

# 长城货币市场证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>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 主要财务指标和基金净值表现</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                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 净资产变动表                              | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 20        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 39        |
| 7.2 债券回购融资情况                            | 39        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                        | 40        |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明         | 41        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41        |
| 7.6 期末按公允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      | 41        |
| 7.7 “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      | 42        |
| 7.8 期末按公允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  | 42        |

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| 7.9 投资组合报告附注.....                       | 42        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 43        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....             | 43        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 44        |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 44        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                | <b>44</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                  | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 45        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....   | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 45        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....       | 46        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....   | 46        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....              | 47        |
| 10.9 其他重大事件.....                        | 47        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>          | <b>48</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 48        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 48        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                  | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 48        |
| 12.2 存放地点.....                          | 48        |
| 12.3 查阅方式.....                          | 48        |

## § 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      | 66,225,982,167.32 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 | 64,688,627,619.36 份 | 75,319,639.87 份 | 1,462,034,908.09 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   | 李建军                             | 赵伟婧                        |
|         | 联系电话 | 0755-29279005                   | (010) 85237681             |
|         | 电子邮箱 | lijj@ccfund.com.cn              | zhaoweijing@hxb.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 | 北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005) |

|       |                                             |                           |
|-------|---------------------------------------------|---------------------------|
|       | 层 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、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                                          | 杨书剑                       |

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             |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.ccfund.com.cn |
| 基金中期报告置备地点        | 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                                        |
|--------|------------|---------------------------------------------|
| 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、38 层、39 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日) |               |                  |
|---------------|---------------------------------------|---------------|------------------|
|               | 长城货币 A                                | 长城货币 B        | 长城货币 E           |
| 本期已实现收益       | 310,294,392.44                        | 271,034.92    | 9,243,079.55     |
| 本期利润          | 310,294,392.44                        | 271,034.92    | 9,243,079.55     |
| 本期净值收益率       | 0.4637%                               | 0.5833%       | 0.5383%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)                 |               |                  |
| 期末基金资产净值      | 64,688,627,619.36                     | 75,319,639.87 | 1,462,034,908.09 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                                | 1.0000        | 1.0000           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)                 |               |                  |

|             |          |          |          |
|-------------|----------|----------|----------|
| 累计净值<br>收益率 | 74.7544% | 51.3890% | 31.2454% |
|-------------|----------|----------|----------|

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<br>值收益<br>率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③          | ②—④         |
|----------------|------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------------|-------------|
| 过去三个月          | 0.2211%          | 0.0001%             | 0.0873%            | 0.0000%               | 0.1338<br>%  | 0.0001<br>% |
| 过去六个月          | 0.4637%          | 0.0002%             | 0.1736%            | 0.0000%               | 0.2901<br>%  | 0.0002<br>% |
| 过去一年           | 0.9764%          | 0.0002%             | 0.3500%            | 0.0000%               | 0.6264<br>%  | 0.0002<br>% |
| 过去三年           | 4.0580%          | 0.0009%             | 1.0510%            | 0.0000%               | 3.0070<br>%  | 0.0009<br>% |
| 过去五年           | 7.9224%          | 0.0011%             | 1.7510%            | 0.0000%               | 6.1714<br>%  | 0.0011<br>% |
| 过去七年           | 12.7626<br>%     | 0.0013%             | 2.4519%            | 0.0000%               | 10.310<br>7% | 0.0013<br>% |
| 过去十年           | 23.9236<br>%     | 0.0024%             | 3.5019%            | 0.0000%               | 20.421<br>7% | 0.0024<br>% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 74.7544<br>%     | 0.0053%             | 24.5923%           | 0.0034%               | 50.162<br>1% | 0.0019<br>% |

长城货币 B

| 阶段             | 份额净值<br>收益<br>率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①－③          | ②－④         |
|----------------|------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------------|-------------|
| 过去三个月          | 0.2811%          | 0.0001%             | 0.0873%            | 0.0000%               | 0.1938<br>%  | 0.0001<br>% |
| 过去六个月          | 0.5833%          | 0.0002%             | 0.1736%            | 0.0000%               | 0.4097<br>%  | 0.0002<br>% |
| 过去一年           | 1.2190%          | 0.0002%             | 0.3500%            | 0.0000%               | 0.8690<br>%  | 0.0002<br>% |
| 过去三年           | 4.8096%          | 0.0009%             | 1.0510%            | 0.0000%               | 3.7586<br>%  | 0.0009<br>% |
| 过去五年           | 9.2249%          | 0.0011%             | 1.7510%            | 0.0000%               | 7.4739<br>%  | 0.0011<br>% |
| 过去七年           | 14.6723<br>%     | 0.0013%             | 2.4519%            | 0.0000%               | 12.220<br>4% | 0.0013<br>% |
| 过去十年           | 26.9310<br>%     | 0.0024%             | 3.5019%            | 0.0000%               | 23.429<br>1% | 0.0024<br>% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 51.3890<br>%     | 0.0042%             | 5.0110%            | 0.0000%               | 46.378<br>0% | 0.0042<br>% |

长城货币 E

| 阶段    | 份额净值<br>收益<br>率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①－③         | ②－④         |
|-------|------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-------------|-------------|
| 过去三个月 | 0.2585%          | 0.0001%             | 0.0873%            | 0.0000%               | 0.1712<br>% | 0.0001<br>% |
| 过去六个月 | 0.5383%          | 0.0002%             | 0.1736%            | 0.0000%               | 0.3647<br>% | 0.0002<br>% |
| 过去一年  | 1.1278%          | 0.0002%             | 0.3500%            | 0.0000%               | 0.7778<br>% | 0.0002<br>% |

