

景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有 期证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38

7.6 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	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
7.8 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贵金属投资明细	39
7.9 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	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3 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	40
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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
§ 12 备查文件目录	48
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	景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
基金简称	景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	015862
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 6 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,440,366,399.62 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采用抽样复制和动态最优化的方法，选取流动性较好的标的指数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。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>1、资产配置策略 本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金跟踪标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。</p> <p>2、同业存单投资策略 本基金将对标的指数采用抽样复制法和动态最优化的方式进行投资，在综合考虑跟踪效果、操作风险、投资可行性等因素的基础上构建收益特性与标的指数收益率高度相关的投资组合，并根据基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及市场交易特性等情况，对投资组合进行优化调整。</p> <p>3、债券投资策略 在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可少量的投资于债券。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的</p>

	久期与收益率的影响。
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率(税后) \times 5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份券及其备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfmc.com
客户服务电话	4008888606	95599
传真	0755-22381339	010-68121816
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	叶才	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfmc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	64,329,210.33
本期利润	64,930,114.63
加权平均基金份额本期利润	0.0091
本期加权平均净值利润率	0.85%
本期基金份额净值增长率	0.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	500,656,892.31
期末可供分配基金份额利润	0.0673

期末基金资产净值	7,973,240,015.93
期末基金份额净值	1.0716
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	7.16%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

4、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。

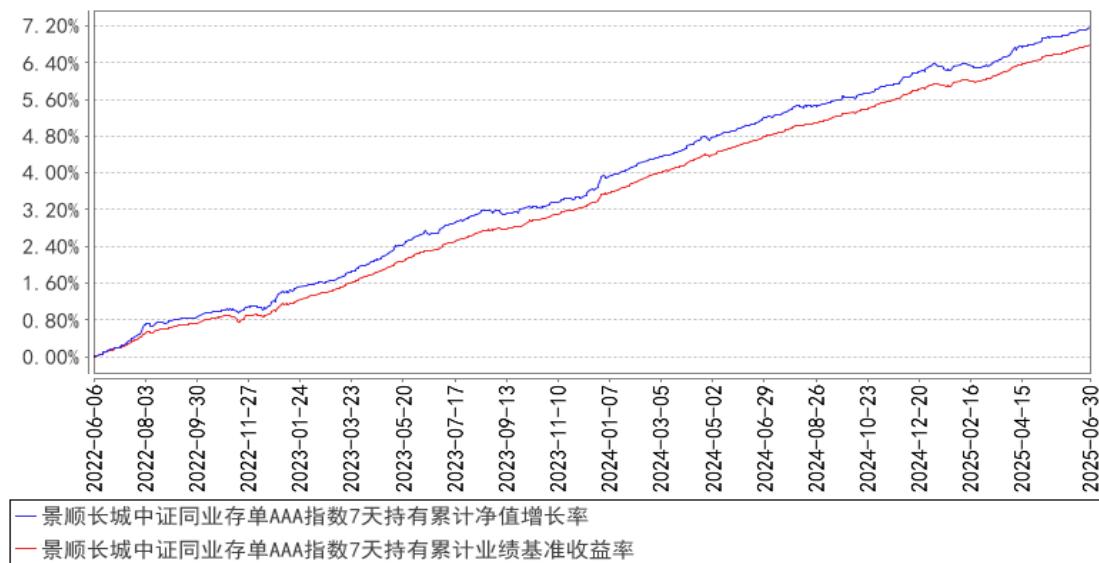
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.16%	0.01%	0.16%	0.01%	0.00%	0.00%
过去三个月	0.56%	0.02%	0.51%	0.01%	0.05%	0.01%
过去六个月	0.79%	0.02%	0.83%	0.01%	-0.04%	0.01%
过去一年	1.85%	0.02%	1.90%	0.01%	-0.05%	0.01%
过去三年	6.96%	0.02%	6.60%	0.01%	0.36%	0.01%
自基金合同生效起至今	7.16%	0.02%	6.78%	0.01%	0.38%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

景顺长城中证同业存单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：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和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的建仓期为自 2022 年 6 月 6 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字〔2003〕76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2025 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 199 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

