

# 长城货币市场证券投资基金更新的招募说明书摘要

长城货币市场证券投资基金

更新的招募说明书摘要

2017 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

二一七年七月

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2017年5月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2017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：何伟
- 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：袁江天
- 9、管理基金情况：目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、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、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金等四十一只基金。
- 10、客户服务电话：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

长城证券股份有限公司 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

何伟先生，董事长，硕士。现任长城证券股份有限公司总裁、党委副书记。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。

熊科金先生，董事、总经理，硕士。曾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。

范小新先生，董事，博士，高级经济师。现任长城证券股份有限公司副总经理、党委委员、纪委书记。曾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。

杨玉成先生，董事，硕士。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书，东方金融控股（香港）有限公司董事长，上海东方证券资产管理有限公司董事。曾任上海财经大学财政系教师，君安证券有限公司证券投资部总经理助理，上海大众科技创业（集团）股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，上海申能资产管理有限公司董事、副总经理，东方证券股份有限公司财务总监、副总经理，申能集团财务有限公司董事、总经理。

姬宏俊先生，董事，硕士。现任中原信托有限公司副总裁。曾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。

金树良先生，董事，硕士。现任北方国际信托股份有限公司总经济师。曾任职于北京大学经济学院国际经济系。1992年7月起历任海南省证券公司副总裁、北京华宇世纪投资有限公司副总裁、昆仑证券有限责任公司总裁、北方国际信托股份有限公司资产管理部总经理及公司总经理助理兼资产管理部总经理、渤海财产保险股份有限公司常务副总经理及总经理、北方国际信托股份有限公司总经理助理。

王连洲先生，独立董事，现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》

三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在中国人民银行总行印制管理局工作，1983年调任全国人大财经委员会，历任办公室财金组组长、办公室副主任、经济法室副主任、研究室负责人、巡视员。

万建华先生，独立董事，硕士。现任上海银行独立非执行董事，上海市互联网金融行业协会会长，珠海华润银行股份有限公司独立非执行董事，通联支付网络股份有限公司董事。曾任中国人民银行资金管理司处长，招商银行总行常务副行长兼上海分行行长(期间兼任长城证券股份有限公司董事长、国通证券有限责任公司(现招商证券股份有限公司)董事长)，中国银联股份有限公司党委书记、总裁，上海国际集团党委副书记、副董事长、总经理，国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长，证通股份有限公司董事长。

徐英女士，独立董事，学士。现已退休。曾任北京财贸学院金融系助教、讲师，海南汇通国际信托投资公司副总经理、常务副总经理，长城证券股份有限公司总经理、董事长、党委书记，景顺长城基金管理有限公司董事长、中国证券业协会理事，新华资产管理股份有限公司副董事长。

鄢维民先生，独立董事，学士。现任深圳市证券业协会常务副会长兼秘书长、深圳上市公司协会副会长兼秘书长。曾任江西省社会科学院经济研究所发展室副主任，深圳市体改委宏观调控处、企业处副处长，深圳市证券管理办公室公司审查处处长，招银证券公司副总经理。

## (2) 监事

吴礼信先生，监事会主席，会计师、中国注册会计师(非执业)。现任长城证券股份有限公司董事会秘书、财务总监。曾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年进入长城证券股份有限公司，任财务部总经理。

曾广炜先生，监事，高级会计师。现任北方国际信托股份有限公司总经理助理兼风险控制部总经理。曾任职于中国燕兴天津公司、天津开发区总公司、天津滨海新兴产业公司，2003年1月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务四部副总经理、证券投资部副总经理、财务中心总经理、风险控制部总经理。

杨斌先生，监事，硕士。现任东方证券股份有限公司首席风险官、合规总监。曾就职于中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处，自1998年7月至2015年5月先后于上海证监局稽查处、案件审理处、案件调查一处、机构监管一处、期货监管处、法制工作处等部门任职，历任科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长。

黄魁粉女士，监事，硕士。现任中原信托有限公司固有业务部总经理。2002年7月进入中原信托有限公司。曾在信托投资部、信托综合部、风险与合规管理部、信托理财服务中心工作。

袁江天先生，监事，博士。现任长城基金管理有限公司总经理助理兼董事会秘书、综合管理部总经理。曾任职于广西国际信托投资公司投资管理部、国海(广西)证券有限责任公

司投资银行部、证券营业部、总裁办、北方国际信托投资股份有限公司博士后工作站。  
王燕女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司财务经理、综合管理部副总经理。  
2007年5月进入长城基金管理有限公司，曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作，  
2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作。

