

长城货币市场证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 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 2023 年 03 月 29 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。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 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 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 12 |
| §4 管理人报告 | 13 |
| 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遵规守信情况的说明..... | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 16 |
| 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..... | 17 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 17 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 18 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 19 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 19 |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明..... | 19 |
| 4.10 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..... | 19 |
| §5 托管人报告 | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 19 |
| 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..... | 20 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 20 |
| §6 审计报告 | 20 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 20 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 20 |
| §7 年度财务报表 | 22 |
| 7.1 资产负债表..... | 22 |
| 7.2 利润表..... | 23 |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表..... | 25 |
| 7.4 报表附注..... | 28 |

| | |
|---|-----------|
| §8 投资组合报告 | 57 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 57 |
| 8.2 债券回购融资情况..... | 58 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 58 |
| 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 | 59 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 59 |
| 8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 59 |
| 8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 | 60 |
| 8.8 期末按实际利率计算账面价值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..... | 60 |
| 8.9 投资组合报告附注..... | 60 |
| §9 基金份额持有人信息 | 62 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 62 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 62 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 62 |
| 9.4 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情况 | 63 |
| 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情 况..... | 63 |
| §10 开放式基金份额变动 | 63 |
| §11 重大事件揭示 | 64 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 64 |
| 11.2 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 | 64 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 64 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 64 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 64 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 64 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 64 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 65 |
| 11.9 其他重大事件..... | 65 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 66 |
| 12.1 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 | 66 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 66 |
| §13 备查文件目录 | 67 |
| 13.1 备查文件目录..... | 67 |
| 13.2 存放地点..... | 67 |
| 13.3 查阅方式..... | 67 |

§ 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 | 72,683,333,374.76 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 | 69,879,218,011.54 份 | 157,078,246.72 份 | 2,647,037,116.50 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 |
| | 联系电话 | 0755-29279005 |
| | 电子邮箱 | chejun@ccfund.com.cn |
| 客户服务电话 | 400-8868-666 | 95577 |
| 传真 | 0755-29279000 | 010-85238680 |
| 注册地址 | 深圳市福田区莲花街道福新社区 鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 | 北京市东城区建国门内大街 22 号（100005） |

| | | |
|-------|--|----------------------------|
| | DEF 单元、38 层、39 层 | |
| 办公地址 | 深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层 | 北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005) |
| 邮政编码 | 518046 | 100005 |
| 法定代表人 | 王军 | 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 | 上海证券报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ccfund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|--|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）17 层 |
| 注册登记机构 | 长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1 1.1 期间 数据 和 指 标 | 2022 年 | | | 2021 年 | | | 2020 年 | | |
|---------------------------------------|------------------|--------------|---------------|------------------|---------------|---------------|------------------|---------------|---------------|
| | 长城货币 A | 长城货币 B | 长城货币 E | 长城货币 A | 长城货币 B | 长城货币 E | 长城货币 A | 长城货币 B | 长城货币 E |
| 本期已实现收益 | 1,209,316,056.02 | 5,873,319.37 | 55,951,037.56 | 1,437,087,008.15 | 19,506,895.09 | 57,955,902.70 | 1,186,855,053.14 | 26,821,687.80 | 42,240,646.86 |
| 本期利润 | 1,209,316,056.02 | 5,873,319.37 | 55,951,037.56 | 1,437,087,008.15 | 19,506,895.09 | 57,955,902.70 | 1,186,855,053.14 | 26,821,687.80 | 42,240,646.86 |
| 本期 | 1.7489% | 1.9933% | 1.9016% | 2.1924% | 2.4377% | 2.3456% | 2.0637% | 2.3089% | 2.2170% |

| | | | | | | | | | |
|--|-------------------|----------------|------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|----------------|------------------|
| 净值 收 益 率 | | | | | | | | | |
| 3.1 .2 期 末 数 据 和 指 标 | 2022 年末 | | | 2021 年末 | | | 2020 年末 | | |
| 期 末 基 金 资 产 净 值 | 69,879,218,011.54 | 157,078,246.72 | 2,647,037,116.50 | 70,932,408,805.67 | 265,737,037.05 | 2,057,402,410.86 | 57,298,000,467.86 | 778,803,808.24 | 1,917,054,477.36 |
| 期 末 基 金 份 额 净 值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1 .3 累 计 期 末 指 标 | 2022 年末 | | | 2021 年末 | | | 2020 年末 | | |
| 累 计 净 值 收 益 率 | 66.5007% | 43.0342% | 24.3931% | 63.6388% | 40.2387% | 22.0717% | 60.1282% | 36.9014% | 19.2740% |

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，由于本基金采用实际利率法计算账面价值并用影子定价和偏离度加以控制的模式核算，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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.3798% | 0.0003% | 0.0882% | 0.0000% | 0.2916% | 0.0003% |
| 过去六个月 | 0.7768% | 0.0003% | 0.1764% | 0.0000% | 0.6004% | 0.0003% |
| 过去一年 | 1.7489% | 0.0007% | 0.3500% | 0.0000% | 1.3989% | 0.0007% |
| 过去三年 | 6.1254% | 0.0010% | 1.0510% | 0.0000% | 5.0744% | 0.0010% |
| 过去五年 | 12.6017% | 0.0019% | 1.7510% | 0.0000% | 10.8507% | 0.0019% |
| 自基金合同生效起至今 | 66.5007% | 0.0056% | 23.3678% | 0.0035% | 43.1329% | 0.0021% |

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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.4405% | 0.0003% | 0.0882% | 0.0000% | 0.3523% | 0.0003% |

| | | | | | | |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| | | | | | % | % |
| 过去六个月 | 0.8988% | 0.0003% | 0.1764% | 0.0000% | 0.7224% | 0.0003% |
| 过去一年 | 1.9933% | 0.0007% | 0.3500% | 0.0000% | 1.6433% | 0.0007% |
| 过去三年 | 6.8920% | 0.0010% | 1.0510% | 0.0000% | 5.8410% | 0.0010% |
| 过去五年 | 13.9590% | 0.0019% | 1.7510% | 0.0000% | 12.2080% | 0.0019% |
| 自基金合同生效起至今 | 43.0342% | 0.0043% | 3.7864% | 0.0001% | 39.2478% | 0.0042% |

