

# 长城货币市场证券投资基金 2021 年年度报告

2021 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：2022 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 2022 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....	16
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.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
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.....	19
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.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25

<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 债券回购融资情况.....	52
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	52
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 .....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	53
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....	53
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	54
8.8 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 .....	54
8.9 投资组合报告附注.....	54
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	56
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.....	57
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>57</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>57</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 基金投资策略的改变.....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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 .....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	59
11.9 其他重大事件.....	59
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>60</b>
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 .....	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
13.1 备查文件目录.....	60
13.2 存放地点.....	60
13.3 查阅方式.....	60

## § 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	73,255,548,253.58 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	70,932,408,805.67 份	265,737,037.05 份	2,057,402,410.86 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	0755-23982338
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn
客户服务电话	400-8868-666	95577
传真	0755-23982328	010-85238680
注册地址	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005)
邮政编码	518026	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) 16 层
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 41 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 期间数据和指标	2021 年			2020 年			2019 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	1,437,087.00	19,506,895.09	57,955,902.70	1,186,855.05	26,821,687.80	42,240,646.86	1,217,272.63	94,685,260.99	31,079,496.48
本期利	1,437,087.00	19,506,895.09	57,955,902.70	1,186,855.05	26,821,687.80	42,240,646.86	1,217,272.63	94,685,260.99	31,079,496.48

润									
本期净值收益率	2.1924%	2.4377%	2.3456%	2.0637%	2.3089%	2.2170%	2.5507%	2.7966%	2.7043%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末			2020 年末			2019 年末		
期末基金资产净值	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	54,933,529,979.68	1,239,614,636.53	1,059,374,478.73
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	2021 年末			2020 年末			2019 年末		
累计	63.6388%	40.2387%	22.0717%	60.1282%	36.9014%	19.2740%	56.8905%	33.8119%	16.6871%

净值 收 益 率									
-------------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

②本基金收益分配按日结转份额。

③上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城货币 A

阶段	份额净 值收 益 率①	份额净 值收 益率标 准差②	业绩比较基 准收 益率③	业绩比较基 准收 益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5263%	0.0007%	0.0882%	0.0000%	0.4381 %	0.0007 %
过去六个月	1.0579%	0.0006%	0.1764%	0.0000%	0.8815 %	0.0006 %
过去一年	2.1924%	0.0007%	0.3500%	0.0000%	1.8424 %	0.0007 %
过去三年	6.9617%	0.0010%	1.0510%	0.0000%	5.9107 %	0.0010 %
过去五年	14.6282 %	0.0021%	1.7510%	0.0000%	12.877 2%	0.0021 %
自基金合同生效起 至今	63.6388 %	0.0057%	23.0178%	0.0036%	40.621 0%	0.0021 %

长城货币 B

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值收益 率①	收益率标 准差②	准收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	0.5871%	0.0007%	0.0882%	0.0000%	0.4989 %	0.0007 %
过去六个月	1.1802%	0.0006%	0.1764%	0.0000%	1.0038 %	0.0006 %
过去一年	2.4377%	0.0007%	0.3500%	0.0000%	2.0877 %	0.0007 %
过去三年	7.7338%	0.0010%	1.0510%	0.0000%	6.6828 %	0.0010 %
过去五年	16.0099 %	0.0021%	1.7510%	0.0000%	14.258 9%	0.0021 %
自基金合同生效起 至今	40.2387 %	0.0043%	3.4364%	0.0001%	36.802 3%	0.0042 %

## 长城货币 E

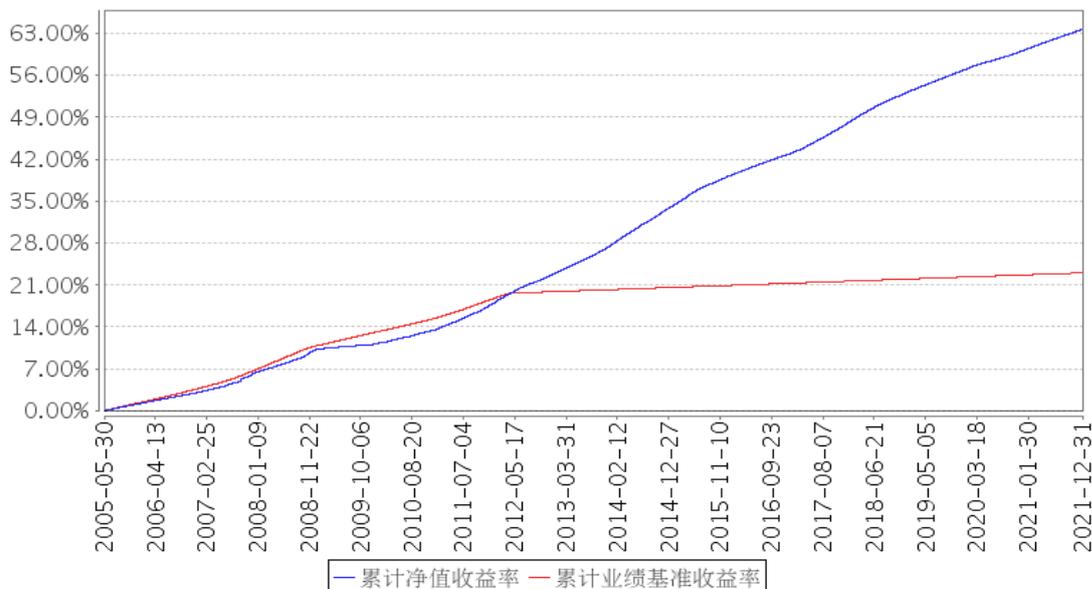
阶段	份额净 值收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.5643%	0.0007%	0.0882%	0.0000%	0.4761 %	0.0007 %
过去六个月	1.1343%	0.0006%	0.1764%	0.0000%	0.9579 %	0.0006 %
过去一年	2.3456%	0.0007%	0.3500%	0.0000%	1.9956 %	0.0007 %
过去三年	7.4437%	0.0010%	1.0510%	0.0000%	6.3927 %	0.0010 %
过去五年	15.4886 %	0.0022%	1.7510%	0.0000%	13.737 6%	0.0022 %