张静女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。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。

### （3）高级管理人员

何伟先生，董事长，简历同上。

熊科金先生，董事、总经理，简历同上。

彭洪波先生，副总经理兼运行保障部总经理、信息技术部总经理，硕士。曾就职于长城证券股份有限公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月进入长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理、公司督察长兼监察稽核部总经理、公司总经理助理兼运行保障部总经理。

桑煜先生，副总经理兼市场开发部总经理、广州管理部总经理，学士。曾任职于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、公司总经理助理。

杨建华先生，副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、研究部总经理、投资决策委员会委员、基金经理，硕士。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券股份有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司工作，历任基金经理助理、长城安心回报混合型证券投资基金基金经理、长城中小盘成长混合型证券投资基金基金经理、长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，期间曾任公司总经理助理。

卢盛春先生，副总经理兼机构理财部总经理，硕士。曾就职于中国人民银行江西省分行、交通银行海南分行、海通证券股份有限公司、富国基金管理有限公司、西北证券有限责任公司、华商基金管理有限公司（筹备组）。2003年进入长城基金管理有限公司，历任上海分公司总经理、北京分公司总经理、公司总经理助理。

车君女士，督察长、监察稽核部总经理，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。

## 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，华中科技大学工程硕士。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，自 2014 年 6 月 25 日起担任长城工资宝货币市场基金的基金经理。

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，投资决策委员会委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、研究部总经理、基金经理。

钟光正先生，投资决策委员会委员，公司总经理助理、固定收益部总经理、基金经理。

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：10,685,572,211 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一室、市场二室、风险与合规管理室和运营室 4 个职能处室。资产托管部共有员工 35 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2016年6月末，本公司托管证券投资基金、券商集合计划、银行理财、信托、保险等各类产品合计671只，托管规模16,109.54亿元，实现托管手续费收入3.92亿元。

### 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：何伟

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](http://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：陈秀良

传真：010-85238680

客户服务电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://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：李建红

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](http://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：周慕冰

联系人：马秀艳

电话：010-85108206

传真：010-85109230

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：田国立

联系人：宋亚平

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：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：胡迪峰

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：010-570692623

传真：010-57092611



联系人：王继伟

客户服务电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://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：孔超

电话：010-66223588

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(9) 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

传真：021-63604199

联系人：唐苑

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

客户服务电话：95528

(10) 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：谢永林

联系人：冯博

电话：021-50979511

传真：021-50979507

网址：<http://bank.pingan.com/>

客户服务电话：95511-3

(11) 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：常振明

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](http://www.bank.ecitic.com)

(12) 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: 王璇

联系电话: 0755-25188269

传真: 0755-25188794

客服电话: 4001961200

公司网站: [www.961200.net](http://www.961200.net)

(13) 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: 杨亢

电话: 0769-22866270

传真: 0769-22320896

客服电话: 0769-961122

网址: [www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

(14) 包商银行股份有限公司

注册(办公)地址: 内蒙古包头市钢铁大街 6 号

法定代表人: 李镇西

联系人: 刘芳

联系电话: (0472) 5109729

传真: (0472) 5176541

客服电话: 内蒙古地区: 0472-96016; 北京地区: 010-96016; 宁波地区: 0574-967210;

深圳地区: 0755-967210; 成都地区: 028-65558555

公司网站: [www.bsb.com.cn](http://www.bsb.com.cn)

(15) 泉州银行股份有限公司

注册地址: 福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人: 傅子能

联系电话: 0595-22551071

联系人: 董培姗

客服电话: 400-8896-312

公司网站: [www.qzccb.com](http://www.qzccb.com)

(16) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：邱艇

电话：0574-87050397

客服电话：95574

公司网站：www.nbc.cn

(17) 武汉农村商业银行股份有限公司

住所：武汉市江岸区建设大道 618 号

法定代表人：徐小建

联系人：邹君

联系电话：027-85497270

客服热线：96555

网站：www.whrcbank.com

(18) 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

(19) 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：021-23219991

联系人：程丽辉

客户服务电话：95553、4008888001

网站：www.htsec.com

(20) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

联系电话：021-38676666

客服电话：400-8888-666/95521

网址：www.gtja.com

(21) 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：潘鑫军

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](http://www.dfzq.com.cn)

(22) 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](http://www.xyzq.com.cn)

