

长城工资宝货币市场基金 2020 年中期报告

2020 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 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。本中期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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 27 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	40
7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	46
10.9 其他重大事件.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48

§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城工资宝货币市场基金	
基金简称	长城工资宝货币	
基金主代码	000615	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 6 月 25 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11, 215, 141, 178. 67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长城工资宝货币 A	长城工资宝货币 B
下属分级基金的交易代码:	000615	004568
报告期末下属分级基金的份额总额	54, 558, 979. 43 份	11, 160, 582, 199. 24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保证本金安全性和良好流动性的前提下，力争获得超过业绩比较基准的表现。
投资策略	<p>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。</p> <p>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、市场偏好等决定不同类别资产的配置比例。</p> <p>三级资产配置策略：根据明细资产的剩余期限、信用等级、流动性指标，确定构建基金投资组合的投资品种。根据对个券收益率水平、剩余期限、流动性状况的权衡，参照收益目标确定个券投资品种与投资数量。</p>
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和收益低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	李修滨
	联系电话	0755-23982338	4006800000
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	lixubini@citicbank.com
客户服务电话		400-8868-666	95558
传真		0755-23982328	010-85230024
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号 新世界商务中心 41 层	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号	北京市东城区朝阳门北大街 9 号

	新世界商务中心 40、41 层	号
邮政编码	518026	100010
法定代表人	王军	李庆萍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	长城工资宝货币 A	长城工资宝货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	612,849.37	106,855,678.34
本期利润	612,849.37	106,855,678.34
本期净值收益率	0.9742%	1.0699%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末基金资产净值	54,558,979.43	11,160,582,199.24
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
累计净值收益率	20.3418%	10.9185%

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

长城工资宝货币 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	0.1420%	0.0011%	0.0288%	0.0000%	0.1132%	0.0011%
过去三个月	0.4099%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.3226%	0.0008%
过去六个月	0.9742%	0.0012%	0.1745%	0.0000%	0.7997%	0.0012%
过去一年	2.2628%	0.0013%	0.3510%	0.0000%	1.9118%	0.0013%
过去三年	9.3633%	0.0027%	1.0510%	0.0000%	8.3123%	0.0027%
自基金合同生效起至今	20.3418%	0.0089%	2.1077%	0.0000%	18.2341%	0.0089%