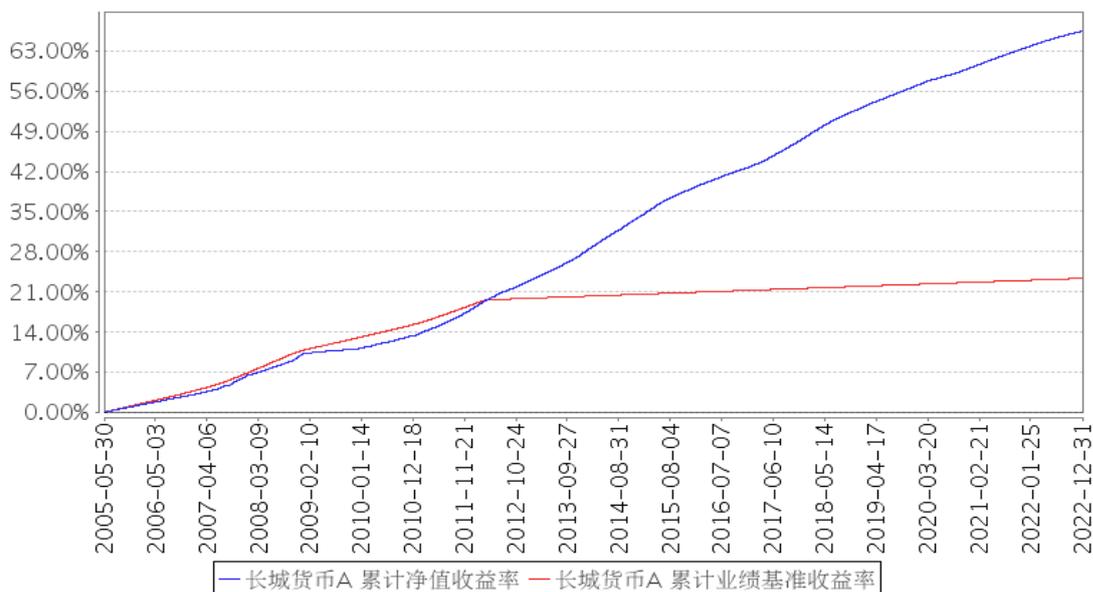
长城货币 E

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.4177% | 0.0003% | 0.0882% | 0.0000% | 0.3295% | 0.0003% |
| 过去六个月 | 0.8531% | 0.0003% | 0.1764% | 0.0000% | 0.6767% | 0.0003% |
| 过去一年 | 1.9016% | 0.0007% | 0.3500% | 0.0000% | 1.5516% | 0.0007% |
| 过去三年 | 6.6040% | 0.0010% | 1.0510% | 0.0000% | 5.5530% | 0.0010% |
| 过去五年 | 13.4476% | 0.0019% | 1.7510% | 0.0000% | 11.6966% | 0.0019% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.3931% | 0.0027% | 2.7156% | 0.0000% | 21.6775% | 0.0027% |

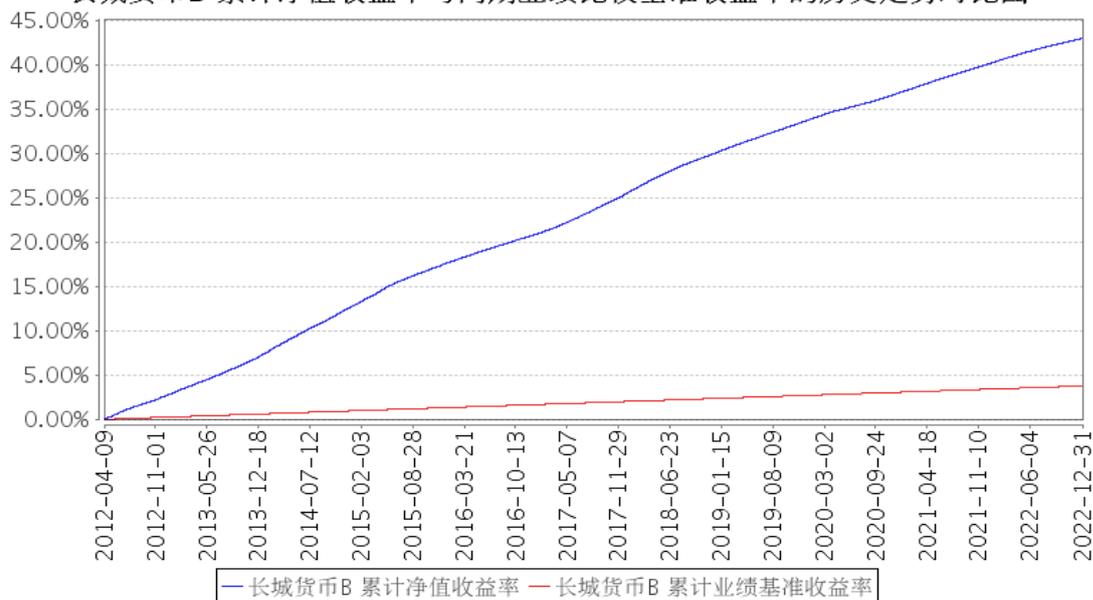
注：本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

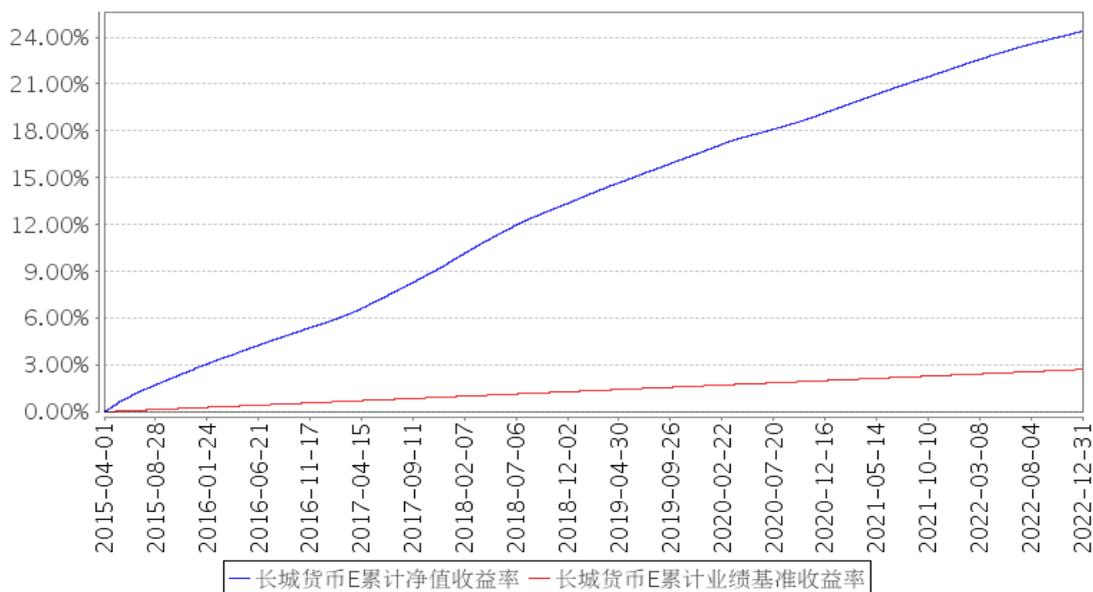
长城货币A 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长城货币B 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



