

长城货币市场证券投资基金 更新的招募说明书摘要

2012 年第 1 号

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

二〇一二年七月

长城货币市场证券投资基金经中国证监会2005年4月12日证监基金字【2005】52号文批准发起设立。基金合同于2005年5月30日正式生效。

重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现，本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2012年5月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年3月31日（财务数据未经审计）。本招募说明书更新已经本基金托管人华夏银行股份有限公司复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

- 1、名称：长城基金管理有限公司
- 2、注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
- 3、办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
- 4、法定代表人：杨光裕
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、设立日期：2001 年 12 月 27 日
- 7、电话：0755-23982338 传真：0755-23982328
- 8、联系人：袁柳生
- 9、管理基金情况：目前管理长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数型证券投资基金、长城

货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金等十五只基金

10、客户服务热线：400-8868-666

11、注册资本：壹亿伍仟万元人民币

12、股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

（二）基金管理人主要人员情况

1、董事、监事及高管人员介绍

（1）董事

杨光裕先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任，长城证券有限责任公司副总裁，现任长城基金管理有限公司董事长。

何伟先生，中共党员，硕士研究生。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司，1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理，华富基金管理有限公司（筹）拟任总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。现任长城证券有限责任公司总裁。

范小新先生，中共党员，经济学博士，高级经济师。1986年7月参加工作，历任重庆市对外经济贸易委员会副处长，西南技术进出口公司总经理助理，重庆对外经贸委美国公司筹备组组长，中国机电产品进出口商会法律部副主任，华能资本服务有限公司总经理工作部副经理。现任长城证券有限责任公司董事会秘书兼纪委书记、党委委员。

梁宇峰先生，中共党员，复旦大学经济学博士。历任东方证券股份有限公司研究发展

总部经理助理、办公室主任助理、研究所副所长，2006年4月至今任东方证券股份有限公司研究所所长。

姬宏俊先生，中共党员，研究生学历，工商管理硕士。历任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长，发展计划委员会财政金融处副处长，国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。现任中原信托有限公司副总裁。

陆妍女士，1991年毕业于天津理工学院管理信息系统专业，获工学学士学位，1997年毕业于天津大学管理学院，获工学硕士学位。曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券投资部项目经理、北方国际信托股份有限公司证券管理总部总经理，现任北方国际信托股份有限公司副总经理。

万建华先生，中共党员，工商管理博士，高级经济师。历任中国人民银行货币政策司处长、招商银行总行副行长、党委副书记、常务副行长、中国银联筹备组组长、党委书记、副董事长、总裁，上海国际集团党委副书记、副董事长、总裁。现任国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长。

谢志华先生，中共党员，经济学博士。历任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商业学校教师、北京商学院（现北京工商大学）副院长、北京工商大学校长助理。2003年至今任北京工商大学副校长。

刘杉先生，经济学博士。曾任中华工商时报社海外部编辑、副主任、中华工商时报财经新闻部主任，中国人民银行深圳分行金融日报社总编辑，中华工商时报社总编辑助理，现任中华工商时报社副总编辑，兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

谭岳衡先生，中共党员，经济学博士。曾任职于国家发展改革委员会，历任南方证券国际部总经理、南方证券咨询公司董事长、南方证券香港公司副董事长，香港江南财务有限公司董事副总经理、招银国际董事副总经理、长城证券公司董事，招商银行董事、招商证券监事长。现任交银国际控股有限公司首席执行官兼副董事长。

熊科金先生，经济学硕士。历任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人，中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人，华夏证券有限公司江西管理总部总经理，中国银河证券有限责任公司基金部负责人、银河基金管理有限公司筹备组负责人，银河基金管理有限公司副总经理、总经理。2011年7月进入长城基金管理有限公司，现任公司董事、总经理。