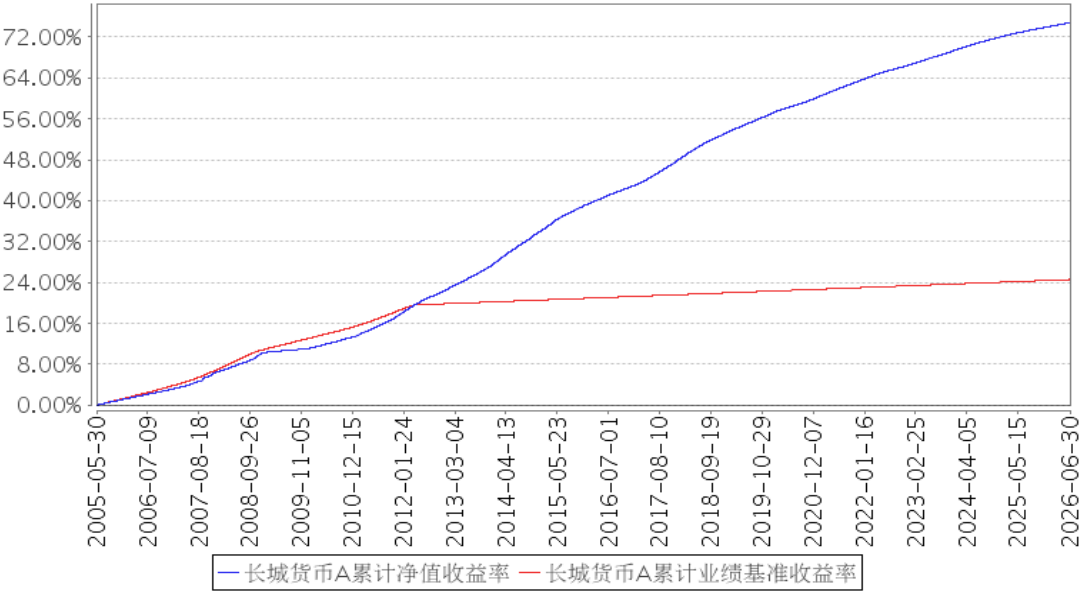


|            |          |         |         |         |          |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去三年       | 4.5268%  | 0.0009% | 1.0510% | 0.0000% | 3.4758%  | 0.0009% |
| 过去五年       | 8.7345%  | 0.0011% | 1.7510% | 0.0000% | 6.9835%  | 0.0011% |
| 过去七年       | 13.9523% | 0.0013% | 2.4519% | 0.0000% | 11.5004% | 0.0013% |
| 过去十年       | 25.7932% | 0.0024% | 3.5019% | 0.0000% | 22.2913% | 0.0024% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.2454% | 0.0028% | 3.9401% | 0.0000% | 27.3053% | 0.0028% |

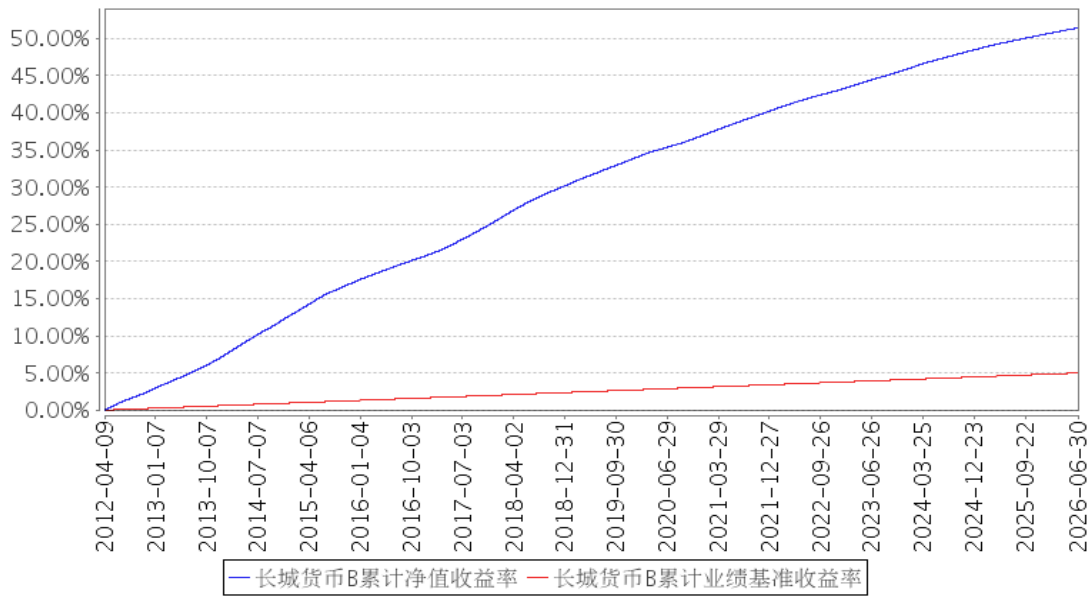
注： 本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

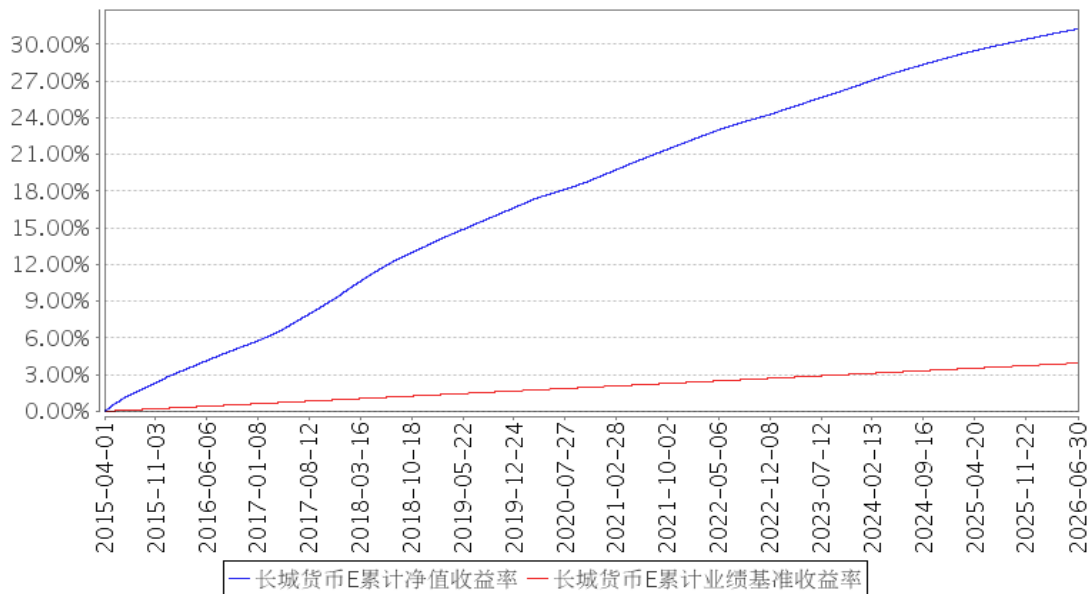
长城货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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：①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%。

