

# 长城货币市场证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 08 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22

6.4 报表附注.....	24
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 债券回购融资情况.....	46
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	47
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 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.....	48
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.9 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	55
10.9 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>
11.1 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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>

12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城货币市场证券投资基金		
基金简称	长城货币		
基金主代码	200003		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2005 年 5 月 30 日		
基金管理人	长城基金管理有限公司		
基金托管人	华夏银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	8,337,945,087.27 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	长城货币 A	长城货币 B	长城货币 E
下属分级基金的交易代码:	200003	200103	000861
报告期末下属分级基金的份额总额	4,184,140,580.39 份	4,124,780,982.12 份	29,023,524.76 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在本金安全和足够流动性的前提下，寻求货币资产稳定的收益。
投资策略	一级资产配置策略：根据宏观经济研究，分析市场趋势和政府政策变化，决定基金投资组合的平均剩余期限。根据债券的信用评级及担保状况，决定组合的信用风险级别。二级资产配置策略：根据不同类别资产的剩余期限结构、流动性指标、收益率水平、市场偏好、法律法规对货币市场基金的限制、基金合同、目标收益、业绩比较基准、估值方式等决定不同类别资产的配置比例。三级资产配置策略：根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标，确定构建基金投资组合的投资品种。
业绩比较基准	税后银行活期存款利率
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	郑鹏
	联系电话	0755-23982338	010-85238667
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	bjxhg@hxb.com.cn
客户服务电话		400-8868-666	95577
传真		0755-23982328	010-85238680
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号 新世界商务中心 41 层	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号 新世界商务中心 40、41 层	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码		518026	100005
法定代表人		何伟	李民吉

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商 务中心 41 层

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6009 号新世界 商务中心 40、41 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长城货币 A	长城货币 B	长城货币 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	76,549,082.12	106,715,553.11	638,209.75
本期利润	76,549,082.12	106,715,553.11	638,209.75
本期净值收益率	1.5881%	1.7092%	1.6634%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )		
期末基金资产净值	4,184,140,580.39	4,124,780,982.12	29,023,524.76
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )		
累计净值收益率	45.0233%	22.9513%	7.4584%

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本基金收益分配按日结转份额。

③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 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

长城货币 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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



过去一个月	0.2998%	0.0009%	0.0288%	0.0000%	0.2710%	0.0009%
过去三个月	0.8990%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.8117%	0.0010%
过去六个月	1.5881%	0.0023%	0.1736%	0.0000%	1.4145%	0.0023%
过去一年	2.8404%	0.0021%	0.3500%	0.0000%	2.4904%	0.0021%
过去三年	10.8739%	0.0043%	1.0510%	0.0000%	9.8229%	0.0043%
自基金合同 生效起至今	45.0233%	0.0065%	21.4404%	0.0037%	23.5829%	0.0028%

长城货币 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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
过去一个月	0.3196%	0.0009%	0.0288%	0.0000%	0.2908%	0.0009%
过去三个月	0.9595%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.8722%	0.0010%
过去六个月	1.7092%	0.0023%	0.1736%	0.0000%	1.5356%	0.0023%
过去一年	3.0876%	0.0021%	0.3500%	0.0000%	2.7376%	0.0021%
过去三年	11.6748%	0.0043%	1.0510%	0.0000%	10.6238%	0.0043%
自基金合同 生效起至今	22.9513%	0.0052%	1.8590%	0.0001%	21.0923%	0.0051%