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		
陈威霖	本基金的基金经理	2022 年 6 月 6 日	-	14 年	管理学硕士。曾任平安利顺货币经纪公司债券市场部债券经纪人。2013 年 6 月加入本公司，历任交易管理部交易员、固定收益部信用研究员，自 2016 年 4 月起担任固定收益部基金经理，现任固定收益部总经理助理、基金经理。具有 14 年证券、基金行业从业经验。
黄惠伶	本基金的基金助理	2023 年 3 月 13 日	-	7 年	管理学硕士。2018 年 7 月加入本公司，历任交易管理部交易员、固定收益部研究员。现任固定收益部基金经理助理。具有 7 年证券、基金行业从业经验。

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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合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%的交易共有 5 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的同日反向交易。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

上半年，货币政策基调经历较大变化，央行对于流动性的态度由收紧逐步放松。一季度，在稳汇率、防风险、防空转的基调下，流动性明显收敛，资金价格保持高位。受到去年 11 月非银同业存款利率自律影响，非银存款大幅下降超 4 万亿，特别是临近春节，受 MLF 到期、春节取现需求增加以及税期影响，大行负债压力在年初明显增大。但在一季度银行面临较大的流动性压力情况下，央行对冲手段相对克制，虽然去年 12 月政治局会议上货币政策重提“适度宽松”，但一季度央行并未进行降准降息操作。3 月底央行公告 MLF 中标方式的改变，标志其政策利率属性进一步淡化，从季度来看 MLF 余额仍继续下滑，当季共计回笼 9320 亿。在买断式回购操作方面，央行在前三个季度分别净投放 1.7 万亿、0.6 万亿以及 0.1 万亿，投放力度也逐步减弱。二季度，在货币政策层面，央行对于流动性的态度较一季度明显转变。5 月初，在国新办新闻发布会上央行行长宣布一揽子货币政策措施，前期市场关注度最高的降准降息终于落地，降准 50BP 同时 OMO 下调 10BP。公开市场操作方面，央行在月中税期以及月末、季末通过 OMO 投放熨平资金波动。央行于二季度提前公告当月 MLF 和买断式回购操作，有助于稳定资金面预期并支持政府债发行，从量上来看，二季度 MLF 余额大幅增长至 51500 万亿，当季共计净投放 9930 亿。在买断式回购操作方面，央行 4-6 月份分别净回笼 5000 亿、2000 亿以及净投放 2000 亿。考虑到降准 50BP 释放的约 1 万流动性，二季度央行对于中长期限流动性仍维持净投放。年初，央行公告暂停开展公开市场国债买入操作，截至半年末仍未恢复购买。

从价格上来看，一季度资金中枢大幅提升，1 月份个别时点隔夜资金价格成交在 10%以上，2、3 月份，虽然并未重现极端情形，但隔夜价格中枢始终维持在 1.8%以上，DR007 月均值也均大幅高于政策利率。二季度，受降准降息以及央行投放流动性较为充裕的影响，资金中枢较一季度明显下移。月中税期走款和 MLF 到期错位时资金面有所收敛，月末、季末逐步转为均衡，虽然该特征仍在二季度持续显现，但波动明显降低。二季度 DR007 月均值分别为 1.73%、1.60%和 1.58%，呈现逐月下行趋势，DR001 在 6 月份更是多日低于政策利率。