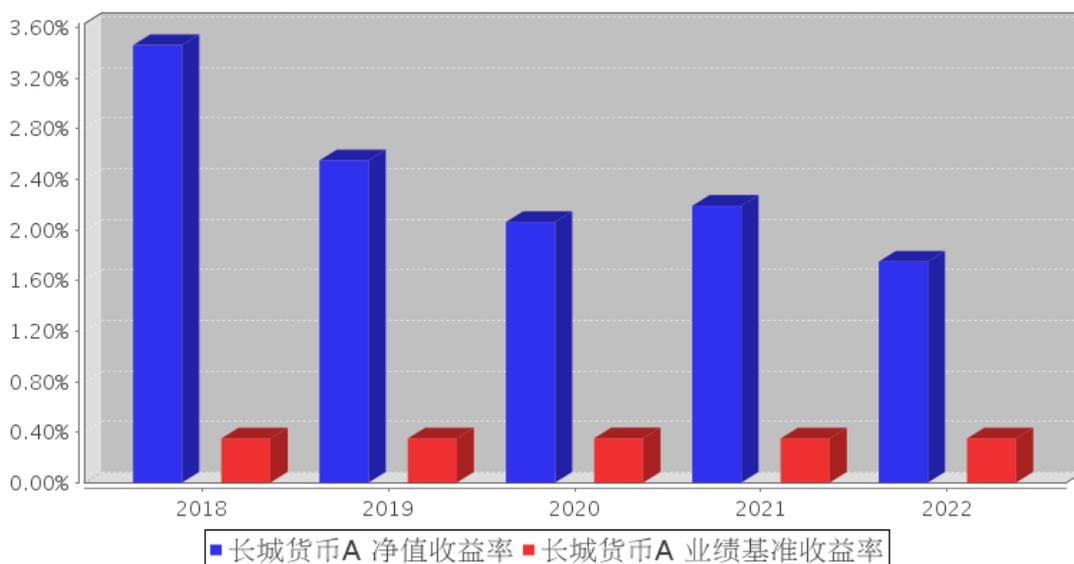
长城货币E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



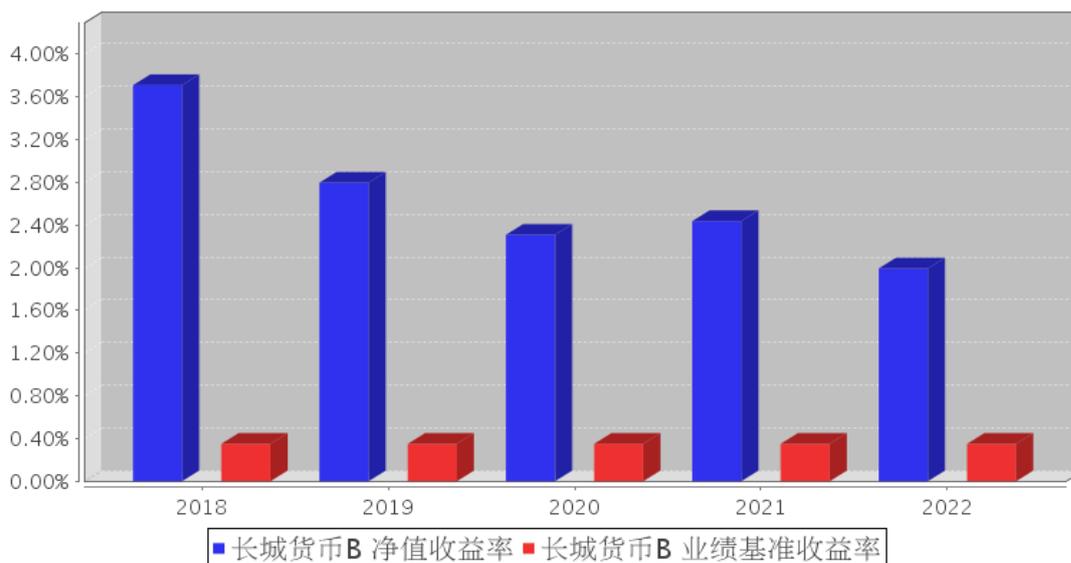
注：本基金合同规定本基金的组合配置比例范围为：央行票据：0—80%，回购 0—70%，短期债券 0—80%，同业存款/现金比例 0—70%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 3 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

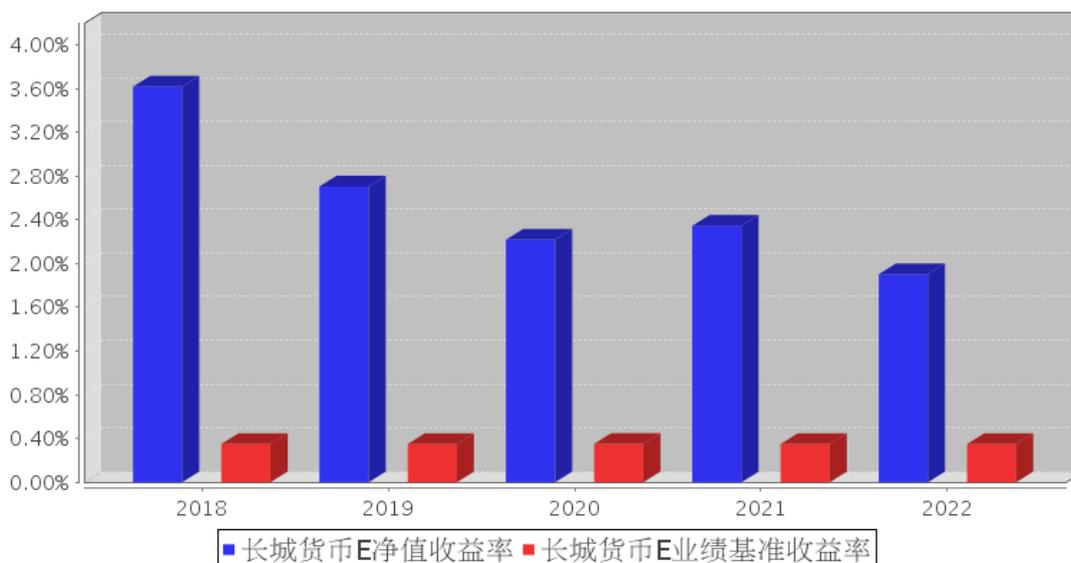
长城货币A 基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长城货币B 基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长城货币E基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长城货币 A

| 年度 | 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 | 年度利润 分配合计 | 备注 |
|--------|----------------------|-------------------|--------------|----------------------|----|
| 2022 年 | 1,209,316,056. 02 | - | - | 1,209,316,056. 02 | - |
| 2021 年 | 1,437,087,008. 15 | - | - | 1,437,087,008. 15 | - |
| 2020 年 | 1,186,855,053. 14 | - | - | 1,186,855,053. 14 | - |

| | | | | | |
|----|------------------|---|---|------------------|---|
| 合计 | 3,833,258,117.31 | - | - | 3,833,258,117.31 | - |
|----|------------------|---|---|------------------|---|

长城货币 B

| 年度 | 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 | 年度利润 分配合计 | 备注 |
|--------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 2022 年 | 5,873,319.37 | - | - | 5,873,319.37 | - |
| 2021 年 | 19,506,895.09 | - | - | 19,506,895.09 | - |
| 2020 年 | 26,821,687.80 | - | - | 26,821,687.80 | - |
| 合计 | 52,201,902.26 | - | - | 52,201,902.26 | - |