长城货币 E

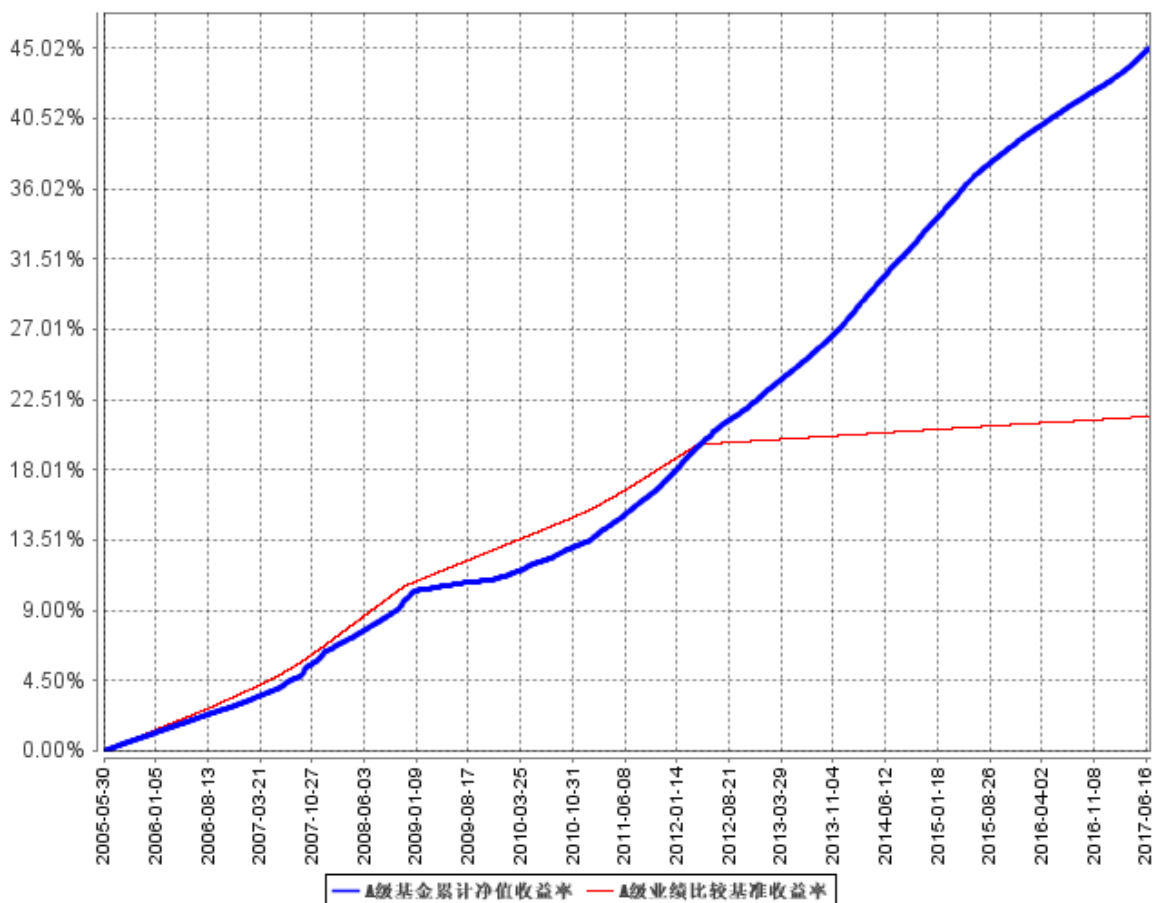
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3122%	0.0009%	0.0288%	0.0000%	0.2834%	0.0009%
过去三个月	0.9365%	0.0010%	0.0873%	0.0000%	0.8492%	0.0010%
过去六个月	1.6634%	0.0023%	0.1736%	0.0000%	1.4898%	0.0023%
过去一年	2.9944%	0.0021%	0.3500%	0.0000%	2.6444%	0.0021%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同	7.4584%	0.0036%	0.7882%	0.0000%	6.6702%	0.0036%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