从同业存单市场来看，NCD 收益率先上后下，曲线仍较为平坦。春节前大行积极提价通过主

动负债弥补较大的负债缺口，而流动性异常收紧，非银卖出负 carry 资产主动去杠杆，NCD 供需矛盾集中体现，3 个月和 1 年期国股行 NCD 收益率分别从年初低点 1.54%、1.58% 快速反弹。虽然春节后资金面稍有缓和，但随着资金中枢始终维持在 1.8% 之上，货币政策宽松预期退坡，银行负债问题也未得到缓解，NCD 对资金价格重定价，3 个月国股行 NCD 继续大幅上行至 2.12%，而 1 年期 NCD 也跟随调整，在 3 月中旬上行至 2.03%，成为本轮调整的高点。之后随着银行融出逐步回升，标志着负债问题得到一定程度的解决，同时非银季末前加大配置力度，收益率从高位回落。4 月初对等关税落地后，收益率从 1.9% 高点快速下行至 1.75% 附近，此后围绕该中枢窄幅震荡。5 月初央行降准降息落地，资金中枢下行，NCD 收益跟随下行至 1.65%。后续因利好出尽带来现券收益率的反弹，同时担心存款利率调降带来的负债流失以及 6 月份 NCD 集中到期带来的供给压力，NCD 收益率从低位有所反弹，但 6 月份隔夜资金异常宽松，央行通过政策工具大量投放了中长期流动性，非银配置盘逼空后加速入场，NCD 收益率最终收于季度内低点。至半年末，3 个月 AAA 评级 NCD 收于 1.595%，持平于去年末水平，而 1 年期 NCD 较年初小幅上行约 5BP，期限利差仍维持偏低水平。

报告期内组合跟踪政策面基本面，采用抽样复制和动态优化策略，投资于标的指数中证同业存单 AAA 指数中成份券和备选成份券，严格控制与中证同业存单 AAA 指数的跟踪误差，组合整体运行情况良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.79%，业绩比较基准收益率为 0.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

流动性方面，三季度有望延续宽松。首先，最重要的还是央行态度，央行 6 月份开始已经对于买断式回购和 MLF 这些中长期限的流动性投放予提前公告，且投放时点分布在上中下旬，叠加通过 OMO 投放短期流动性，充分表明呵护资金面的态度，基本面承压阶段，央行更没有理由主动收紧。其次，4 月 25 日中央政治局会议首次提出设立新型政策性金融工具，规模约为 5000 亿元；5 月 7 日，潘行长在国新办发布会上宣布增加 3000 亿元科技创新和技术改造再贷款额度，增加支农支小再贷款额度 3000 亿元，设立 5000 亿元“服务消费与养老再贷款”，上述工具将在三季度陆续落地，这将构成基础货币投放，有助于补充市场流动性。最后，三季度银行负债压力也将有所减轻。5 月银行存款降息后，中小行调降跟随也较快，而理财收益率随市场下行，因此未出现明显的存款搬家现象。另外三季度银行同业存单月均到期基本在 3 万亿以内，政府债净融资预计也不会明显提升。从基本面和资金面角度来看，债市或仍有支撑，虽然下行空间可能有限，但上行风险也较低。虽然短期来看，央行降准降息预期较低，但跨季后隔夜资金有望维持在政策利率以

下，NCD 预计低位震荡。

组合将继续跟踪各类宏观数据，密切关注资金利率对于 NCD 的定价引导，后续将采用抽样复制策略上适当进行动态优化，以实现对指数的有效跟踪，同时控制跟踪误差。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人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，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能产生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金管理信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6. 4. 7. 1	132, 535, 077. 95	266, 342, 034. 19
结算备付金		4, 585, 662. 11	639, 106. 10
存出保证金		22, 261. 76	18, 418. 40
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	10, 913, 340, 359. 61	9, 510, 607, 148. 78
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		10, 913, 340, 359. 61	9, 510, 607, 148. 78
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	-	-
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		30, 713, 701. 49	158, 091, 770. 38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		11, 081, 197, 062. 92	9, 935, 698, 477. 85
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		3, 104, 268, 396. 20	2, 671, 942, 051. 10
应付清算款		4, 209. 90	-
应付赎回款		357, 947. 11	6, 168. 76
应付管理人报酬		1, 338, 737. 09	1, 052, 930. 15
应付托管费		334, 684. 25	263, 232. 55
应付销售服务费		1, 338, 737. 09	1, 052, 930. 15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	4, 865. 39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	314, 335. 35	396, 934. 00
负债合计		3, 107, 957, 046. 99	2, 674, 719, 112. 10
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 10	7, 440, 366, 399. 62	6, 828, 732, 267. 69
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	532, 873, 616. 31	432, 247, 098. 06
净资产合计		7, 973, 240, 015. 93	7, 260, 979, 365. 75
负债和净资产总计		11, 081, 197, 062. 92	9, 935, 698, 477. 85