长城工资宝货币 B

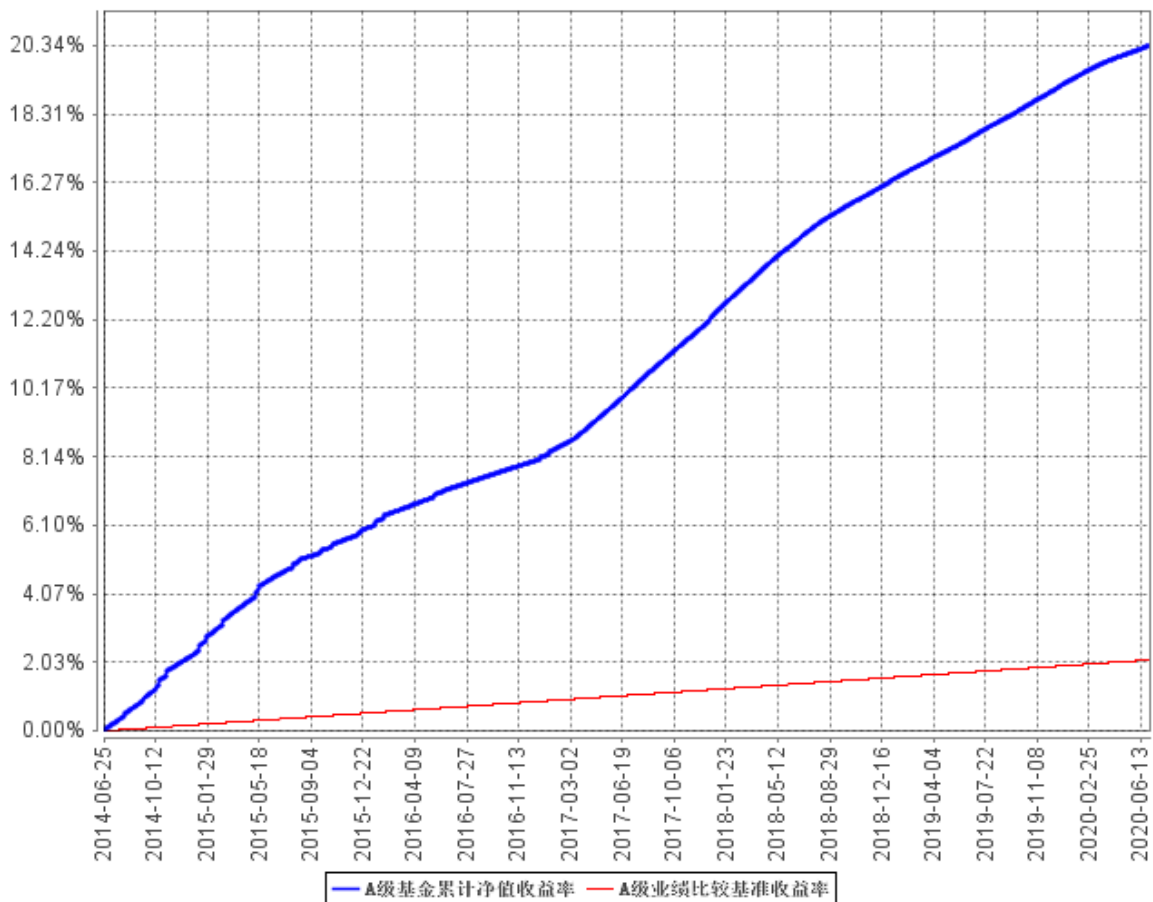
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去一个月	0.1575%	0.0011%	0.0288%	0.0000%	0.1287%	0.0011%
过去三个月	0.4574%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.3701%	0.0008%
过去六个月	1.0699%	0.0012%	0.1745%	0.0000%	0.8954%	0.0012%
过去一年	2.4576%	0.0013%	0.3510%	0.0000%	2.1066%	0.0013%
过去三年	9.9893%	0.0027%	1.0510%	0.0000%	8.9383%	0.0027%
自基金合同生效起至今	10.9185%	0.0028%	1.1200%	0.0000%	9.7985%	0.0028%