自基金合同生效起 至今	22.0717 %	0.0027%	2.3656%	0.0000%	19.706 1%	0.0027 %
----------------	--------------	---------	---------	---------	--------------	-------------

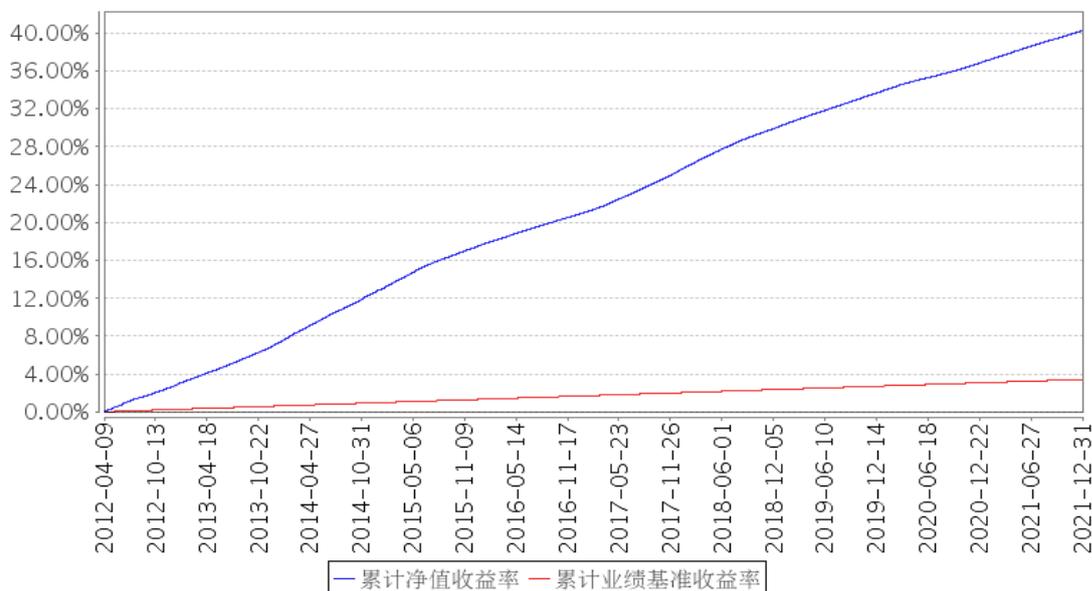
注：本基金收益分配按日结转份额。

### 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

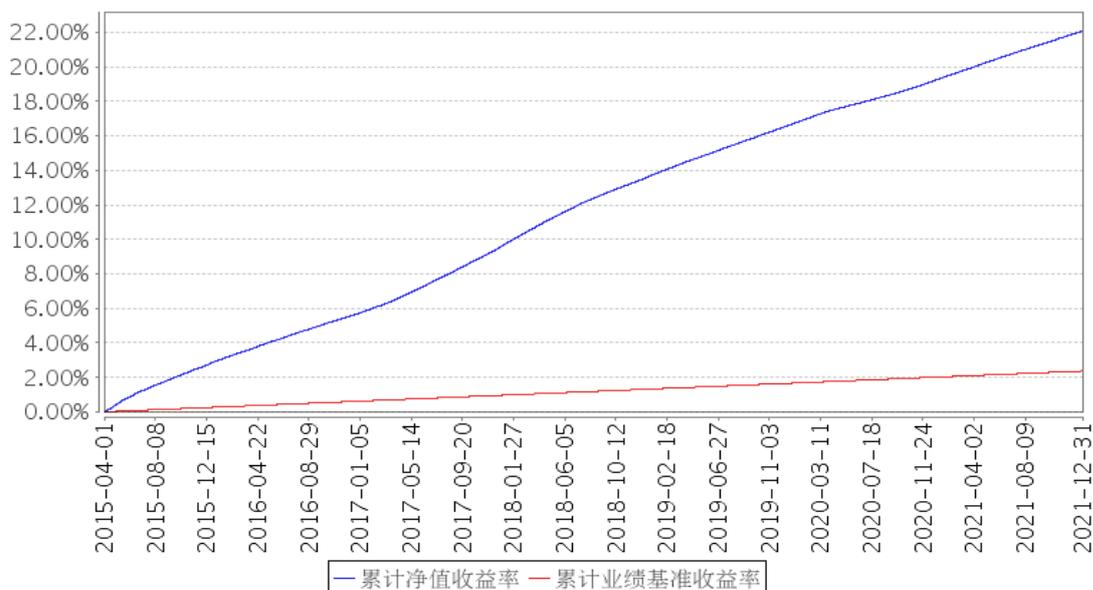
长城货币A 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