(23) 长城证券股份有限公司

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：刘阳

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000，4006666888

网站：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(24) 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：田薇

电话：010-66568047

客户服务电话：4008-888-888

网站：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(25) 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 3845 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82960167

传真：0755-82943237

联系人：黄婵君

客户服务电话：95565

网站：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(26) 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：石静武

电话：021-38631117

传真：021-33830395

客户服务电话：4008816168

网站：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

(27) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号

港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

联系人：庞晓芸

客户服务电话：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(28) 申万宏源证券股份有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：021-33388215

传真：021-33388224

客服电话：95523/4008895523/4008000562

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(29) 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：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

网站：[www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

(30) 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：王宜四

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

(31) 华西证券股份有限公司

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：张曼

电话：010-52723273

传真：0755-83025991

客户服务电话：4008-888-818

公司网站：www.hx168.com.cn

(32) 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：周欣玲

客户服务电话：4008222111

网站：www.gsstock.com

(33) 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：周杨

电话：0755-82133066

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(34) 广州证券股份有限公司

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：邱三发

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

（35）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：姜味军

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199599

网站：www.csc.com.cn

（36）中泰证券股份有限公司

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.zts.com.cn

（37）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

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 20 层

法定代表人：杨宝林

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（38）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：郑向溢

电话：0755-82558038

传真：0755-82558355

公司网址：www.essence.com.cn

客服热线：4008001001

（39）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

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

（40）东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（41）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：0471-4972042

传真：0471-4930707

联系人：孙伟

客服电话：0471-4961259

网址：www.cnht.com.cn

（42）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

(43) 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、95532

网址：www.china-invs.cn

(44) 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：029-87406649

传真：029-87406387

客服热线：02987419999

联系人：刘莹

网址：www.westsecu.com.cn

(45) 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

(46) 国融证券股份有限公司

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：陈文彬

电话：010-83991888

传真：010-88086637

客户服务电话：400-660-9839

网址：www.grzq.com

(47) 华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

电话：021-68778790

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

(48) 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：侯艳红

电话：010-60838995

客户服务电话：95548

网站：www.cs.ecitic.com

(49) 国都证券股份有限公司

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

(50) 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.msq.com

(51) 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

(52) 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：祝献忠

联系人：李慧灵

联系电话：010-58315221

传真：010-58568062

客服电话：010-58568118

公司网站：www.hrsec.com.cn

(53) 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：0755-83702462

传真：0755-83700205

法定代表人：张雅锋

联系人：张亦潇

客服电话：95563

公司网站：www.ghzq.com.cn

(54) 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

(55) 方正证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 40-43 层

法定代表人：何其聪

联系人：高洋

联系电话：010-59355546

客服电话：95571

网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

（56）大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

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](http://www.dtsbc.com.cn)

（57）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客服电话：400-8888-993

公司网站：[www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

（58）信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（59）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网站：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(60) 西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

公司网站：www.swsc.com.cn

(61) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李学东

电话：010-85679888

传真：010-85679535

联系人：秦朗

客服电话：400-910-1166

网站：www.cicc.com.cn

(62) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张磊

联系人：洪成

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客服电话：400-990-8826

公司网站：www.citicsf.com

(63) 申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：李巍

传真：010-88085195

客户服务电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

(64) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪  
电话：028-86690057  
客户服务电话：4006-600109  
网址：www.gjq.com.cn

(65) 深圳众禄金融控股股份有限公司  
办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25 层  
法定代表人：薛峰  
联系人：童彩平  
电话：0755-33227950  
传真：0755-82080798  
客服电话：4006-788-887  
公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(66) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司  
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室  
法定代表人：陈柏青  
联系人：顾祥柏  
电话：13918979642  
客服电话：4000-766-123  
公司网址：www.fund123.cn

(67) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司  
住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室  
办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室  
法定代表人：汪静波  
联系人：徐诚  
联系电话：021-38509636  
客服电话：400-821-5399  
公司网站：www.noah-fund.com

(68) 上海天天基金销售有限公司  
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层  
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦  
法定代表人：其实  
联系人：黄妮娟  
联系电话：021-54509998  
客服电话：400-1818-188  
公司网站：www.1234567.com.cn