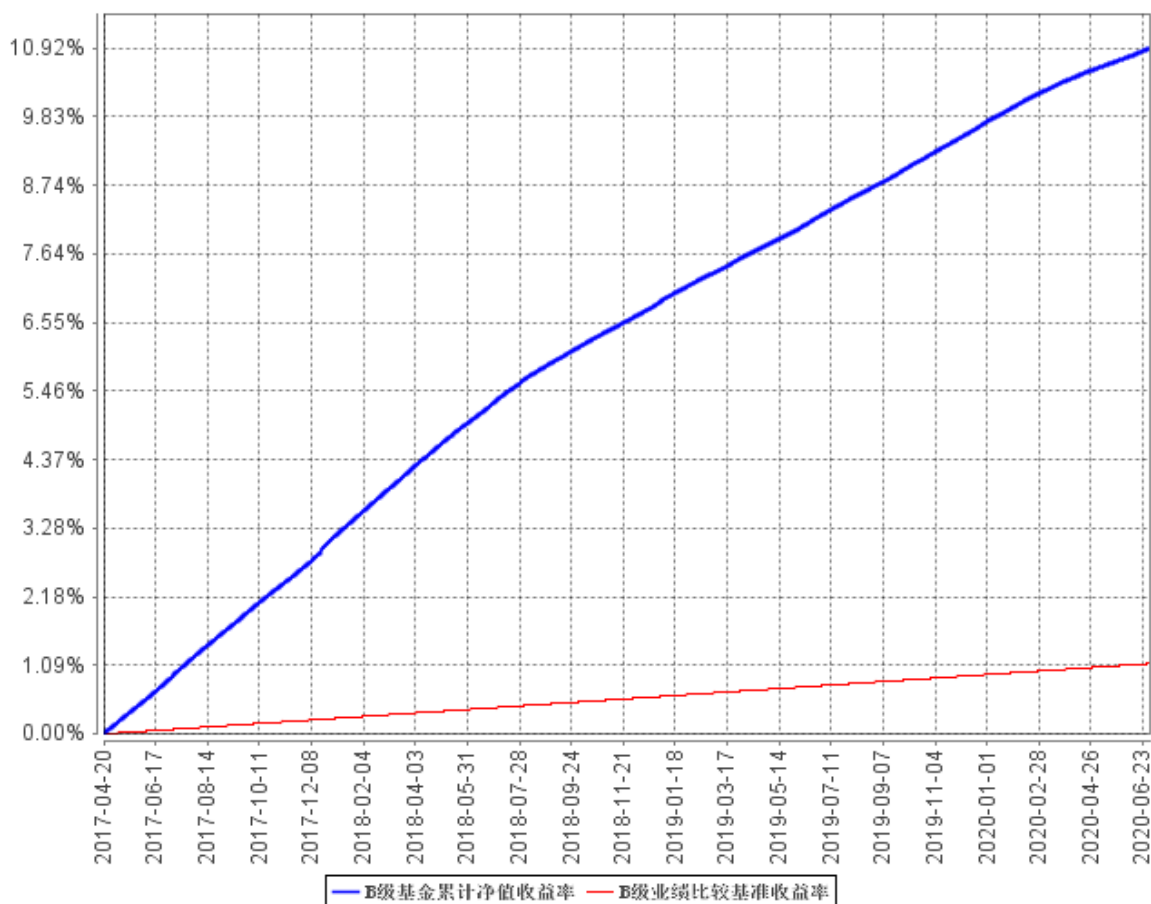
注：本基金收益分配按日结转份额。

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



注：①本基金合同规定本基金投资范围包括：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。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 3 个月内。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。截至本报告期末，公司管理的基金包括：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、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置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、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、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（《长城久信债券型证券投资基金基金合同》自 2020 年 7 月 15 日起终止）、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、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久悦债券型证券

投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、长城创新驱动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		
徐涛国	长城工资宝货币、长城嘉鑫两年定期债券、长城嘉裕六个月定期债券的基金经理	2017年6月22日	-	12年	男，中国籍，华中科技大学工学学士、管理学硕士、风险控制师（FRM）。2008年5月进入长城基金管理有限公司，曾任运行保障部TA清算、债券交易员、固定收益部货币基金经理助理。
邹德立	固定收益部副总经理，长城货币、长城工资宝货币、长城收益宝货币、长城短债的基金经理	2014年6月25日	-	11年	男，中国籍，武汉大学经济学学士、华中科技大学工程硕士。具有13年债券投资管理经历，曾就职于深圳农村商业银行总行资金部。2009年3月进入长城基金管理有限公司，曾任运行保障部债券交易员，兼固定收益研究员。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城工资宝货币市场基金基金合同》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

上半年经济增长受疫情影响明显，同比出现大幅回落。劳动力由于疫情拖累未充分就业，导致一季度 GDP 同比-6.8%，经济实际增速低于潜在增速，同时海外疫情扩散导致外需持续承压，内外失衡。二季度随着疫情逐步平缓，复工复产持续推进，国家基建等投资的持续加大，预计 GDP 同比增速为 3-4%。根据最新经济数据，国内经济边际趋向正常化、未来仍有提高空间。债券收益率在经济基本面的承压和央行货币政策的宽松推动下快速下行，后期随着经济基本面触底修复及央行货币政策放松力度的减小，收益率出现上行。央行政策态度与经济复苏程度是关注焦点，也是影响未来市场走势的重要因素。

回顾本基金上半年的投资，我们基于利率逐步上行行情的判断，在季末收益率高点根据组合情况增加了杠杆，并在上半年维持了高杠杆率以增加组合的收益。预计下半年资金面仍将维持较为宽松的局面，我们将在保持较高杠杆率的同时，努力抓住收益上行的配置机会，提高组合的收益水平。

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 0.9742%、B 级为 1.0699%，同期业绩比较基准为 0.1745%。

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 2020 年下半年，我们认为经济修复仍在途中。地产、基建投资持续回升，地产销售端也

在不断回暖。下半年在稳增长政策下，基建作为主要抓手，有望进一步发力。目前债券利率水平已快速修复至疫情初期，进一步快速上行乏力，而货币政策大概率仍将维持中性偏宽松。债券收益率维持震荡波动。我们将根据经济基本面及资金面的变化，根据组合情况适时优化配置，重点防范流动性风险和利率风险，把握流动性、收益性和风险性三者的平衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人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、运行保障部总经理、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、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。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。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城工资宝货币市场基金基金合同》规定，本基金收益“每日分配、每日支付”，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益。

