00%
33	红利再投	2017 年 8 月 14 日	18,463.90	18,463.90	0.00%
34	红利再投	2017 年 8 月 15 日	6,184.13	6,184.13	0.00%
35	红利再投	2017 年 8 月 16 日	6,233.56	6,233.56	0.00%
36	红利再投	2017 年 8 月 17 日	6,475.51	6,475.51	0.00%
37	红利再投	2017 年 8 月 18 日	6,615.64	6,615.64	0.00%
38	红利再投	2017 年 8 月 21 日	20,313.18	20,313.18	0.00%
39	红利再投	2017 年 8 月 22 日	6,814.54	6,814.54	0.00%
40	红利再投	2017 年 8 月 23 日	6,815.45	6,815.45	0.00%
41	申赎	2017 年 8 月 23 日	18,000,000.00	-18,000,000.00	0.00%
42	红利再投	2017 年 8 月 24 日	4,829.95	4,829.95	0.00%
43	红利再投	2017 年 8 月 25 日	4,874.39	4,874.39	0.00%
44	红利再投	2017 年 8 月 28 日	14,246.22	14,246.22	0.00%
45	红利再投	2017 年 8 月	4,798.87	4,798.87	0.00%

		29 日			
46	申赎	2017 年 8 月 29 日	12,000,000.00	-12,000,000.00	0.00%
47	红利再投	2017 年 8 月 30 日	3,626.30	3,626.30	0.00%
48	红利再投	2017 年 8 月 31 日	3,797.68	3,797.68	0.00%
49	红利再投	2017 年 9 月 1 日	3,798.07	3,798.07	0.00%
50	红利再投	2017 年 9 月 4 日	11,309.64	11,309.64	0.00%
51	红利再投	2017 年 9 月 5 日	3,793.23	3,793.23	0.00%
52	红利再投	2017 年 9 月 6 日	3,752.21	3,752.21	0.00%
53	红利再投	2017 年 9 月 7 日	3,685.95	3,685.95	0.00%
54	红利再投	2017 年 9 月 8 日	3,675.20	3,675.20	0.00%
55	红利再投	2017 年 9 月 11 日	11,078.68	11,078.68	0.00%
56	红利再投	2017 年 9 月 12 日	3,703.66	3,703.66	0.00%
57	红利再投	2017 年 9 月 13 日	3,653.79	3,653.79	0.00%
58	红利再投	2017 年 9 月 14 日	3,668.21	3,668.21	0.00%
59	红利再投	2017 年 9 月 15 日	6,304.16	6,304.16	0.00%
60	红利再投	2017 年 9 月 18 日	23,197.62	23,197.62	0.00%
61	红利再投	2017 年 9 月 19 日	3,686.75	3,686.75	0.00%
62	红利再投	2017 年 9 月 20 日	3,314.90	3,314.90	0.00%
63	红利再投	2017 年 9 月 21 日	3,436.58	3,436.58	0.00%
64	红利再投	2017 年 9 月 22 日	3,361.68	3,361.68	0.00%
65	红利再投	2017 年 9 月 25 日	9,973.68	9,973.68	0.00%
66	红利再投	2017 年 9 月 26 日	3,369.15	3,369.15	0.00%
67	申赎	2017 年 9 月 26 日	10,000,000.00	-10,000,000.00	0.00%
68	红利再投	2017 年 9 月 27 日	2,712.29	2,712.29	0.00%
69	红利再投	2017 年 9 月 28 日	2,899.26	2,899.26	0.00%

70	红利再投	2017 年 9 月 29 日	3,132.67	3,132.67	0.00%
合计			72,583,416.39	-71,416,583.61	

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	20170701--20170930	201,985,186.45	1,938,116.22	-	203,923,302.67	23.93%
	2	20170701--20170817	209,009,517.99	8,475,833.60	139,980,733.49	77,504,618.10	9.09%
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 10 月 25 日