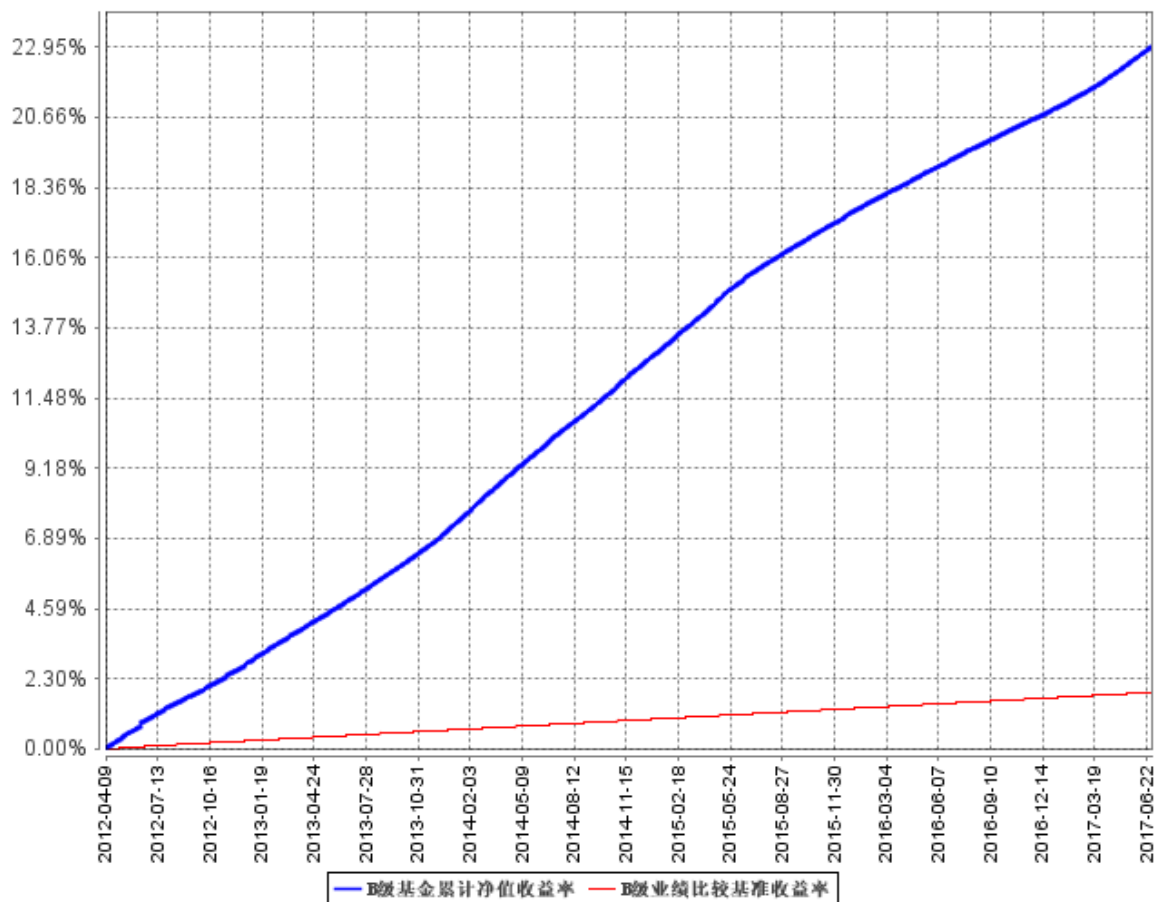
注：本基金收益分配按日结转份额。

### 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

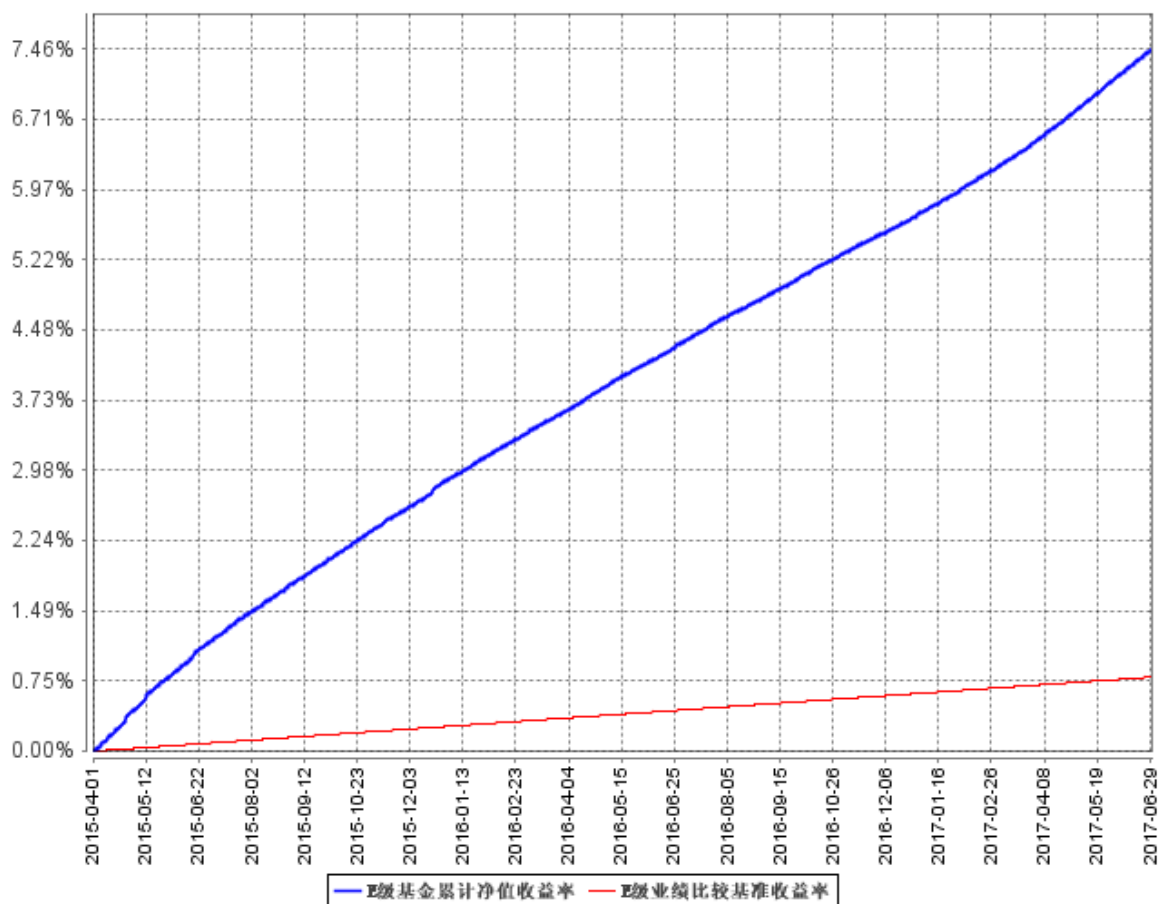
**A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