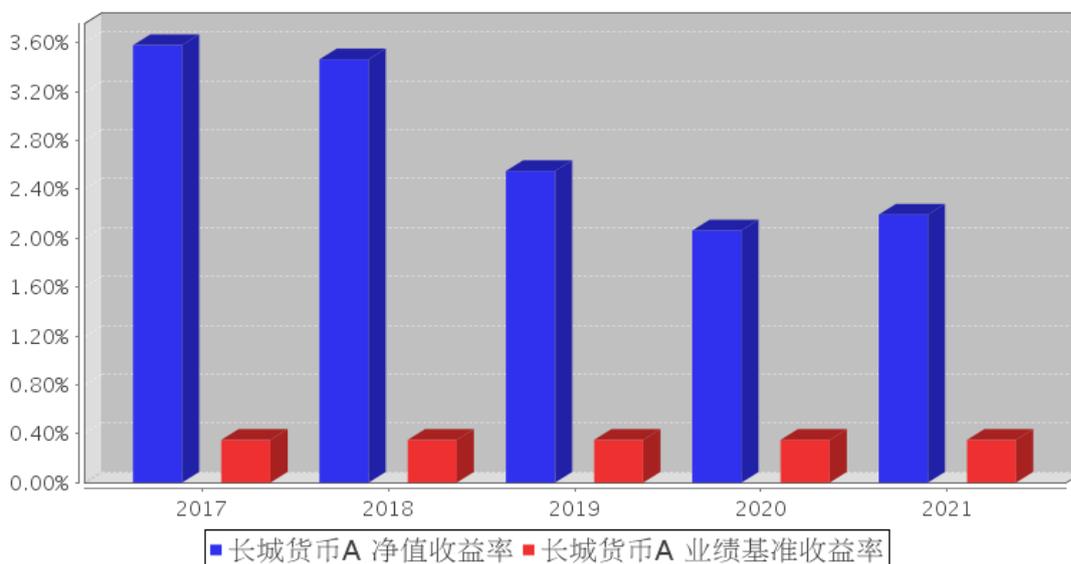
长城货币E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



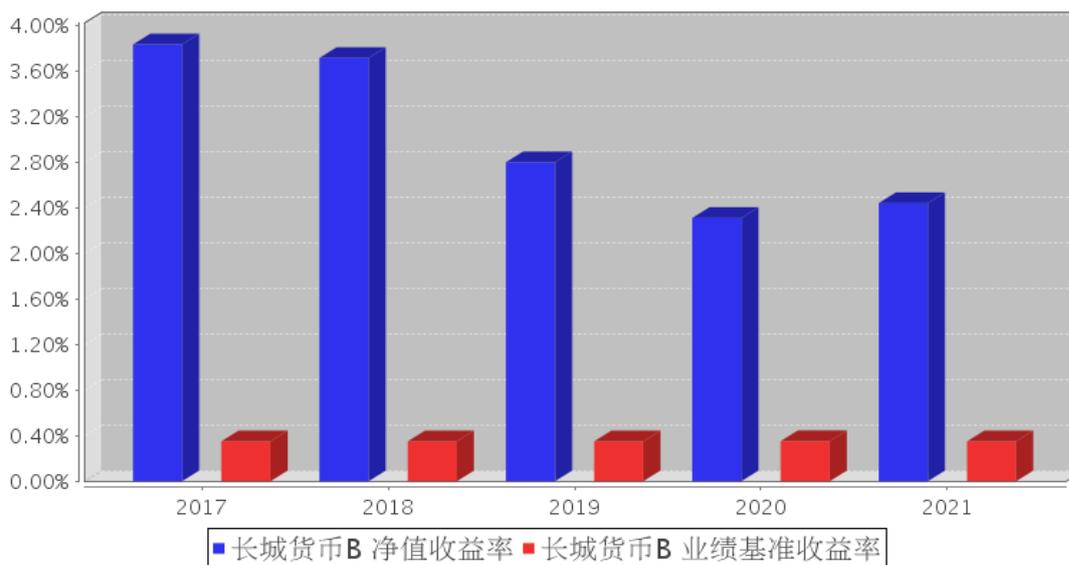
注：本基金合同规定本基金的组合配置比例范围为：央行票据：0—80%，回购 0—70%，短期债券 0—80%，同业存款/现金比例 0—70%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 3 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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