本报告期应以再投资形式分配利润人民币 107,468,527.71 元，已分配利润人民币 107,468,527.71 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对长城工资宝货币市场基金 2020 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，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

本托管人认为，长城基金管理有限公司在长城工资宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2020 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：长城工资宝货币市场基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	500,563,742.73	637,013.20
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	8,069,393,437.65	4,277,170,953.72
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,069,393,437.65	4,277,170,953.72
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	3,179,138,878.28	1,222,395,673.59
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	16,275,748.99	11,623,050.69
应收股利		-	-
应收申购款		170,245.16	252,201,530.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,765,542,052.81	5,764,028,221.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
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		547,399,166.30	692,048,401.92
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		10,246.56	-
应付管理人报酬		1,888,908.01	1,808,261.33
应付托管费		604,450.57	578,643.64
应付销售服务费		83,467.58	84,756.24
应付交易费用	6.4.7.7	241,404.34	192,486.80
应交税费		19,309.94	3,525.81

应付利息		35,522.46	68,817.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	118,398.38	209,000.00
负债合计		550,400,874.14	694,993,893.00
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	11,215,141,178.67	5,069,034,328.46
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		11,215,141,178.67	5,069,034,328.46
负债和所有者权益总计		11,765,542,052.81	5,764,028,221.46

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，长城工资宝货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 54,558,979.43 份；长城工资宝货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 11,160,582,199.24 份。长城工资宝货币份额总额合计为 11,215,141,178.67 份。

6.2 利润表

会计主体：长城工资宝货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		134,730,085.78	83,723,412.28
1.利息收入		132,450,757.73	83,515,942.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,464,531.59	5,985,789.29
债券利息收入		78,428,875.44	47,974,301.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		48,557,350.70	29,555,851.26
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,279,328.05	207,469.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,279,328.05	207,469.92
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		27,261,558.07	14,978,276.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,694,906.66	6,684,842.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,062,370.16	2,139,149.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	565,985.34	314,294.38
4. 交易费用	6.4.7.19	694.25	509.60
5. 利息支出		9,797,210.15	5,687,201.27
其中：卖出回购金融资产支出		9,797,210.15	5,687,201.27
6. 税金及附加		4,321.12	51.20
7. 其他费用	6.4.7.20	136,070.39	152,227.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		107,468,527.71	68,745,136.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		107,468,527.71	68,745,136.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城工资宝货币市场基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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）	5,069,034,328.46	-	5,069,034,328.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	107,468,527.71	107,468,527.71
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）	6,146,106,850.21	-	6,146,106,850.21
其中：1. 基金申购款	41,554,936,219.82	-	41,554,936,219.82
2. 基金赎回款	-35,408,829,369.61	-	-35,408,829,369.61
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）	-	-107,468,527.71	-107,468,527.71

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	11,215,141,178.67	-	11,215,141,178.67
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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)	3,023,670,668.29	-	3,023,670,668.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,745,136.17	68,745,136.17
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)	1,751,612,257.92	-	1,751,612,257.92
其中：1. 基金申购款	27,398,827,218.61	-	27,398,827,218.61
2. 基金赎回款	-25,647,214,960.69	-	-25,647,214,960.69
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)	-	-68,745,136.17	-68,745,136.17
五、期末所有者权益(基金净值)	4,775,282,926.21	-	4,775,282,926.21

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>王军</u>	<u>邱春杨</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

长城工资宝货币市场基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014] 374 号文“关于核准长城工资宝货币市场基金募集的批复”的核准,由长城基金管理有限公司自 2014 年 6 月 16 日至 2014 年 6 月 20 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014) 验字第 60737541_H03 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2014 年 6 月 25 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币 211,513,658.46 元,