长城货币 E

| 年度 | 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 | 年度利润 分配合计 | 备注 |
|--------|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 2022 年 | 55,951,037.56 | - | - | 55,951,037.56 | - |
| 2021 年 | 57,955,902.70 | - | - | 57,955,902.70 | - |
| 2020 年 | 42,240,646.86 | - | - | 42,240,646.86 | - |
| 合计 | 156,147,587.12 | - | - | 156,147,587.12 | - |

§ 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，公司管理的基金有：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、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、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、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城悦享增利债券型证券投资基金、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、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、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（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城新能源股票型发起式证券投资基金、长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金、长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金、长城中证医药

卫生指数增强型证券投资基金、长城瑞利纯债债券型证券投资基金、长城产业成长混合型证券投资基金、长城鑫享 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业趋势混合型证券投资基金、长城远见成长混合型证券投资基金、长城聚利纯债债券型证券投资基金、长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长城永利债券型证券投资基金。

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 | 固定收益投资部总经理、本基金的基金经理 | 2011 年 10 月 19 日 | - | 13 年 | 男，中国籍，硕士。2005 年 7 月-2009 年 3 月曾就职于深圳农村商业银行总行资金部，具有 15 年债券投资管理经历。2009 年 3 月加入长城基金管理有限公司，历任运行保障部债券交易员、固定收益部研究员、固定收益部副总经理，现任固定收益投资部总经理兼基金经理。自 2011 年 10 月至今任“长城货币市场证券投资基金”基金经理，自 2014 年 6 月至今任“长城工资宝货币市场基金”基金经理，自 2017 年 9 月至今任“长城收益宝货币市场基金”基金经理，自 2019 年 8 月至今任“长城短债债券型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 8 月至今任“长城鑫享 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 11 月至今任“长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金”基金经理。 |

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从业人员的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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》、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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 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相关法律法规和公司制度的规定，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，并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

报告期内，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，同一组合经理管理的多个投资组合的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同一组合经理管理的多个投资组合的同日反向交易，对同向交易的价差进行强化的监测和事后分析，对不同时间窗的（同日、3日内、5日内、7日内、9日内、11日内、13日内）同向交易和临近交易日的反向交易价差进行监控分析，并结成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下同一组合经理管理的多个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。

4.3.3 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

国际方面：世界百年未有之大变局加速演进。美欧多年量化宽松货币政策和贸易战导致通胀恶果显现，俄乌战争爆发并长期化，进一步助推国际高通胀，能源危机和粮食危机蔓延。美欧连续加息趋势尚未结束，美国国债收益率和美元见顶，经济面临衰退风险。高通胀海外影响剧烈，美欧股债暴跌，但对国内金融市场并未造成巨大的影响，除了强势美元背景下人民币贬值并见顶落回。全球资本大量回流美国，美元再次收割全世界。

国内方面：2022 年，我国坚持人民利益至上，房住不炒和动态清零。消费较为疲弱，线下经济低迷，民企地产大面积项目烂尾和债券违约，宏观经济高开低走，GDP 增速预期从 5%一步步下调为 3%附近。党的二十大提出以中国式现代化全面推进中华民族伟大复兴，凝聚共识，指明方向。动态优化政策，经济复苏有望。

国内货币政策方面：降息操作上，2022 年以来，央行分别在 1 月和 8 月两次将 MLF 和公开市场逆回购的中标利率均下降 10 个基点；LPR 报价于 1 月、5 月和 8 月进行了三次调降，5 年期以上 LPR 累计下调 35 个基点。同时，5 月央行和银保监会调整差别化住房信贷政策，将首套住房商业性个人住房贷款利率下限调整为不低于相应期限贷款市场报价利率（LPR）减 20 个基点。降准方面，央行于 2022 年 4 月下调金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，12 月再次降低金融机构存款准备金率 0.25 个百分点。全年总体流动性宽松，但由于需求疲弱，宽信用效果不理想。

回顾我们全年的操作，我们安全地应对了春节与季末的流动性大幅冲击，上半年加大对回购资产和同业存款配置，下半年则加大了对银行存单和债券的配置力度。总体上把握住了债券牛市行情的机会，规避了年末债市急跌的风险，合理调节组合久期水平，为持有人取得了稳健的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城货币 A 基金份额净值收益率为 1.7489%；长城货币 B 基金份额净值收益率为 1.9933%；长城货币 E 基金份额净值收益率为 1.9016%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

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 2023 年，中央经济工作会在安排 2023 年的经济工作时，把“扩大内需”排到第一位，给予“稳增长”最高优先级，这意味着 2023 年会有更大规模刺激复苏的政策。从政策紧迫与数据反馈来看，“扩内需、稳增长”将会是 2023 年中国经济关键词。经济谷底已现，对于 2023 年的债券市场来说，并非完全利好。首先，去年经济数据越差，意味着 2023 年基数越低，经济复苏时

数据的增长表现越喜人；其次，此时的谷底已经反映在债券价格当中，所以定价权来自于边际变化，11-12月债市承受的打击来自于政策放松、银行理财赎回，2023年债市将真正的面临经济基本面改善带来的冲击。

总体上，考虑到流动性相对充裕和估值价值，债券利率更可能先下后上，货币基金和短债基金持续具备投资价值和风险规避能力。具体投资上要坚持银行、国企、城投等三大信仰，坚守信用安全的底线，尤其规避民营地产风险和网红区域。我们认为，组合投资策略，永远第一是规避亏损，第二才是赚多赚少问题。坚守信用底线可以规避本金风险，抓住波段机会可以多赚一点，选准趋势方向方能长期卓越。我们将根据经济基本面及市场流动性的变化，适时优化组合配置，努力为基金持有人取得稳健的投资回报。我们应为持有人提供好流动性管理的便利，并始终坚持风险与收益的权衡，启蒙和培养千家万户的科学投资理财观。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监察关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“规范、专业、高效、拼搏”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

4.7 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。

4.8 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 1,271,140,412.95 元，已分配利润人民币 1,271,140,412.95 元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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 2022 年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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 安永华明（2023）审字第 60737541_H04 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 长城货币市场证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了长城货币市场证券投资基金财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表及净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的长城货币市场证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城货币市场证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城货币市场证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 强调事项 | 不适用 |
| 其他事项 | 不适用 |
| 其他信息 | 长城货币市场证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过 |

| | |
|------------------------|---|
| | <p>程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估长城货币市场证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长城货币市场证券投资基金的财务报告过程。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长城货币市场证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城货币市场证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注</p> |

| | | |
|-----------|--------------------|-----|
| | 的内部控制缺陷。 | |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | |
| 注册会计师的姓名 | 吴翠蓉 | 黄雨飞 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 北京 | |
| 审计报告日期 | 2023 年 3 月 29 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 38,146,493,744.52 | 41,000,618,337.44 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 11,803.84 | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 28,332,881,931.39 | 24,881,104,266.20 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 28,332,881,931.39 | 24,881,104,266.20 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 12,964,396,719.44 | 12,645,337,208.00 |
| 债权投资 | 7.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 7.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 7.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 5,615,302.79 | 2,171,322.05 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.8 | - | 381,326,120.36 |
| 资产总计 | | 79,449,399,501.98 | 78,910,557,254.05 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|-------------------|-------------------|
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 6,722,530,511.14 | 5,609,721,981.87 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 23,628.00 | 20,851.10 |
| 应付管理人报酬 | | 20,286,277.64 | 20,887,795.42 |
| 应付托管费 | | 6,147,356.86 | 6,329,634.97 |
| 应付销售服务费 | | 14,902,584.58 | 15,364,559.96 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,391,591.32 | 1,325,547.00 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.9 | 784,177.68 | 1,358,630.15 |
| 负债合计 | | 6,766,066,127.22 | 5,655,009,000.47 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 72,683,333,374.76 | 73,255,548,253.58 |
| 其他综合收益 | 7.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.12 | - | - |
| 净资产合计 | | 72,683,333,374.76 | 73,255,548,253.58 |
| 负债和净资产总计 | | 79,449,399,501.98 | 78,910,557,254.05 |