（2）监事

吴礼信先生，中共党员，会计师，中国注册会计师（非执业）。历任安徽省地矿局三二六地质队会计主管，深圳中达信会计师事务所审计一部部长，大鹏证券有限责任公司计财综合部经理，大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理，第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券有限责任公司，任财务部总经理，现任长城证券有限责任公司财务总监，并担任长城基金管理有限公司监事会主席。

王燕滨先生，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任内蒙银行学校教师、校团委书记、学生科科长、教研室主任，内蒙古证券公司发行部经理、上海业务部总经理、总经理助理、副总经理，海通证券天津、北京营业部总经理，北方信托业务二部总经理、公司总经理助理兼信托业务二部总经理。现任北方信托总经理助理兼资产管理部总经理。

张令先生，中共党员，研究生学历。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。

孟凡君先生，中共党员，经济学学士，经济师。历任工商银行河南华信资金市场融资二部经理、总经理助理、中原信托投资有限公司开封证券营业部副经理、资产管理部经理，现任中原信托有限公司投资管理二部经理。

桑煜先生，中共党员，经济学学士。曾任职于中国建设银行山东日照市分行、中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司，历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理、市场开发部总经理、综合管理部总经理，现任公司总经理助理。

张静女士，中共党员，2005年毕业于南开大学，法学硕士。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员，2007年5月进入长城基金管理有限公司，现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。

（3）高级管理人员

杨光裕先生，长城基金管理有限公司董事长，简历同上。

熊科金先生，长城基金管理有限公司董事、总经理，简历同上。

余骏先生，硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经管学院，历任中国人民银行湖北省分行科室负责人，君安证券有限公司研究部宏观室负责人，长城证券有限责任公司营业部总经理，长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理，长城基金管理有限公司副总经理兼运行保障部总经理和综合管理部总经理，长城基金管理有限公司副总经理兼市场开发部总经理，现任公司副总经理。

车君女士，中共党员，经济学硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司，1993年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审理执行处、稽查一处、机构监管二处、党办等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、正处级调研员等职务。现任公司督察长兼监察稽核部总经理。

2、本基金基金经理简历

邹德立先生，武汉大学金融学专业学士，具有6年债券投资管理经历。曾就职于深圳农村商业银行总行资金部，从事债券投资与研究。2009年3月进入长城基金管理有限公司，曾任运行保障部债券交易员兼固定收益研究员。自2011年10月19日起担任本基金的基金经理。

“长城货币市场证券投资基金”历任基金经理如下：黄瑞庆先生自2005年5月30日至2005年9月24日任基金经理，王定元先生自2005年9月25日至2006年3月8日任基金经理，刘海先生自2006年3月9日至2009年9月21日任基金经理，王定元先生自2009年9月22日至2010年10月21日任基金经理。钟光正先生自2010年2月24日至2011年10月18日任基金经理。

3、本基金管理人公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

熊科金先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。

杨建华先生，投资决策委员会执行委员，投资总监兼基金管理部总经理。

杨毅平先生，投资决策委员会委员，公司首席策略分析师。

秦玲萍女士，投资决策委员会委员，公司研究部总经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街22号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号（100005）

法定代表人：吴建

成立时间：1992年10月14日

组织形式：股份有限公司

注册资本：6,849,725,776元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25号

联系人：郑鹏

电话：(010) 85238667

传真：(010) 85238680

(二) 主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场综合室、交易管理室、风险管理室和销售管理室4个职能处室。资产托管部共有员工32人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

(三) 基金托管业务经营情况

华夏银行于2005年2月23日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神，始终遵循“安全保管基金资产，提供优质托管服务”的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验，严格履行法律和托管协议所规定的各项义务，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2011年12月末，已托管长城货币市场基金、国联安德盛精选股票基金、万家货币市场基金、诺安优化收益债券型基金、益民红利成长混合型基金、东吴行业轮动股票基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金及其它受托资产产品，托管各类资产规模2395.1亿元。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