**E级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：本基金合同规定本基金的组合配置比例范围为：央行票据：0—80%，回购 0—70%，短期债券 0—80%，同业存款/现金比例 0—70%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 3 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有：久嘉证券投资基金（2017 年 7 月 5 日起由封闭式基金转为开放式基金，并更名为长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金）、长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置

混合型证券投资基金、长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹德立	长城货币市场基金、长城工资宝货币市场基金基金经理	2011年10月19日	-	8年	男，中国籍，武汉大学经济学学士、华中科技大学工程硕士。曾就职于深圳农村商业银行总行资金部，从事债券投资与研究。2009年3月进入长城基金管理有限公司，任运行保障部债券交易员，兼固定收益研究员。
徐涛国	长城货币基金经理助理	2016年6月8日	2017年6月22日	9年	男，华中科技大学工学学士、管理学硕士。2008年进入长城基金管理有限公司，曾任运行保障部登记结算专员、交易员，“长城货币市场证券投资基金”的基金经理助理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《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了《证券投资基金法》、《长城货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金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% 的现象。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国际上，美国经济增长放缓，美联储持续加息，美元回落，英国脱欧进展缓慢，法国右翼选举受挫，德国经济增长强劲，韩国政局动荡。国内，我国经济增速高于市场预期，但强劲度上二季度相对于一季度有所衰减。工业生产平稳，企业利润冲高回落，基建投资下行，进出口增速回落，消费平稳增长。M1 维持高位，M2 持续回落，人民币贬值压力变小。黄金、油价和大宗商品价格回落。

债券市场方面，1 季度，央行货币政策偏紧，公开市场变向加息，银行面临首次 MPA 考核压力，季末流动性紧张。回购利率抬升，各类债券收益率逐步上行，季末 AA+ 级短期融资券和 AA 级同业存单收益率在 4.8% 附近。2 季度，央行货币政策偏宽松，银行 MPA 考核未导致流动性紧张。回购和各类债券收益率持续上行创阶段性新高后又大幅回落，季末 AA+ 级短期融资券和 AA 级同业存单收益率在 4.8% 附近。

回顾我们上半年的操作，总体看来较为成功，为基金持有人获取了稳健回报。1 季度，我们看好短端债券行情机会而规避长端风险，适度买入高等级短期融资券，加大协议存款和同业存单投资，降低回购资产比重。2 季度，我们基于震荡行情的判断，在收益率高点加大协议存款、同业存单和回购资产投资，保持中高组合久期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值收益率 A 级为 1.5881%，B 级为 1.7092%，E 级为 1.6634%，同期业绩

比较基准为 0.1736%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，我们认为美联储继续加息，美国经济增速放缓，但以德国为代表的欧盟经济增长较为强劲。中国经济增速将在 6.8%附近，CPI 维持在 2.0%左右，地产高位企稳，贸易和消费增长较好。政府推进供给侧改革，去杠杆，严监管，流动性保持中性。

债券市场收益率分化，高等级信用债将继续得到追捧，中低等级信用债收益率预计上行，个别信用风险暴露甚至违约。全球流动性趋于收缩，长期债券面临跌价风险，短期债券更具投资价值 and 风险规避能力。我们将根据经济基本面及资金面的变化，适时优化组合配置，把握流动性、收益性和风险性三者的平衡，努力为基金持有人取得稳健的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。

受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据受托资产估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查，对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

受托资产估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力；基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精



通投资、研究理论知识和工具方法。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

#### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。本基金管理人旗下管理的基金，其参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

#### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城货币市场证券投资基金基金合同》规定，本基金收益“每日分配、按月支付”，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。

本报告期应以再投资形式分配利润人民币 183,902,844.98 元，已分配利润人民币 183,902,844.98 元。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2017 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,858,457,503.79	7,574,528,140.37
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,077,910,470.58	9,822,364,800.99
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,077,910,470.58	9,822,364,800.99
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,059,002,188.50	13,695,647,542.18
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	55,578,072.99	99,492,897.95
应收股利		-	-
应收申购款		1,050,507.65	381,072,344.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,051,998,743.51	31,573,105,726.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		708,165,325.91	1,188,157,657.76
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		51,827.42	42,900.00
应付管理人报酬		2,631,425.57	5,434,304.59
应付托管费		797,401.69	1,646,759.00
应付销售服务费		946,528.19	1,368,113.18
应付交易费用	6.4.7.7	76,280.65	163,667.59
应交税费		1,160,735.69	1,160,735.69
应付利息		56,432.77	618,310.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	167,698.35	109,160.00
负债合计		714,053,656.24	1,198,701,608.77
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	8,337,945,087.27	30,374,404,117.63
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		8,337,945,087.27	30,374,404,117.63
负债和所有者权益总计		9,051,998,743.51	31,573,105,726.40