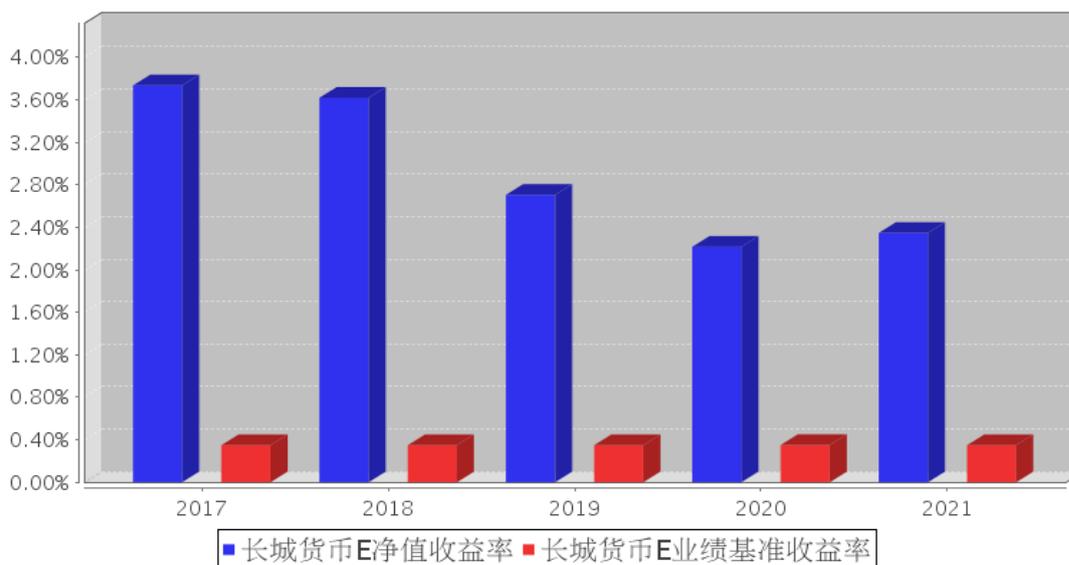
长城货币A 基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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
2021 年	1,437,087,008. 15	-	-	1,437,087,008. 15	-
2020 年	1,186,855,053. 14	-	-	1,186,855,053. 14	-
2019 年	1,217,272,630. 85	-	-	1,217,272,630. 85	-

合计	3,841,214,692.14	-	-	3,841,214,692.14	-
----	------------------	---	---	------------------	---

## 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
2021 年	19,506,895.09	-	-	19,506,895.09	-
2020 年	26,821,687.80	-	-	26,821,687.80	-
2019 年	94,685,260.99	-	-	94,685,260.99	-
合计	141,013,843.88	-	-	141,013,843.88	-

## 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
2021 年	57,955,902.70	-	-	57,955,902.70	-
2020 年	42,240,646.86	-	-	42,240,646.86	-
2019 年	31,079,496.48	-	-	31,079,496.48	-
合计	131,276,046.04	-	-	131,276,046.04	-

## § 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资金、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、长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、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。

#### 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		
邹立德	固定收益部总经理、本基金的基金经理	2011 年 10 月 19 日	-	12 年	男，中国籍，硕士。曾就职于深圳农村商业银行总行资金部，具有 14 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。
程书峰	本基金的基金经理	2019 年 8 月 28 日	2021 年 10 月 29 日	7 年	男，中国籍，硕士。2014 年 7 月毕业加入长城基金管理有限公司，历任交易管理部交易员、固定收益部债券基金经理助理。自 2020 年 7 月至 2021 年 4 月任“长城泰丰纯债债券型证券投资基金”基金经理，自 2019 年 8 月至 2021 年 10 月任“长城货币市场证券投资基金”、“长城收益宝货币市场基金”基金经理，自 2021 年 1 月至今任“长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 10 月至今任“长城久惠灵活配置混合型证券投资基金”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证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》、《长城货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》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《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。

##### 4.3.2.1 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

无。

#### 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继续演进。2021 年，欧美新冠疫情泛滥至数亿，德尔塔和奥密克戎变种毒株轮番冲击西方所谓民主与自由的价值体系，货币继续天量宽松，各国经济在货币泛滥下有所恢复，但油价大涨、商品大涨、海运大涨，美国通胀连续创下历史新高，美联储加息预期渐起。

国内方面：2021 年，中国成功防控新冠疫情，但在清零政策地方层层加码环境下，宏观经济高开低走，GDP 全年同比增长 8.1%，两年复合增长 5.1%。具体看，GDP 季度同比分别为 18.3%、7.9%、4.9%、4.0%，消费和投资疲弱，出口强劲，总体而言宏观经济虽总量较高，但各季度环比