(69) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

客服电话：400-059-8888

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

公司网站：www.zscffund.com

(70) 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

联系电话：010-62020088

客服电话：400-888-6661

公司网站：www.myfund.com

(71) 北京增财基金销售有限公司

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：王昌庆

联系人：张蕾

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

公司网站：www.zcvc.com.cn

(72) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：吴阿婷

联系电话：0755-82721106

客服电话：400-9200-022

公司网站：licaike.hexun.com

(73) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

联系人：胡轶隼

联系电话：021-20613635

客服电话：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

(74) 上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

联系人：凌秋艳

联系电话：021-52822063-8105

客服电话：4000-466-788

公司网站：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(75) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号

法定代表人：肖雯

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

公司网站：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(76) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客户服务热线：4008219031

公司网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(77) 上海中正达广投资管理有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 3 楼

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

联系电话：021-33768132

客服电话：4006767523

网址：[www.zzwealth.cn](http://www.zzwealth.cn)

(78) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：盛大

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533-3011

客服电话：400-067-6266

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

(79) 深圳富济财富管理有限公司



注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒大厦二期418室

法定代表人：齐小贺

联系人：陈勇军

电话：0755-83999913

传真：0755-83999926

客服电话：0755-83999907

网址：[www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(80) 深圳金斧子投资咨询有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼

法定代表人：赖任军

联系人：张烨

电话：0755-66892301

传真：0755-66892399

客服电话：400-9500-888

网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

(81) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层

法定代表人：陈超

客服电话：400-0988-511/400-0888-816

公司网站：[kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

(82) 北京汇成基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

客服电话：400-619-9059

公司网站：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(83) 南京苏宁基金销售有限公司

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

联系人：王锋

电话：025-66996699-887226

客服电话：95177

公司网站: [www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

(84) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

法定代表人: 王廷富

联系人: 徐亚丹

电话: 13818306630

客服电话: 400-821-0203

网址: [www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(85) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

法定代表人: 张彦

联系人: 文雯

电话: 010-83363101

客服电话: 400-166-1188

公司网站: [8.jrj.com.cn](http://8.jrj.com.cn)

本基金E级基金份额目前可通过华夏银行股份有限公司电子交易平台以及本公司网上直销交易平台办理相关业务, 未来如新增销售渠道, 基金管理人将另行公告。

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: 何伟

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: 北京市中伦律师事务所

注册地址: 北京市朝阳区建国门外大街甲6号SK大厦36-37层

负责人: 张学兵

电话: 0755-33256666

传真: 0755-33206888

联系人: 李雅婷

#### （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（特殊普通合伙）

住所（办公地址）：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：NgAlbertKongPing 吴港平

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：李妍明

#### 四、基金的名称

本基金名称：长城货币市场证券投资基金

#### 五、基金的类型与运作方式

基金类型：货币型

运作方式：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、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：080%，回购070%，短期债券080%，同业存款/现金比例070%。

#### 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：080%，回购070%，短期债券080%，同业存款/现金比例070%。

##### 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2017年6月27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2017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 6,876,669,110.36 69.91

其中：债券 6,876,669,110.36 69.91

资产支持证券 -

-

2 买入返售金融资产 399,416,439.14

4.06

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 2,501,061,724.76 25.43

4 其他资产 59,650,976.70 0.61

5 合计 9,836,798,250.96 100.00

##### 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 5.49

其中：买断式回购融资 -

序号 项目 金额（元） 占基金资产净值的比例（%）

2 报告期末债券回购融资余额 1,126,716,309.92 12.95

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%。

### 3、基金投资组合平均剩余期限

#### 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 96

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 97

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 49

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。

#### 3.2 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 21.36 12.95

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

2 30 天(含)-60 天 15.63 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

3 60 天(含)-90 天 32.78 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

4 90 天(含)-120 天 13.07 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

5 120 天(含)-397 天(含) 29.50 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

合计 112.34 12.95

#### 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。

#### 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 1,271,076,794.66 14.60  
 其中：政策性金融债 1,271,076,794.66 14.60  
 4 企业债券 --  
 5 企业短期融资券 2,168,816,561.15 24.92  
 6 中期票据 --  
 7 同业存单 3,436,775,754.55 39.49  
 8 其他 --  
 9 合计 6,876,669,110.36 79.01  
 10 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 --