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0716 元，基金份额总额 7, 440, 366, 399. 62 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		99,898,525.11	110,025,193.89
1. 利息收入		2,129,658.48	8,065,155.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,793,459.30	994,339.98
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		336,199.18	7,070,815.85
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		97,167,962.33	106,084,434.92
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	97,167,962.33	106,084,434.92
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.17	—	—
衍生工具收益	6.4.7.18	—	—
股利收益	6.4.7.19	—	—
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		—	—
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	600,904.30	-4,124,396.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	—	—
减：二、营业总支出		34,968,410.48	31,932,580.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,502,887.23	6,716,620.13
其中：暂估管理人报酬		—	—
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,875,721.85	1,679,154.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,502,887.23	6,716,620.13
4. 投资顾问费		—	—
5. 利息支出		17,926,081.67	16,639,913.39

其中：卖出回购金融资产支出		17,926,081.67	16,639,913.39
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		159.07	44.47
8. 其他费用	6.4.7.23	160,673.43	180,227.83
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		64,930,114.63	78,092,613.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		64,930,114.63	78,092,613.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		64,930,114.63	78,092,613.00

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	6,828,732,267.69	-	432,247,098.06	7,260,979,365.75
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,828,732,267.69	-	432,247,098.06	7,260,979,365.75
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	611,634,131.93	-	100,626,518.25	712,260,650.18
(一)、综合收益总额	-	-	64,930,114.63	64,930,114.63
(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)	611,634,131.93	-	35,696,403.62	647,330,535.55
其中：1. 基金申购款	12,511,318,552.02	-	810,512,336.84	13,321,830,888.86

2. 基金赎回款	-11,899,684,420.09	-	-774,815,933.22	-12,674,500,353.31
(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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	7,440,366,399.62	-	532,873,616.31	7,973,240,015.93
项目				
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日				
项目	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	7,738,475,315.51	-	305,055,716.60	8,043,531,032.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	7,738,475,315.51	-	305,055,716.60	8,043,531,032.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,448,783,920.78	-	22,642,038.17	-1,426,141,882.61
(一)、综合收益总额	-	-	78,092,613.00	78,092,613.00
(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)	-1,448,783,920.78	-	-55,450,574.83	-1,504,234,495.61
其中：1. 基金申购款	17,130,000,061.74	-	796,648,889.09	17,926,648,950.83
2. 基金赎回款	-18,578,783,982.52	-	-852,099,463.92	-19,430,883,446.44
(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)	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,289,691,394.73	-	327,697,754.77	6,617,389,149.50

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（以下简称“本基金”），系根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]1029 号文《关于准予景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2022 年 6 月 6 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 9,985,343,388.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 265,832.11 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 9,985,609,220.11 元，折合 9,985,609,220.11 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数的成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券（包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府支持债券、政府支持机构债券等）、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、现金等货币市场工具等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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

资产占基金总资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2025 年 8 月 27 日批准报出。

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管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》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 号文《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，（如有）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 号文《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，（如有）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（如适用）

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 号文《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 号文《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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	987,343.13
等于：本金	987,242.07
加：应计利息	101.06

减：坏账准备	-
定期存款	131,547,734.82
等于：本金	130,000,000.00
加：应计利息	1,547,734.82
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	131,547,734.82
存款期限 1 年（含）以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	132,535,077.95

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	673,840,903.27	8,515,421.39	679,707,421.39
	银行间市场	10,177,264,041.21	44,883,338.22	10,233,632,938.22
	合计	10,851,104,944.48	53,398,759.61	10,913,340,359.61
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,851,104,944.48	53,398,759.61	10,913,340,359.61	8,836,655.52

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

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 债券投资情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债券投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

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

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,063.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	203,792.58

其中：交易所市场	-
银行间市场	203,792.58
应付利息	-
预提费用	108,478.95
合计	314,335.35

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	6,828,732,267.69	6,828,732,267.69
本期申购	12,511,318,552.02	12,511,318,552.02
本期赎回(以“-”号填列)	-11,899,684,420.09	-11,899,684,420.09
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	7,440,366,399.62	7,440,366,399.62