法定代表人：杨光裕

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：黄念英

客户服务电话：400-8868-666

网站: www.ccfund.com.cn

2、代销机构

(1) 华夏银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人: 吴建

联系人: 姜驰

电话: 010-85237356

传真: 010-85238680

客户服务电话: 95577

网址: www.hxb.com.cn

(2) 招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人: 傅育宁

电话: 0755-83198888

传真: 0755-83195049

联系人: 邓炯鹏

客户服务电话: 95555

网站: www.cmbchina.com

(3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 王洪章

联系人: 张静

电话: 010-66275654

客户服务电话: 95533

网站: www.ccb.com

(4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址: 北京市海淀区复兴路甲 23 号

法定代表人: 蒋超良

电话：010-85109219

传真：010-85109219

联系人：吴双

客户服务电话：95599

网站：www.abchina.com

(5) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖钢

电话：010-66596688

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(6) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(7) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

电话：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

(8) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网站：www.bankofbeijing.com.cn

(9) 深圳发展银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：张青

电话：0755-82088888 转 8811

客户服务电话：95501

公司网站：www.sdb.com.cn

(10) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：徐伟

网址：www.spdb.com.cn

客户服务电话：95528

(11) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：霍兆龙

电话：0755-25859591

传真：0755-25879453

网址：www.pingan.com

客户服务电话：4006699999

(12) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

联系人：丰靖

电话：010-65550827

传真：010-65541230

客户服务电话：95558

网站：www.bank.ecitic.com

(13) 深圳农村商业银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区3038号合作金融大厦

办公地址：深圳市罗湖区3038号合作金融大厦

法定代表人：李伟

联系人：宋永成

联系电话：0755-25188266

客服电话：4001961200

公司网站：www.961200.net

(14) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市南城路2号

办公地址：东莞市南城路2号

法定代表人：何沛良

联系人：何茂才

电话：0769-22321089

传真：0769-22320896

客服电话：0769-961122

网址：www.drcbank.com

(15) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130577

联系人：权唐

客户服务电话：4008888108

网站：www.csc108.com

(16) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-53594566

联系人：金芸

客户服务电话：95553、4008888001

网站：www.htsec.com

(17) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

联系人：芮敏祺

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400

客户服务电话：4008888666

网站：www.gtja.com

(18) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63327888

客户服务电话：95503

网站：www.dfzq.com.cn

(19) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

联系人：谢高得

客户服务热线：95562

网站：www.xyzq.com.cn

(20) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000，4006666888

网站：www.cgws.com

(21) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：田徽

电话：010-66568047

客户服务电话：4008-888-888

网站：www.chinastock.com.cn

(22) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82960223

传真：0755-82943237

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网站：www.newone.com.cn

(23) 平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

客户服务电话：4008816168

网站：www.pingan.com

(24) 华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-83290845

联系人：肖亦玲

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(25) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网站：www.sywg.com

(26) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

联系电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

网站：www.bhzq.com

(27) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86868681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

网站：www.avicsec.com

(28) 华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼

法定代表人：张慎修

联系人：张有德

电话：0755-83025046

传真：0755-83025991

客户服务电话：4008-888-818

公司网站：www.hx168.com.cn

(29) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

法定代表人：曾小普

联系电话：0791-86281305

联系人：陈明

客户服务电话：4008222111

网站：www.gsstock.com

(30) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法人代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82133066

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(31) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人：刘东

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客户服务电话：020-961303

网站：www.gzs.com.cn

(32) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：卢长才

联系人：方文

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199599

网站：www.csco.com.cn

(33) 齐鲁证券有限责任公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李炜

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（34）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：张智河