②本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 3 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2001 年 12 月 27 日，是经中国证监会批

准设立的第十五家公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，初始注册资本为人民币壹亿元。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司股权结构变更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%），该股权结构稳定不变至今。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至人民币壹亿伍仟万元。

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 128 只开放式基金，产品线涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、养老 FOF 以及 QDII 等各个类型，曾多次获得金牛奖、英华奖、明星基金奖等业内大奖。

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 | 公司总经理助理、现金管理部总经理、本基金的基金经理 | 2011 年 10 月 19 日 | -    | 17 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。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、固定收益投资部总经理，现任公司总经理助理、现金管理部总经理。自 2022 年 8 月至 2023 年 8 月任“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 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 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，自 2023 年 2 月至今任“长城鑫利 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金”基金经理，自 2024 年 6 月至今任“长城月月鑫 30 天持有期纯债债券型证券投资基金”基金经 |

|     |            |                 |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----|------------|-----------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |            |                 |   |      | 理。                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 洪利平 | 本基金的基金经理   | 2025 年 7 月 11 日 | - | 17 年 | 女，中国籍，硕士。曾就职于生命人寿保险股份有限公司（2009 年 4 月-2010 年 6 月）、金鹰基金管理有限公司（2010 年 7 月-2015 年 8 月）、银华基金管理股份有限公司（2015 年 8 月-2024 年 8 月）。2024 年 9 月加入长城基金管理有限公司。自 2025 年 4 月至今任“长城工资宝货币市场基金”基金经理，自 2025 年 7 月至今任“长城货币市场证券投资基金”基金经理。                                                                      |
| 蒋雨琪 | 本基金的基金经理助理 | 2025 年 9 月 3 日  | - | 6 年  | 男，中国籍，硕士。曾任宏信证券债券交易员（2020 年 7 月-2021 年 7 月），2021 年 7 月加入长城基金管理有限公司，历任债券交易员，自 2025 年 9 月至今任“长城货币市场证券投资基金”“长城收益宝货币市场基金”“长城工资宝货币市场基金”“长城短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”“长城鑫利 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金”“长城月月鑫 30 天持有期纯债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”“长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金”基金经理助理。 |

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从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 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

2026 年上半年中国经济相对平稳。出口持续超预期，AI 产业链蓬勃发展，但国内有效需求不足，基建和房地产持续拖累固定资产投资。通胀受原油价格飙升影响短期走高，但也进一步冲击内需。市场方面，海内外共振，在业绩驱动下，权益市场走出耀眼的科技牛大行情，但传统板块低迷，呈现明显的 K 型分化。债市方面，年初中长期国债收益率冲高后持续修复，随后进入震荡区间。信用债供给紧缺格局仍未见改善，但 6 月起评级下调潮来临，弱资质信用债估值调整幅度偏大，信用下沉策略性价比降低。

回顾我们上半年的操作，总体看来较为积极。经过主动研判，努力应对，较好地把握住了短券收益率下行的行情，在利率高点加大了长久期存单的投资，业绩较好。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城货币 A 基金份额净值收益率为 0.4637%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%；长城货币 B 基金份额净值收益率为 0.5833%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%；长城货币 E 基金份额净值收益率为 0.5383%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济增速尚可，但二季度降速较快，名义增速有待进一步修复。展望下半年，我们将重点关注一系列“扩内需”政策落地效果，跟踪 AI 产业链景气度，跟进未来宏观调控政策的力度和节奏以及股债商等大类资产走势。货币政策方面，央行将维持“适度宽松”的基调，呵护资金面平稳，债市仍处于相对有利的环境中。我们将在保持组合流动性安全的前提下，努力抓住收益或有冲高的配置机会，提高组合的收益水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设立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、投资总监、固收投资总监、分管估值业务副总经理、督察长、运行保障部负责人、风险管理部负责人、相关研究部门负责人、基金会计等岗位资深人员组成，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。投资总监和相关研究部门负责人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。基金经理可以列席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城货币市场证券投资基金基金合同》规定，通常情况下，本基金按月结转收益到投资者基金账户；此外，经基金管理人和销售机构双方协商一致后，本基金的收益支付方式可以采用按日结转收益，本基金收益分配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 319,808,506.91 元，已分配利润人民币 319,808,506.91 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 38,318,381,081.65      | 29,445,996,941.41        |
| 结算备付金    |         | 1,333,508.87           | 415,260.45               |
| 存出保证金    |         | 13,980.54              | 22,758.61                |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 26,256,328,513.17      | 37,657,919,695.69        |
| 其中：股票投资  |         | -                      | -                        |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | 26,256,328,513.17      | 37,657,919,695.69        |
| 资产支持证券投资 |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                      | -                        |
| 其他投资     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产   | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 3,296,380,275.21       | 5,640,567,148.70         |
| 债权投资     | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 其中：债券投资  |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资 |         | -                      | -                        |
| 其他投资     |         | -                      | -                        |
| 其他债权投资   | 6.4.7.6 | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | -                      | -                        |
| 应收清算款    |         | -                      | -                        |
| 应收股利     |         | -                      | -                        |
| 应收申购款    |         | 42,727.70              | 564,641.85               |