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	399,448,418.55	32,798,679.51	432,247,098.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	399,448,418.55	32,798,679.51	432,247,098.06
本期利润	64,329,210.33	600,904.30	64,930,114.63
本期基金份额交易产生的变动数	36,879,263.43	-1,182,859.81	35,696,403.62
其中：基金申购款	770,350,228.77	40,162,108.07	810,512,336.84
基金赎回款	-733,470,965.34	-41,344,967.88	-774,815,933.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	500,656,892.31	32,216,724.00	532,873,616.31

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,973.81
定期存款利息收入	1,778,183.21
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,869.66
其他	432.62
合计	1,793,459.30

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	86,615,645.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,552,316.80
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	97,167,962.33

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	26,767,651,326.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,641,445,610.76
减：应计利息总额	115,461,491.20
减：交易费用	191,907.50
买卖债券差价收入	10,552,316.80

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**

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

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**

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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**

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	600,904.30
股票投资	—
债券投资	600,904.30
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	600,904.30

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,600.00
银行划款手续费	42,894.48
合计	160,673.43

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,502,887.23	6,716,620.13
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,425,264.76	3,067,113.86
应支付基金管理人的净管理费	4,077,622.47	3,649,506.27

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,875,721.85	1,679,154.94

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

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 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
	景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持 有
景顺长城基金管理有限公司	5,676.93
中国农业银行	1,495,552.10
长城证券	166,601.28
合计	1,667,830.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

		景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
景顺长城基金管理有限公司		1,484.29
中国农业银行		2,625,782.45
长城证券		149,759.63
合计		2,777,026.37

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：
日销售服务费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

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

单位：人民币元

银行间市场交易的 各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	197,393,800.00	-	-	-	680,000,000.00	43,554.80
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	基金逆回购					
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	196,234,100.00	-	-	-	142,500,000.00	6,908.24

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
中国农业银行-活期	987,343.13	12,973.81	1,990,328.32	29,569.06

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期，本基金因投资托管人发行的债券而取得的利息收入为人民币 4,357,771.98 元。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 3,000,000 张托管人发行的债券，期末账面价值为人民币 296,453,084.38 元，占基金资产净值的比例为 3.72%。（于上年度可比期间，本基金因投资托管人发行的债券而取得的利息收入为人民币 2,447,980.17 元。于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有 5,000,000 张托管人发行的债券，期末账面价值为人民币 494,498,462.20 元，占基金资产净值的比例为 6.81%。）

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2025 年 6 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 2,908,591,125.77 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112405397	24 建设银行 CD397	2025 年 7 月 1 日	99.26	1,000,000	99,262,206.03
112413164	24 深商银行 CD164	2025 年 7 月 1 日	99.25	2,327,000	230,948,254.80
112502035	25 工商银行	2025 年 7 月 1	98.99	1,000,000	98,990,263.56