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 72,683,333,374.76 份，其中长城货币 A 基金份额总额 69,879,218,011.54 份，基金份额净值 1.0000 元；长城货币 B 基金份额总额 157,078,246.72 份，基金份额净值 1.0000 元；长城货币 E 基金份额总额 2,647,037,116.50 份，基金份额净值 1.0000 元。

（2）比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|-----|----------------------------------|----------------------------------|
| | | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
| 一、营业总收入 | | 1,813,297,340.51 | 2,046,339,541.34 |
| 1. 利息收入 | | 1,259,404,972.19 | 2,030,467,017.22 |

| | | | |
|----------------------------|------------|------------------|------------------|
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.13 | 988,058,503.73 | 1,138,899,198.74 |
| 债券利息收入 | | - | 562,158,039.22 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | 46,825,861.72 |
| 买入返售金融资产收入 | | 271,346,468.46 | 282,583,917.54 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 553,846,728.32 | 15,842,564.12 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.15 | 553,846,728.32 | 15,842,564.12 |
| 资产支持证券投资 | 7.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.19 | - | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.20 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.21 | 45,640.00 | 29,960.00 |
| 减：二、营业总支出 | | 542,156,927.56 | 531,789,735.40 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 240,409,064.59 | 230,367,650.22 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 72,851,231.73 | 69,808,378.81 |
| 3. 销售服务费 | | 176,904,667.47 | 168,814,248.15 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 51,439,764.11 | 62,173,472.52 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 51,439,764.11 | 62,173,472.52 |
| 6. 信用减值损失 | 7.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 278,316.55 | 352,414.88 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.23 | 273,883.11 | 273,570.82 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,271,140,412.95 | 1,514,549,805.94 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” | | 1,271,140,412.95 | 1,514,549,805.94 |

| | | | |
|---------------|--|------------------|------------------|
| 号填列) | | | |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,271,140,412.95 | 1,514,549,805.94 |

注：比较数据已根据本年《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〉》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | | |
|----------------------|--|--------|------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 73,255,548,253.58 | - | - | 73,255,548,253.58 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 73,255,548,253.58 | - | - | 73,255,548,253.58 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -572,214,878.82 | - | - | -572,214,878.82 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 1,271,140,412.95 | 1,271,140,412.95 |
| (二)、本期基 | -572,214,878.82 | - | - | -572,214,878.82 |

| | | | | |
|--|----------------------------------|--------|-------------------|---------------------|
| 金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 748,213,884,017.22 | - | - | 748,213,884,017.22 |
| 2. 基金赎回款 | -748,786,098,896.04 | - | - | -748,786,098,896.04 |
| （三）、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) | - | - | -1,271,140,412.95 | -1,271,140,412.95 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产(基金净值) | 72,683,333,374.76 | - | - | 72,683,333,374.76 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 59,993,858,753.46 | - | - | 59,993,858,753.46 |

| | | | | |
|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------|-----------------------|
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期末期初净资产(基金净值) | 59,993,858,753.46 | - | - | 59,993,858,753.46 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 13,261,689,500.12 | - | - | 13,261,689,500.12 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 1,514,549,805.94 | 1,514,549,805.94 |
| (二)、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) | 13,261,689,500.12 | - | - | 13,261,689,500.12 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,108,452,407,422.85 | - | - | 1,108,452,407,422.85 |
| 2.基金赎回款 | -1,095,190,717,922.73 | - | - | -1,095,190,717,922.73 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值 | - | - | -1,514,549,805.94 | -1,514,549,805.94 |

| | | | | |
|------------------|-------------------|---|---|-------------------|
| 变动(净值减少以“-”号填列) | | | | |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产(基金净值) | 73,255,548,253.58 | - | - | 73,255,548,253.58 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王军

基金管理人负责人

邱春杨

主管会计工作负责人

赵永强

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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(以下简称“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。

7.4.2 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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 2 号《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〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

(2) 金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评

估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最底层输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的可相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当按实际利率法计算确定的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) “每日分配、按月支付”。本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。投资者当日收益的精度为 0.01 元，第三位采用去尾的方式，因去尾形成的余额进行再次分配；

(2) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，为投资者不记收益；

(3) 本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，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，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则将缩减投资者基金份额。若投资者全部赎回基金份额时，其收益将立即结清，若收益为负值，则将从投资者赎回基金款中扣除；

(4) T 日申购的基金份额不享有当日分红权益，赎回的基金份额仍享有当日分红权益；

(5) 本基金收益每月中旬集中支付一次，成立不满一个月不支付。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(6) 在不影响投资者利益情况下，若基金管理人和基金托管人协商一致，并报有关监管机构批准后，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的

经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会〔2022〕14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 41,000,618,337.44 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 236,206,272.01 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 41,236,824,609.45 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,645,337,208.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 23,262,851.98 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,668,600,059.98 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 381,326,120.36 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 236,206,272.01 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 121,856,996.37 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 23,262,851.98 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 24,881,104,266.20 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 121,856,996.37 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 25,002,961,262.57 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,609,721,981.87 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 577,651.94 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,610,299,633.81 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 577,651.94 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 577,651.94 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 增值税

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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

7.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业

费附加的单位外) 及地方教育费附加。

7.4.6.3 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, 继续免征企业所得税。

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。

7.4.6.4 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 1,584,355.69 | 618,337.44 |
| 等于: 本金 | 1,584,212.50 | 618,337.44 |
| 加: 应计利息 | 143.19 | - |
| 减: 坏账准备 | - | - |
| 定期存款 | 38,144,909,388.83 | 41,000,000,000.00 |
| 等于: 本金 | 37,900,000,000.00 | 41,000,000,000.00 |
| 加: 应计利息 | 244,909,388.83 | - |
| 减: 坏账准备 | - | - |
| 其中: 存款期限1个月以内 | - | - |
| 存款期限1-3个月 | 2,000,566,666.68 | 3,000,000,000.00 |
| 存款期限3个月以上 | 36,144,342,722.15 | 38,000,000,000.00 |
| 其他存款 | - | - |
| 等于: 本金 | - | - |
| 加: 应计利息 | - | - |
| 减: 坏账准备 | - | - |
| 合计 | 38,146,493,744.52 | 41,000,618,337.44 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | | | |
|----|--------------------|------|------|-----|
| | 按实际利率计算的账 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 |
| | | | | |

| | | 面价值 | | (%) | |
|--------|-------|---------------------|-------------------|---------------|---------|
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 28,332,881,931.39 | 28,322,985,169.30 | -9,896,762.09 | -0.0136 |
| | 合计 | 28,332,881,931.39 | 28,322,985,169.30 | -9,896,762.09 | -0.0136 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 28,332,881,931.39 | 28,322,985,169.30 | -9,896,762.09 | -0.0136 |
| 项目 | | 上年度末 2021年12月31日 | | | |
| | | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 24,881,104,266.20 | 24,902,810,300.00 | 21,706,033.80 | 0.0296 |
| | 合计 | 24,881,104,266.20 | 24,902,810,300.00 | 21,706,033.80 | 0.0296 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 24,881,104,266.20 | 24,902,810,300.00 | 21,706,033.80 | 0.0296 |