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，长城货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 4,184,140,580.39 份；长城货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 4,124,780,982.12 份；长城货币 E 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 29,023,524.76 份。长城货币份额总额合计为 8,337,945,087.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		226,416,605.19	386,515,002.94
1.利息收入		225,705,311.29	386,650,274.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,520,044.94	118,509,232.47
债券利息收入		130,138,998.11	213,447,946.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,046,268.24	54,693,095.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		711,293.90	-135,271.51
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	711,293.90	-135,271.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.12.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		42,513,760.21	67,784,119.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,162,307.45	36,872,400.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,806,759.82	11,173,454.87

3. 销售服务费		6,427,471.07	8,640,264.10
4. 交易费用	6.4.7.18	-	2,719.40
5. 利息支出		10,939,883.52	10,928,200.70
其中：卖出回购金融资产支出		10,939,883.52	10,928,200.70
6. 其他费用	6.4.7.19	177,338.35	167,079.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		183,902,844.98	318,730,883.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		183,902,844.98	318,730,883.36

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,374,404,117.63	-	30,374,404,117.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	183,902,844.98	183,902,844.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-22,036,459,030.36	-	-22,036,459,030.36
其中：1. 基金申购款	14,679,882,207.45	-	14,679,882,207.45

2. 基金赎回款	-36,716,341,237.81	-	-36,716,341,237.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-183,902,844.98	-183,902,844.98
五、期末所有者权益（基金净值）	8,337,945,087.27	-	8,337,945,087.27
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	25,638,046,583.72	-	25,638,046,583.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	318,730,883.36	318,730,883.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	5,769,221,691.90	-	5,769,221,691.90
其中：1. 基金申购款	48,299,906,939.71	-	48,299,906,939.71
2. 基金赎回款	-42,530,685,247.81	-	-42,530,685,247.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-318,730,883.36	-318,730,883.36
五、期末所有者权益（基金净值）	31,407,268,275.62	-	31,407,268,275.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>何伟</u>	<u>熊科金</u>	<u>赵永强</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监基金字[2005]52号文《关于同意长城货币市场证券投资基金募集的批复》的核准,由长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,首次设立募集规模为2,934,887,104.33份基金份额,本基金基金合同于2005年5月30日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,注册登记机构为长城基金管理有限公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司(“华夏银行”)。

根据2012年3月29日《长城货币市场证券投资基金实施基金份额分级与变更业绩比较基准并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》,本基金自2012年4月6日起对本基金实施基金份额分级,同时对本基金的业绩比较基准进行变更,于2012年4月9日确认分级为A级与B级。根据2015年3月27日《长城货币市场证券投资基金增设基金份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》,本基金自2015年4月1日起增设E级基金份额。

本基金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,因此形成不同的基金份额等级。本基金设A级基金份额、B级基金份额和E级基金份额,各级基金份额单独设置基金代码,并分别公布各级基金每万份基金净收益和七日年化收益率。本基金的A级和B级基金份额,根据投资者基金交易账户所有持有份额数量是否不低于500万份进行升降级的判断和处理;本基金的E级基金份额不进行基金份额升降级。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于2016年10月14日发布的《关于修改长城货币市场证券投资基金基金合同和托管协议的公告》,本基金的投资范围进行如下变更。变更前,本基金投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余到期期限的债券、央行票据、回购,以及法律法规允许投资的其他金融工具。包括:现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;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。变更后,本基金投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余到期期限的债券、央行票据、



回购，以及法律法规允许投资的其他金融工具。包括：现金、期限在 1 年以内（含 1 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；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。

自基金合同生效至 2012 年 4 月 5 日的业绩比较基准为：税后一年期银行定期存款利率；自 2012 年 4 月 6 日起业绩比较基准为：税后银行活期存款利率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更说明。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 1. 营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称

资管产品运营业务)，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

## 2. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	457,503.79
定期存款	2,858,000,000.00
其中：存款期限 1 个月内	0.00
存款期限 1-3 个月	1,700,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	1,158,000,000.00
其他存款	-
合计：	2,858,457,503.79

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债 券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	5,077,910,470.58	5,082,412,000.00	4,501,529.42	0.0540%
	合计	5,077,910,470.58	5,082,412,000.00	4,501,529.42	0.0540%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

买入返售证券_银行间	1,059,002,188.50	-
合计	1,059,002,188.50	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末未持有因买断式逆回购交易取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	69.48
应收定期存款利息	11,156,771.75
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	43,809,035.46
应收买入返售证券利息	612,196.30
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	55,578,072.99

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	76,280.65

合计	76,280.65
----	-----------

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付银行划款手续费	160.00
预提费用	167,538.35
合计	167,698.35

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长城货币 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,453,872,281.50	5,453,872,281.50
本期申购	5,709,038,121.16	5,709,038,121.16
本期赎回(以“-”号填列)	-6,978,769,822.27	-6,978,769,822.27
本期末	4,184,140,580.39	4,184,140,580.39

