

长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证  
券投资基金  
2022 年第 4 季度报告

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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 日

## § 1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 01 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 11 月 30 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	016625
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 30 日
报告期末基金份额总额	6,199,768,676.15 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、优化抽样复制策略</p> <p>本基金主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素，根据投资标的流动性、基金日常申购赎回以及债券交易特性及交易惯例等情况，采取“久期匹配”等优化策略对基金资产进行抽样化调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p>

	<p>2、替代性策略</p> <p>对于市场流动性不足、因法律法规原因个别成份券被限制投资等情况,本基金无法获得对个别成份券足够数量的投资时,基金管理人将通过投资其他成份券、非成份券等方式进行替代。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将根据“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策,以及债券市场资金供求等因素的分析,重点参考基金的流动性管理需要,运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略等多种积极管理策略,选取收益稳定、流动性较好的债券进行配置。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过资产支持证券基础资产及结构设计的研究,结合多种定价模型,根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。</p>
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	<p>一般而言,本基金长期平均风险和预期的收益低于股票型基金和偏股混合型基金,高于货币市场基金。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券,具有与标的指数以及标的指数所代表的组合相似的风险收益特征。</p>
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2022年11月30日-2022年12月31日)
1. 本期已实现收益	11,899,763.61
2. 本期利润	18,277,483.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0029
4. 期末基金资产净值	6,218,046,159.76
5. 期末基金份额净值	1.0029

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上述基金业绩指标不包括持有人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本基金合同于2022年11月30日生效,截止本报告期末,基金合同生效未满一个季度。

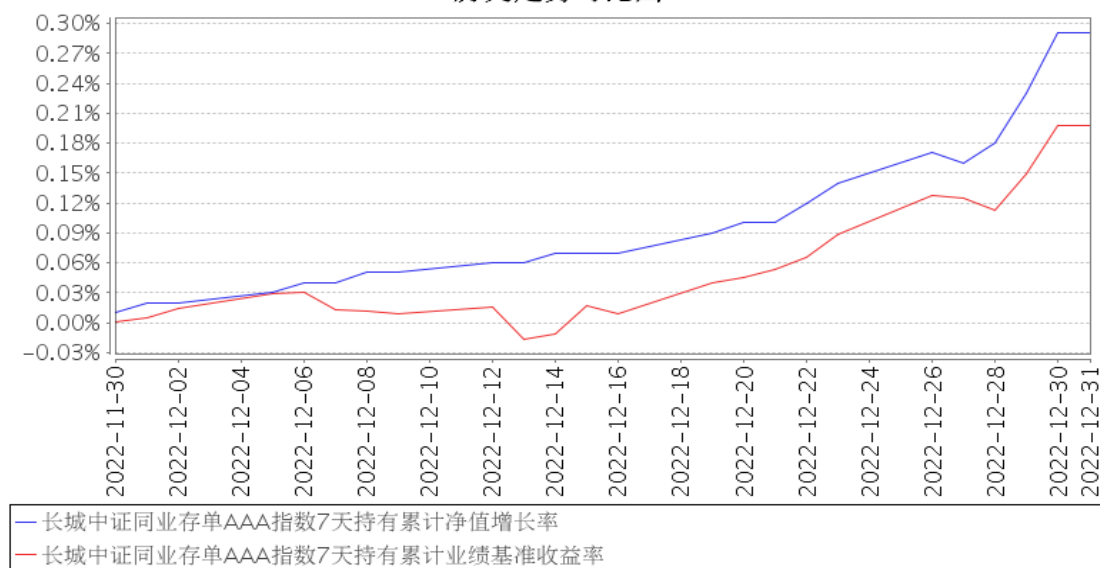
#### 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率 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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	0.29%	0.02%	0.20%	0.02%	0.09%	0.00%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长城中证同业存单AAA指数7天持有累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①本基金合同规定本基金的投资组合比例为：本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于标的指数成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内。