在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 3,229.56 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 211,516,888.02 元，折合 211,516,888.02 份基金份额。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，基金托管人为中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于 2016 年 9 月 30 日发布的《关于修改长城工资宝货币市场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，本基金的投资范围为现金、通知存款、短期融资券、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款和大额存单、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期票据，以及中国证监会、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，本基金的投资范围为：1、现金；2、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；3、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；4、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于 2017 年 4 月 20 日发布的《关于长城工资宝货币市场基金增设基金份额并相应修改基金合同的公告》，本基金自 2017 年 4 月 20 日起增设 B 类基金份额。增设基金份额后，本基金将分设 A 类基金份额和 B 类基金份额。两类份额根据销售服务费收取方式的不同进行划分；其中，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 B 类基金份额。两类基金份额分别公布每万份净收益和七日年化收益率。增设 B 类基金份额后，在本基金存续期内的任何一个开放日，若单个基金账户内保留的本基金份额超过 500 万份（含 500 万份）时，本基金注册登记机构将自动升级其单个基金账户内持有的可用基金份额为 B 类基金份额，并于升级当日适用 B 类基金份额的相关费率；若单个基金账户内保留的本基金份额低于 500 万份（不含 500 万份）时，本基金注册登记机构将自动降级其单个基金账户内持有的可用基金份额为 A 类基金份额，并于降级当日适用 A 类基金份额的相关费率。

本基金的业绩比较基准为：银行活期存款利率（税后）。

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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

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. 增值税、企业所得税

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（以下简称“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，资管产品管理人未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的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

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。

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 2020年6月30日
活期存款	563,742.73
定期存款	500,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	500,000,000.00
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	500,563,742.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020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	50,006,959.80	49,830,000.00	-176,959.80	-0.0016%
	银行间市场	8,019,386,477.85	8,017,808,000.00	-1,578,477.85	-0.0141%
	合计	8,069,393,437.65	8,067,638,000.00	-1,755,437.65	-0.0157%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	8,069,393,437.65	8,067,638,000.00	-1,755,437.65	-0.0157%

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

本基金本期末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

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 2020年6月30日
----	-------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	700,300,000.00	-
银行间市场	2,478,838,878.28	-
合计	3,179,138,878.28	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	5,669.56
应收定期存款利息	271,250.01
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	13,150,991.42
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,847,838.00
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	16,275,748.99

6.4.7.6 其他资产

本基金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 2020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	241,404.34
合计	241,404.34

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费	49,726.04
预提信息披露费	59,672.34
预提中债登账户维护费	4,500.00
预提上清所账户维护费	4,500.00
合计	118,398.38

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长城工资宝货币 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,146,634.56	75,146,634.56
本期申购	102,555,239.36	102,555,239.36
本期赎回(以“-”号填列)	-123,142,894.49	-123,142,894.49
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	54,558,979.43	54,558,979.43

金额单位：人民币元

长城工资宝货币 B		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,993,887,693.90	4,993,887,693.90
本期申购	41,452,380,980.46	41,452,380,980.46
本期赎回(以“-”号填列)	-35,285,686,475.12	-35,285,686,475.12
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	11,160,582,199.24	11,160,582,199.24

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 级基金份额和 B 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 万份自动进行升降级的判断和处理。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长城工资宝货币 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	612,849.37	-	612,849.37
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	-612,849.37	-	-612,849.37
本期末	-	-	-

单位：人民币元

长城工资宝货币 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	106,855,678.34	-	106,855,678.34
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	-106,855,678.34	-	-106,855,678.34
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。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,184.36
定期存款利息收入	5,450,347.23

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	5,464,531.59

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期未发生股票投资收益/损失。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,124,484,092.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,082,669,501.74
减：应收利息总额	39,535,262.39
买卖债券差价收入	2,279,328.05

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金于本期无资产支持证券投资收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

本基金于本期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金于本期无公允价值变动收益/损失。

6.4.7.18 其他收入

本基金于本期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	694.25
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	694.25

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
上清所结算账户维护费	9,000.00
银行间结算账户维护费	9,000.00
银行划付手续费	8,072.01
其他	600.00
合计	136,070.39

注：其他为上清所查询服务费 600.00 元。

6.4.7.21 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
中信银行	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构

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

本基金本期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
长城证券	50,007,095.89	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
长城证券	3,087,500,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均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

本基金本期及上年度可比期间未产生应支付关联方的佣金。

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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,694,906.66	6,684,842.23
其中：支付销售机构的客户维护费	1,411,673.40	1,364,456.04

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,062,370.16	2,139,149.55

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.08%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% / \text{当年天数}$$