|           |          |                        |                          |
|-----------|----------|------------------------|--------------------------|
| 递延所得税资产   |          | -                      | -                        |
| 其他资产      | 6.4.7.8  | -                      | -                        |
| 资产总计      |          | 67,872,480,087.14      | 72,745,486,446.71        |
| 负债和净资产    | 附注号      | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
| 负 债:      |          |                        |                          |
| 短期借款      |          | -                      | -                        |
| 交易性金融负债   |          | -                      | -                        |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3  | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款 |          | 1,607,065,909.87       | 2,005,114,954.25         |
| 应付清算款     |          | -                      | -                        |
| 应付赎回款     |          | 657,891.68             | 5,299.35                 |
| 应付管理人报酬   |          | 18,172,273.34          | 19,917,020.98            |
| 应付托管费     |          | 5,506,749.49           | 6,035,460.89             |
| 应付销售服务费   |          | 13,552,771.68          | 14,824,397.92            |
| 应付投资顾问费   |          | -                      | -                        |
| 应交税费      |          | 1,226,061.01           | 1,208,425.61             |
| 应付利润      |          | -                      | -                        |
| 递延所得税负债   |          | -                      | -                        |
| 其他负债      | 6.4.7.9  | 316,262.75             | 418,929.13               |
| 负债合计      |          | 1,646,497,919.82       | 2,047,524,488.13         |
| 净资产:      |          |                        |                          |
| 实收基金      | 6.4.7.10 | 66,225,982,167.32      | 70,697,961,958.58        |
| 其他综合收益    | 6.4.7.11 | -                      | -                        |
| 未分配利润     | 6.4.7.12 | -                      | -                        |
| 净资产合计     |          | 66,225,982,167.32      | 70,697,961,958.58        |
| 负债和净资产总计  |          | 67,872,480,087.14      | 72,745,486,446.71        |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 66,225,982,167.32 份，其中长城货币 A 基金份额总额 64,688,627,619.36 份，基金份额净值 1.0000 元；长城货币 B 基金份额总额 75,319,639.87 份，基金份额净值 1.0000 元；长城货币 E 基金份额总额 1,462,034,908.09 份，基金份额净值 1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目     | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|---------|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入 |     | 556,028,371.50                           | 677,682,646.74                                |
| 1. 利息收入 |     | 302,185,394.33                           | 317,845,831.47                                |



|                                 |            |                |                |
|---------------------------------|------------|----------------|----------------|
| 其中：存款利息收入                       | 6.4.7.13   | 276,661,179.34 | 193,088,304.35 |
| 债券利息收入                          |            | -              | -              |
| 资产支持证券<br>利息收入                  |            | -              | -              |
| 买入返售金融<br>资产收入                  |            | 25,524,214.99  | 124,757,527.12 |
| 其他利息收入                          |            | -              | -              |
| 2. 投资收益（损失以<br>“-”填列）           |            | 253,842,977.17 | 359,836,815.27 |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.14   | -              | -              |
| 基金投资收益                          |            | -              | -              |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.15   | 253,842,977.17 | 359,836,815.27 |
| 资产支持证券<br>投资收益                  | 6.4.7.16   | -              | -              |
| 贵金属投资收<br>益                     | 6.4.7.17   | -              | -              |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.18   | -              | -              |
| 股利收益                            | 6.4.7.19   | -              | -              |
| 以摊余成本计<br>量的金融资产终止确<br>认产生的收益   |            | -              | -              |
| 其他投资收益                          |            | -              | -              |
| 3. 公允价值变动收益<br>（损失以“-”号填<br>列）  | 6.4.7.20   | -              | -              |
| 4. 汇兑收益（损失以<br>“-”号填列）          |            | -              | -              |
| 5. 其他收入（损失以<br>“-”号填列）          | 6.4.7.21   | -              | -              |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 236,219,864.59 | 249,122,624.56 |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 112,608,457.27 | 116,386,065.18 |
| 其中：暂估管理人报<br>酬                  |            | -              | -              |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 34,123,774.97  | 35,268,504.57  |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | 83,973,278.79  | 86,665,696.29  |
| 4. 投资顾问费                        |            | -              | -              |
| 5. 利息支出                         |            | 5,357,689.16   | 10,523,983.97  |
| 其中：卖出回购金融<br>资产支出               |            | 5,357,689.16   | 10,523,983.97  |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.22   | -              | -              |
| 7. 税金及附加                        |            | 28,003.46      | 150,428.61     |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.23   | 128,660.94     | 127,945.94     |
| <b>三、利润总额（亏损<br/>总额以“-”号填列）</b> |            | 319,808,506.91 | 428,560,022.18 |

|                   |  |                |                |
|-------------------|--|----------------|----------------|
| 减：所得税费用           |  | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 319,808,506.91 | 428,560,022.18 |
| 五、其他综合收益的税后净额     |  | -              | -              |
| 六、综合收益总额          |  | 319,808,506.91 | 428,560,022.18 |

6.3 净资产变动表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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                           | 70,697,961,958.58                     | -      | -              | 70,697,961,958.58  |
| 加：会计政策变更                            | -                                     | -      | -              | -                  |
| 前期差错更正                              | -                                     | -      | -              | -                  |
| 其他                                  | -                                     | -      | -              | -                  |
| 二、本期期初净资产                           | 70,697,961,958.58                     | -      | -              | 70,697,961,958.58  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -                                     | -      | -              | -                  |
|                                     | 4,471,979,791.26                      |        |                | 4,471,979,791.26   |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -      | 319,808,506.91 | 319,808,506.91     |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -                                     | -      | -              | -                  |
|                                     | 4,471,979,791.26                      |        |                | 4,471,979,791.26   |
| 其中：1. 基金申购款                         | 301,265,918,293.48                    | -      | -              | 301,265,918,293.48 |
| 2. 基金赎回款                            | -                                     | -      | -              | -                  |
|                                     | 305,737,898,084.                      |        |                | 305,737,898,084.   |

|                                          |                                            |        |                 |                        |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|-----------------|------------------------|
|                                          | 74                                         |        |                 | 74                     |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                          | -      | -319,808,506.91 | -319,808,506.91        |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                          | -      | -               | -                      |
| 四、本期期末净资产                                | 66,225,982,167.3<br>2                      | -      | -               | 66,225,982,167.3<br>2  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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                                | 69,089,262,558.1<br>6                      | -      | -               | 69,089,262,558.1<br>6  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -               | -                      |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -               | -                      |
| 其他                                       | -                                          | -      | -               | -                      |
| 二、本期期初净资产                                | 69,089,262,558.1<br>6                      | -      | -               | 69,089,262,558.1<br>6  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 479,879,302.02                             | -      | -               | 479,879,302.02         |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 428,560,022.18  | 428,560,022.18         |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 479,879,302.02                             | -      | -               | 479,879,302.02         |
| 其中：1. 基金申购款                              | 292,761,453,890.<br>04                     | -      | -               | 292,761,453,890.<br>04 |
| 2. 基金                                    | -                                          | -      | -               | -                      |

|                                          |                    |   |                 |                    |
|------------------------------------------|--------------------|---|-----------------|--------------------|
| 赎回款                                      | 292,281,574,588.02 |   |                 | 292,281,574,588.02 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                  | - | -428,560,022.18 | -428,560,022.18    |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                  | - | -               | -                  |
| 四、本期期末净资产                                | 69,569,141,860.18  | - | -               | 69,569,141,860.18  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

