

# 长城货币市场证券投资基金

## [2015] 第一季度报告

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

报告送出日期:2015年4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。

基金托管人和代理人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。

本基金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。

基金的过往业绩未经审计。

本报告期自2015年01月01日起至03月31日止。

### § 2 基金产品概况

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	12.64
	其中：买断式回购融资	2.59
2	报告期内债券回购融资余额	17.40
	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的简单平均值。

债券回购融资余额占基金资产净值的20%的说明

注:本基金在报告期未出现融资余额超过净资产的20%的情况。

§ 3 主要财务指标

基金名称	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
报告期末基金份额总额	6,688,923,818.97份
投资目标	本基金是足额现金类理财产品，其投资组合由现金及现金等价物构成，投资于流动性强、风险低、收益稳定的金融工具，以追求本金保值、最大限度地保护投资者的利益。
投资策略	本基金将根据宏观经济形势、政策变化、资金供求状况、金融市场运行情况，分析判断货币市场趋势，通过综合考虑资金的期限、流动性、收益水平、市场价格等，选择适当的金融工具进行投资操作。
业绩比较基准	银行同期定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是一只低风险、低收益的货币型基金，其预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金，高于货币型基金。
基金经理	无
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
基金销售机构	长城货币A 长城货币B
下属分级基金的基金简称	200003
下属分级基金的交易代码	200103
报告期末下属分级基金的份额总额	3,192,890,991.66份
报告期末下属分级基金的单位净值	1.496,032,827.31份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1. 主本期末基金资产净值	38,375,601.39
2. 本期利润	38,375,601.39
3. 期末基金资产净值	38,375,601.39
注:本期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。本期利息收入为本期公允价值变动收入，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。	24,945,360.30
4. 本期基金份额净值	1.496,032,827.31
5. 本期每万份基金净收益	0.0000%
6. 本期基金份额累计净值	1.496,032,827.31份
7. 本期基金份额净值增长率	0.0000%
8. 本期基金份额净值增长率标准差	0.0000%
9. 本期基金份额净值增长率偏离度	0.0000%
10. 本期基金份额净值增长率偏离度标准差	0.0000%
11. 本期末基金份额净值	1.496,032,827.31份
12. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
13. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
14. 本期末基金份额净值增长率偏离度	0.0000%
15. 本期末基金份额净值增长率偏离度标准差	0.0000%
16. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
17. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
18. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
19. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
20. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
21. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
22. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
23. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
24. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
25. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
26. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
27. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
28. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
29. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
30. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
31. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
32. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
33. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
34. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
35. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
36. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
37. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
38. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
39. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
40. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
41. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
42. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
43. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
44. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
45. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
46. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
47. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
48. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
49. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
50. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
51. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
52. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
53. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
54. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
55. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
56. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
57. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
58. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
59. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
60. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
61. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
62. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
63. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
64. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
65. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
66. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
67. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
68. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
69. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
70. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
71. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
72. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
73. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
74. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
75. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
76. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
77. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
78. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
79. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
80. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
81. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
82. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
83. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
84. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
85. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
86. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
87. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
88. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
89. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
90. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
91. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
92. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
93. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
94. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
95. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
96. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
97. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
98. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%
99. 本期末基金份额净值增长率标准差	0.0000%
100. 本期末基金份额净值增长率	0.0000%

注:本基金收益分配以份额折算的方式。

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

注:本基金在报告期未出现赎回情形。

3.23 本期报告期各时间段每万份基金净收益

注:本基金在报告期未持有资产支持证券。

3.24 投资组合报告

注:本基金在报告期未持有资产支持证券。

3.25 买入返售金融资产

注:本基金在报告期未持有买入返售金融资产。

3.26 贷款及应收款

注:本基金在报告期未持有贷款及应收款。

3.27 其他资产

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.28 其他负债

注:本基金在报告期未持有其他负债。

3.29 公允价值变动损益

注:本基金在报告期未持有公允价值变动损益。

3.30 资产支持证券

注:本基金在报告期未持有资产支持证券。

3.31 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.32 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.33 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.34 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.35 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.36 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.37 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.38 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.39 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.40 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.41 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.42 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.43 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.44 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.45 其他

注:本基金在报告期未持有其他资产。

3.46 其他

注:本基金在报告