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

公司网址：www.zxwt.com.cn

客户服务电话：0532-96577

（35）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

公司网址：www.essence.com.cn

客服热线：4008001001

（36）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(37) 东海证券有限责任公司

注册地址：常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼

办公地址：上海市浦东区东方路 989 号中达广场 17 楼

法定代表人：朱科敏

电话：021-50586660

传真：021-50586660-8880

联系人：邵一明

客服电话：0519-8166222 0379-64912266

网址：www.longone.com.cn

(38) 恒泰证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

电话：0471-4972343

传真：0471-4930707

联系人：王旭华

客服电话：0471-4961259

网址：www.cnht.com.cn

(39) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2257012

传真：0551-2272100

联系人：祝丽萍

客户服务电话：全国统一热线 4008888777，安徽省内热线 96888

网址：www.gyzq.com.cn

(40) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

（41）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406172

传真：029-87406387

客服热线：029-87419999

联系人：崔轶梅

网址：www.westsecu.com.cn

（42）长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服热线：4008-888-999 或 95579

网址：www.95579.com

（43）日信证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

联系人：陈韦杉、朱晓光

联系电话：010-88086830-730、010-88086830-737

传真：010-66412537

网址：www.rxzq.com.cn

(44) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号27层

法定代表人：陈林

联系人：袁月

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

(45) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

(46) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(47) 民生证券有限责任公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

电话：010-85127622

传真：010-85127917

联系人：赵明

客户服务电话：4006198888

网址：www.msza.com

(48) 天源证券经纪有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦 6 楼

法人代表：林小明

联系人：王斌

联系电话：0755-33331188-8801

客服电话：4006543218

公司网站：www.tyzq.com.cn

(49) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层

法定代表人：丁之锁

联系人：梁宇

联系电话：010-58568007

传真：010-58568062

客服电话：010-58568118

公司网站：www.hrsec.com.cn

(50) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦

电话：0755-83709350

传真：0755-83700205

法定代表人：张雅锋

联系人：程一天

客服电话：95563

公司网站：www.ghzq.com.cn

(51) 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

传真：0571-86065161

客户服务电话：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

(52) 民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

联系人：赵明

客户服务热线：40088-95618

网址：www.e5618.com

(53) 大同证券经纪有限责任公司

注册地址：山西省大同市大北街 13 号

办公地址：山西省太原市长治路 111 号世贸中心 A 座 13 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务热线：400-7121-212

网址：www.dtsbc.com.cn

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

(二) 基金注册登记人

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：杨光裕

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：张真珍

客户服务电话：400-8868-666

(三) 律师事务所与经办律师

律师事务所名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO A 座 31 层

负责人：王玲

经办律师：靳庆军、冯艾

电话：0755-22163333

传真：0755-22163380

联系人：冯艾

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所

注册地址：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼(即东三办公楼)16 层

法定代表人：葛明

经办注册会计师：梁成杰、周刚

联系人：李妍明

电话：010-58153000

传真：010-85188298

四、基金的名称

本基金名称：长城货币市场证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资对象

本基金投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余到期期限的债券、央行票据、

回购，以及法律法规允许投资的其他金融工具。包括：现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

八、基金的投资策略

1、一级资产配置策略

根据宏观经济研究（利率水平、CPI 指标、GDP 增长率、货币供应量、可比币种利率水平、主要币种汇率水平等），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。

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、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（二级市场存量、二级市场交易量、交易场所等）、收益率水平（到期收益率、票面利率、付息方式、利息税务条款、附加期权价值、类别资产收益率差异等）、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。

3、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。

根据对个券收益率水平、剩余期限、流动性状况的权衡，参照收益目标确定个券投资品种与投资数量。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为，税后银行活期存款利率。

如果今后法律法规发生变化，或者市场上有更加适合的业绩比较基准，在不损害投资者利益的前提下，本基金管理人可根据投资目标、投资方向和投资策略，变更业绩比较基准，

并提前公告。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、投资组合报告

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

本基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年4月19日复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告数据截至2012年3月31日止，本报告财务资料未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	723,570,122.65	59.33
	其中：债券	723,570,122.65	59.33
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	25,000,157.50	2.05
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	460,695,029.33	37.78
4	其他资产	10,249,341.02	0.84
5	合计	1,219,514,650.50	100.00