祝函

刘沛

李志朋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

本基金自 2012 年 4 月 6 日起增设 B 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额，自 2015 年 4 月 1 日起增设 E 类基金份额。

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。根据当前市场的实际情况以及相关法律法规的规定，长城货币市场证券投资基金的组合

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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### （1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营

契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## （2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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。

## （3）个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个

人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,010,604,046.66       |
| 等于：本金          | 2,009,774,992.38       |
| 加：应计利息         | 829,054.28             |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | 36,307,777,034.99      |
| 等于：本金          | 36,174,000,000.00      |
| 加：应计利息         | 133,777,034.99         |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | 4,309,895,834.21       |
| 存款期限 3 个月以上    | 31,997,881,200.78      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 38,318,381,081.65      |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 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 | 212,293,472.53         | 212,405,422.48    | 111,949.95   | 0.0002  |
|        | 银行间市场 | 26,044,035,040.64      | 26,052,588,196.14 | 8,553,155.50 | 0.0129  |
|        | 合计    | 26,256,328,513.17      | 26,264,993,618.62 | 8,665,105.45 | 0.0131  |
| 资产支持证券 |       | -                      | -                 | -            | -       |
| 合计     |       | 26,256,328,513.17      | 26,264,993,618.62 | 8,665,105.45 | 0.0131  |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                      | -         |
| 银行间市场 | 3,296,380,275.21       | -         |
| 合计    | 3,296,380,275.21       | -         |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。



6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|--------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金  | -                      |
| 应付赎回费        | -                      |
| 应付证券出借违约金    | -                      |
| 应付交易费用       | 196,466.27             |
| 其中：交易所市场     | -                      |
| 银行间市场        | 196,466.27             |
| 应付利息         | -                      |
| 预提审计费        | 49,588.57              |
| 预提信息披露费      | 59,507.37              |
| 预提上清所债券账户维护费 | 4,800.00               |
| 预提中债登债券账户维护费 | 4,500.00               |
| 其他应付款        | 1,400.54               |
| 合计           | 316,262.75             |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城货币 A

| 项目 | 本期                              |      |
|----|---------------------------------|------|
|    | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |      |
|    | 基金份额（份）                         | 账面金额 |

|               |                     |                     |
|---------------|---------------------|---------------------|
| 上年度末          | 68,886,445,099.21   | 68,886,445,099.21   |
| 本期申购          | 283,089,970,375.97  | 283,089,970,375.97  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -287,287,787,855.82 | -287,287,787,855.82 |
| 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           | 64,688,627,619.36   | 64,688,627,619.36   |

长城货币 B

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额(份)                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 42,877,116.41                         | 42,877,116.41  |
| 本期申购          | 60,772,803.50                         | 60,772,803.50  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -28,330,280.04                        | -28,330,280.04 |
| 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           | 75,319,639.87                         | 75,319,639.87  |

长城货币 E

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                    |
|---------------|---------------------------------------|--------------------|
|               | 基金份额(份)                               | 账面金额               |
| 上年度末          | 1,768,639,742.96                      | 1,768,639,742.96   |
| 本期申购          | 18,115,175,114.01                     | 18,115,175,114.01  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -18,421,779,948.88                    | -18,421,779,948.88 |
| 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           | 1,462,034,908.09                      | 1,462,034,908.09   |

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 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 |
|----------|-------|-------|---------|
| 上年度末     | -     | -     | -       |
| 加：会计政策变更 | -     | -     | -       |

|                |                 |   |                 |
|----------------|-----------------|---|-----------------|
| 前期差错更正         | -               | - | -               |
| 其他             | -               | - | -               |
| 本期期初           | -               | - | -               |
| 本期利润           | 310,294,392.44  | - | 310,294,392.44  |
| 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        | -310,294,392.44 | - | -310,294,392.44 |
| 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           | -           | -     | -           |
| 加：会计政策变更       | -           | -     | -           |
| 前期差错更正         | -           | -     | -           |
| 其他             | -           | -     | -           |
| 本期期初           | -           | -     | -           |
| 本期利润           | 271,034.92  | -     | 271,034.92  |
| 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        | -271,034.92 | -     | -271,034.92 |
| 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           | -             | -     | -             |
| 加：会计政策变更       | -             | -     | -             |
| 前期差错更正         | -             | -     | -             |
| 其他             | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 9,243,079.55  | -     | 9,243,079.55  |
| 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        | -9,243,079.55 | -     | -9,243,079.55 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

注：本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配。

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|           | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 17,274,563.38                   |
| 定期存款利息收入  | 259,385,044.88                  |
| 其他存款利息收入  | —                               |
| 结算备付金利息收入 | 684.47                          |
| 其他        | 886.61                          |
| 合计        | 276,661,179.34                  |

#### 6.4.7.14 股票投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 251,636,543.87             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,206,433.30               |
| 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                           | 253,842,977.17             |

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 45,430,069,541.67          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 45,377,485,871.67          |
| 减：应计利息总额               | 50,377,236.70              |
| 减：交易费用                 | —                          |
| 买卖债券差价收入               | 2,206,433.30               |

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

注：无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

注：无。

6.4.7.21 其他收入

注：无。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|            | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------|
| 审计费用       | 49,588.57                       |
| 信息披露费      | 59,507.37                       |
| 证券出借违约金    | —                               |
| 其他         | 665.00                          |
| 上清所债券账户服务费 | 9,600.00                        |
| 中债登债券账户服务费 | 9,000.00                        |
| 上清所查询费     | 300.00                          |
| 合计         | 128,660.94                      |