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2022年12月31日 | |
|-------|---------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 12,964,396,719.44 | - |
| 合计 | 12,964,396,719.44 | - |
| 项目 | 上年度末 2021年12月31日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 12,645,337,208.00 | - |

| | | |
|----|-------------------|---|
| 合计 | 12,645,337,208.00 | - |
|----|-------------------|---|

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

| |
|----|
| 无。 |
|----|

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 应收利息 | - | 381,326,120.36 |
| 其他应收款 | - | - |
| 待摊费用 | - | - |
| 合计 | - | 381,326,120.36 |

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31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 | - | - |
| 应付交易费用 | 535,017.68 | 531,818.21 |
| 其中：交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 535,017.68 | 531,818.21 |
| 应付利息 | - | - |
| 预提审计费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 预提信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 预提中债登债券账户维护费 | 4,500.00 | 4,500.00 |
| 预提上清所债券账户维护费 | 4,500.00 | 4,500.00 |
| 应付银行划款手续费 | 160.00 | 160.00 |
| 应计利息 | - | 577,651.94 |
| 合计 | 784,177.68 | 1,358,630.15 |

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城货币 A

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|---------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 70,932,408,805.67 | 70,932,408,805.67 |
| 本期申购 | 703,154,768,099.15 | 703,154,768,099.15 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -704,207,958,893.28 | -704,207,958,893.28 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 69,879,218,011.54 | 69,879,218,011.54 |

长城货币 B

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 265,737,037.05 | 265,737,037.05 |
| 本期申购 | 494,806,682.12 | 494,806,682.12 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -603,465,472.45 | -603,465,472.45 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 157,078,246.72 | 157,078,246.72 |

长城货币 E

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | |
|------|--|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,057,402,410.86 | 2,057,402,410.86 |

| | | |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 本期申购 | 44,564,309,235.95 | 44,564,309,235.95 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -43,974,674,530.31 | -43,974,674,530.31 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 2,647,037,116.50 | 2,647,037,116.50 |

注：本期申购包含红利再投资、分级调整以及基金转入的份额及金额；本期赎回包含分级调整以及基金转出的份额及金额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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 |
|----------------|-------------------|-------|-------------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,209,316,056.02 | - | 1,209,316,056.02 |
| 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 | -1,209,316,056.02 | - | -1,209,316,056.02 |
| 本期末 | - | - | - |

长城货币 B

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 5,873,319.37 | - | 5,873,319.37 |
| 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 | -5,873,319.37 | - | -5,873,319.37 |
| 本期末 | - | - | - |

长城货币 E

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 55,951,037.56 | - | 55,951,037.56 |
| 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 | -55,951,037.56 | - | -55,951,037.56 |
| 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。

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 12,877.59 | 18,001.27 |
| 定期存款利息收入 | 988,044,802.62 | 1,138,881,197.47 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 763.29 | - |
| 其他 | 60.23 | - |
| 合计 | 988,058,503.73 | 1,138,899,198.74 |

7.4.7.14 股票投资收益

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 545,769,287.67 | - |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 8,077,440.65 | 15,842,564.12 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | 553,846,728.32 | 15,842,564.12 |

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
|----|-----------------------------|----------------------------------|

| | | |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 44,886,073,051.36 | 45,576,099,742.53 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 44,604,914,300.63 | 45,339,851,324.14 |
| 减：应计利息总额 | 273,081,310.08 | 220,405,854.27 |
| 减：交易费用 | - | - |
| 买卖债券差价收入 | 8,077,440.65 | 15,842,564.12 |

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年12月 31日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | - | 2,077,458,638.21 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | - | 2,027,000,000.00 |
| 减：应计利息总额 | - | 50,458,638.21 |
| 减：交易费用 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

注：无。

7.4.7.20 公允价值变动收益

注：无。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年12月 31日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - | - |
| 其他 | 45,640.00 | 29,960.00 |
| 合计 | 45,640.00 | 29,960.00 |

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年12 月31日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 账户维护费 | 31,500.00 | 31,500.00 |
| 其他 | - | 1,200.00 |
| 上交所查询费 | 1,200.00 | - |
| 交易费用 | 1,183.11 | 870.82 |
| 合计 | 273,883.11 | 273,570.82 |

7.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 长城基金管理有限公司(“长城基金”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 华夏银行股份有限公司(“华夏银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 东方证券股份有限公司(“东方证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 长城证券股份有限公司(“长城证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 北方国际信托股份有限公司(“北方国际”) | 基金管理人的股东 |
| 中原信托有限公司(“中原信托”) | 基金管理人的股东 |
| 长城嘉信资产管理有限公司(“长城嘉信”) | 基金管理人的控股子公司 |

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 240,409,064.59 | 230,367,650.22 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 119,176,935.27 | 113,395,591.97 |

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 0.33% 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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 72,851,231.73 | 69,808,378.81 |

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 0.10% 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

7.4.10.2.3 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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 |
| | | | | |

| | | | | |
|--------------------|---|-----------|--------------|--------------|
| 长城基金管理有限 公司 | 424,408.77 | 15,441.53 | 532.31 | 440,382.61 |
| 长城证券 | 18,044.92 | 6.85 | 957,265.81 | 975,317.58 |
| 东方证券 | 5,615.52 | 640.24 | - | 6,255.76 |
| 华夏银行 | 25,592.36 | - | 198,934.58 | 224,526.94 |
| 合计 | 473,661.57 | 16,088.62 | 1,156,732.70 | 1,646,482.89 |
| 获得销售服务费的各 关联方名称 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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 |
| 长城基金管理有限 公司 | 647,580.71 | 62,718.22 | 1,849.03 | 712,147.96 |
| 长城证券 | 24,198.18 | - | 769,489.85 | 793,688.03 |
| 东方证券 | 3,569.56 | 148.45 | - | 3,718.01 |
| 华夏银行 | 25,796.74 | - | 245,233.76 | 271,030.50 |
| 合计 | 701,145.19 | 62,866.67 | 1,016,572.64 | 1,780,584.50 |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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均未运用固有资金投资于本基金，于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

