

# 长城货币市场证券投资基金

## 更新的招募说明书摘要

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

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，投资人申购基金前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承认并接受了基金合同，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

- 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
- 组织形式：有限责任公司
- 电话：0755-83662688 传真：0755-83662600
- 联系人：于晓岚
- 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、长城久泰中信债普 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等七只基金
- 客户服务热线：400-8868-666
- 注册资本：10000 万元人民币
- 股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.069%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托投资有限公司	17.647%
北方国际信托投资股份有限公司	17.647%
合计	100%

#### (二) 基金管理人主要人员情况

#### 1. 董事、监事及高级管理人员介绍

#### (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。

邹平先生，博士研究生毕业，管理学博士，高级经济师。历任湖南省进出口总公司部门经理，中国宝安集团分公司副总经理，大鹏证券有限责任公司首席分析师，金元证券有限责任公司研究所所长，长城证券有限责任公司总裁助理。

龙熙霖先生，硕士研究生毕业，经济师。历任长城证券有限责任公司海口营业部总经理助理、总经理，公司经纪业务管理总部副总经理，投资管理总部总经理助理，证券投资部总经理，现任长城证券有限责任公司投资总监。

吕莉女士，中共党员，高级经济师。历任宁夏证券分公司副总经理、总经理、董事长，理直证券有限责任公司董事长、监事长。

王国斌先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任上海万国证券公司证券投行部副经理、申银万国证券股份有限公司国际业务部副经理，中国经济开发信託投资公司证券投资部总经理助理、东方证券有限责任公司证券投资部总经理、总助理助理兼证券投资业务总部总经理，东方基金管理有限责任公司总裁、东方证券股份有限公司副总裁助理兼受托资产管理业务总部总经理，2006 年 9 月至今任职于东方证券股份有限公司，任公司副总经理。

崔泽军先生，中共党员，硕士研究生毕业，高级会计师。历任中原信托投资公司财务部副经理、经理，公司副总经理，现任中原信托投资有限公司总经理。

陆蔚，女，1965 年生，1991 年毕业于天津理工大学管理信息系统专业，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长、天津泰达集团证券投资项目日理，现任北方国际信托投资股份有限公司证券管理总部总经理。

任俊杰先生，大学本科毕业。历任中国人民银行深圳分行处长、深圳金融机构同业协会首任秘书长、赛格投资有限公司（香港注册）董事总经理、祥安证券有限公司（香港联交所会员）董事、中国投资环境协会副理事长，现任深圳岭南企业投资顾问有限公司副总经理。

王英女士，中共党员，研究生毕业。历任最高人民法院法官、副院长、庭长、副院长，中国女法官协会会长、中国人民大学兼职教授。

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。

刘彤，男，1964 年生，经济学博士。曾任中华工商时报社外部编辑、副主任，现任中华工商时报社新闻部主任、中国人民银行深圳分行金融创新部主任、现任任职于北方国际信托投资公司，曾任总编辑、兼任北京工商大学客座教授、中国人民大学经济学院研究所研究员。

关林戈先生，中共党员，经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任，中共天津市委领导同志秘书，南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理，长城证券有限责任公司总裁助理，长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理，现任长城基金管理有限公司总经理。

#### (2) 监事

阮争先生，大学本科毕业。历任黄河证券有限责任公司发行部经理，港澳信托投资有限公司信托基金部投资经理，中国电力信托投资公司投资公司基金部经理，现任中原信托投资有限公司投资管理部经理，并担任长城基金管理有限公司监事长。

杨业彦女士，会计师。历任伊斯坦国际信托投资公司计划财务部经理兼证券交易部部主任，宁夏证券登记公司经理，宁夏证券财务总监兼财务部经理，西北证券有限责任公司总裁助理。