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	111610353	16 兴业 CD353	7,500,000	750,000,000.00	8.62
2	160414	16 农发 14	6,300,000	629,976,825.34	7.24
3	111610331	16 兴业 CD331	6,000,000	599,906,847.95	6.89
4	111698278	16 德阳银行 CD083	4,200,000	419,582,292.97	4.82
5	111610344	16 兴业 CD344	3,900,000	390,000,000.00	4.48
6	140347	14 进出 47	3,100,000	311,205,052.32	3.58
7	111794632	17 泸州商行 CD014	2,700,000	266,913,834.39	3.07
8	011760004	17 中建材 SCP001	2,000,000	199,929,749.78	2.30
9	011766006	17 北京国资 SCP002	2,000,000	199,920,535.78	2.30
10	011752011	17 物产中大 SCP003	2,000,000	199,895,946.10	2.30

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 --

报告期内偏离度的最高值 -0.0080%

报告期内偏离度的最低值 -0.0805%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0410%

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。

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十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期内未持有资产支持证券。

## 9、投资组合报告附注

### 9.1

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。

### 9.2

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。

### 9.3 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	53,594,314.58
4	应收申购款	6,056,662.12
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	59,650,976.70

### 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。

## 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 2017 年 3 月 31 日）：

长城货币 A

阶段	基金净值收益率	基金净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
----	---------	------------	-----------	--------------

基金合同生效日至 2005 年 12 月 31 日	1.1590%	0.0040%	1.0652%	0.0000%
---------------------------	---------	---------	---------	---------

0.0938%

2006 年	1.8773%	0.0030%	1.8799%	0.0003%
--------	---------	---------	---------	---------

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%  
2012年 4.1070% 0.0083% 1.2584% 0.0038% 2.8486% 0.0045%  
2013年 5.0055% 0.0091% 0.3500% 0.0000% 4.6555% 0.0091%  
2014年 5.1149% 0.0052% 0.3500% 0.0000% 4.7649% 0.0052%  
2015年 3.9344% 0.0049% 0.3500% 0.0000% 3.5844% 0.0049%  
2016年 2.5956% 0.0018% 0.3510% 0.0000% 2.2446% 0.0018%  
2017年1月1日至3月31日 0.6653% 0.0026% 0.0844% 0.0000% 0.5809% 0.0026%  
基金合同生效至2017年3月31日 45.3740% 0.0071% 21.3531% 0.0037% 24.0209%  
0.0034%

#### 长城货币B

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
自2012年4月9日（B级设立日）起至2012年12月31日	2.8911%	0.0081%	0.3090%	0.0001%
2013年	5.3299%	0.0096%	0.3500%	0.0000%
2014年	5.3770%	0.0052%	0.3500%	0.0000%
2015年	4.1842%	0.0049%	0.3500%	0.0000%
2016年	2.8423%	0.0018%	0.3510%	0.0000%
2017年1月1日至3月31日	0.7236%	0.0026%	0.0844%	0.0000%
自2012年4月9日（B级设立日）起至2017年3月31日	23.2712%	0.0068%	1.7718%	0.0001%
	21.4994%	0.0067%		

#### 长城货币E

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
自2015年4月1日（E级设立日）起至2015年12月31日	2.8731%	0.0050%	0.2637%	0.0000%
2016年	2.7481%	0.0018%	0.3510%	0.0000%
2017年1月1日至3月31日	0.7016%	0.0026%	0.0844%	0.0000%
自2015年4月1日（E级设立日）起至2017年3月31日	6.4613%	0.0037%	0.7010%	



0.0000% 5.7603% 0.0037%

#### 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,每月将投资人帐户累计的收益结转为其基金份额,计入该投资人帐户的本基金份额中。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。

本基金自2012年4月6日起业绩比较基准由税后一年期银行定期存款利率变更为税后银行活期存款利率。

### 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:

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

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:

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

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

本基金各级基金份额按照不同的费率计提销售服务费，其中，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%，E 级基金份额的年销售服务费率为 0.1%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$H = ER \times \text{当年天数}$

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 个工作日内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；

本基金一般情况下不收取赎回费用，但当基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5% 且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的 1% 以上的赎回申请（超过基金总份额 1% 以上的部分）征收 1% 的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

#### 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。

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

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（基金合同或招募说明书另有规定的除外）。

(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2017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、在重要提示中，更新了招募说明书所载内容截止日期与有关财务数据、净值表现截止日期。
- 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，更新了基金托管人概况。
- 4、在第五部分相关服务机构中，更新了代销机构信息。
- 5、在第七部分基金份额的申购与赎回中，更新了基金的转换与定期定额投资计划的内容。
- 6、在第八部分基金的投资管理中，更新了投资组合报告内容，披露截至2017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2017年3月31日本基金的业绩数据。
- 8、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

2017年7月12日