金额单位：人民币元

长城货币 B		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	24,860,060,045.80	24,860,060,045.80
本期申购	8,911,905,326.66	8,911,905,326.66
本期赎回(以“-”号填列)	-29,647,184,390.34	-29,647,184,390.34
本期末	4,124,780,982.12	4,124,780,982.12

金额单位：人民币元

长城货币 E		
项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,471,790.33	60,471,790.33
本期申购	58,938,759.63	58,938,759.63
本期赎回(以“-”号填列)	-90,387,025.20	-90,387,025.20
本期末	29,023,524.76	29,023,524.76

注：（1）本期申购包含红利再投资和基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

（2）本基金设 A 级基金份额、B 级基金份额和 E 级基金份额，本基金的 A 级和 B 级基金份额，根据投资者基金交易账户所有持有份额数量是否不低于 500 万份进行升降级的判断和处理；本基金的 E 级基金份额不进行基金份额升降级。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长城货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	76,549,082.12	-	76,549,082.12
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-76,549,082.12	-	-76,549,082.12
本期末	-	-	-

单位：人民币元

长城货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	106,715,553.11	-	106,715,553.11
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-106,715,553.11	-	-106,715,553.11
本期末	-	-	-

单位：人民币元

长城货币 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	638,209.75	-	638,209.75
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-638,209.75	-	-638,209.75
本期末	-	-	-

注：本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每月以红利再投资方式集中支付累积收益，即按份额面值 1.00 元转为基金份额。



**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	23,925.96
定期存款利息收入	68,496,118.98
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	68,520,044.94

**6.4.7.12 债券投资收益****6.4.7.12.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,928,477,118.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,818,270,916.13
减：应收利息总额	109,494,908.28
买卖债券差价收入	711,293.90

**6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益**

注：本基金于本期未发生资产支持证券投资收益/损失。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

注：本基金于本期未发生贵金属投资收益/损失。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

注：本基金于本期未发生衍生工具收益/损失。

**6.4.7.15 股利收益**

注：本基金于本期未发生股利收益。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

注：本基金于本期未发生公允价值变动收益。

**6.4.7.17 其他收入**

注：本基金于本期未发生其他收入。

**6.4.7.18 交易费用**

注：本基金于本期未发生交易费用。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	99,177.14
上清所结算账户维护费	8,926.92
银行间结算账户维护费	8,926.92
其他	800.00
合计	177,338.35

注：“其他”为上清所银行间查询服务费。

**6.4.7.20 分部报告**

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本期无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本期及上年度可比期间未发生应支付关联方的佣金，本期末及上年度可比期间期末亦无应付关联方佣金余额。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	19,162,307.45	36,872,400.87
其中：支付销售机构的客户维护费	882,936.97	2,328,242.10

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,806,759.82	11,173,454.87

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	长城货币 A	长城货币 B	长城货币 E	合计
华夏银行	14,666.87	-	20,235.30	34,902.17
长城基金管理有限公司	4,768,125.84	310,934.85	3.02	5,079,063.71
长城证券	101,300.81	2,474.41	-	103,775.22
东方证券	1,037.26	49.32	-	1,086.58
合计	4,885,130.78	313,458.58	20,238.32	5,218,827.68
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	长城货币 A	长城货币 B	长城货币 E	合计
华夏银行	16,128.75	-	37,668.78	53,797.53
长城基金管理有限公司	4,713,378.94	729,171.25	4.96	5,442,555.15
长城证券	184,338.56	2,959.45	-	187,298.01
东方证券	2,970.64	0.00	-	2,970.64
合计	4,916,816.89	732,130.70	37,673.74	5,686,621.33

注：基金销售服务费用用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金 A 级份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提；本基金 B 级份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提；本基金 E 级份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为各级基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费年费率

各级基金份额的销售服务费每日计提，按月支付；由基金托管人于次月首 2 个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户，由基金管理人支付给各销售机构。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金于本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金份额，于本期末及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

长城货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
长城证券	-	-	500,000,000.00	2.0113%

注：本报告期内，本基金管理人长城基金管理有限公司控股股东长城证券股份有限公司于 2017 年 1 月 12 日赎回本基金 B 类份额 100,000,000.00 份、于 2017 年 1 月 16 日分红本基金 B 类份额 677,457.88 份、于 2017 年 1 月 18 日赎回本基金 B 类份额 100,000,000.00 份、2017 年 1 月 19 日赎回本基金 B 类份额 300,677,457.88 份。上述交易按照基金合同、招募说明书的约定费率进行交易。截至本报告期末，长城证券股份有限公司未持有本基金 B 类份额。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

华夏银行	457,503.79	23,925.96	550,313.16	138,406.65
------	------------	-----------	------------	------------