	CD035	日			
112502084	25 工商银行 CD084	2025 年 7 月 1 日	98.90	2,151,000	212,742,294.20
112503084	25 农业银行 CD084	2025 年 7 月 1 日	98.88	839,000	82,956,172.35
112503122	25 农业银行 CD122	2025 年 7 月 1 日	98.73	1,000,000	98,727,540.27
112505117	25 建设银行 CD117	2025 年 7 月 1 日	98.90	1,000,000	98,903,902.47
112505140	25 建设银行 CD140	2025 年 7 月 1 日	98.85	1,000,000	98,847,903.56
112506136	25 交通银行 CD136	2025 年 7 月 1 日	98.49	852,000	83,914,122.38
112511051	25 平安银行 CD051	2025 年 7 月 1 日	99.01	3,000,000	297,015,375.00
112514058	25 江苏银行 CD058	2025 年 7 月 1 日	98.80	2,151,000	212,519,964.49
112520033	25 广发银行 CD033	2025 年 7 月 1 日	99.41	1,063,000	105,670,500.74
160210	16 国开 10	2025 年 7 月 1 日	102.02	100,000	10,201,797.26
210305	21 进出 05	2025 年 7 月 1 日	101.91	600,000	61,148,071.23
220412	22 农发 12	2025 年 7 月 1 日	101.98	100,000	10,198,013.70
230202	23 国开 02	2025 年 7 月 1 日	101.79	100,000	10,179,339.73
230405	23 农发 05	2025 年 7 月 1 日	101.27	600,000	60,759,780.82
240302	24 进出 02	2025 年 7 月 1 日	101.00	100,000	10,100,260.27
250301	25 进出 01	2025 年 7 月 1 日	100.46	650,000	65,298,198.63
250401	25 农发 01	2025 年 7 月 1 日	100.39	1,400,000	140,551,638.36
250421	25 农发 21	2025 年 7 月 1 日	100.08	500,000	50,038,205.48
112512041	25 北京银行 CD041	2025 年 7 月 7 日	98.83	2,000,000	197,652,061.37
112512050	25 北京银行 CD050	2025 年 7 月 7 日	98.74	2,000,000	197,470,978.63
112514054	25 江苏银行 CD054	2025 年 7 月 7 日	99.22	528,000	52,386,331.01
112514058	25 江苏银行	2025 年 7 月 7	98.80	130,000	12,844,070.38

	CD058	日			
112515133	25 民生银行 CD133	2025 年 7 月 7 日	99.28	840,000	83,396,541.24
112516077	25 上海银行 CD077	2025 年 7 月 7 日	99.28	2,000,000	198,562,015.30
112518028	25 华夏银行 CD028	2025 年 7 月 9 日	99.12	2,151,000	213,200,764.83
合计				31,182,000	3,094,486,568.09

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 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 195,677,270.43 元，于 2025 年 7 月 15 日前（含当日）先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 131.63%（上年度末：125.95%）。

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投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

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在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，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投资的公允价值。本基金主动

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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，并按照合约规定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月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	987,343.13	-	131,547,734.82	-	-	-	132,535,077.95
结算备付金	4,585,662.11	-	-	-	-	-	4,585,662.11
存出保证金	22,261.76	-	-	-	-	-	22,261.76
交易性金融资 产	71,439,255.89	101,892,267.40	10,689,069,345.91	50,939,490.41	-	-	10,913,340,359.61

应收申购款	-	-	-	-	-	30,713,701.49	30,713,701.49
资产总计	77,034,522.89	101,892,267.40	10,820,617,080.73	50,939,490.41	-	30,713,701.49	11,081,197,062.92
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	357,947.11	357,947.11
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	1,338,737.09	1,338,737.09
应付托管费	-	-	-	-	-	334,684.25	334,684.25
应付清算款	-	-	-	-	-	4,209.90	4,209.90
卖出回购金融 资产款	3,104,268,396.20	-	-	-	-	-	3,104,268,396.20
应付销售服务 费	-	-	-	-	-	1,338,737.09	1,338,737.09
其他负债	-	-	-	-	-	314,335.35	314,335.35
负债总计	3,104,268,396.20	-	-	-	-	3,688,650.79	3,107,957,046.99
利率敏感度缺 口	-3,027,233,873.31	101,892,267.40	10,820,617,080.73	50,939,490.41	-	-	-
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
货币资金	3,557,565.91	132,491,668.00	130,292,800.28	-	-	-	266,342,034.19
结算备付金	639,106.10	-	-	-	-	-	639,106.10
存出保证金	18,418.40	-	-	-	-	-	18,418.40
交易性金融资 产	-	20,322,142.08	9,439,608,683.41	50,676,323.29	-	-	9,510,607,148.78
应收申购款	-	-	-	-	-	158,091,770.38	158,091,770.38
资产总计	4,215,090.41	152,813,810.08	9,569,901,483.69	50,676,323.29	-	158,091,770.38	9,935,698,477.85
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,168.76	6,168.76
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	1,052,930.15	1,052,930.15
应付托管费	-	-	-	-	-	263,232.55	263,232.55
卖出回购金融 资产款	2,671,942,051.10	-	-	-	-	-	2,671,942,051.10
应付销售服务 费	-	-	-	-	-	1,052,930.15	1,052,930.15
应交税费	-	-	-	-	-	4,865.39	4,865.39
其他负债	-	-	-	-	-	396,934.00	396,934.00
负债总计	2,671,942,051.10	-	-	-	-	2,777,061.00	2,674,719,112.10
利率敏感度缺 口	-2,667,726,960.69	152,813,810.08	9,569,901,483.69	50,676,323.29	-	-	-