2、报告期债券回购融资情况

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	4.21	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	金额
2	报告期末债券回购融资余额	179,999,530.00	17.36
	其中：买断式回购融资	-	-

注：（1）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日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

（2）债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
----	------	------------------	----	-----

1	2012年1月4日	21.15	巨额赎回	两个交易日
2	2012年1月5日	21.75	巨额赎回	-

3、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	144
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	162
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

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 180 天的情况。

4、报告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	9.28	17.36
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.77	-
2	30 天(含)—60 天	14.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	23.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	13.57	-
4	90 天(含)—180 天	42.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	27.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	116.62	17.36

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	392,818,985.18	37.88
	其中：政策性金融债	392,818,985.18	37.88
4	企业债券	19,977,046.96	1.93
5	企业短期融资券	310,774,090.51	29.97
6	其他	-	-
7	合计	-	-
8	剩余存续期超过 397 天的浮	723,570,122.65	69.77

	动利率债券		
--	-------	--	--

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	070419	07 农发 19	1,300,000	131,401,953.28	12.67
2	100236	10 国开 36	800,000	80,150,702.36	7.73
3	090205	09 国开 05	600,000	60,585,130.86	5.84
4	070219	07 国开 19	500,000	50,428,430.22	4.86
5	041253009	12 恒逸 CP001	500,000	50,082,170.30	4.83
6	090213	09 国开 13	400,000	40,368,542.08	3.89
7	041258002	12 广汇汽车 CP001	400,000	40,128,383.79	3.87
8	041158016	11 广汇汽车 CP001	300,000	30,219,375.61	2.91
9	041260006	12 昊融 CP001	300,000	30,041,176.10	2.90
10	041256003	12 赣高速 CP001	300,000	30,012,701.50	2.89

7、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	23
报告期内偏离度的最高值	0.3518%
报告期内偏离度的最低值	0.1657%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2494%

8、报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

9、投资组合报告附注

(1) 本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

本基金通过每日分红使得基金份额的净值始终维持在 1.0000 元。

(2) 本基金在本报告期内存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20% 的情况。

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2012 年 3 月 30 日	20.35	巨额赎回	四个交易日
2	2012 年 3 月 31 日	20.34	持续赎回	-

(3) 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告

编制日前一年内受到过公开谴责、处罚，不存在需说明的证券投资决策程序。

(4) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,752,631.02
4	应收申购款	246,710.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	10,249,341.02

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效于2005年5月30日。本基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示（数据截止日为2012年3月31日）：

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2005年	1.1590%	0.0040%	1.0652%	0.0000%	0.0938%	0.0040%
2006年	1.8773%	0.0030%	1.8799%	0.0003%	-0.0026%	0.0027%
2007年	3.2799%	0.0069%	2.7850%	0.0019%	0.4949%	0.0050%
2008年	3.5389%	0.0109%	3.7725%	0.0012%	-0.2336%	0.0097%
2009年	0.8435%	0.0029%	2.2500%	0.0000%	-1.4065%	0.0029%
2010年	2.0594%	0.0061%	2.3041%	0.0003%	-0.2447%	0.0058%
2011年	3.8924%	0.0058%	3.2801%	0.0007%	0.6123%	0.0051%
基金合同生效至2012年3月31日	19.3343%	0.0071%	18.2094%	0.0021%	1.1249%	0.0050%

重要说明：

本基金采取的收益分配方式是：每日计算投资人帐户当日所产生的收益，每月将投资人账户累计的收益结转为其基金份额，计入该投资人账户的本基金份额中。本基金管理人继

2005年7月15日首次对本基金收益进行集中支付并结转为基金份额后，本基金投资者的累计收益定于每月15日集中支付并按1元面值自动转为基金份额。若该日为非工作日，则顺延到下一工作日。

十三、基金的费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金的费用种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金销售服务费；
- (4) 证券交易费用；
- (5) 基金合同生效后与基金相关的基金信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，本基金的管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，本基金的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) 销售服务费