#### 6.4.7.24 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期无与对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系             |
|--------------------|---------------------|
| 长城基金管理有限公司（“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     |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费       | 112,608,457.27                           | 116,386,065.18                                |
| 其中：应支付销售机构的客户维<br>护费 | 56,146,122.57                            | 57,970,012.74                                 |
| 应支付基金管理人的净管理费        | 56,462,334.70                            | 58,416,052.44                                 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times\text{管理费费率}\div\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 34,123,774.97                            | 35,268,504.57                                 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计

算方法如下：

$$H=E\times\text{托管费费率}\div\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |        |           |            |
|----------------|---------------------------------|--------|-----------|------------|
|                | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |        |           |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |        |           |            |
|                | 长城货币 A                          | 长城货币 B | 长城货币 E    | 合计         |
| 长城基金管理有限公司     | 104,251.84                      | 939.18 | 67.88     | 105,258.90 |
| 长城证券           | 3,603.55                        | -      | -         | 3,603.55   |
| 东方证券           | 30.77                           | -      | -         | 30.77      |
| 华夏银行           | 14,740.69                       | 32.82  | 27,714.62 | 42,488.13  |
| 合计             | 122,626.85                      | 972.00 | 27,782.50 | 151,381.35 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |        |           |            |
|                | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |           |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |        |           |            |
|                | 长城货币 A                          | 长城货币 B | 长城货币 E    | 合计         |
| 长城基金管理有限公司     | 115,052.95                      | 403.02 | 75.80     | 115,531.77 |
| 长城证券           | 4,316.01                        | -      | -         | 4,316.01   |
| 东方证券           | 117.31                          | -      | -         | 117.31     |
| 华夏银行           | 11,604.74                       | 303.91 | 35,963.37 | 47,872.02  |
| 合计             | 131,091.01                      | 706.93 | 36,039.17 | 167,837.11 |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。销售服务费按该类基金份额前一日资产净值的销售服务费年费率计提。计算公式如下：

$$H=E\times\text{该类基金份额销售服务费年费率}\div\text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。



6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月<br>30 日 |          | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------------------------|----------|--------------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                                     | 当期利息收入   | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 华夏银行  | 793,036.43                               | 2,052.03 | 1,298,466.33                               | 17,851.43 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 长城货币 A           |                   |              |                |    |
|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 310,294,392.44   | -                 | -            | 310,294,392.44 | -  |
| 长城货币 B           |                   |              |                |    |
| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 271,034.92       | -                 | -            | 271,034.92     | -  |
| 长城货币 E           |                   |              |                |    |
| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 9,243,079.55     | -                 | -            | 9,243,079.55   | -  |

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 1,607,065,909.87 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<br>单价 | 数量（张）      | 期末估值总额           |
|-----------|--------------------|-------------------|------------|------------|------------------|
| 112605180 | 26 建设银行<br>行 CD180 | 2026 年 7 月<br>1 日 | 98.92      | 1,100,000  | 108,814,087.93   |
| 160213    | 16 国开 13           | 2026 年 7 月<br>1 日 | 102.82     | 2,800,000  | 287,901,849.57   |
| 210208    | 21 国开 08           | 2026 年 7 月<br>1 日 | 102.57     | 1,000,000  | 102,567,672.29   |
| 220203    | 22 国开 03           | 2026 年 7 月<br>1 日 | 101.62     | 500,000    | 50,808,362.32    |
| 220402    | 22 农发 02           | 2026 年 7 月<br>1 日 | 101.70     | 4,000,000  | 406,808,403.67   |
| 240403    | 24 农发 03           | 2026 年 7 月<br>1 日 | 101.19     | 1,000,000  | 101,188,794.62   |
| 250431    | 25 农发 31           | 2026 年 7 月<br>1 日 | 101.22     | 6,402,000  | 648,026,296.12   |
| 合计        |                    |                   |            | 16,802,000 | 1,706,115,466.52 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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“期末本基金持有的流通受限证券”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“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

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账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 年 6 月<br>30 日 | 1 个月以内            | 1-3 个月            | 3 个月-1 年          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计                |
|---------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------|-------|---------------|-------------------|
| 资产                        |                   |                   |                   |       |       |               |                   |
| 货币资金                      | 6,221,866,713.78  | 15,715,375,198.45 | 16,381,139,169.42 | -     | -     | -             | 38,318,381,081.65 |
| 结算备付金                     | 1,333,508.87      | -                 | -                 | -     | -     | -             | 1,333,508.87      |
| 存出保证金                     | 13,980.54         | -                 | -                 | -     | -     | -             | 13,980.54         |
| 交易性金融资产                   | 1,463,471,780.20  | 11,086,510,014.77 | 13,706,346,718.20 | -     | -     | -             | 26,256,328,513.17 |
| 买入返售金融资产                  | 3,296,380,275.21  | -                 | -                 | -     | -     | -             | 3,296,380,275.21  |
| 应收申购款                     | -                 | -                 | -                 | -     | -     | 42,727.70     | 42,727.70         |
| 资产总计                      | 10,983,066,258.60 | 26,801,885,213.22 | 30,087,485,887.62 | -     | -     | 42,727.70     | 67,872,480,087.14 |
| 负债                        |                   |                   |                   |       |       |               |                   |
| 应付赎回款                     | -                 | -                 | -                 | -     | -     | 657,891.68    | 657,891.68        |
| 应付管理人报酬                   | -                 | -                 | -                 | -     | -     | 18,172,273.34 | 18,172,273.34     |
| 应付托管费                     | -                 | -                 | -                 | -     | -     | 5,506,749.49  | 5,506,749.49      |
| 卖出回购金融资产款                 | 1,607,065,909.87  | -                 | -                 | -     | -     | -             | 1,607,065,909.87  |
| 应付销售服务费                   | -                 | -                 | -                 | -     | -     | 13,552,771.68 | 13,552,771.68     |
| 应交税费                      | -                 | -                 | -                 | -     | -     | 1,226,061.01  | 1,226,061.01      |
| 其他负债                      | -                 | -                 | -                 | -     | -     | 316,262.75    | 316,262.75        |
| 负债总计                      | 1,607,065,909.87  | -                 | -                 | -     | -     | 39,432,009.95 | 1,646,497,919.82  |
| 利率敏感度缺口                   | 9,376,000,348.73  | 26,801,885,213.22 | 30,087,485,887.62 | -     | -     | -             |                   |
| 上年度末                      | 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                |