增速下滑，经济承压。人民币继续升值，外资加速流入，股市结构性牛市，房价平稳微跌。

国内货币政策方面：稳中有放。2021 年春节前银行间市场流动性骤然收紧，债券利率快速上行。2-6 月经济较强复苏，货币政策相对稳健中性。下半年经济失速，货币政策明显转向宽松充裕，7 月和 12 月两次降准，且 12 月下调 1 年期 LPR 报价，标志着降准降息通道完全打开。至 12 月底，1Y 期的 AAA 国股同业存单收益率下行至 2.60%，10Y 期国开债收益率下行至 3.08%。

回顾我们全年的操作，我们安全地应对了春节前的流动性大幅冲击，一季度和二季度增加了对同业存单、同业存款和债券的配置，三季度和四季度则加大了对同业存款、债券和回购资产的配置力度。把握住了债券牛市行情的机会，在严格风险控制的基础上，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 2.1924%；长城货币 B 基金份额净值收益率为 2.4377%；长城货币 E 基金份额净值收益率为 2.3456%，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 2022 年，全球新冠疫情依然挥之不去，世界各国发展将更加不安和分化，谁都很不容易，我国宏观经济增速依然承压。要想实现比较优势，我们必须坚持以经济建设为中心，稳字当头，六保六稳，需要多次降准降息的货币政策和积极的财政政策支持，需要基建投资加速，地产政策因城放松，大力促进内需消费，保持进出口强劲势头。预计二三季度宏观经济有望环比企稳回升，全年 GDP 实现同比 5.5%以上增速。

总体上，债券利率更可能先下后上，震荡中逐步走高，货币基金和短债基金持续具备投资价值 and 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，尤其规避民营地产业风险。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“诚信、稳健、规范、创新”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及其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 1,514,549,805.94 元，已分配利润人民币 1,514,549,805.94 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 2021 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（2022）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 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表及所有者权益（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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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>
注册会计师对财务报表审计的责任	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>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，就可能对导致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的内部控制缺陷。</p>	
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	2022 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	41,000,618,337.44	28,400,694,102.63
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	7.4.7.2	24,881,104,266.20	20,991,133,992.41
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		24,881,104,266.20	18,964,133,992.41
资产支持证券投资		-	2,027,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	12,645,337,208.00	13,998,348,477.53
应收证券清算款		-	493,904,068.50
应收利息	7.4.7.5	381,326,120.36	262,406,682.00
应收股利		-	-
应收申购款		2,171,322.05	2,669,065.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		78,910,557,254.05	64,149,156,388.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,609,721,981.87	4,117,461,116.84
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,851.10	-
应付管理人报酬		20,887,795.42	17,024,661.90
应付托管费		6,329,634.97	5,158,988.48
应付销售服务费		15,364,559.96	12,416,900.23
应付交易费用	7.4.7.7	531,818.21	617,581.36
应交税费		1,325,547.00	1,483,718.40
应付利息		577,651.94	855,507.72
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	249,160.00	279,160.00
负债合计		5,655,009,000.47	4,155,297,634.93
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	73,255,548,253.58	59,993,858,753.46
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		73,255,548,253.58	59,993,858,753.46
负债和所有者权益总计		78,910,557,254.05	64,149,156,388.39

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 73,255,548,253.58 份，其中长城货币 A 基金份额总额 70,932,408,805.67 份，基金份额净值 1.0000 元；长城货币 B 基金份额总额 265,737,037.05 份，基金份额净值 1.0000 元；长城货币 E 基金份额总额 2,057,402,410.86 份，

基金份额净值 1.0000 元。

## 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		2,046,339,541.34	1,771,867,572.70
1. 利息收入		2,030,467,017.22	1,768,297,302.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,138,899,198.74	772,774,022.13
债券利息收入		562,158,039.22	566,287,671.42
资产支持证券利息收入		46,825,861.72	57,083,403.79
买入返售金融资产收入		282,583,917.54	372,152,205.44
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,842,564.12	3,570,269.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,842,564.12	3,570,369.93
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-100.01
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	29,960.00	-
减：二、费用		531,789,735.40	515,950,184.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	230,367,650.22	202,225,050.24
2. 托管费	7.4.10.2.2	69,808,378.81	61,280,318.25
3. 销售服务费		168,814,248.15	147,442,286.70
4. 交易费用	7.4.7.19	870.82	2,672.52
5. 利息支出		62,173,472.52	104,199,104.00
其中：卖出回购金融资产支出		62,173,472.52	104,199,104.00

6. 税金及附加		352,414.88	493,553.19
7. 其他费用	7.4.7.20	272,700.00	307,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,514,549,805.94	1,255,917,387.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,514,549,805.94	1,255,917,387.80

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	59,993,858,753.46	-	59,993,858,753.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,514,549,805.94	1,514,549,805.94
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）	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
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）	-	-1,514,549,805.94	-1,514,549,805.94
五、期末所有者权益（基金净值）	73,255,548,253.58	-	73,255,548,253.58
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者	57,232,519,094.94	-	57,232,519,094.94