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

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 2020年1月1日至2020年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城工资宝货币 A	长城工资宝货币 B	合计
中信银行	6,567.86	-	6,567.86
长城基金	3,574.19	395,781.42	399,355.61
长城证券	17.71	-	17.71
合计	10,159.76	395,781.42	405,941.18
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城工资宝货币 A	长城工资宝货币 B	合计
	中信银行	6,779.53	-
长城基金	2,422.57	170,085.00	172,507.57
长城证券	84.76	-	84.76
合计	9,286.86	170,085.00	179,371.86

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率均为 0.20%，B 类基金份额的年销售服务费率均为 0.01%，基金份额升级与降级的具体的计算方法在招募说明书中列示。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

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

本基金于本期及上年度可比期间，均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

长城工资宝货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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
东方证券股份 有限公司	100,038,417.21	0.8920%	-	-
中原信托有 限公司	100,000,000.00	0.8917%	-	-
北方国际信 托股份有限 公司	400,000,000.00	3.5666%	-	-
长城嘉信资 产管理有限 公司	100,000,000.00	0.8917%	-	-

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东方证券股份有限公司于 2020 年 6 月 23 日申购本基金 B 类份额 100,000,000.00 份，本基金管理人长城基金管理有限公司控股股东中原信托有限公司于 2020 年 6 月 30 日申购本基金 B 类份额 100,000,000.00 份，本基金管理人长城基金管理有限公司控股股东北方国际信托股份有限公司于 2020 年 6 月 30 日申购本基金 B 类份额 400,000,000.00 份，本基金管理人长城基金管理有限公司控股子公司长城嘉信资产管理有限公司于 2020 年 6 月 30 日申购本基金 B 类份额 100,000,000.00 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，东方证券股份有限公司持有本基金 B 类份额 100,038,417.21 份（含结转收益 38,417.21 份），中原信托有限公司持有本基金 B 类份额 100,000,000.00 份，北方国际信托股份有限公司持有本基金 B 类份额 400,000,000.00 份，长城嘉信资产管理有限公司持有本基金 B 类份额 100,000,000.00 份。

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		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 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
中信银行	563,742.73	14,184.36	369,633.05	1,502.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行活期利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均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

长城工资宝货币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
612,849.37	-	-	612,849.37	-

长城工资宝货币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
106,855,678.34	-	-	106,855,678.34	-

6.4.12 期末（2020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**

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

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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 2020 年 6 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人民币 547,399,166.30 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
209926	20 贴现国债 26	2020 年 7 月 1 日	99.67	1,300,000	129,571,000.00
209925	20 贴现国债 25	2020 年 7 月 1 日	99.77	800,000	79,816,000.00
170310	17 进出 10	2020 年 7 月 1 日	100.16	1,000,000	100,160,000.00
112009130	20 浦发银行 CD130	2020 年 7 月 1 日	98.96	460,000	45,521,600.00
209923	20 贴现国债 23	2020 年 7 月 1 日	99.82	1,100,000	109,802,000.00
200401	20 农发 01	2020 年 7 月 1 日	100.21	600,000	60,126,000.00
200403	20 农发 03	2020 年 7 月 1 日	100.01	500,000	50,005,000.00

合计				5,760,000	575,001,600.00
----	--	--	--	-----------	----------------

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押债券。

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、监察稽核部和风险管理部，以及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