注：本基金上述银行存款由基金托管人华夏银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 长城货币A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
76,549,082.12	-	-	76,549,082.12	-

##### 长城货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
106,715,553.11	-	-	106,715,553.11	-

##### 长城货币E

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
638,209.75	-	-	638,209.75	-

#### 6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 708,165,325.91 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170408	17 农发 08	2017 年 7 月 3 日	99.92	2,104,000	210,231,680.00
111682542	16 中原银行 CD220	2017 年 7 月 3 日	97.60	105,000	10,248,000.00
041671005	16 南新工 CP001	2017 年 7 月 3 日	99.99	1,500,000	149,985,000.00
11762009	17 昆山创业 SCP001	2017 年 7 月 3 日	99.97	1,500,000	149,955,000.00
041656023	16 珠轨交 CP001	2017 年 7 月 3 日	99.99	1,000,000	99,990,000.00
041662038	16 金茂 CP001	2017 年 7 月 3 日	99.97	1,000,000	99,970,000.00
合计				7,209,000	720,379,680.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末本基金无从事证券交易所债券正回购交易所形成的卖出回购证券款余额，因此没有相关抵押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会和监



察稽核部、相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金投资于高信用等级且具有较短剩余期限的国内货币市场工具，因此投资组合具有较高的短期变现能力，期末除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的国债的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为三个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的组合配置比例范围为：央行票据：0-80%，回购 0-70%，短期债券 0-80%，同业存款/现金比例 0-70%，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上取决于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2017年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年 以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,000,457,503.79	1,558,000,000.00	300,000,000.00	-	-	-	2,858,457,503.79
交易性金融 资产	559,589,316.24	1,497,735,349.86	3,020,585,804.48	-	-	-	5,077,910,470.58
买入返售金 融资产	1,059,002,188.50	-	-	-	-	-	1,059,002,188.50
应收利息	-	-	-	-	-	55,578,072.99	55,578,072.99
应收申购款	-	-	-	-	-	1,050,507.65	1,050,507.65
资产总计	2,619,049,008.53	3,055,735,349.86	3,320,585,804.48	-	-	56,628,580.64	9,051,998,743.51
负债							
卖出回购金 融资产款	708,165,325.91	-	-	-	-	-	708,165,325.91
应付赎回款	-	-	-	-	-	51,827.42	51,827.42
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	2,631,425.57	2,631,425.57
应付托管费	-	-	-	-	-	797,401.69	797,401.69
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	946,528.19	946,528.19
应付交易费 用	-	-	-	-	-	76,280.65	76,280.65

应付利息	-	-	-	-	-	56,432.77	56,432.77
应交税费	-	-	-	-	-	1,160,735.69	1,160,735.69
其他负债	-	-	-	-	-	167,698.35	167,698.35
负债总计	708,165,325.91	-	-	-	-	5,888,330.33	714,053,656.24
利率敏感度 缺口	1,910,883,682.62	3,055,735,349.86	3,320,585,804.48	-	-	-	-
上年度末 2016年12 月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年 以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,074,528,140.37	6,500,000,000.00	-	-	-	-	7,574,528,140.37
交易性金融 资产	641,972,972.58	4,009,366,920.54	5,150,906,460.79	20,118,447.08	-	-	9,822,364,800.99
买入返售金 融资产	13,695,647,542.18	-	-	-	-	-	13,695,647,542.18
应收利息	-	-	-	-	-	99,492,897.95	99,492,897.95
应收申购款	-	-	-	-	-	381,072,344.91	381,072,344.91
资产总计	15,412,148,655.13	10,509,366,920.54	5,150,906,460.79	20,118,447.08	-	480,565,242.86	31,573,105,726.40
负债							
卖出回购金 融资产款	1,188,157,657.76	-	-	-	-	-	1,188,157,657.76
应付赎回款	-	-	-	-	-	42,900.00	42,900.00
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	5,434,304.59	5,434,304.59
应付托管费	-	-	-	-	-	1,646,759.00	1,646,759.00
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	1,368,113.18	1,368,113.18
应付交易费 用	-	-	-	-	-	163,667.59	163,667.59

应付利息	-	-	-	-	618,310.96	618,310.96
应交税费	-	-	-	-	1,160,735.69	1,160,735.69
其他负债	-	-	-	-	109,160.00	109,160.00
负债总计	1,188,157,657.76	-	-	-	10,543,951.01	1,198,701,608.77
利率敏感度 缺口	14,223,990,997.37	10,509,366,920.54	5,150,906,460.79	20,118,447.08	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	利率上升 25 个基点	-4,675,564.66	-1,597,602.76
	利率下降 25 个基点	4,688,227.48	1,600,379.83