罗世蓉女士，大学本科毕业，会计师。历任四川轻工厅盐业学校财经教研室主任、海南信托投资公司财务部主办会计、长城证券总部财务主管、长城证券总部副经理、长城证券资产管理部副经理、成都营业部副经理兼理财部副经理，深圳一部副经理兼财务部经理，公司审计部总经理、公司审计部副经理，现任长城证券有限责任公司财务部副经理。

张建辉先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任上海浦东发展银行信托证券发行部科员、东方证券股份有限公司经济业务管理总部辽宁管理总部副经理、总经理，现任东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理。

田德良，男，1966 年生，2005 年毕业于中央广播电视大学会计学专业，经济师。曾任任职于中国建设银行天津开发区分行，任经理助理、事后总稽核。现任任职于北方国际信托投资股份有限公司，曾任会计部经理助理、会计部副经理、会计部经理、总稽核兼资产管理部、项目评估部项目经理、业务发展部客户经理，现任运营业务总部项目经理。

桑煜，男，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，现任市场开发部总经理。

韩刚，男，中共党员，1999 年毕业于中国人民银行研究生部，经济学硕士。曾任任职于证券业研究中心研究员，2001 年 7 月进入长城基金管理有限公司，历任研究员、长城久富基金经理，现任基金管理部副总经理。

#### (3) 高级管理人员

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。

关林戈先生，中共党员，经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任，中共天津市委领导同志秘书，南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、常务副总经理，现任长城基金管理有限公司董事、总经理。

余波先生，博士研究生毕业。曾任教于中国人民大学经济学院，历任中国人民大学银行湖北支行科室负责人、君安证券股份有限公司宏观室负责人、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，现任长城基金管理有限公司副总经理兼运行保障部总经理。

汪秋先生，中共党员，博士研究生毕业。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处、海南港澳国际信托投资公司证券部，历任三业方实业股份有限公司副总经理，国信证券有限责任公司研究所所长，长城基金管理有限公司总经理助理，并先后兼任研究策划部总经理、市场开发部总经理，现任长城基金管理有限公司副经理。

韩涛先生，硕士研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资产管理部总经理，长城基金管理有限公司投资总监兼投资管理总部总经理、“久嘉证券投资基金”基金经理、总经理助理，“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理，现任长城基金管理有限公司副总经理。投资总监兼基金管理部总经理。

彭洪波先生，经济学硕士，MBA，13 年证券从业经历。曾就职于长城证券有限责任公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组组长，公司市场部技术主管。2002 年 3 月加盟长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副经理、部门经理，现任长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理。

2. 本基金基金经理简历

刘海先生，生于 1978 年，1999 年毕业于清华大学经济管理学院国际金融与财务专业，经济学学士。曾就职于深圳发展银行总行，任职债券交易员，2006 年 6 月进入长城基金管理有限公司，曾任“长城货币市场证券投资基金”基金经理，自 2006 年 3 月 9 日起任“长城货币市场证券投资基金”基金经理。“长城货币市场证券投资基金”历任基金经理如下：黄瑞端先生自 2005 年 5 月 30 日生效 2006 年 9 月 24 日任基金经理，王定元先生自 2005 年 9 月 25 日起 2006 年 3 月 8 日任基金经理。

3. 本基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

关林戈先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。  
韩涛先生，投资决策委员会执行委员，公司副总经理，投资总监兼基金管理部总经理。  
汪秋先生，投资决策委员会委员，公司副总经理。

### 二、基金托管人

#### (一) 基本情况

- 名称：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：刘海燕
- 组织形式：股份有限公司
- 成立日期：1992 年 10 月 14 日
- 批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行【银复（1992）391 号】
- 基金托管资格批复及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号
- 注册资本：42 亿元人民币
- 存续期间：持续经营
- 联系人：郑翔
- 电话：010-85238418
- 传真：010-85239680
- 客户服务电话：95577