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-16,748,767.06	-16,886,177.89
	市场利率下降 25 个基点	16,805,294.12	16,949,604.30

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

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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它价格风险，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本报告期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	10,913,340,359.61	9,510,607,148.78
第三层次	-	-
合计	10,913,340,359.61	9,510,607,148.78

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,913,340,359.61	98.49
	其中：债券	10,913,340,359.61	98.49
	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	-	-
	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	137,120,740.06	1.24
8	其他各项资产	30,735,963.25	0.28
9	合计	11,081,197,062.92	100.00

注：银行存款和结算备付金合计中包含定期存款 131,547,734.82 元。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	418,475,305.48	5.25
	其中：政策性金融债	418,475,305.48	5.25
4	企业债券	679,707,421.39	8.52
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	9,815,157,632.74	123.10
9	其他	-	-
10	合计	10,913,340,359.61	136.87

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112597497	25 杭州银行 CD097	5,000,000	494,364,703.30	6.20
2	112597753	25 长沙银行 CD127	5,000,000	492,257,972.60	6.17
3	112520033	25 广发银行 CD033	4,000,000	397,631,235.16	4.99
4	112519165	25 恒丰银行 CD165	4,000,000	397,126,386.89	4.98
5	112518028	25 华夏银行 CD028	4,000,000	396,468,181.92	4.97

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局、国家外汇管理局地方分局等的处罚。

恒丰银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.12.3 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	22,261.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,713,701.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,735,963.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
308,771	24,096.71	987,767,558.50	13.28	6,452,598,841.12	86.72

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,248,520.02	0.030221

8.3 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	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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年6月6日)基金份额总额	9,985,609,220.11
本报告期期初基金份额总额	6,828,732,267.69
本报告期基金总申购份额	12,511,318,552.02
减：本报告期基金总赎回份额	11,899,684,420.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,440,366,399.62

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2025 年 4 月 2 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任卫学文先生担任本公司副总经理。

2、本基金管理人于 2025 年 5 月 30 日发布公告，因李进董事长任期届满，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于 2025 年 8 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任叶才先生担任本公司董事长。本基金管理人于 2025 年 8 月 15 日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为叶才先生。

有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
长城证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	本期 报告 新增 1个
长江证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
诚通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
川财证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	本期 报告 退租 1个
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
东方财富 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变 更
东方证券 股份有限	2	-	-	-	-	未变 更

公司						
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	未变更
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增1个
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	本期报告退租1个
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
民生证券股份有限	1	-	-	-	-	未变更

公司						
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增1个
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信证券股份有限公司	6	-	-	-	-	未变更

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额 的比例(%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例(%)
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	81,192,387.67	100.00	863,391,000.00	30.41	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-

有限责任公司						
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	1,975,617,000.00	69.59	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 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	关于不法分子冒用景顺长城基金 APP 及员工名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 3 日
2	关于不法分子冒用景顺长城基金 APP 及员工名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 3 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 6 日
4	关于景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金限制壹仟万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
5	景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天	中国证监会指定报刊及	2025 年 1 月 22 日

	持有期证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	网站	
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 25 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 11 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
10	景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
11	关于景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金限制伍拾万元以上申购（含日常申购和定期定额投资）业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
13	景顺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	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 31 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 2 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 14 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 15 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
18	景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 23 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 12 日
21	关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方 APP 进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
22	关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方 APP 进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于董事	中国证监会指定报刊及	2025 年 5 月 30 日

	长离任及总经理代行董事长职务的公告	网站	
24	景顺长城基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 30 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 3 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增贵文基金为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 17 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

无。

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

- 1、中国证监会准予景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日