|                     |                   |                   |                   |   |   |                |                   |
|---------------------|-------------------|-------------------|-------------------|---|---|----------------|-------------------|
| 2025 年 12 月<br>31 日 |                   |                   |                   |   |   |                |                   |
| 资产                  |                   |                   |                   |   |   |                |                   |
| 货币资金                | 5,033,628,628.76  | 10,240,064,545.27 | 14,172,303,767.38 | - | - | -              | 29,445,996,941.41 |
| 结算备付金               | 415,260.45        | -                 | -                 | - | - | -              | 415,260.45        |
| 存出保证金               | 22,758.61         | -                 | -                 | - | - | -              | 22,758.61         |
| 交易性金融资产             | 4,008,212,032.88  | 9,844,800,299.13  | 23,804,907,363.68 | - | - | -              | 37,657,919,695.69 |
| 买入返售金融资产            | 5,640,567,148.70  | -                 | -                 | - | - | -              | 5,640,567,148.70  |
| 应收申购款               | -                 | -                 | -                 | - | - | -564,641.85    | 564,641.85        |
| 资产总计                | 14,682,845,829.40 | 20,084,864,834.40 | 37,977,211,131.06 | - | - | -564,641.85    | 72,745,486,446.71 |
| 负债                  |                   |                   |                   |   |   |                |                   |
| 应付赎回款               | -                 | -                 | -                 | - | - | -5,299.35      | 5,299.35          |
| 应付管理人报酬             | -                 | -                 | -                 | - | - | -19,917,020.98 | 19,917,020.98     |
| 应付托管费               | -                 | -                 | -                 | - | - | -6,035,460.89  | 6,035,460.89      |
| 卖出回购金融资产款           | 2,005,114,954.25  | -                 | -                 | - | - | -              | 2,005,114,954.25  |
| 应付销售服务费             | -                 | -                 | -                 | - | - | -14,824,397.92 | 14,824,397.92     |
| 应交税费                | -                 | -                 | -                 | - | - | -1,208,425.61  | 1,208,425.61      |
| 其他负债                | -                 | -                 | -                 | - | - | -418,929.13    | 418,929.13        |
| 负债总计                | 2,005,114,954.25  | -                 | -                 | - | - | -42,409,533.88 | 2,047,524,488.13  |
| 利率敏感度缺口             | 12,677,730,875.15 | 20,084,864,834.40 | 37,977,211,131.06 | - | - | -              | -                 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2026 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 24,616,159.40               | 33,998,469.63          |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -24,551,908.66              | -33,915,930.85         |

|  |     |  |  |
|--|-----|--|--|
|  | 个基点 |  |  |
|--|-----|--|--|

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

6.4.13.4.3.2 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。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
|---------------|------------------------|--------------------------|

|      |                   |                   |
|------|-------------------|-------------------|
| 第一层次 | -                 | -                 |
| 第二层次 | 26,256,328,513.17 | 37,657,919,695.69 |
| 第三层次 | -                 | -                 |
| 合计   | 26,256,328,513.17 | 37,657,919,695.69 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                    | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资                | 26,256,328,513.17 | 38.68         |
|    | 其中：债券                 | 26,256,328,513.17 | 38.68         |
|    | 资产支持证券                | -                 | -             |
| 2  | 买入返售金融资产              | 3,296,380,275.21  | 4.86          |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                 | -             |
| 3  | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 38,319,714,590.52 | 56.46         |
| 4  | 其他各项资产                | 56,708.24         | 0.00          |
| 5  | 合计                    | 67,872,480,087.14 | 100.00        |

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例（%）    |               |
|----|--------------|------------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 0.98             |               |
|    | 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 | 1,607,065,909.87 | 2.43          |
|    | 其中：买断式回购融资   | —                | —             |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 118 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 119 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 87  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生违规超过 120 天的情况。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 16.56              | 2.43               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 12.49              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 26.93              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 3.06               | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 43.18              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 合计 |                        | 102.22             | 2.43               |



#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 公允价值              | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 国家债券                 | -                 | -             |
| 2  | 央行票据                 | -                 | -             |
| 3  | 金融债券                 | 2,137,267,956.08  | 3.23          |
|    | 其中：政策性金融债            | 1,627,465,676.66  | 2.46          |
| 4  | 企业债券                 | 212,293,472.53    | 0.32          |
| 5  | 企业短期融资券              | 633,038,146.80    | 0.96          |
| 6  | 中期票据                 | 143,708,355.48    | 0.22          |
| 7  | 同业存单                 | 23,130,020,582.28 | 34.93         |
| 8  | 其他                   | -                 | -             |
| 9  | 合计                   | 26,256,328,513.17 | 39.65         |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                 | -             |

#### 7.6 期末按公允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)  | 公允价值 (元)       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|-------------------|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 250431    | 25 农发 31          | 6,700,000 | 678,190,594.19 | 1.02          |
| 2  | 112695857 | 26 长沙银行 CD093     | 6,000,000 | 598,846,286.41 | 0.90          |
| 3  | 112608161 | 26 中信银行 CD161     | 6,000,000 | 598,055,834.21 | 0.90          |
| 4  | 112585539 | 25 青岛银行 CD076     | 6,000,000 | 596,014,890.62 | 0.90          |
| 5  | 112604004 | 26 中国银行 CD004     | 6,000,000 | 595,528,877.32 | 0.90          |
| 6  | 112695989 | 26 广州农村商业银行 CD055 | 6,000,000 | 594,431,899.77 | 0.90          |
| 7  | 112605150 | 26 建设银行 CD150     | 6,000,000 | 593,990,083.63 | 0.90          |
| 8  | 112599686 | 25 中原银行 CD167     | 5,000,000 | 499,635,042.24 | 0.75          |
| 9  | 112696012 | 26 广州银行           | 5,000,000 | 498,963,244.17 | 0.75          |

|    |           |                     |           |                |      |
|----|-----------|---------------------|-----------|----------------|------|
|    |           | CD080               |           |                |      |
| 10 | 112585557 | 25 重庆农村<br>商行 CD175 | 5,000,000 | 498,781,066.13 | 0.75 |