本基金A级基金份额的年销售服务费率为0.25%，B级基金份额的年销售服务费率为0.01%。二类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H=E \times R \div \text{当年天数}$$

H为各级基金份额每日应计提的销售服务费

E为前一日该级基金份额的基金资产净值

R为该级基金份额的销售服务费年费率

各级基金份额的销售服务费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首2个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户，由基金管理人支付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可以调整对各级基金份额计提的销售服务费率，但销售服务费年费率最高不超过0.25%。在基金合同规定的范围内调整基金销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

上述（一）中(4)到(8)项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费用和赎回费用

本基金不收取申购费用；

本基金不收取赎回费用。

2、转换费

(1) 基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。

①如转入基金的申购费率>转出基金的申购费率

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入总金额=转出金额-转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率=转入基金适用申购费率-转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差=转入总金额-转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)

转入净金额=转入总金额-转入基金申购费补差

转入份额=转入净金额/转入基金当日基金份额净值

基金转换费=转出基金赎回费+转入基金申购费补差

例：某投资者持有本基金 10 万份基金份额，决定转换为长城久泰沪深 300 指数证券投资基金，假设转换当日转入基金（长城久泰沪深 300 指数证券投资基金）份额净值是 1.5800 元，转出基金赎回费率为 0，申购补差费率为 1.5%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1=100,000 元

转出基金赎回费=0

转入总金额=100,000-0=100,000 元

转入基金申购费补差=100,000-100,000/(1+1.5%)=1,477.83 元

转入净金额=100,000-1,477.83=98,522.17 元

转入份额=98,522.17/1.58=62,355.80 份

基金转换费=0+1,477.83=1,477.83 元

②如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率

基金转换费用=转出金额×转出基金赎回费率

例：某投资者持有长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 10 万份基金份额，持有期为 100 天，决定转换为本基金，假设转换当日转出基金（长城久泰沪深 300 指数证券投资基金）份额净值是 1.5800 元，转出基金对应赎回费率为 0.5%，申购补差费率为 0，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1.58=158,000 元

转出基金赎回费=158,000×0.5%=790 元

转入总金额=158,000-790=157,210 元

转入基金申购费补差=0

转入净金额=157,210-0=157,210 元

转入份额=157,210/1=157,210 份

基金转换费=790+0=790 元

(2) 对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率的基金), 以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用; 如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时, 申购补差费用视为 0。

(3) 转出基金赎回费的 25% 计入转出基金资产。

(4) 计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行, 对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务, 按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下, 调整上述收费方式和费率水平, 但最迟应于新收费办法开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(三) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失, 以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前的相关费用, 包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。

(四) 基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费和基金销售服务费, 下调前述费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及《长城货币市场证券投资基金基金合同》的要求, 并结合本基金管理人对基金实施的投资管理活动, 对2012年1月12日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新, 更新的主要内容如下:

- 1、在第二部分“释义”中, 修改、新增了与基金份额分级相关的释义。
- 2、在第三部分“基金管理人”中, 更新了基金管理人概况和基金管理人主要人员情况。
- 3、在第四部分“基金托管人”中, 更新了基金托管人的基本情况、主要人员情况和基金托管业务经营情况。
- 4、在第五部分“相关服务机构”中, 更新了代销机构信息和经办注册会计师信息。
- 5、在第七部分“基金份额的申购与赎回”中, 新增了基金份额分级的内容; 更新了基金转换业务的内容; 更新了定期定额投资计划服务机构的信息。

6、在第八部分“基金的投资管理”中，修改了本基金的业绩比较基准；更新了投资组合报告内容，披露截至2012年3月31日的的数据。

7、在第九部分“基金的业绩”中，披露了截至2012年3月31日本基金的业绩数据。

8、在第十三部分“基金的费用与税收”中，修改了销售服务费的相关内容。

9、在第二十一部分“其他应披露的事项”中，披露了本期已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司

二〇一二年七月十二日