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，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债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的投资范围为：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。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 2020 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	563,742.73	500,000,000.00	-	-	-	-	500,563,742.73
交易性金融资产	2,686,822,414.00	3,948,944,292.34	1,433,626,731.31	-	-	-	8,069,393,437.65
买入返售金融资产	3,150,638,878.28	28,500,000.00	-	-	-	-	3,179,138,878.28
应收利息	-	-	-	-	-	16,275,748.99	16,275,748.99
应收申购款	-	-	-	-	-	170,245.16	170,245.16
资产总计	5,838,025,035.01	4,477,444,292.34	1,433,626,731.31	-	-	16,445,994.15	11,765,542,052.81
负债							
卖出回购金融资产款	547,399,166.30	-	-	-	-	-	547,399,166.30
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,246.56	10,246.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,888,908.01	1,888,908.01
应付托管费	-	-	-	-	-	604,450.57	604,450.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	83,467.58	83,467.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	241,404.34	241,404.34
应付利息	-	-	-	-	-	35,522.46	35,522.46
应交税费	-	-	-	-	-	19,309.94	19,309.94
其他负债	-	-	-	-	-	118,398.38	118,398.38
负债总计	547,399,166.30	-	-	-	-	3,001,707.84	550,400,874.14
利率敏感度缺口	5,290,625,868.71	4,477,444,292.34	1,433,626,731.31	-	-	-	-
上年度末 2019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	637,013.20	-	-	-	-	-	637,013.20
交易性金融资产	1,378,258,295.78	2,760,378,978.77	138,533,679.17	-	-	-	4,277,170,953.72
买入返售金融资产	1,222,395,673.59	-	-	-	-	-	1,222,395,673.59
应收利息	-	-	-	-	-	11,623,050.69	11,623,050.69
应收申购款	-	-	-	-	-	252,201,530.26	252,201,530.26
资产总计	2,601,290,982.57	2,760,378,978.77	138,533,679.17	-	-	263,824,580.95	5,764,028,221.46
负债							
卖出回购金融资产款	692,048,401.92	-	-	-	-	-	692,048,401.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,808,261.33	1,808,261.33
应付托管费	-	-	-	-	-	578,643.64	578,643.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	84,756.24	84,756.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	192,486.80	192,486.80
应付利息	-	-	-	-	-	68,817.26	68,817.26
应交税费	-	-	-	-	-	3,525.81	3,525.81
其他负债	-	-	-	-	-	209,000.00	209,000.00
负债总计	692,048,401.92	-	-	-	-	2,945,491.08	694,993,893.00

利率敏感度缺口	1,909,242,580.65	2,760,378,978.77	138,533,679.17	-	-		
---------	------------------	------------------	----------------	---	---	--	--

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（2020年6月30 日）	上年度末（2019年12月31 日）
	利率上升 25 个基点	-3,956,170.51	-1,312,043.05
	利率下降 25 个基点	3,962,216.19	1,313,211.79

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	8,069,393,437.65	68.58
	其中:债券	8,069,393,437.65	68.58
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,179,138,878.28	27.02
	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	500,563,742.73	4.25
4	其他各项资产	16,445,994.15	0.14
5	合计	11,765,542,052.81	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	11.01	
	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	547,399,166.30	4.88
	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

本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

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	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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	47.60	4.88
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	19.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	12.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	13.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	11.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.76	4.88

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

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	319,186,228.12	2.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	300,672,489.26	2.68
	其中：政策性金融债	300,672,489.26	2.68
4	企业债券	50,006,959.80	0.45
5	企业短期融资券	2,820,150,135.99	25.15
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,579,377,624.48	40.83
8	其他	-	-
9	合计	8,069,393,437.65	71.95
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	112013041	20 浙商银行 CD041	12,000,000	1,193,587,934.97	10.64
2	112016153	20 上海银行 CD153	10,000,000	998,240,965.41	8.90
3	072000114	20 中信证券 CP009	3,000,000	300,001,220.40	2.67
4	112095580	20 昆仑银行 CD049	3,000,000	298,612,890.97	2.66
5	112095577	20 广州农村商业银行 CD050	3,000,000	296,747,571.10	2.65
6	112009130	20 浦发银行 CD130	2,500,000	247,403,165.00	2.21
7	072000159	20 广发证券 CP007BC	2,000,000	200,002,778.82	1.78
8	072000115	20 光大证券 CP006BC	2,000,000	200,001,180.07	1.78
9	072000118	20 招商 CP009BC	2,000,000	200,001,167.16	1.78
10	072000087	20 渤海证券 CP004	2,000,000	200,000,292.68	1.78

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	0.1032%
报告期内偏离度的最低值	-0.0372%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0406%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期本基金投资的前十名证券除光大证券、浙商银行发行主体外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据上海证券交易所公布的纪律处分决定书：

光大证券股份有限公司（简称光大证券）因信息披露等相关违规情形，于 2020 年 06 月 04 日被上海证券交易所予以公开谴责。

根据中国人民银行杭州中心支行公布的行政处罚信息公开表：

浙商银行股份有限公司（简称浙商银行）因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料及交易记录、未按规定进行可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等案由，于 2019 年 12 月 31 日被中国人民银行杭州中心支行处以罚款。