#### (二) 基金托管业务主要人员情况

华夏银行基金托管部成立于 2004 年 7 月，内设市场综合室、交易管理室和稽察室 3 个职能处室，并在上海、深圳分行设立 2 个托管分部。基金托管部

共有员工 14 人，全部具有基金从业资格，高管人员均拥有硕士学位或高级职称。

### 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《证券投资基金托管业务管理办法》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，华夏银行基金托管部本着“诚实守信、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，取得了优异成绩。截至 2007 年 3 月末，已托管长城货币市场基金、国联安德盛纯债股票基金、万家货币市场基金、诺安中短债基金、益民红利成长混合型基金等 5 只开放式证券投资基金和 5 只其它受托资产管理产品，托管各类资产规模 65.93 亿元。

#### 三、相关服务机构

##### (一) 基金销售机构

- 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：0755-83662688
    - 传真：0755-83662600
    - 联系人：黄金英
    - 客户服务电话：400-8868-666
    - 网站：www.ccfund.com.cn
  - 代销机构
    - (1) 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
      - 办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号
      - 法定代表人：刘海燕
      - 电话：010-85238038
      - 联系人：刘伟刚
      - 客户服务电话：95577
      - 网站：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：秦晓
      - 电话：0755-82090060
      - 联系人：刘微
      - 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：郭树清
      - 客户服务电话：95533
      - 网站：www.ccb.com
    - (4) 中信建投证券股份有限公司
      - 注册地址：北京市朝阳区光华路 69 号
      - 办公地址：北京市朝阳区朝内大街 188 号
      - 法定代表人：黎晓宏
      - 电话：010-65186758
      - 联系人：权恒
      - 客户服务电话：4008888108
      - 网站：www.cscc108.com
    - (5) 海通证券股份有限公司
      - 注册地址：上海市广东路 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：021-962503
      - 网站：www.htsec.com
    - (6) 国泰君安证券股份有限公司
      - 注册地址：上海市浦东新区锦康路 618 号
      - 办公地址：上海延平路 135 号
      - 法定代表人：鲍广
      - 联系人：卢敏
      - 电话：021-62590818-213
      - 传真：021-62594000
      - 客户服务电话：4008888666
      - 网站：www.gtja.com
    - (7) 东方证券股份有限公司
      - 注册地址：上海市浦东新区东川路 270 号 20 楼
      - 法定代表人：刘宛
      - 联系人：吴宇
      - 电话：021-50367888
      - 传真：021-50366868
      - 客户服务电话：021-962506
      - 网站：www.dfzq.com.cn
    - (8) 兴业证券股份有限公司
      - 注册地址：福建省福州市湖光路 99 号标力大厦
      - 法定代表人：兰荣
      - 电话：021-68419974
      - 联系人：杨晓芳
      - 网站：www.xyzq.com.cn
    - (9) 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：牛宝霖
      - 联系人：高峰
      - 电话：0755-82516094
      - 传真：0755-83516199
      - 客户服务电话：0755-82288968
      - 网站：www.cc168.com.cn
    - (10) 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：朱利
      - 联系人：郭杨
      - 客户服务电话：8008201868
      - 网站：www.chinastock.com.cn
    - (11) 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：0755-82943511
      - 传真：0755-82943237
      - 联系人：黄薇
      - 客户服务电话：4008881111、0755-26951111
      - 网站：www.newone.com.cn
    - (12) 平安证券股份有限公司
      - 办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦二樓
      - 法定代表人：杨宇翔
      - 联系人：余江
      - 电话：0755-82450226
      - 传真：0755-82437794
      - 客户服务电话：95511
      - 网站：www.pazq.com.cn
    - (13) 华泰证券股份有限公司
      - 地址：南京市市中山东路 90 号华泰证券大厦
      - 法定代表人：吴万福
      - 电话：025-84457777-882, 721
      - 联系人：张雪薇、袁红彬
      - 客户服务电话：025-84579897
      - 网站：www.htsec.com
    - (14) 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：谢平
      - 电话：021-54383888
      - 传真：021-54035333
      - 客户服务电话：021-962505
      - 公司网站：www.sw2000.com.cn
    - (15) 渤海证券股份有限公司
      - 办公地址：天津市河西区滨水道 3 号
      - 法定代表人：张志坚
      - 联系人：徐晓媛
      - 客户服务电话：022-28455888
      - 公司网站：www.bhzq.com.cn
  - (16) 江铃证券有限责任公司
    - 注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号
    - 法定代表人：曾荣兴
    - 联系人：余维娜
    - 电话：0791-6788763
    - 传真：0791-6789414
    - 网站：www.scstock.com
  - (17) 华西证券有限责任公司
    - 注册地址：四川省成都市陕西路 239 号
    - 办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼（深圳总部）
    - 法定代表人：张慎修
    - 联系人：杨玲
    - 电话：0755-83025430
    - 传真：0755-83025391
  - (18) 国盛证券有限责任公司
    - 注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号
    - 办公地址：江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼
    - 法定代表人：管荣平
    - 联系电话：0791-6285337
    - 联系人：徐美云
    - 网站：www.gststock.com
  - (19) 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
    - 法人代表人：何如
    - 联系人：林建海
    - 电话：0755-82133066
    - 传真：0755-82133302
    - 客户服务电话：800-810-8868
    - 公司网站：www.guosen.com.cn
  - (20) 联合证券有限责任公司
    - 注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10.25 层
    - 法定代表人：王峻
    - 联系人：范雷鸣
    - 电话：0755-82492000
    - 传真：0755-82492062
    - 客户服务电话：400-8888-555、0755-25125666
    - 网站：www.lhzq.com
  - (21) 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 5 楼