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,255,917,387.80	1,255,917,387.80
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)	2,761,339,658.52	-	2,761,339,658.52
其中:1.基金申购款	1,033,799,274,910.72	-	1,033,799,274,910.72
2.基金赎回款	-1,031,037,935,252.20	-	-1,031,037,935,252.20
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)	-	-1,255,917,387.80	-1,255,917,387.80
五、期末所有者权益(基金净值)	59,993,858,753.46	-	59,993,858,753.46

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

邱春杨

赵永强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

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 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〉》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。

### 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 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

本基金的金融资产分类为交易性金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的交易性金融资产主要为债券投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为交易性金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目；应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算

影子价格(附注 7.4.4.5)，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。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，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

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。

本基金金融工具的估值方法具体如下：

##### (1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息。

##### (2) 债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

##### (3) 回购协议

1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；  
2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值。

##### (4) 其他

1) 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价格估值；

2) 为了避免采用摊余成本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”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，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。

3) 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

当本基金同时满足下列条件时，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：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

#### 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收入损失，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，自 2016 年 2 月 1 日起，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) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 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

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提；

(3) 基金 A 级份额销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；B 级份额销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率逐日计提；E 级基金份额销售服务费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 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

无。

## 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

### 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

### 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。

## 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	618,337.44	694,102.63
定期存款	41,000,000,000.00	28,400,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	3,000,000,000.00	-
存款期限 3 个月以上	38,000,000,000.00	28,400,000,000.00
其他存款	-	-
合计	41,000,618,337.44	28,400,694,102.63

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	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
项目		上年度末 2020年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	18,964,133,992.41	18,971,489,900.00	7,355,907.59	0.0123
	合计	18,964,133,992.41	18,971,489,900.00	7,355,907.59	0.0123
资产支持证券		2,027,000,000.00	2,027,000,000.00	-	-
合计		20,991,133,992.41	20,998,489,900.00	7,355,907.59	0.0123

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

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 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	-
项目	上年度末 2020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	13,998,348,477.53	-
合计	13,998,348,477.53	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,019.13	1,185.83
应收定期存款利息	236,203,252.88	196,821,805.39
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	121,856,996.37	34,217,156.85
应收资产支持证券利息	-	14,842,716.45
应收买入返售证券利息	23,262,851.98	16,523,817.48
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	381,326,120.36	262,406,682.00

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	531,818.21	617,581.36
合计	531,818.21	617,581.36

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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	-	-
应付银行划款手续费	160.00	160.00
预提上清所债券账户维护费	4,500.00	4,500.00
预提审计费	120,000.00	150,000.00
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
合计	249,160.00	279,160.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长城货币 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	57,298,000,467.86	57,298,000,467.86
本期申购	1,060,575,322,634.96	1,060,575,322,634.96
本期赎回(以“-”号填列)	-1,046,940,914,297.15	-1,046,940,914,297.15
-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	70,932,408,805.67	70,932,408,805.67

## 长城货币 B

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	778,803,808.24	778,803,808.24
本期申购	1,286,097,458.70	1,286,097,458.70
本期赎回(以“-”号填列)	-1,799,164,229.89	-1,799,164,229.89
-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	265,737,037.05	265,737,037.05

## 长城货币 E

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,917,054,477.36	1,917,054,477.36
本期申购	46,590,987,329.19	46,590,987,329.19
本期赎回(以“-”号填列)	-46,450,639,395.69	-46,450,639,395.69
-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	2,057,402,410.86	2,057,402,410.86

注：(1) 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。

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

(3) 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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

##### 长城货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,437,087,008.15	-	1,437,087,008.15
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	-1,437,087,008.15	-	-1,437,087,008.15
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
上年度末	-	-	-
本期利润	19,506,895.09	-	19,506,895.09
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	-19,506,895.09	-	-19,506,895.09
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
上年度末	-	-	-
本期利润	57,955,902.70	-	57,955,902.70
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	-57,955,902.70	-	-57,955,902.70
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。

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	18,001.27	27,746.62
定期存款利息收入	1,138,881,197.47	772,746,275.51
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	1,138,899,198.74	772,774,022.13

#### 7.4.7.12 股票投资收益

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	15,842,564.12	3,570,369.93
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	15,842,564.12	3,570,369.93

## 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	45,576,099,742.53	49,336,439,861.26
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	45,339,851,324.14	49,064,717,760.32
减：应收利息总额	220,405,854.27	268,151,731.01
买卖债券差价收入	15,842,564.12	3,570,369.93

## 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	2,077,458,638.21	2,990,786,347.11
减：卖出资产支持证券成本总额	2,027,000,000.00	2,947,000,000.00
减：应收利息总额	50,458,638.21	43,786,447.12
资产支持证券投资收益	-	-100.01

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

## 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.16 股利收益

注：无。

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

注：无。

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	29,960.00	-
合计	29,960.00	-

注：其他为上交所减免费用。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	870.82	2,672.52
合计	870.82	2,672.52

注：交易费用为银行间外汇中心交易手续费和交易结算服务费。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	120,000.00	150,000.00
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	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	272,700.00	307,200.00