③本基金合同于 2022 年 11 月 30 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐涛国	本基金的基金经理	2022 年 11 月 30 日	-	14 年	男，中国籍，硕士，金融风险管理师（FRM）。2008 年 5 月加入长城基金管理有限公司，历任运行保障部 TA 清算、债券交易员、固定收益部货币基金经理助理。自 2017 年 6 月至今任“长城工资宝货币市场基金”的基金经理，自 2019 年 12 月至今任“长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金”、“长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金”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。
邹德立	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2022 年 11 月 30 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。

#### 4.1.1 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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度我国经济基本面总体延续缓慢修复的状态，可谓不温不火。主要的影响变量发生在政策面，首先是疫情防控边际出现快速调整，到 12 月份，基本上全国已放开管控；其次，稳定房地产发展的政策显著加码，央行出台金融十六条，政策重新将房地产作为经济支柱产业；最后一方面，资金价格有所抬升，R007 一度上升至 2% 以上水平。这些政策变量的变化导致市场利率出现快速攀升。叠加理财产品的赎回踩踏引起市场进一步恐慌。年底在央行持续呵护资金面之后，市场出现一定回暖。

回顾本基金四季度投资，我们基于年末利率上行行情的判断，在年末利率高点完成了组合建仓，取得了较好的收益。预计 2023 年一季度资金面仍将维持中性偏松的局面，存单利率将保持相对平稳的行情，我们将在跟踪中证存单指数的前提下，努力抓住收益波动的时机，灵活调整组合久期，提高组合的收益水平。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0029 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.29%，业绩比较基准收益率为 0.20%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,559,802,580.35	69.34
	其中：债券	5,559,802,580.35	69.34
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,457,843,626.88	30.65
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	633,391.51	0.01
8	其他资产	-	-
9	合计	8,018,279,598.74	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

##### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

##### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

#### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

##### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：无。

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：无。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	356,576,260.27	5.73
	其中：政策性金融债	356,576,260.27	5.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	5,203,226,320.08	83.68
9	其他	-	-
10	合计	5,559,802,580.35	89.41

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	200313	20 进出 13	3,500,000	356,576,260.27	5.73
2	112215527	22 民生银行 CD527	3,000,000	296,970,985.71	4.78
3	112213148	22 浙商银行 CD148	3,000,000	296,750,347.25	4.77
4	112203112	22 农业银行 CD112	2,000,000	199,042,540.00	3.20
4	112210382	22 兴业银行 CD382	2,000,000	199,042,540.00	3.20
5	112206253	22 交通银行 CD253	2,000,000	198,037,885.71	3.18

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：无。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。



## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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进出口银行、中国民生银行、浙商银行、中国农业银行、兴业银行、交通银行、中信银行、招商银行、中国光大银行发行主体外，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：

中国进出口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：

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：

浙商银行股份有限公司（简称浙商银行）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：

中国农业银行股份有限公司（简称农业银行）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。

中国农业银行股份有限公司（简称农业银行）因作为托管机构，存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况等案由，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：

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）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。

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因债券承销业务严重违反审慎经营规则案由，于 2022 年 9 月 9 日被中国银保监会处以罚款。

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因老产品规模在部分时点出现反弹等案由，于 2022 年 9 月 28 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：

交通银行股份有限公司（简称交通银行）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。

交通银行股份有限公司（简称交通银行）因个人经营贷款挪用至房地产市场等案由，于 2022 年 9 月 9 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：

中信银行股份有限公司（简称中信银行）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：

招商银行股份有限公司（简称招商银行）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。

招商银行股份有限公司（简称招商银行）因个人经营贷款挪用至房地产市场等案由，于 2022 年 9 月 9 日被中国银保监会处以罚款。

根据中国人民银行公布的行政处罚信息公开表：

招商银行股份有限公司（简称招商银行）因违反账户管理规定等案由，于 2022 年 8 月 31 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：

中国光大银行股份有限公司（简称光大银行）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。

中国光大银行股份有限公司（简称光大银行）因理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹等违法违规行为案由，于 2022 年 5 月 24 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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 5.11.3 其他资产构成

注：无。

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年11月30日)基金份额总额	6,199,768,676.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

报告期期末基金份额总额	6,199,768,676.15
-------------	------------------

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动，于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》
- (四) 《长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 中国证监会规定的其他文件

### 9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 9.3 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](http://www.ccfund.com.cn)