法定代表人：吴志明

联系人：曾洋

电话：020-87322668

传真：020-87325036

客户服务电话：020-9613003

网站：www.gzsc.com.cn

(22) 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：段强

联系人：刘军辉

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199511

网站：www.csco.com.cn

基金管理人可以根据情况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：0755-83662688

传真：0755-83662600

联系人：杜翼

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

(二) 律师事务所与经办律师

律师事务所名称：北京市杜君律师事务所

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、宋萍萍

电话：0755-22163333

传真：0755-22163380

联系人：宋萍萍

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：深圳大华天诚会计师事务所

注册地址：深圳市福田区滨河大道 5022 号联合广场 B 座 11 楼

负责人：李秉心

经办注册会计师：李秉心、徐海宁

电话：0755-82900952

传真：0755-82900965

### 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

根据宏观经济状况、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构成比例。

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情况下，本基金货币市场基金的投资组合比例范围为：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%。

### 八、基金的投资策略

1. 一级资产配置策略

根据宏观预期对利率水平、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构成比例。

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情况下，本基金货币市场基金的投资组合比例范围为：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%。

### 九、基金的投资组合

根据不同类型的基金份额的剩余期限结构、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、法律法规对市场投资市值的限制、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。

### 十、基金的风险收益特征

本基金在证券投资基金中属于中高风险、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都高于一般债券、货币和混合型基金。

### 十一、基金投资组合

本基金管理人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 2007 年 4 月 12 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本报告期为 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 3 月 31 日止，本报告财务资料未经审计。

1. 报告期内基金资产组合			
	资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例
债券投资		535,063,994.55	85.62%
买入返售证券		60,408,000.00	9.67%
其中:买断式回购的买入返售证券		0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计		5,231,871.74	0.84%
其他资产		24,230,086.46	3.88%
合计		624,923,952.75	100.00%

2. 报告期债券回购融资情况			
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例
1	报告期内债券回购融资余额	6,510,390,000.00	7.45%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	101,500,000.00	19.46%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%

在本报告期内，本基金未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

3. 投资组合平均剩余期限基本情况		
	项目	天数
报告期未投资组合平均剩余期限		114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值		143
报告期内投资组合平均剩余期限最低值		47

在本报告期内，本基金投资组合