#### 7.4.7.21 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

截至财务报表批准日，本基金无需要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
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
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
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 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	230,367,650.22	202,225,050.24
其中：支付销售机构的客户维护费	113,395,591.97	127,090,865.92

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 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	69,808,378.81	61,280,318.25

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 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
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
华夏银行	26,653.37	16.44	187,537.15	214,206.96
长城基金管理有限公司	4,893,878.33	94,861.13	5,240.77	4,993,980.23
长城证券	34,988.62	198.95	789,379.31	824,566.88
东方证券	3,178.51	-	-	3,178.51
合计	4,958,698.83	95,076.52	982,157.23	6,035,932.58

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自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自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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	618,337.44	18,001.27	694,102.63	27,746.62

注：本基金的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
1,437,087,008.15	-	-	1,437,087,008.15	-
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
19,506,895.09	-	-	19,506,895.09	-

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
57,955,902.70	-	-	57,955,902.70	-

#### 7.4.12 期末(2021 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 2021 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 5,609,721,981.87 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
112115182	21 民生银 行 CD182	2022 年 1 月 4 日	98.63	6,522,000	643,274,274.50
112115208	21 民生银 行 CD208	2022 年 1 月 4 日	98.48	5,440,000	535,704,752.10
112171491	21 中原银 行 CD319	2022 年 1 月 4 日	99.87	5,320,000	531,296,934.00
112173902	21 中原银 行 CD362	2022 年 1 月 4 日	99.68	2,980,000	297,031,692.18
112176329	21 中原银 行 CD393	2022 年 1 月 4 日	99.49	5,470,000	544,219,830.71
150216	15 国开 16	2022 年 1 月 4 日	100.75	3,100,000	312,330,187.41
150412	15 农发 12	2022 年 1 月 4 日	100.57	4,020,000	404,297,397.16
170206	17 国开 06	2022 年 1 月 4 日	100.45	6,530,000	655,965,065.81
210201	21 国开 01	2022 年 1 月 4	100.01	5,000,000	500,053,177.96

		日			
210206	21 国开 06	2022 年 1 月 4 日	100.03	5,181,000	518,255,468.98
210401	21 农发 01	2022 年 1 月 4 日	100.04	5,700,000	570,242,965.10
219955	21 贴现国 债 55	2022 年 1 月 4 日	99.74	3,470,000	346,107,862.09
合计				58,733,000	5,858,779,608.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注:无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 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 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 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，并按照合同约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 2021 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	5,200,618,337.44	10,500,000.00	25,300,000.00	-	-	-	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
应收利息						381,326,120.36	381,326,120.36
应收申购款						2,171,322.05	2,171,322.05
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
应付交易费用						531,818.21	531,818.21
应付利息						577,651.94	577,651.94
应交税费						1,325,547.00	1,325,547.00
其他负债						249,160.00	249,160.00
负债总计	5,609,721,981.87					45,287,018.60	5,655,009,000.47
利率敏感度缺口	17,646,669,849.45	15,081,012,747.03	40,189,655,233.29				
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,000,694,102.63	10,200,000,000.00	17,200,000,000.00				28,400,694,102.63
交易性金融资产	1,319,873,910.73	10,728,476,635.31	8,942,783,446.37				20,991,133,992.41
买入返售金融资产	12,677,437,176.17	1,320,911,301.36					13,998,348,477.53
应收利息						262,406,682.00	262,406,682.00
应收申购款						2,669,062.00	2,669,062.00

						5.32	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	493,904,068.50	493,904,068.50
资产总计	14,998,005,189.53	22,249,387,936.67	26,142,783,446.37	-	-	758,979,815.82	64,149,156,388.39
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,024,661.90	17,024,661.90
应付托管费	-	-	-	-	-	5,158,988.48	5,158,988.48
卖出回购金融资产款	4,117,461,116.84	-	-	-	-	-	4,117,461,116.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,416,900.23	12,416,900.23
应付交易费用	-	-	-	-	-	617,581.36	617,581.36
应付利息	-	-	-	-	-	855,507.72	855,507.72
应交税费	-	-	-	-	-	1,483,718.40	1,483,718.40
其他负债	-	-	-	-	-	279,160.00	279,160.00
负债总计	4,117,461,116.84	-	-	-	-	37,836,518.09	4,155,297,634.93
利率敏感度缺口	10,880,544,072.69	22,249,387,936.67	26,142,783,446.37	-	-	-	-

#### 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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	利率上升25个基点	-23,944,441.21	-20,138,601.74
	利率下降25个基点	24,018,371.43	20,199,497.36

#### 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

#### 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、权证投资等其他交易性金融资产，因此无重大的其他价格风险。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.2 其他事项

(1) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(以上统称新金融工具相关会计准则)，以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号)，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(2) 除以上事项，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	24,881,104,266.20	31.53
	其中：债券	24,881,104,266.20	31.53
	资产支持证	-	-