7.7 “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                   | 0.0280% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0091% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0178% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内负偏离度的绝对值未发生达到或超过 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内正偏离度的绝对值未发生达到或超过 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金按照实际利率法计算金融资产的账面价值，并使用影子定价和偏离度加以控制。

7.9.2 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农业发展银行、中信银行股份有限公司、青岛银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、重庆农村商业银行股份有限公司发行主体外，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。

中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到处罚。

中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

青岛银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

重庆农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 13,980.54 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收利息  | -         |
| 4  | 应收申购款 | 42,727.70 |
| 5  | 其他应收款 | -         |
| 6  | 待摊费用  | -         |
| 7  | 其他    | -         |
| 8  | 合计    | 56,708.24 |

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级<br>别     | 持有人户<br>数（户） | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构          |                       |                   |                       |
|--------------|--------------|---------------|----------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|
|              |              |               | 机构投资者          |                       | 个人投资者             |                       |
|              |              |               | 持有份额           | 占总<br>份额<br>比例<br>（%） | 持有份额              | 占总<br>份额<br>比例<br>（%） |
| 长 城 货<br>币 A | 8,028,302    | 8,057.57      | 12,085,637.67  | 0.02                  | 64,676,541,981.69 | 99.98                 |
| 长 城 货<br>币 B | 8            | 9,414,954.98  | 52,693,987.26  | 69.96                 | 22,625,652.61     | 30.04                 |
| 长 城 货<br>币 E | 51,961       | 28,137.16     | 78,822,616.59  | 5.39                  | 1,383,212,291.50  | 94.61                 |
| 合 计          | 8,080,271    | 8,196.01      | 143,602,241.52 | 0.22                  | 66,082,379,925.80 | 99.78                 |

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

8.2 期末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    | 42,759,944.81 | 0.06      |
| 2  | 个人    | 38,864,410.60 | 0.06      |
| 3  | 其他机构  | 22,414,953.71 | 0.03      |
| 4  | 其他机构  | 21,810,205.91 | 0.03      |
| 5  | 其他机构  | 20,547,643.60 | 0.03      |
| 6  | 个人    | 20,093,614.63 | 0.03      |

|    |      |               |      |
|----|------|---------------|------|
| 7  | 个人   | 17,640,647.24 | 0.03 |
| 8  | 其他机构 | 17,426,866.45 | 0.03 |
| 9  | 个人   | 16,979,560.62 | 0.03 |
| 10 | 个人   | 16,564,109.98 | 0.03 |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别   | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|--------|--------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 长城货币 A | 3,836,697.70 | 0.0059      |
|                  | 长城货币 B | —            | —           |
|                  | 长城货币 E | 245.20       | 0.0000      |
|                  | 合计     | 3,836,942.90 | 0.0058      |

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）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 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 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                         | 68,886,445,099.21 | 42,877,116.41 | 1,768,639,742.96 |

|               |                    |               |                   |
|---------------|--------------------|---------------|-------------------|
| 基金份额总额        |                    |               |                   |
| 本报告期基金总申购份额   | 283,089,970,375.97 | 60,772,803.50 | 18,115,175,114.01 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 287,287,787,855.82 | 28,330,280.04 | 18,421,779,948.88 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | —                  | —             | —                 |
| 本报告期期末基金份额总额  | 64,688,627,619.36  | 75,319,639.87 | 1,462,034,908.09  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动：

（1）自 2026 年 3 月 25 日起，邱春杨不再担任公司总经理，聘任祝函为公司总经理，同时解聘其公司督察长职务。在公司新任督察长正式任职之前，由祝函代为履行公司督察长职务。

（2）自 2026 年 6 月 23 日起，李建军正式任职公司督察长，祝函不再代为履行督察长职务。

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，本基金托管人于 2026 年 3 月 12 日发布公告，朱绍纲先生自 2026 年 3 月 9 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，陈秀良先生自 2026 年 3 月 16 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 6 月 22 日发布公告，赵伟婧女士自 2026 年 6 月 22 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人未有受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注  |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|-----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |     |
| 长城证券 | 2      | —    | —                | —         | —              | 未变更 |
| 东方证券 | 1      | —    | —                | —         | —              | 未变更 |
| 银河证券 | 1      | —    | —                | —         | —              | 未变更 |

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

公司设立了券商服务评价协调小组，建立了完善的证券公司选择、协议签署、证券公司服务评价、交易佣金分配等的管理机制和流程，并禁止上述业务环节与证券公司的基金销售规模、保有规模挂钩，且基金销售业务人员不得参与上述业务环节。督察长对上述业务环节进行合规性审查。

1、选择标准

公司选择证券公司参与证券交易的标准主要包含以下几方面：

- (1) 财务状况良好，各项财务指标显示证券公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (3) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度和安全的交易环境，能有效保护客户权益；
- (4) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件、交易设施和信息服

务：

(5) 研究服务能力较强，能及时为基金提供高质量的研究咨询服务。

2、选择程序

公司选择证券公司参与证券交易的程序主要包括：

(1) 对拟入库证券公司进行审慎调查，经内部审议通过后将证券公司加入公司证券公司库；

(2) 按照公司审批流程，与证券公司签订交易单元租用或经纪服务等协议；

(3) 业务部门与证券公司办理完成交易单元租用、交易系统测试和对接等交易前准备工作，通知各相关部门和托管行启用证券公司交易。

10.7.2 基金租用或者通过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 | -              | -               | -              | -                 | -    | -               |
| 东方证券 | -              | -               | -              | -                 | -    | -               |
| 银河证券 | 191,749,669.57 | 100.00          | 360,000,000.00 | 100.00            | -    | -               |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式        | 法定披露日期          |
|----|--------------------------------------------|---------------|-----------------|
| 1  | 长城基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                   | 在证监会规定报刊和网站披露 | 2026 年 3 月 27 日 |
| 2  | 长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度） | 在证监会规定报刊和网站披露 | 2026 年 3 月 30 日 |
| 3  | 长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                    | 在证监会规定报刊和网站披露 | 2026 年 6 月 24 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日