7.4.10.4.2 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

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.5 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 2022年1月1日至2022年12月31日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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 | 1,584,355.69 | 12,877.59 | 618,337.44 | 18,001.27 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人华夏银行保管，并按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

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 |
| 1,209,316,056.02 | - | - | 1,209,316,056.02 | - |
| 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 |
| 5,873,319.37 | - | - | 5,873,319.37 | - |
| 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 |
| 55,951,037.56 | - | - | 55,951,037.56 | - |

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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为人民币 6,722,530,511.14 元，是以如下债券作为质押：

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 |
|-----------|---------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 112215220 | 22 民生银行 CD220 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.65 | 1,540,000 | 153,462,024.97 |
| 160404 | 16 农发 04 | 2023 年 1 月 3 日 | 103.29 | 1,936,000 | 199,974,121.02 |
| 200207 | 20 国开 07 | 2023 年 1 月 3 日 | 101.93 | 4,450,000 | 453,588,400.16 |
| 220201 | 22 国开 01 | 2023 年 1 月 3 日 | 102.02 | 3,928,000 | 400,737,861.66 |
| 220206 | 22 国开 06 | 2023 年 1 月 3 日 | 101.06 | 6,500,000 | 656,873,488.65 |
| 220304 | 22 进出 04 | 2023 年 1 月 3 日 | 101.30 | 5,000,000 | 506,500,946.53 |
| 2203694 | 22 进出 694 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.84 | 1,000,000 | 99,841,351.44 |
| 220404 | 22 农发 04 | 2023 年 1 月 3 日 | 100.94 | 600,000 | 60,562,269.35 |
| 229958 | 22 贴现国债 58 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.95 | 6,000,000 | 599,683,177.55 |
| 229966 | 22 贴现国债 66 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.82 | 9,000,000 | 898,338,725.57 |
| 229969 | 22 贴现国债 69 | 2023 年 1 月 3 日 | 99.71 | 5,000,000 | 498,559,456.41 |
| 160404 | 16 农发 04 | 2023 年 1 月 4 日 | 103.29 | 264,000 | 27,269,198.32 |
| 200407 | 20 农发 07 | 2023 年 1 月 4 日 | 101.99 | 5,000,000 | 509,959,903.83 |
| 220201 | 22 国开 01 | 2023 年 1 月 4 日 | 102.02 | 1,172,000 | 119,568,425.12 |
| 229959 | 22 贴现国债 59 | 2023 年 1 月 4 日 | 99.93 | 7,000,000 | 699,541,851.67 |
| 229961 | 22 贴现国债 61 | 2023 年 1 月 4 日 | 99.89 | 7,000,000 | 699,241,311.05 |
| 229970 | 22 贴现国债 70 | 2023 年 1 月 4 日 | 99.66 | 6,000,000 | 597,982,786.31 |
| 合计 | | | | 71,390,000 | 7,181,685,299.61 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 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》、《货币市场基金监督管理办法》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、份额持有人集中度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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。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 7.4.12.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、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，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 202 2 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 | 4,756,257,578.26 | 11,695,503,387.82 | 21,694,732,778.44 | - | - | - | 38,146,493,744.52 |

| | | | | | | |
|----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|---------------|-------------------|
| 款 | | | | | | |
| 存出保证金 | 11,803.84 | - | - | - | - | 11,803.84 |
| 交易性金融资产 | 5,114,664,546.47 | 9,739,129,173.01 | 13,479,088,211.91 | - | - | 28,332,881,931.39 |
| 买入返售金融资产 | 9,622,107,733.84 | 3,342,288,985.60 | - | - | - | 12,964,396,719.44 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 5,615,302.79 | 5,615,302.79 |
| 资产总计 | 19,493,041,662.41 | 24,776,921,546.43 | 35,173,820,990.35 | - | 5,615,302.79 | 79,449,399,501.98 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 23,628.00 | 23,628.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 20,286,277.64 | 20,286,277.64 |
| 应 | - | - | - | - | 6,147,356.86 | 6,147,356.86 |

| | | | | | | |
|-------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------|---------------|------------------|
| 付托管费 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 6,722,530,511.14 | - | - | - | - | 6,722,530,511.14 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 14,902,584.58 | 14,902,584.58 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 1,391,591.32 | 1,391,591.32 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 784,177.68 | 784,177.68 |
| 负债总计 | 6,722,530,511.14 | - | - | - | 43,535,616.08 | 6,766,066,127.22 |
| 利率敏感度缺口 | 12,770,511,151.27 | 24,776,921,546.43 | 35,173,820,990.35 | - | - | - |
| 上年度末 2021 年 | 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 |

| | | | | | | |
|----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|----------------|-------------------|
| 12月31日 | | | | | | |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 5,200,618,337.44 | 10,500,000,000.00 | 25,300,000,000.00 | - | - | 41,000,618,337.44 |
| 交易性金融资产 | 6,678,614,428.14 | 3,312,834,604.77 | 14,889,655,233.29 | - | - | 24,881,104,266.20 |
| 买入返售金融资产 | 11,377,159,065.74 | 1,268,178,142.26 | - | - | - | 12,645,337,208.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 2,171,322.05 | 2,171,322.05 |
| 其他资产 | - | - | - | - | 381,326,120.36 | 381,326,120.36 |
| 资产总计 | 23,256,391,831.32 | 15,081,012,747.03 | 40,189,655,233.29 | - | 383,497,442.41 | 78,910,557,254.05 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 20,851.10 | 20,851.10 |

| | | | | | | |
|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|---------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 20,887,795.42 | 20,887,795.42 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 6,329,634.97 | 6,329,634.97 |
| 卖出回购金融资产款 | 5,609,721,981.87 | - | - | - | - | 5,609,721,981.87 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 15,364,559.96 | 15,364,559.96 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 1,325,547.00 | 1,325,547.00 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 1,358,630.15 | 1,358,630.15 |
| 负债总计 | 5,609,721,981.87 | - | - | - | 45,287,018.60 | 5,655,009,000.47 |
| 利率敏感度 | 17,646,669,849.45 | 15,081,012,747.03 | 40,189,655,233.29 | - | - | - |

| | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 缺口 | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|

7.4.13.4.1.2 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 | | |
|----|---------------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 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（2022年12月31日） | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 利率上升 25 个基点 | -21,430,887.66 | -23,944,441.21 |
| | 利率下降 25 个基点 | 21,478,434.87 | 24,018,371.43 |

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：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、权证投资等其他权益类交易性金融资产，因此无重大的其他价格风险。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可

观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 28,332,881,931.39 | 24,881,104,266.20 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 28,332,881,931.39 | 24,881,104,266.20 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金于本期初及上年度期初均未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金于本期及上年度可比期间均未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 28,332,881,931.39 | 35.66 |
| | 其中：债券 | 28,332,881,931.39 | 35.66 |
| | 资产支持证 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 12,964,396,719.44 | 16.32 |
| | 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 | 38,146,493,744.52 | 48.01 |
| 4 | 其他各项资产 | 5,627,106.63 | 0.01 |
| 5 | 合计 | 79,449,399,501.98 | 100.00 |