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

于本期末及上年度末，本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有股票投资、权证投资等其他交易性金融资产，因此无重大的其他价格风险。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	5,077,910,470.58	56.10
	其中: 债券	5,077,910,470.58	56.10
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,059,002,188.50	11.70
	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	2,858,457,503.79	31.58
4	其他各项资产	56,628,580.64	0.63
5	合计	9,051,998,743.51	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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		7.27
	其中: 买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	708,165,325.91	8.49
	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

注：在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%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生违规超过 120 天的情况。

#### 7.3.2 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	31.41	8.49
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	18.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	18.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	36.50	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		107.88	8.49

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生违规超过 240 天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,130,104,833.87	13.55
	其中：政策性金融债	1,130,104,833.87	13.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,949,325,529.70	23.38
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,998,480,107.01	23.97
8	其他	-	-
9	合计	5,077,910,470.58	60.90
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	170408	17 农发 08	3,000,000	299,765,058.53	3.60
2	111795680	17 锦州银	3,000,000	299,554,074.73	3.59



		行 CD097			
3	111780373	17 佛山农 商行 CD009	3,000,000	293,205,330.90	3.52
4	111780190	17 龙江银 行 CD152	2,500,000	241,331,707.33	2.89
5	140347	14 进出 47	2,100,000	210,227,763.85	2.52
6	110236	11 国开 36	2,000,000	200,470,359.56	2.40
7	011766006	17 北京国 资 SCP002	2,000,000	199,970,979.14	2.40
8	011760004	17 中建材 SCP001	2,000,000	199,967,902.46	2.40
9	011752011	17 物产中 大 SCP003	2,000,000	199,936,126.21	2.40
10	170203	17 国开 03	2,000,000	199,603,301.17	2.39

### 7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0565%
报告期内偏离度的最低值	-0.0805%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0336%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内负偏离度的绝对值未发生达到或超过 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

注：本基金本报告期内正偏离度的绝对值未发生达到或超过 0.5%的情况。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。本基金通过每日分红使得基金份额的净值始终维持在 1.0000 元。

### 7.9.2

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚，不存在需说明的证券投资决策程序。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	55,578,072.99
4	应收申购款	1,050,507.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	56,628,580.64

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份 额 级 别	持有 人 户 数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额 比例	持有份额	占总份 额 比例
长 城 货 币 A	214,171	19,536.45	45,592,420.53	1.09%	4,138,548,159.86	98.91%
长 城 货 币 B	47	87,761,297.49	4,054,472,105.21	98.30%	70,308,876.91	1.70%
长 城 货 币 E	645	44,997.71	21,900,542.31	75.46%	7,122,982.45	24.54%
合 计	214,863	38,805.87	4,121,965,068.05	49.44%	4,215,980,019.22	50.56%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	长城货币 A	11,613,674.53	0.2776%

持有本基金	长城货币 B	-	-
	长城货币 E	-	-
	合计	11,613,674.53	0.1393%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长城货币 A	>100
	长城货币 B	0
	长城货币 E	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	长城货币 A	0~10
	长城货币 B	0
	长城货币 E	0
	合计	0~10

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长城货币 A	长城货币 B	长城货币 E
基金合同生效日（2005 年 5 月 30 日）基金份额总额	2,935,209,062.29	-	-
本报告期期初基金份额总额	5,453,872,281.50	24,860,060,045.80	60,471,790.33
本报告期基金总申购份额	5,709,038,121.16	8,911,905,326.66	58,938,759.63
减：本报告期基金总赎回份额	6,978,769,822.27	29,647,184,390.34	90,387,025.20
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期末基金份额总额	4,184,140,580.39	4,124,780,982.12	29,023,524.76

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本期无租用证券公司交易单元的变更情况，截止本报告期末共计 2 个交易日。

2、本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期没有租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期没有偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金关于增加万得投顾为	中国证券报、上海证券报、	2017 年 1 月 4

	旗下开放式基金代销机构并开通定投和转换业务及参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报及本基金经理人网站	日
2	长城货币基金 2017 年春节假期前暂停申购和转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报及本基金经理人网站	2017 年 1 月 20 日
3	长城基金关于增加新兰德投资咨询为旗下开放式基金代销机构并开通定投和转换业务及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站	2017 年 3 月 24 日
4	长城基金管理有限公司关于参加微众银行费率优惠活动的公告（放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金经理人网站	2017 年 3 月 31 日
5	长城基金管理有限公司关于参加长城证券费率优惠活动的公告（含定投-放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站	2017 年 5 月 15 日
6	长城基金管理有限公司关于参加中信建投证券费率优惠活动的公告（含定投-放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站	2017 年 5 月 18 日
7	长城基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告（含定投-放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站	2017 年 6 月 16 日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 本基金设立批准的相关文件
- (二) 《长城货币市场证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城货币市场证券投资基金托管协议》
- (四) 《长城货币市场证券投资基金招募说明书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

公司网址：<http://www.ccfund.com.cn>