	券		
2	买入返售金融资产	12,645,337,208.00	16.02
	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	41,000,618,337.44	51.96
4	其他各项资产	383,497,442.41	0.49
5	合计	78,910,557,254.05	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	3.95	
	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	5,609,721,981.87	7.66
	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	110
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

### 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	31.64	7.66
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	8.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-

3	60 天（含）—90 天	11.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	13.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	42.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		107.20	7.66

#### 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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	658,166,653.44	0.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,699,012,447.26	5.05
	其中：政策性 金融债	3,699,012,447.26	5.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	3,288,814,774.63	4.49
6	中期票据	-	-
7	同业存单	17,235,110,390.87	23.53
8	其他	-	-
9	合计	24,881,104,266.20	33.96
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

#### 8.6 期末按摊余成本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）	摊余成本	占基金资产 净值比例 （%）
1	112110177	21 兴业银行 CD177	13,000,000	1,297,951,163.40	1.77
2	112115167	21 民生银行 CD167	13,000,000	1,284,970,740.23	1.75

3	112115208	21 民生银行 CD208	12,000,000	1,181,701,659.04	1.61
4	112115182	21 民生银行 CD182	10,000,000	986,314,434.99	1.35
5	112115402	21 民生银行 CD402	9,000,000	875,873,421.13	1.20
6	112171491	21 中原银行 CD319	8,000,000	798,942,757.89	1.09
7	112173902	21 中原银行 CD362	8,000,000	797,400,515.92	1.09
8	112176329	21 中原银行 CD393	8,000,000	795,933,938.88	1.09
9	170206	17 国开 06	7,400,000	743,360,105.21	1.01
10	210401	21 农发 01	5,700,000	570,242,965.10	0.78

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0386%
报告期内偏离度的最低值	-0.0432%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0162%

### 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

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兴业银行、民生银行发行主体外，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。

根据中国人民银行公布的行政处罚信息公开表：

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因为违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等相关违法违规行为，于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行处以罚款。

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）因监管发现问题屡查屡犯等案由，于 2021 年 7 月 13 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	381,326,120.36
4	应收申购款	2,171,322.05
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	383,497,442.41

### 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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	8,518,780	8,326.59	22,225,795.64	0.03	70,910,183,010.03	99.97
长城货币 B	25	10,629,481.48	236,084,655.16	88.84	29,652,381.89	11.16
长城货币 E	55,340	37,177.49	119,841,788.90	5.82	1,937,560,621.96	94.18
合计	8,574,145	8,543.77	378,152,239.70	0.52	72,877,396,013.88	99.48

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	银行类机构	71,486,887.40	0.10
2	个人	52,465,674.86	0.07
3	个人	33,591,706.67	0.05
4	其他机构	31,392,447.20	0.04
5	其他机构	28,879,914.27	0.04
6	个人	26,129,233.51	0.04
7	保险类机构	25,261,553.43	0.03
8	个人	19,076,835.30	0.03
9	个人	17,941,896.24	0.02
10	其他机构	17,376,878.38	0.02

## 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	3,345,923.84	0.0047
	长城货币 B	-	-
	长城货币 E	374.65	0.0000
	合计	3,346,298.49	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	50~100
	长城货币 B	0
	长城货币 E	0

	合计	50~100
本基金基金经理持有 本开放式基金	长城货币 A	0
	长城货币 B	0
	长城货币 E	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。

### 9.5 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	57,298,000,467.86	778,803,808.24	1,917,054,477.36
本报告期基金 总申购份额	1,060,575,322,634.96	1,286,097,458.70	46,590,987,329.19
减：本报告期 基金总赎回份 额	1,046,940,914,297.15	1,799,164,229.89	46,450,639,395.69
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	70,932,408,805.67	265,737,037.05	2,057,402,410.86

## § 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 2021 年 4 月 14 日起，许明波先生不再担任公司董事，由曾晓玲女士担任公司董事。

自 2021 年 7 月 20 日起，赵建兴先生不再担任公司副总经理、首席信息官。

自 2021 年 7 月 30 日起，由邱春杨先生兼任公司首席信息官。

自 2021 年 9 月 30 日起，袁柳生先生不再担任公司职工监事。

自 2021 年 11 月 11 日起，由侯涛先生担任公司职工监事。

## 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，本基金托管人 2021 年 5 月 11 日发布公告，胡捷先生自 2021 年 4 月 30 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

本报告期内，本基金托管人 2021 年 8 月 13 日发布公告，国然女士自 2021 年 8 月 9 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

### 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

本报告期内，本基金管理人、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

注：无。

## 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参加宁波银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
2	关于终止包商银行股份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	2021 年 2 月 8 日
3	长城基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并更新、完善身份信息以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 7 月 1 日
4	关于变更公司副总经理的公告	中国证监会规定报刊及	2021 年 7 月 22 日

		网站	
5	关于变更长城货币市场证券投资基金基金经理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 10 月 30 日
6	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	2021 年 11 月 9 日
7	长城基金管理有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 12 月 30 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：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