本基金管理小组分析认为，相关违规事项已经调查完毕，行政处罚决定也已经开出。考虑到此次处罚金额相对上一年的经营利润占比较小，对于公司的未来财务并无重大影响。该行政处罚措施不影响公司的长期信用基本面，主体信用和债项信用资质均良好。本基金经理依据基金合同和本公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对 20 光大证券 CP006BC、20 浙商银行 CD041 进行了投资。

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	16,275,748.99
4	应收申购款	170,245.16
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	16,445,994.15

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
长城工资宝货币 A	4,200	12,990.23	12,429,525.61	22.78%	42,129,453.82	77.22%
长城工资宝货币 B	49	227,766,983.66	11,160,582,199.24	100.00%	-	-
合计	4,249	2,639,477.80	11,173,011,724.85	99.62%	42,129,453.82	0.38%

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。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	1,000,481,480.16	8.92%
2	其他机构	800,000,000.00	7.13%
3	信托类机构	770,770,000.00	6.87%
4	券商类机构	705,214,414.09	6.29%
5	银行类机构	704,576,740.52	6.28%
6	其他机构	637,888,258.40	5.69%
7	银行类机构	502,070,624.57	4.48%
8	银行类机构	500,000,000.00	4.46%

9	券商类机构	500,000,000.00	4.46%
10	保险类机构	500,000,000.00	4.46%

8.3 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持有本基金	长城工资宝货币 A	3,887.59	0.0071%
	长城工资宝货币 B	-	-
	合计	3,887.59	0.0000%

注：1、上述基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

2、上表中合计持有份额总数占基金总份额比例实际为 0.00003%。

8.4 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	长城工资宝货币 A	0
	长城工资宝货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长城工资宝货币 A	0
	长城工资宝货币 B	0
	合计	0

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

	长城工资宝货币 A	长城工资宝货币 B
基金合同生效日（2014 年 6 月 25 日）基金份额总额	211,516,888.02	-
本报告期期初基金份额总额	75,146,634.56	4,993,887,693.90
本报告期基金总申购份额	102,555,239.36	41,452,380,980.46
减：本报告期基金总赎回份额	123,142,894.49	35,285,686,475.12
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	54,558,979.43	11,160,582,199.24

§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

自 2020 年 6 月 19 日起，熊科金先生不再担任长城基金管理有限公司总经理，由董事长王军先生代为履职。

自 2020 年 6 月 19 日起，彭洪波先生不再担任长城基金管理有限公司副总经理。

自 2020 年 6 月 19 日起，熊科金先生、金树良先生、杨玉成先生、杨超先生不再担任公司董事，由张文栋先生、朱静女士、韩飞先生担任公司董事。

自 2020 年 6 月 19 日起，鄢维民先生不再担任公司独立董事。

自 2020 年 7 月 14 日起，邱春杨先生担任长城基金管理有限公司总经理，董事长王军先生不再代任。

自 2020 年 7 月 14 日起，邱春杨先生担任公司董事。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止本报告期末共计 2 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序

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
要，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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	50,007,095.89	100.00%	3,087,500,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

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	长城工资宝货币基金 2020 年春	证券时报及本基金管理人网	2020 年 1 月 17

	节假日前暂停申购和转换转入业务的公告	站	日
2	长城基金关于旗下基金 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放时间等相关安排调整的公告	本基金管理人网站	2020 年 1 月 31 日
3	关于长城工资宝货币基金暂停大额申购、转换转入和定投业务的公告	证券时报及本基金管理人网站	2020 年 3 月 21 日
4	长城基金管理有限公司关于延期披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报及本基金管理人网站	2020 年 3 月 26 日
5	关于长城工资宝货币基金调整大额申购、转换转入和定投业务限额的公告	证券时报及本基金管理人网站	2020 年 4 月 9 日
6	长城工资宝货币基金 2020 年劳动节假期前暂停申购和转换转入业务的公告	证券时报及本基金管理人网站	2020 年 4 月 24 日
7	长城基金管理有限公司关于取消纸质对账单的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2020 年 5 月 27 日
8	长城工资宝货币基金 2020 年端午节假期前暂停申购和转换转入业务的公告	证券时报及本基金管理人网站	2020 年 6 月 18 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

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

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) 中国证监会核准长城工资宝货币市场基金募集的文件
- (二) 《长城工资宝货币市场基金基金合同》
- (三) 《长城工资宝货币市场基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (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

网站：www.ccfund.com.cn