8.2 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 | 3.94 | |
| | 其中：买断式回购融资 | 0.00 | |
| 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 | 6,722,530,511.14 | 9.25 |
| | 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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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 | 108 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 116 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 91 |

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。

8.3.2 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 | 25.71 | 9.25 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |

| | | | |
|----|----------------------------|--------|------|
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 17.47 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 17.43 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 6.75 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 41.47 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 108.83 | 9.25 |

8.4 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。

8.5 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 | 按实际利率计算的账面价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------------------|-------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 3,993,347,308.56 | 5.49 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 3,034,875,966.08 | 4.18 |
| | 其中：政策性 金融债 | 3,034,875,966.08 | 4.18 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融 资券 | 4,241,753,688.26 | 5.84 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 17,062,904,968.49 | 23.48 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 28,332,881,931.39 | 38.98 |
| 10 | 剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券 | - | - |

8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资 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） | 按实际利率计算的 账面价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|-------------|---------------------|--------------|
| 1 | 112215527 | 22 民生银行 CD527 | 17,000,000 | 1,682,614,741.07 | 2.31 |

| | | | | | |
|----|-----------|------------------|------------|------------------|------|
| 2 | 112215220 | 22 民生银行 CD220 | 15,000,000 | 1,494,759,983.51 | 2.06 |
| 3 | 112270026 | 22 贵州银行 CD098 | 11,000,000 | 1,085,645,186.68 | 1.49 |
| 4 | 229966 | 22 贴现国债 66 | 9,000,000 | 898,338,725.57 | 1.24 |
| 5 | 112271401 | 22 中原银行 CD373 | 8,000,000 | 792,305,722.47 | 1.09 |
| 6 | 112205107 | 22 建设银行 CD107 | 8,000,000 | 791,302,987.99 | 1.09 |
| 7 | 229959 | 22 贴现国债 59 | 7,000,000 | 699,541,851.67 | 0.96 |
| 8 | 229961 | 22 贴现国债 61 | 7,000,000 | 699,241,311.05 | 0.96 |
| 9 | 220206 | 22 国开 06 | 6,500,000 | 656,873,488.65 | 0.90 |
| 10 | 229958 | 22 贴现国债 58 | 6,000,000 | 599,683,177.55 | 0.83 |

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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 | 0.0738% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0613% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0380% |

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。

8.8 期末按实际利率计算账面价值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

注：无。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期本基金投资的前十名证券除中国建设银行、中国民生银行、国家开发银行发行主体外，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。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

中国建设银行股份有限公司（简称建设银行）因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为案由，于 2022 年 3 月 21 日被中国银保监会处以罚款。

中国建设银行股份有限公司（简称建设银行）因个人经营贷款“三查”不到位等案由，于 2022 年 9 月 9 日被中国银保监会处以罚款。

中国建设银行股份有限公司（简称建设银行）因建设银行理财业务存在以下违法违规行为：老产品规模在部分时点出现反弹案由，于 2022 年 9 月 30 日被中国银保监会处以罚款。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

中国民生银行股份有限公司（简称民生银行）因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为案由，于 2022 年 3 月 21 日被中国银保监会处以罚款。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

国家开发银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为案由，于 2022 年 3 月 21 日被中国银保监会处以罚款。

以上发行主体涉及证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

8.9.3 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 | 11,803.84 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 5,615,302.79 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,627,106.63 |

8.9.4 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 | 8,471,025 | 8,249.20 | 18,560,055.31 | 0.03 | 69,860,657,956.23 | 99.97 |
| 长城货币 B | 22 | 7,139,920.31 | 116,698,943.23 | 74.29 | 40,379,303.49 | 25.71 |
| 长城货币 E | 61,803 | 42,830.24 | 195,358,100.16 | 7.38 | 2,451,679,016.34 | 92.62 |
| 合计 | 8,532,850 | 8,518.06 | 330,617,098.70 | 0.45 | 72,352,716,276.06 | 99.55 |

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。

9.2 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 | 个人 | 111,085,341.18 | 0.15 |
| 2 | 个人 | 91,390,150.12 | 0.13 |
| 3 | 个人 | 62,924,137.91 | 0.09 |
| 4 | 个人 | 55,602,657.18 | 0.08 |
| 5 | 其他 | 40,063,297.54 | 0.06 |
| 6 | 其他 | 39,565,607.02 | 0.05 |
| 7 | 个人 | 33,482,624.77 | 0.05 |
| 8 | 个人 | 27,064,648.59 | 0.04 |
| 9 | 其他 | 25,166,995.84 | 0.03 |
| 10 | 个人 | 22,319,540.34 | 0.03 |

9.3 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 | 长城货币 A | 3,347,367.03 | 0.0048 |
| | 长城货币 B | - | - |
| | 长城货币 E | 354.27 | 0.0000 |
| | 合计 | 3,347,721.30 | 0.0046 |

注：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)。

9.4 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 | 10~50 |
| | 长城货币 B | 0 |
| | 长城货币 E | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 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。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本报告期无基金经理兼任投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 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 | 2,934,887,104.33 | - | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 70,932,408,805.67 | 265,737,037.05 | 2,057,402,410.86 |
| 本报告期基金总申购份额 | 703,154,768,099.15 | 494,806,682.12 | 44,564,309,235.95 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 704,207,958,893.28 | 603,465,472.45 | 43,974,674,530.31 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 69,879,218,011.54 | 157,078,246.72 | 2,647,037,116.50 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 2022 年 1 月 11 日起，沈阳女士不再担任公司副总经理。

自 2022 年 9 月 19 日起，杨斌先生不再担任公司监事，由丁艳女士担任公司监事。

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无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币壹拾贰万元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内共新增 0 个交易单元，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
- (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。

11.7.2 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 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 100,006,635.61 | 100.00 | - | - | - | - |

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。

11.9 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 | 长城基金管理有限公司关于旗下公开 | 中国证监会规定报刊及 | 2022 年 1 月 4 日 |

| | | | |
|----|---|--------------|------------------|
| | 募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 网站 | |
| 2 | 长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 1 月 13 日 |
| 3 | 长城基金管理有限公司关于上海分公司营业场所变更的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 2 月 12 日 |
| 4 | 长城基金管理有限公司关于上海分公司变更负责人的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 4 月 20 日 |
| 5 | 长城基金管理有限公司关于营业场所变更的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 4 月 21 日 |
| 6 | 长城基金管理有限公司深圳分公司关于营业场所变更的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 4 月 21 日 |
| 7 | 长城基金管理有限公司关于北京分公司变更负责人的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 4 月 23 日 |
| 8 | 长城基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 5 月 18 日 |
| 9 | 长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 7 月 1 日 |
| 10 | 长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 7 月 8 日 |
| 11 | 长城基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 7 月 14 日 |
| 12 | 长城基金管理有限公司关于提醒投资者公司名称存在雷同的提示公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 10 月 11 日 |
| 13 | 长城基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下非货币公募基金事宜的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 10 月 22 日 |
| 14 | 长城基金管理有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 11 月 7 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会同意长城货币市场证券投资基金募集的文件
- (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

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

13.3 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：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn