

中海货币市场证券投资基金 2013 年半年度 报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 28 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 22 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 2013 年 1 月 1 日起至 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 基金表现...	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况...	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ...	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ...	10
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 ...	11
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
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ...	12
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 托管人对本半年度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...	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表...	15
6.4 报表附注...	16
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况...	30
7.2 债券回购融资情况...	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限...	31
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 ...	32
7.5 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 ...	33
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 ...	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 ...	34
7.8 投资组合报告附注 ...	34
§8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ...	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ...	35
§9 开放式基金份额变动	35
§10 重大事件揭示	36

10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
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	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	37
10.9 其他重大事件.....	37
§11 备查文件目录.....	39
11.1 备查文件目录.....	39
11.2 存放地点.....	40
11.3 查阅方式.....	40

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中海货币市场证券投资基金	
基金简称	中海货币	
基金主代码	392001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 7 月 28 日	
基金管理人	中海基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,472,181,478.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中海货币 A	中海货币 B
下属分级基金的交易代码:	392001	392002
报告期末下属分基基金的份额总额	177,618,924.03 份	1,294,562,554.03 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保证资产安全与资产充分流动性前提下，追求高于业绩比较基准的收益率，为基金份额持有人创造稳定的当期收益。
投资策略	<p>1、利率预期策略 根据对宏观经济和利率走势的分析，本基金将制定利率预期策略。如果预期利率下降，将增加组合的久期；反之，如果预期利率将上升，则缩短组合的久期。</p> <p>2、期限结构配置策略 各类债券资产在期限结构上的配置是本基金所选择的收益率曲线策略在资产配置过程中的具体体现，本基金采用总收益分析法在子弹组合、杠铃组合、梯形组合等三种基础类型中进行选择。</p> <p>3、类属配置策略 根据各类短期固定收益类金融工具的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。</p> <p>4、流动性管理策略 在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下，通过基金资产安排（包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或其他措施），保证基金资产的高流动性。</p> <p>5、套利策略 本基金的套利策略主要是利用不同市场、不同期限和不同品种之间的收益率差异，通过融入和融出的资金安排，获取无风险的利差收益。</p>
业绩比较基准	同期 7 天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属货币市场证券投资基金，为证券投资基金中的低风险品种。

	本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
--	-------------------------------------

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	中海基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王莉
	联系电话	021-38429808
	电子邮箱	wangl@zhfund.com
客户服务电话	400-888-9788 021-38789788	95588
传真	021-68419525	010-66105798
注册地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	黄鹏	姜建清

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、证券时报
登载基金半年度报告报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金半年度报告报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中海基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 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

基金级别	中海货币 A	中海货币 B
------	--------	--------

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	5,388,682.57	39,313,122.52
本期利润	5,388,682.57	39,313,122.52
本期净值收益率	1.6555%	1.7775%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末基金资产净值	177,618,924.03	1,294,562,554.03
期末基金份额净值	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)	
累计净值收益率	10.4162%	11.1965%

注 1：本报告期指自 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日。

注 2：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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

注 3：本基金按日结转份额。

3.2 基金表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中海货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2507%	0.0014%	0.1081%	0.0000%	0.1426%	0.0014%
过去三个月	0.8191%	0.0040%	0.3286%	0.0000%	0.4905%	0.0040%
过去六个月	1.6555%	0.0033%	0.6558%	0.0000%	0.9997%	0.0033%
过去一年	3.4533%	0.0059%	1.3318%	0.0000%	2.1215%	0.0059%
自基金合同生效日起至今	10.4162%	0.0067%	4.1849%	0.0002%	6.2313%	0.0065%

中海货币 B

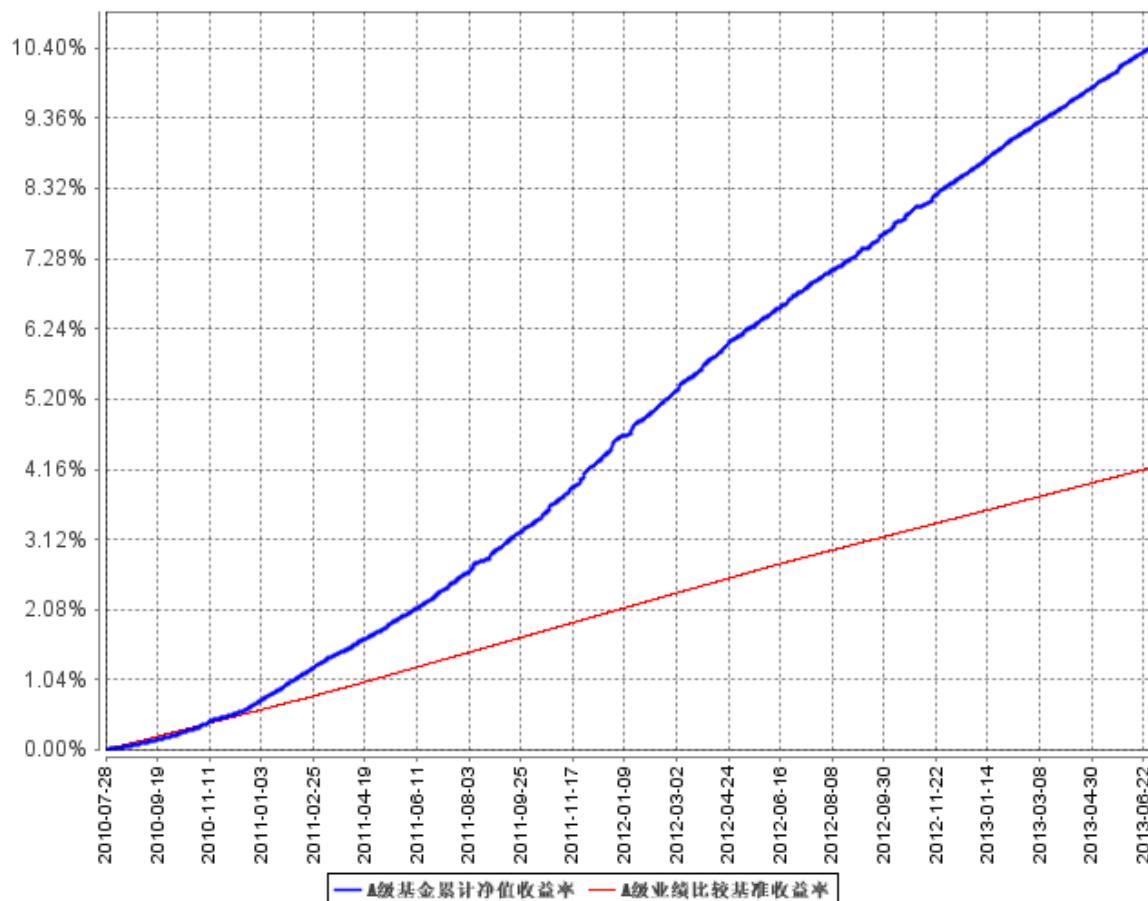
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2707%	0.0014%	0.1081%	0.0000%	0.1626%	0.0014%
过去三个月	0.8797%	0.0040%	0.3286%	0.0000%	0.5511%	0.0040%
过去六个月	1.7775%	0.0033%	0.6558%	0.0000%	1.1217%	0.0033%
过去一年	3.7023%	0.0059%	1.3318%	0.0000%	2.3705%	0.0059%

自基金合同生效日起至今	11.1965%	0.0067%	4.1849%	0.0002%	7.0116%	0.0065%
-------------	----------	---------	---------	---------	---------	---------

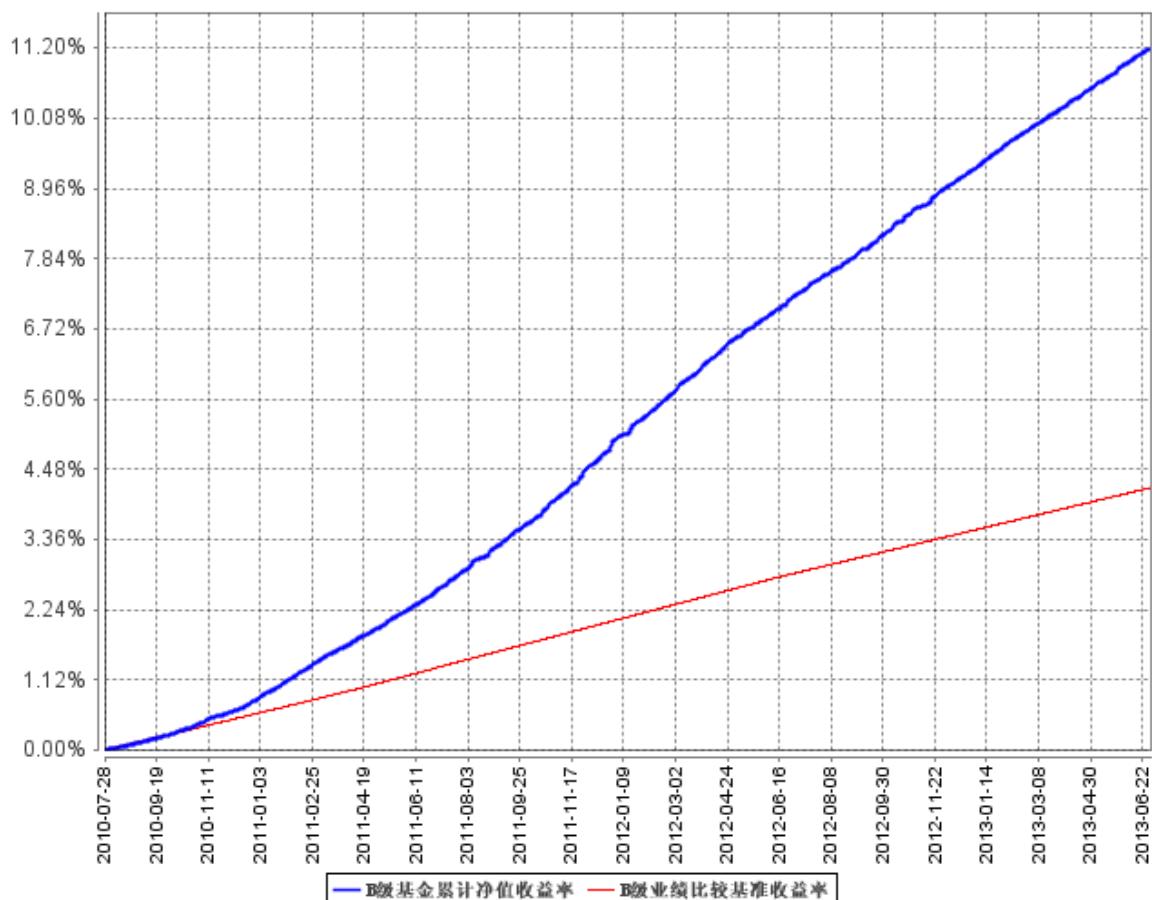
注：“自基金合同生效起至今”指 2010 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日

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

A 级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B 级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2013 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 15 只。

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		
冯小波	本基金基金经理	2012 年 10 月 26 日	-	11	冯小波先生，上海交通大学管理科学与工程专业硕士。

					历任华泰保险股份有限公司交易员，平安证券股份有限公司投资经理，兴业银行股份有限公司债券交易员、高级副理。2012 年 8 月进入本公司工作，任职于投研中心。2012 年 10 月至今任中海货币市场证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注 1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注 2：证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司依据 2011 年修订的《中海基金公平交易管理办法》，从投资决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估等方面对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动进行全程公平交易管理。

投资决策内部控制方面：(1) 公司研究平台共享，基金经理和专户投资经理通过研究平台平等获取研究信息。(2) 公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监因工作管理的需要外，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

交易执行内部控制方面：(1) 对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据研究报告独立确定申购价格和数量，在获配额度确定后，由交易部遵循公平原则对获配额度进行分配，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。(2) 投资交易指令统一通过交易室下达，通过启用公平交易模块，保证时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实。(3) 根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数被动投资组合外）的同日反向交易。(4) 债券场外交易，交易部在银行间市场上公平公正地进行询价，并由风险管理部对询价收益率偏离、交易对手及交易方式进行事前审核。

行为监控和分析评估方面：(1) 公司每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、

反向及异常交易分析。(2) 公司对 2013 年上半年所有组合在日内、3 日、5 日所有同向交易数据进行了采集，对于相关采集样本进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 t 统计检验，绝大多数样本通过相关检验。(3) 对 2013 年上半年所有组合同向交易的交易占优情况进行了统计，在同向交易采集样本数大于 30 个的前提下，日内、3 日、5 日的期间窗口下，部分组合对比的统计值未满足交易占优比 45%-55% 的比例。需要指出的是，组合的同向交易的样本数越大，组合之间的交易占优情况满足交易占优比 45%-55% 的比例越高。(4) 对于不同时间期间的同组合反向交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量进行了综合分析，未发现异常情况。不同时间期间的不同组合的反向交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量进行了综合分析，未发现异常交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金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

2013 年上半年，在出口下滑、国内需求不振的情况下，国内经济增速逐季回落，经济增长缺乏动力。内外需求都比较疲弱：基建投资反弹未能抵消制造业投资放缓影响，汽车销售下滑，就业市场疲弱，增长减速可能进一步影响工资收入并掣肘消费；外需疲弱，加之人民币升值对出口负面影响持续。CPI 低位徘徊，总体通胀压力不大。受多方面因素影响，6 月份银行间市场出现资金面持续紧张的局面，在美联储退出 QE 的预期作用下，银行间市场资金面持续宽松将成过去式，市场需要时间消化和适应目前这种紧平衡格局。

债券市场受资金面波动影响较大，一季度资金面较为宽松，债券市场交投活跃，收益率不断走低，尤其低评级信用债收益率下降幅度惊人；二季度资金面趋紧，债券收益率受资金成本抬升的影响，债券收益率开始回升，信用债市场出现大量评级下调的现象，信用风险陡增。

上半年，本基金遵循一贯的以流动性管理为目标的原则，在满足持有人资金安排需求的同时，努力提高基金的收益。策略上，资产配置更为关注资产流动性，关键时点备足流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，报告期内本基金 A 净值收益率为 1.6555%，高于业绩比较基准 0.9997 个百分点；报告期内本基金 B 净值收益率为 1.7775%，高于业绩比较基准 1.1217 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年的债券市场，我们认为应相对谨慎。

宏观经济在三季度仍有可能继续下滑，是否触及管理层所谓底线以及触及底线时管理层会出什么牌，这是市场关注的重点。在出口疲弱的背景下，人民币小幅贬值很有可能作为稳增长的重要手段被管理层采用。

就债券市场而言，尽管有经济增长疲弱的基本面支持，资金面格局的变化，资金成本抬升已经是既定事实，投资者不得不长期面对这个事实，因此债券市场投资者的思维要从过去十多年来人民币升值的宽松货币环境中转换过来，学会勒紧裤带过紧日子，从这点来看，债券市场短期内很难有大的机会。但一些交易性和结构性的机会仍会继续存在，需要投资者密切关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的估值核算小组，组成人员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等，成员均具有多年基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理，但对于非活跃投资品种，投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，本基金每日将各级基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对中海货币市场证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中海货币市场证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海货币市场证券投资基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的中海货币市场证券投资基金 2013 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：中海货币市场证券投资基金
报告截止日： 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	202, 465, 769. 85	1, 643, 156, 908. 37
结算备付金		3, 624, 090. 91	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1, 370, 026, 286. 06	1, 160, 130, 163. 80
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1, 370, 026, 286. 06	1, 160, 130, 163. 80
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	715, 202, 432. 80
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	20, 460, 548. 00	17, 484, 438. 57
应收股利		-	-
应收申购款		236, 100. 00	12, 550. 00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1, 596, 812, 794. 82	3, 535, 986, 493. 54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		123, 499, 574. 75	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		839. 85	—
应付管理人报酬		613, 647. 30	697, 602. 82
应付托管费		185, 953. 73	211, 394. 82
应付销售服务费		69, 064. 69	168, 193. 45
应付交易费用	6.4.7.7	18, 001. 51	29, 298. 58
应交税费		—	—
应付利息		67, 191. 35	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	177, 043. 58	60, 000. 00
负债合计		124, 631, 316. 76	1, 166, 489. 67
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1, 472, 181, 478. 06	3, 534, 820, 003. 87
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		1, 472, 181, 478. 06	3, 534, 820, 003. 87
负债和所有者权益总计		1, 596, 812, 794. 82	3, 535, 986, 493. 54

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 1, 472, 181, 478. 06 份，其中 A 级基金份额总额 177, 618, 924. 03 份，B 级基金份额总额 1, 294, 562, 554. 03 份。

6.2 利润表

会计主体：中海货币市场证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013 年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012 年6月30日
一、收入		52, 388, 862. 08	37, 004, 853. 91
1.利息收入		48, 821, 489. 95	31, 174, 962. 56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21, 912, 431. 57	19, 589, 949. 78
债券利息收入		22, 004, 651. 55	7, 460, 284. 76
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		4, 904, 406. 83	4, 124, 728. 02
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		3, 567, 372. 13	5, 829, 891. 35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—

债券投资收益	6.4.7.13	3, 567, 372. 13	5, 829, 891. 35
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		7, 687, 056. 99	5, 059, 920. 13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4, 237, 159. 23	2, 575, 504. 24
2. 托管费	6.4.10.2.2	1, 283, 987. 67	780, 455. 76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	519, 157. 75	838, 046. 69
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		1, 482, 490. 35	668, 927. 90
其中：卖出回购金融资产支出		1, 482, 490. 35	668, 927. 90
6. 其他费用	6.4.7.19	164, 261. 99	196, 985. 54
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		44, 701, 805. 09	31, 944, 933. 78
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		44, 701, 805. 09	31, 944, 933. 78

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中海货币市场证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3, 534, 820, 003. 87	-	3, 534, 820, 003. 87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44, 701, 805. 09	44, 701, 805. 09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2, 062, 638, 525. 81	-	-2, 062, 638, 525. 81

其中：1. 基金申购款	4,183,353,572.24	-	4,183,353,572.24
2. 基金赎回款	-6,245,992,098.05	-	-6,245,992,098.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-44,701,805.09	-44,701,805.09
五、期末所有者权益(基金净值)	1,472,181,478.06	-	1,472,181,478.06
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,280,455,859.10	-	1,280,455,859.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,944,933.78	31,944,933.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	336,541,839.60	-	336,541,839.60
其中：1. 基金申购款	5,747,908,215.44	-	5,747,908,215.44
2. 基金赎回款	-5,411,366,375.84	-	-5,411,366,375.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-31,944,933.78	-31,944,933.78
五、期末所有者权益(基金净值)	1,616,997,698.70	-	1,616,997,698.70

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：

黄鹏

宋宇

曹伟

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

中海货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)由中海基金管理有限公司依照《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》及有关法规规定，经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】872号《关于核准中海货币市场证券投资基金募集的批复》核准募集。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为中海基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行；有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于 2010 年 7 月 28 日生效，该日的基金份额总额为 2,958,869,207.75 份，其中 A 级基金份额总额 784,590,763.21 份，B 级基金份额总额 2,174,278,444.54 份。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下简称“企业会计准则”）、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金管理业务指引》、本基金合同和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

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

本基金在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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

6.4.6.1

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

6.4.6.2

基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

6.4.6.3

对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
活期存款	2,465,769.85
定期存款	200,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	200,000,000.00
其他存款	-
合计：	202,465,769.85

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 2013年6月30日			
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	1,370,026,286.06	1,368,592,000.00	-1,434,286.06
	合计	1,370,026,286.06	1,368,592,000.00	-1,434,286.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	990.75
应收定期存款利息	311,111.08
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,630.80
应收债券利息	20,146,815.37
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	20,460,548.00

6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	18,001.51
合计	18,001.51

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.60
预提费用	177,030.98
合计	177,043.58

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中海货币 A	
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日

	基金份额(份)	账面金额
上年度末	670,926,191.45	670,926,191.45
本期申购	367,035,637.84	367,035,637.84
本期赎回(以"-"号填列)	-860,342,905.26	-860,342,905.26
本期末	177,618,924.03	177,618,924.03

金额单位：人民币元

中海货币 B		
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,863,893,812.42	2,863,893,812.42
本期申购	3,816,317,934.40	3,816,317,934.40
本期赎回(以"-"号填列)	-5,385,649,192.79	-5,385,649,192.79
本期末	1,294,562,554.03	1,294,562,554.03

注：其中本期申购包含红利再投、转换入份额，本期赎回包含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中海货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	5,388,682.57	-	5,388,682.57
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-5,388,682.57	-	-5,388,682.57
本期末	-	-	-

单位：人民币元

中海货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	39,313,122.52	-	39,313,122.52
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-39,313,122.52	-	-39,313,122.52
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	91,607.11
定期存款利息收入	21,677,653.25
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	22,550.57
其他	120,620.64
合计	21,912,431.57

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金在本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	762,118,136.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	739,341,889.52
减：应收利息总额	19,208,875.31
债券投资收益	3,567,372.13

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金在本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

注：本基金在本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

注：本基金在本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

注：本基金在本报告期无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

注：本基金在本报告期无交易费用。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	37,687.82
信息披露费	79,343.16
银行汇划费用	28,831.01
债券帐户维护费	18,400.00
合计	164,261.99

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

本基金在本报告期无需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日后的收益分配事项如下：

2013 年度	宣告日	分配收益所属期间
—第 7 号收益支付公告	2013/07/15	2013/6/17–2013/7/14
—第 8 号收益支付公告	2013/08/15	2013/7/15–2013/8/14

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
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
工商银行	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构
中国海洋石油总公司	基金管理人的关联方
中海石油财务有限责任公司	基金管理人的关联方

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

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未在关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未在关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未在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

注：本基金本期及上年度可比期间无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 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,237,159.23	2,575,504.24
其中：支付销售机构的客户维护费	332,723.68	639,601.57

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提，计算方法如下：

$H=E \times 0.33\% / \text{当年天数}$ (H 为每日应支付的基金管理费， E 为前一日的基金资产净值)

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30 日
当期发生的基金应支付	1,283,987.67	780,455.76

的托管费		
------	--	--

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数} \quad (H \text{ 为每日应支付的基金托管费, } E \text{ 为前一日的基金资产净值})$$

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中海货币 A	中海货币 B	合计
中海基金	23,115.74	96,087.11	119,202.85
工商银行	141,107.53	3,875.33	144,982.86
国联证券	1,409.39	0.00	1,409.39
合计	165,632.66	99,962.44	265,595.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中海货币 A	中海货币 B	合计
中海基金	15,495.35	35,145.23	50,640.58
工商银行	340,178.91	3,945.06	344,123.97
国联证券	601.50	8.20	609.70
合计	356,275.76	39,098.49	395,374.25

注：本基金 A 级基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，B 级基金份额的销售服务费年费率为 0.01%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数} \quad (H \text{ 为每日该级基金份额应支付的基金销售服务费, } E \text{ 为前一日该级基金份额的基金资产净值, } R \text{ 为该级基金份额的年销售服务费率})$$

基金销售服务费每日计算，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。

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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：中海货币 A 类

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

中海货币 B 类

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

中海货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
-	-	-	-	-

中海货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中海石油财务 有限责任公司	100,172,841.11	7.74%	302,151,331.94	8.55%
中国海洋石油 总公司	758,831,349.21	58.62%	-	-

注：本基金已按照招募说明书上列示的费率对关联方收取了基金投资的相关费用。

6.4.10.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
工商银行	2,465,769.85	91,607.11	4,517,281.81	200,688.13

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

中海货币A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
5,388,682.57	-	-	5,388,682.57	-

中海货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
39,313,122.52	-	-	39,313,122.52	-

6.4.12 期末（2013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

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金在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 2013 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 123,499,574.75 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
090407	09农发07	2013年7月1日	100.60	200,000	20,120,000.00
130306	13进出06	2013年7月5日	99.11	1,100,000	109,021,000.00
合计				1,300,000	129,141,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

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涉及的财务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《中海基金投资决策委员会议事规则》、《中海基金投资业务流程》、《中海基金权限管理办法》、《中海基金固定收益部管理办法》、《中海基金债券库管理制度》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阀值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理部、监察稽核部、相关部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部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，以控制可能的信用风险。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，不得超过该证券的 10%。

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极小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
A-1	820,406,761.17	941,468,401.13
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	319,835,385.58	188,584,138.69
合计	1,140,242,146.75	1,130,052,539.82

注：本期末按短期信用评级为“未评级”的债券为政策性金融债及清算所超级短期融资券；上年度末按短期信用评级为“未评级”的债券为政策性金融债及超级短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00

未评级	229,784,139.31	30,077,623.98
合计	229,784,139.31	30,077,623.98

注：本期末按长期信用评级为“未评级”的债券均为政策性金融债；上年度末按长期信用评级为“未评级”的债券投资为中央银行票据及政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现困难，从而对基金收益造成的不利影响。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另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。

本基金所持有大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。为了应对银行间同业市场交易不活跃而带来的变现困难，本基金持有的银行间金融债的久期均小于一年。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，保证现金和到期日不超过 1 年的政府债券持有量在基金资产净值中的占比在 5%以上的水平。

2013 年 6 月 30 日本基金债券持仓比例为 93.06%，提前支取不损失利息的“定期存款”持仓比例为 13.59%；2012 年 12 月 31 日，本基金债券资产持仓比例为 32.82%，提前支取不损失利息的“定期存款”持仓比例为 46.40%。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过多种金融工程工具对基金资产结构及剩余期限等指标进行合理搭配，从而达到有效控制本基金市场风险的目的。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金持有的债券资产在一定程度上存在着利率风险，本基金通过对债券资产的剩余期限及券种结构进行优化，从而达到有效降低利率风险的目的。

下表分别列示了截止 2013 年 6 月 30 日与 2012 年 12 月 31 日，本基金所面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早

者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013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							
银行存款	2,465,769.85	200,000,000.00		-	-	-	202,465,769.85
结算备付 金	3,624,090.91	-		-	-	-	3,624,090.91
交易性金 融资产	309,665,410.34	199,990,486.51	860,370,389.21	-	-	-	1,370,026,286.06
应收利息	-	-		-	-	20,460,548.00	20,460,548.00
应收申购 款	-	-		-	-	236,100.00	236,100.00
资产总计	315,755,271.10	399,990,486.51	860,370,389.21	-	-	20,696,648.00	1,596,812,794.82
负债							
卖出回购 金融资产 款	123,499,574.75	-		-	-	-	123,499,574.75
应付赎回 款	-	-		-	-	839.85	839.85
应付管理 人报酬	-	-		-	-	613,647.30	613,647.30
应付托管 费	-	-		-	-	185,953.73	185,953.73
应付销售 服务费	-	-		-	-	69,064.69	69,064.69
应付交易 费用	-	-		-	-	18,001.51	18,001.51
应付利息	-	-		-	-	67,191.35	67,191.35
其他负债	-	-		-	-	177,043.58	177,043.58
负债总计	123,499,574.75	-	-	-	-	1,131,742.01	124,631,316.76
利率敏感 度缺口	192,255,696.35	399,990,486.51	860,370,389.21	-	-	19,564,905.99	1,472,181,478.06
上年度末 2012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							
银行存款	1,443,156,908.37	200,000,000.00		-	-	-	1,643,156,908.37
交易性金 融资产	40,249,383.77	60,223,955.22	1,059,656,824.81	-	-	-	1,160,130,163.80

买入返售金融资产	715,202,432.80	-	-	-	-	-	-	715,202,432.80
应收利息	-	-	-	-	-	17,484,438.57	17,484,438.57	
应收申购款	-	-	-	-	-	12,550.00	12,550.00	
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,198,608,724.94	260,223,955.22	1,059,656,824.81	-	-	17,496,988.57	3,535,986,493.54	
负债								
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	697,602.82	697,602.82	
应付托管费	-	-	-	-	-	211,394.82	211,394.82	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	168,193.45	168,193.45	
应付交易费用	-	-	-	-	-	29,298.58	29,298.58	
其他负债	-	-	-	-	-	60,000.00	60,000.00	
负债总计	-	-	-	-	-	1,166,489.67	1,166,489.67	
利率敏感度缺口	2,198,608,724.94	260,223,955.22	1,059,656,824.81	-	-	16,330,498.90	3,534,820,003.87	

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本报告期末及上年度末，在“影子定价”机制有效的前提下，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降 25 个基点，对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金没有持有外汇资产及负债，故汇率变化不会对本基金产生重大的影响。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于银行间的固定收益品种，其风险为利率风险和信用风险，因此其他市场因素对本基金资产净值不会产生直接影响。

§ 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	固定收益投资	1,370,026,286.06	85.80
	其中：债券	1,370,026,286.06	85.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	206,089,860.76	12.91
4	其他各项资产	20,696,648.00	1.30
5	合计	1,596,812,794.82	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	2.94
	其中：买断式回购融资	-
序号	项目	金额
2	报告期末债券回购融资余额	123,499,574.75
	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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	132
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	76

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余	原因	调整期

		期限(天数)		
1	2013 年 1 月 11 日	122	大额赎回	2
2	2013 年 1 月 12 日	121	大额赎回	1
3	2013 年 1 月 24 日	132	存款到期	7
4	2013 年 1 月 25 日	129	存款到期	6
5	2013 年 1 月 26 日	128	存款到期	5
6	2013 年 1 月 27 日	127	存款到期	4
7	2013 年 1 月 28 日	127	存款到期	3
8	2013 年 1 月 29 日	129	存款到期	2
9	2013 年 1 月 30 日	127	存款到期	1
10	2013 年 6 月 27 日	122	遭遇巨额赎回	2
11	2013 年 6 月 28 日	121	遭遇巨额赎回	1

注：报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况。

根据本基金基金合同规定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，下同。

7.3.2 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	21.45	8.39
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	14.25	-
2	30 天(含)—60 天	10.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	16.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	36.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	21.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		107.06	8.39

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)

1	国家债券		-	-
2	央行票据		-	-
3	金融债券	479,655,144.98	32.58	
	其中：政策性金融债	479,655,144.98	32.58	
4	企业债券		-	-
5	企业短期融资券	890,371,141.08	60.48	
6	中期票据		-	-
7	其他		-	-
8	合计	1,370,026,286.06	93.06	
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	209,726,170.65	14.25	

