

景顺长城景益货币市场基金 2017 年第 4 季度报告

2017 年 12 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：2018 年 1 月 22 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 2018 年 1 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 10 月 1 日起至 2017 年 12 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	609,038,382.64 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	364,624,393.68 份	244,413,988.96 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10月1日—2017年12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	3,905,540.69	4,449,213.37
2. 本期利润	3,905,540.69	4,449,213.37
3. 期末基金资产净值	364,624,393.68	244,413,988.96

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	0.9795%	0.0032%	0.3403%	0.0000%	0.6392%	0.0032%

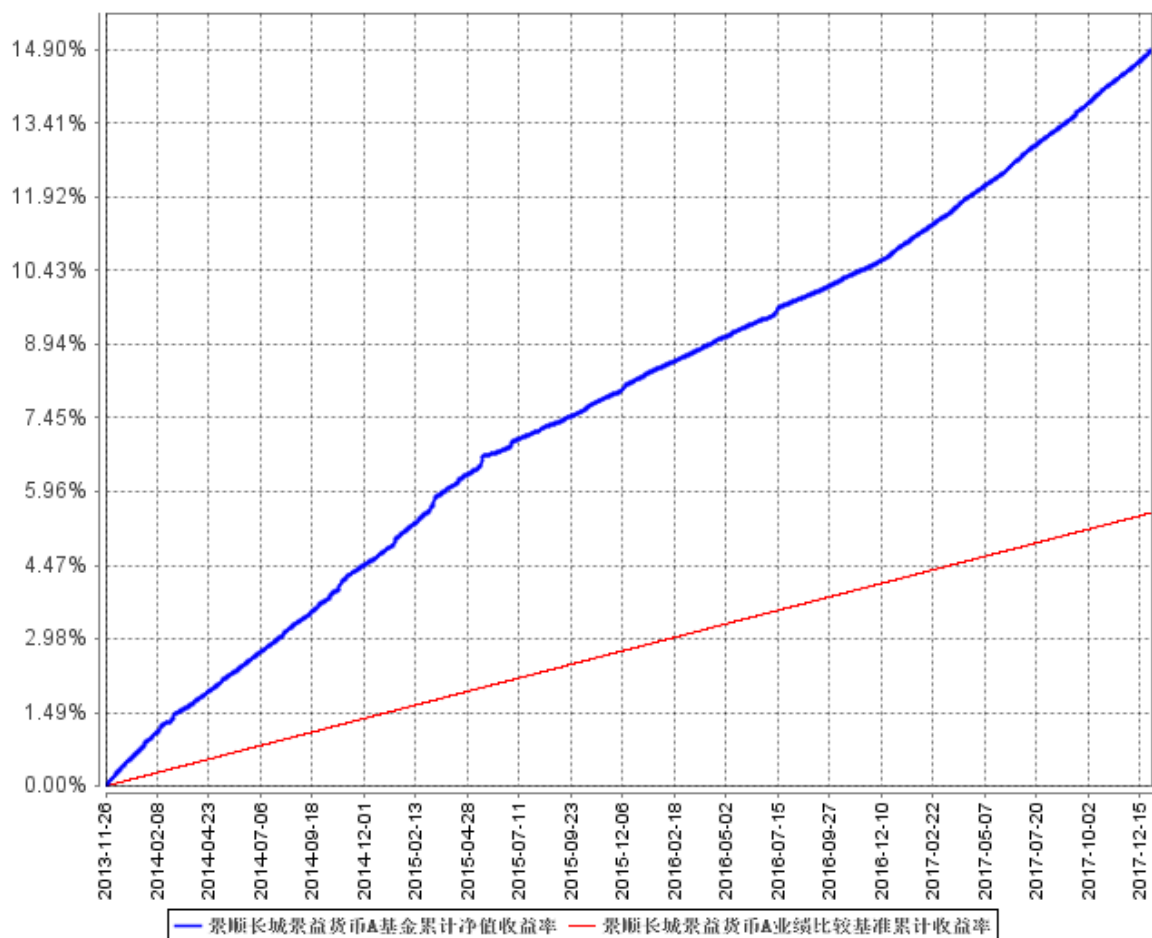
注：本基金的收益分配方式为按日结转份额。

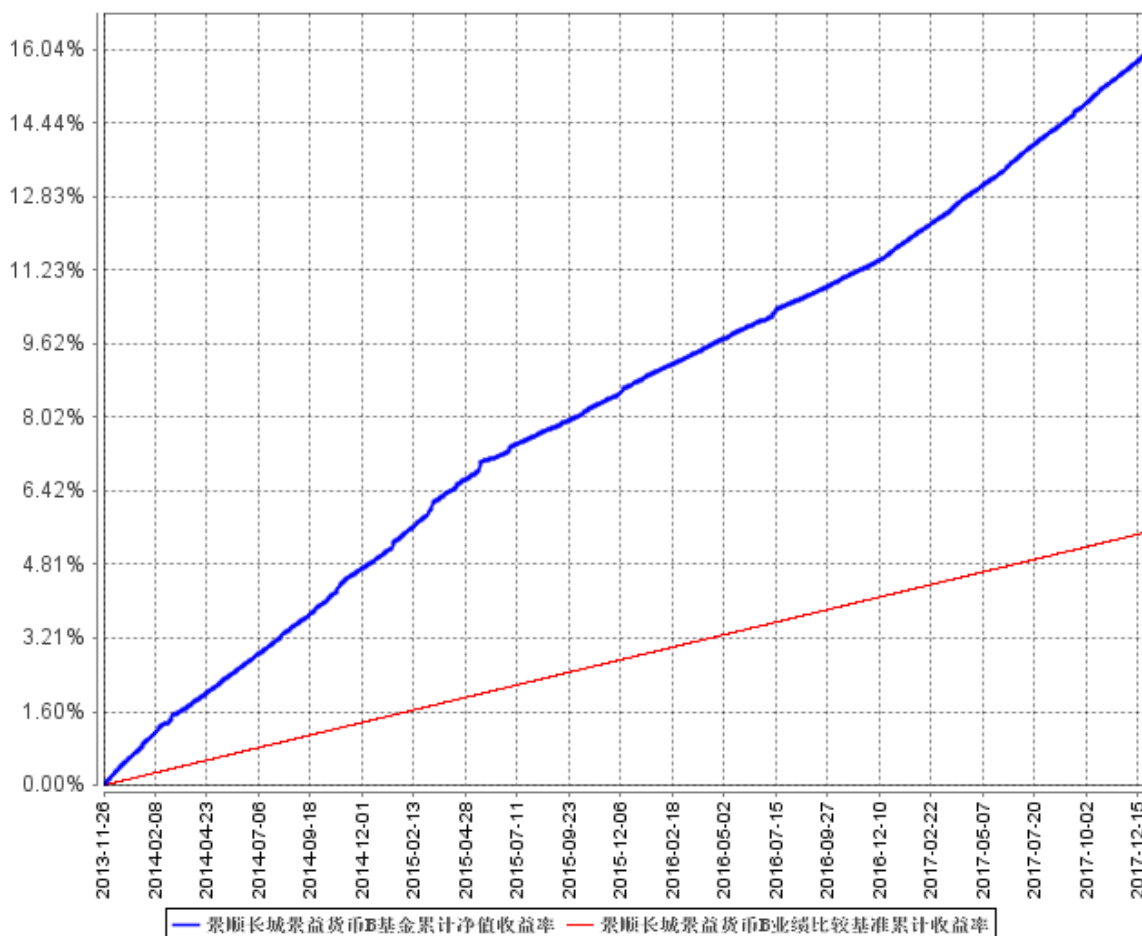
景顺长城景益货币 B

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
过去三个月	1.0407%	0.0033%	0.3403%	0.0000%	0.7004%	0.0033%

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合规守信情况的说明

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 8 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相互发生的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 4 季度债市收益率整体呈现大幅震荡走高走势。国庆节前央行定向降准政策力度远低于市场预期，叠加对基本面和金融监管的担忧、海外债市调整等因素，4 季度债市再度大幅调整，十年国债创 14 年 10 月以来的三年新高。10 月在周小川行长表示下半年 GDP 增速有望实现 7% 的背景下收益率开始调整，市场担忧监管再度加强。11 月债券市场在市场情绪悲观，大资管条例

落地的背景下，继续呈现明显调整。经济数据显示经济韧性还在。作为资管行业的纲领性监管文件的资管新规靴子落地，被监管主体的银行看法普遍较悲观。往后看资管规模爆发式增长告一段落，债市需求趋降。12 月债券市场主要仍受政策预期影响，全月熊平走势。影响市场的主要因素还是政策面。包括理财新规进入征求意见阶段和中央经济工作会议定调均较指向去杠杆，商业银行资产负债普遍面临较大的持续调整压力；同时，美联储按预期加息后央行小幅调升公开市场利率 5BP，传递持续中性偏紧的货币政策意图。截至 12 月 31 日，10 年期国债和 10 年期国开债收益率分别为 3.88%和 4.82%，较 9 月末上行 27BP 和 64BP。3 年 AAA 中票和 5 年期 AA+企业债收益率分别为 5.29%和 5.67%，较 9 月末分别上行 69BP 和 71BP。

4 季度央行货币政策态度维持中性，公开市场操作上更趋精细化，一方面于 10 月底启动 2M 期限逆回购维稳跨年资金面，另一方面继续削峰填谷操作保持流动性整体中性。全季资金面在银行超储率维持 1.3%-1.4%背景下，月度效应较为明显，整体呈现月初初中下旬又逐渐趋紧的格局，货币市场利率维持高位。报告期内组合遵循公募流动性新规中对于货币基金操作的规定，同时秉承追求长期稳健回报的原则。报告期内未确认流动性趋势性宽松拐点，组合仍然保持短久期，配置上以同业存款、短期回购为主，同业存单为辅，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 2018 年 1 季度宏观经济，将继续保持平稳的态势。从政策层表态看，对经济的认知也比较乐观。在总量相对平稳的情况下，可能更需要关注结构性的变化。新旧经济继续转换，过去的经济增长周期主要依赖基建和房地产投资驱动，2018 年消费继续复苏，租赁房、保障房等增量投资将对地产投资有较大的支撑作用。基建投资因为财政和准财政的力度放缓而出现回落，我们认为地产投资相对不差将抵补基建投资的可能放缓，与出口和消费相关制造业的结构升级仍值得关注。以过剩产能为代表的老经济继续去杠杆，以消费升级和制造业升级为代表的新经济迎来量价齐升的增长周期。2017 年全年看经济企稳回升主要得益于出口回暖、房地产销售和投资链条。2018 年房地产销售周期回落、地方融资收紧将导致投资大概率继续走弱，但外需向好有望延续，基数提升明年出口增速略降，居民收入提升带动消费稳定增长，整体看经济增长动能略回落。对于 PPI 我们认为在供给侧改革深化，需求略走弱的背景下会缓慢回落，不会走到通缩的情况。CPI 可能因基数和油价的原因阶段性有压力，但看不到失控的情况。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。风险点上，需要关注国内房地产市场超预期下行；美国经济超预期回升带来联储加快加息进程。

海外基本面看，12 月议息会议美联储宣布加息 25bp，2018 年隐含 3 次加息概率。联储全

面上调未来经济预期，美国税改正式落地。美国 3 季度实际 GDP 终值年化季率增速为 3.2%，为过去两年多来美国 GDP 增速首次连续两个季度维持在 3%以上。欧元区 3 季度实际 GDP 创欧债危机以来新高。日本 3 季度 GDP 当季同比回升至近两年来高位。欧日货币政策收缩正在路上。海外货币政策收紧趋势明显，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。央行宣布建立“临时准备金动用安排”，应对春节期间的流动性缺口。显示央行对市场的预调微调。流动性环境 1 季度还是比较紧，短端资金利率仍将维持高位。为支持实体经济以及理财回表需求下，信贷环境还是非常强劲。

政策面上，十九大后淡化经济增长的数量目标。防范系统性风险是重要政策着力点之一。中央经济工作会议传递出我国经济已由高速增长阶段转向高质量发展阶段，对经济增速下滑容忍度提高，在金融监管防风险的目标下货币政策将继续保持“稳健中性”基调。M2 明年定调 9%左右，货币政策难以放松。而监管方面，2018 年金融监管持续，相关政策进入补短板阶段，1 季度继续出台相关政策可能性较大，不过在维护金融稳定的考虑下，未来监管政策的出台方式将兼顾金融市场反应。

货币市场方面，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呈现阶段性波动。在流动性方面 2018 年预计结构性紧张将会继续，但情况整体将比 2017 年会有所缓和，未来我们看价格型调控方面，在央行货币政策中性态度下，公开市场等政策型利率仍然存在继续上调可能。组合将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，细致管理现金流。在短融的选择上选取高评级央企，规避信用风险，同时保持高流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017 年 4 季度，景益货币 A 净值收益率为 0.9795%，业绩比较基准收益率为 0.3403%；

2017 年 4 季度，景益货币 B 净值收益率为 1.0407%，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	129,989,793.86	21.22
	其中：债券	129,989,793.86	21.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	230,313,922.96	37.59
	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	244,429,346.79	39.90
4	其他资产	7,938,735.51	1.30
5	合计	612,671,799.12	100.00

注：银行存款和结算备付金其中包含定期存款 241,000,000 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	0.57	
	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	30
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	47
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

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	58.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	22.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	15.43	-
	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)	3.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.29	-

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	39,998,039.28	6.57
	其中：政策性金融债	39,998,039.28	6.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	89,991,754.58	14.78
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	129,989,793.86	21.34
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	071702002	17 国泰君安 CP002	400,000	40,001,441.48	6.57
2	170401	17 农发 01	400,000	39,998,039.28	6.57
3	011756037	17 华电 SCP010	300,000	30,012,582.40	4.93
4	011751088	17 华电 SCP013	200,000	19,977,730.70	3.28

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	0.0465%
报告期内偏离度的最低值	0.0037%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0217%

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	3,400,719.09
4	应收申购款	4,538,016.42
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,938,735.51

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	433,595,281.37	418,705,294.76
报告期期间基金总申购份额	485,736,943.18	605,879,145.53
报告期期间基金总赎回份额	554,707,830.87	780,170,451.33
报告期期末基金份额总额	364,624,393.68	244,413,988.96

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10月9日	32,245.73	32,245.73	0.00%
2	红利再投	2017年10月10日	3,169.75	3,169.75	0.00%
3	红利再投	2017年10月11日	5,297.82	5,297.82	0.00%
4	红利再投	2017年10月12日	3,217.43	3,217.43	0.00%
5	申赎	2017年10月12日	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
6	红利再投	2017年10月13日	8,487.45	8,487.45	0.00%
7	红利再投	2017年10月16日	24,800.48	24,800.48	0.00%

8	红利再投	2017 年 10 月 17 日	7,994.93	7,994.93	0.00%
9	红利再投	2017 年 10 月 18 日	8,070.28	8,070.28	0.00%
10	红利再投	2017 年 10 月 19 日	7,624.58	7,624.58	0.00%
11	红利再投	2017 年 10 月 20 日	7,778.33	7,778.33	0.00%
12	红利再投	2017 年 10 月 23 日	37,824.17	37,824.17	0.00%
13	红利再投	2017 年 10 月 24 日	7,859.03	7,859.03	0.00%
14	红利再投	2017 年 10 月 25 日	7,643.56	7,643.56	0.00%
15	红利再投	2017 年 10 月 26 日	7,249.35	7,249.35	0.00%
16	红利再投	2017 年 10 月 27 日	7,787.33	7,787.33	0.00%
17	红利再投	2017 年 10 月 30 日	22,269.08	22,269.08	0.00%
18	红利再投	2017 年 10 月 31 日	7,901.25	7,901.25	0.00%
19	红利再投	2017 年 11 月 1 日	7,875.40	7,875.40	0.00%
20	红利再投	2017 年 11 月 2 日	7,847.54	7,847.54	0.00%
21	红利再投	2017 年 11 月 3 日	7,715.65	7,715.65	0.00%
22	红利再投	2017 年 11 月 6 日	22,704.05	22,704.05	0.00%
23	红利再投	2017 年 11 月 7 日	7,381.74	7,381.74	0.00%
24	红利再投	2017 年 11 月 8 日	7,445.71	7,445.71	0.00%
25	红利再投	2017 年 11 月 9 日	7,417.08	7,417.08	0.00%
26	红利再投	2017 年 11 月 10 日	7,376.90	7,376.90	0.00%
27	红利再投	2017 年 11 月 13 日	22,303.89	22,303.89	0.00%
28	红利再投	2017 年 11 月 14 日	7,399.24	7,399.24	0.00%
29	红利再投	2017 年 11 月 15 日	7,394.75	7,394.75	0.00%
30	红利再投	2017 年 11 月 16 日	14,732.13	14,732.13	0.00%
31	红利再投	2017 年 11 月 17 日	7,342.76	7,342.76	0.00%
32	红利再投	2017 年 11 月 20 日	22,281.17	22,281.17	0.00%
33	红利再投	2017 年 11 月 21 日	7,432.55	7,432.55	0.00%
34	红利再投	2017 年 11 月 22 日	7,582.92	7,582.92	0.00%
35	红利再投	2017 年 11 月 23 日	7,561.37	7,561.37	0.00%
36	红利再投	2017 年 11 月 24 日	7,504.51	7,504.51	0.00%
37	红利再投	2017 年 11 月 27 日	22,911.75	22,911.75	0.00%
38	红利再投	2017 年 11 月 28 日	7,104.81	7,104.81	0.00%
39	红利再投	2017 年 11 月 29 日	7,836.97	7,836.97	0.00%
40	申赎	2017 年 11 月 29 日	10,000,000.00	-10,000,000.00	0.00%
41	红利再投	2017 年 11 月 30 日	6,847.87	6,847.87	0.00%
42	红利再投	2017 年 12 月 1 日	6,903.41	6,903.41	0.00%
43	红利再投	2017 年 12 月 4 日	18,970.48	18,970.48	0.00%
44	红利再投	2017 年 12 月 5 日	6,605.95	6,605.95	0.00%
45	红利再投	2017 年 12 月 6 日	6,599.94	6,599.94	0.00%
46	红利再投	2017 年 12 月 7 日	12,873.09	12,873.09	0.00%
47	红利再投	2017 年 12 月 8 日	6,692.24	6,692.24	0.00%

48	红利再投	2017 年 12 月 11 日	20,389.67	20,389.67	0.00%
49	红利再投	2017 年 12 月 12 日	6,905.71	6,905.71	0.00%
50	红利再投	2017 年 12 月 13 日	6,732.35	6,732.35	0.00%
51	申赎	2017 年 12 月 13 日	10,000,000.00	-10,000,000.00	0.00%
52	红利再投	2017 年 12 月 14 日	5,894.04	5,894.04	0.00%
53	红利再投	2017 年 12 月 15 日	5,661.44	5,661.44	0.00%
54	红利再投	2017 年 12 月 18 日	16,519.71	16,519.71	0.00%
55	红利再投	2017 年 12 月 19 日	13,931.15	13,931.15	0.00%
56	红利再投	2017 年 12 月 20 日	6,173.66	6,173.66	0.00%
57	红利再投	2017 年 12 月 21 日	6,508.24	6,508.24	0.00%
58	红利再投	2017 年 12 月 22 日	6,642.30	6,642.30	0.00%
59	红利再投	2017 年 12 月 25 日	20,258.32	20,258.32	0.00%
60	红利再投	2017 年 12 月 26 日	6,661.18	6,661.18	0.00%
61	红利再投	2017 年 12 月 27 日	7,552.85	7,552.85	0.00%
62	红利再投	2017 年 12 月 28 日	7,811.17	7,811.17	0.00%
63	申赎	2017 年 12 月 28 日	20,000,000.00	-20,000,000.00	0.00%
64	红利再投	2017 年 12 月 29 日	4,716.48	4,716.48	0.00%
合计			90,640,224.69	10,640,224.69	

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	份额占比
机构	1	20171001--20171115	203,923,302.67	1,125,265.80	200,000,000.00	5,048,568.47	0.83%
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

2018 年 1 月 22 日