7.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	130306	13 进出 06	1,600,000	159,785,324.74	10.85
2	130210	13 国开 10	1,500,000	149,931,765.98	10.18
3	130214	13 国开 14	1,000,000	99,939,239.69	6.79
4	041351012	13 雅砻江 CP001	800,000	80,097,317.45	5.44
5	041259077	12 贵投 CP001	800,000	80,074,091.43	5.44
6	011340002	13 港中旅 SCP002	700,000	69,964,379.91	4.75
7	041264033	12 沈机床 CP001	600,000	60,040,493.31	4.08
8	041360015	13 森工集 CP001	500,000	50,049,437.84	3.40
9	041253061	12 云电投 CP001	500,000	50,024,481.34	3.40
10	041260072	12 厦路桥 CP001	500,000	50,015,750.95	3.40

7.6 “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	3
报告期内偏离度的最高值	0.2560%
报告期内偏离度的最低值	-0.3052%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1831%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1

本基金估值采用摊余成本法估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提收益。

7.8.2

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

7.8.3

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.8.4 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,460,548.00
4	应收申购款	236,100.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,696,648.00

7.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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。

§ 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

份	持有人	户均持有的基金	持有人结构
---	-----	---------	-------

份额 级别	户数 (户)	份额	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
中海货币 A	4,951	35,875.36	6,121,987.70	3.45%	171,496,936.33	96.55%
中海货币 B	9	143,840,283.78	1,283,389,211.51	99.14%	11,173,342.52	0.86%
合计	4,960	296,810.78	1,289,511,199.21	87.59%	182,670,278.85	12.41%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中海货币 A	420,830.21	0.2369%
	中海货币 B	-	-
	合计	420,830.21	0.0286%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中海货币 A	中海货币 B
基金合同生效日（2010 年 7 月 28 日）基金 份额总额	784,590,763.21	2,174,278,444.54
本报告期期初基金份额总额	670,926,191.45	2,863,893,812.42
本报告期基金总申购份额	367,035,637.84	3,816,317,934.40
减：本报告期基金总赎回份额	860,342,905.26	5,385,649,192.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	177,618,924.03	1,294,562,554.03

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为江苏公证天业会计师事务所有限公司，本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

本报告期内本基金管理人、托管机构及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
申银万国	1	-	-	-	-	-

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单

元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报监察稽核部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

注 4：以上数据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。

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
申银万国	-	-	3,445,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

注：本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

10.9 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	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、证券时报	2013年1月15日
2	中海货币市场证券投资基金 2012 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报	2013年1月22日
3	关于中海货币市场证券投资基金春节假期前暂停申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告	中国证券报、证券时报	2013年2月4日
4	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、证券时报	2013年2月18日
5	中海货币市场证券投资基金更新招募说明书（2013年第1号）	中海基金网站	2013年3月13日

6	中海货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要(2013年第1号)	中国证券报、证券时报	2013年3月13日
7	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、证券时报	2013年3月15日
8	关于中海货币市场证券投资基金清明节假期前暂停申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告	中国证券报、证券时报	2013年3月27日
9	中海货币市场证券投资基金2012年年度报告(正文)	中海基金网站	2013年3月30日
10	中海货币市场证券投资基金2012年年度报告(摘要)	中国证券报、证券时报	2013年3月30日
11	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、证券时报	2013年4月15日
12	关于中海货币市场证券投资基金劳动节假期前暂停申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告	中国证券报、证券时报	2013年4月19日
13	中海货币市场证券投资基金2013年第1季度报告	中国证券报、证券时报	2013年4月20日
14	中海基金管理有限公司关于变更中国银行直销账号的公告	中国证券报、证券时报	2013年5月8日
15	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增和讯信息科技有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报	2013年5月14日
16	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、证券时报	2013年5月15日

17	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海天天基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报	2013年5月23日
18	中海基金管理有限公司关于开通中海 e 家网上直销系统 e 通宝账户快速取现服务的公告	中国证券报、证券时报	2013年5月30日
19	中海基金管理有限公司关于中海货币市场证券投资基金端午节假期前暂停申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告	中国证券报、证券时报	2013年6月3日
20	中海基金管理有限公司关于旗下基金在上海天天基金销售有限公司调整定期定额投资业务起点金额的公告	中国证券报、证券时报	2013年6月3日
21	中海基金管理有限公司关于变更对账单服务方式的公告	中国证券报、证券时报	2013年6月14日
22	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、证券时报	2013年6月17日
23	中海基金管理有限公司关于中海 e 家网上直销系统 e 通宝账户快速取现服务升级的公告	中国证券报、证券时报	2013年6月21日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海货币市场证券投资基金的文件
- 2、中海货币市场证券投资基金基金合同

- 3、中海货币市场证券投资基金管理协议
- 4、中海货币市场证券投资基金管理财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

11.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

11.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021) 38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司
2013 年 8 月 28 日