

中海货币市场证券投资基金 2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 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：2014 年 3 月 29 日

§ 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 2014 年 3 月 20 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	1,688,562,218.00 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
报告期末下属分级基金的份额总额	235,005,697.95 份	1,453,556,520.05 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	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。 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。 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。 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、剩余期限管理或以其他措施），保证基金资产的高流动性。 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。
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	赵会军
	联系电话	021-38429808	010-66105799
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9788 021-38789788	95588
传真		021-68419525	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间 数据 和指 标	2013 年		2012 年		2011 年	
	中海货币 A	中海货币 B	中海货币 A	中海货币 B	中海货币 A	中海货币 B
本期 已实 现收 益	10,142,739.77	70,185,789.21	22,493,833.72	45,584,688.22	8,374,004.86	52,814,103.29
本期 利润	10,142,739.77	70,185,789.21	22,493,833.72	45,584,688.22	8,374,004.86	52,814,103.29
本期 净值 收益 率	3.8570%	4.1074%	3.8537%	4.1035%	3.8521%	4.1012%
3.1.2 期末	2013 年末		2012 年末		2011 年末	

数据和指标						
期末基金资产净值	235,005,697.95	1,453,556,520.05	670,926,191.45	2,863,893,812.42	504,680,920.97	775,774,938.13
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

金额单位：人民币元

注 1：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，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 2：本基金按日结转份额。

3.2 基金表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中海货币 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.2088%	0.0099%	0.3300%	0.0000%	0.8788%	0.0099%
过去六个月	2.1656%	0.0074%	0.6623%	0.0000%	1.5033%	0.0074%
过去一年	3.8570%	0.0059%	1.3224%	0.0000%	2.5346%	0.0059%
过去三年	12.0142%	0.0070%	4.2611%	0.0002%	7.7531%	0.0068%
自基金合同生效日起至 今	12.8073%	0.0069%	4.8749%	0.0002%	7.9324%	0.0067%

中海货币 B

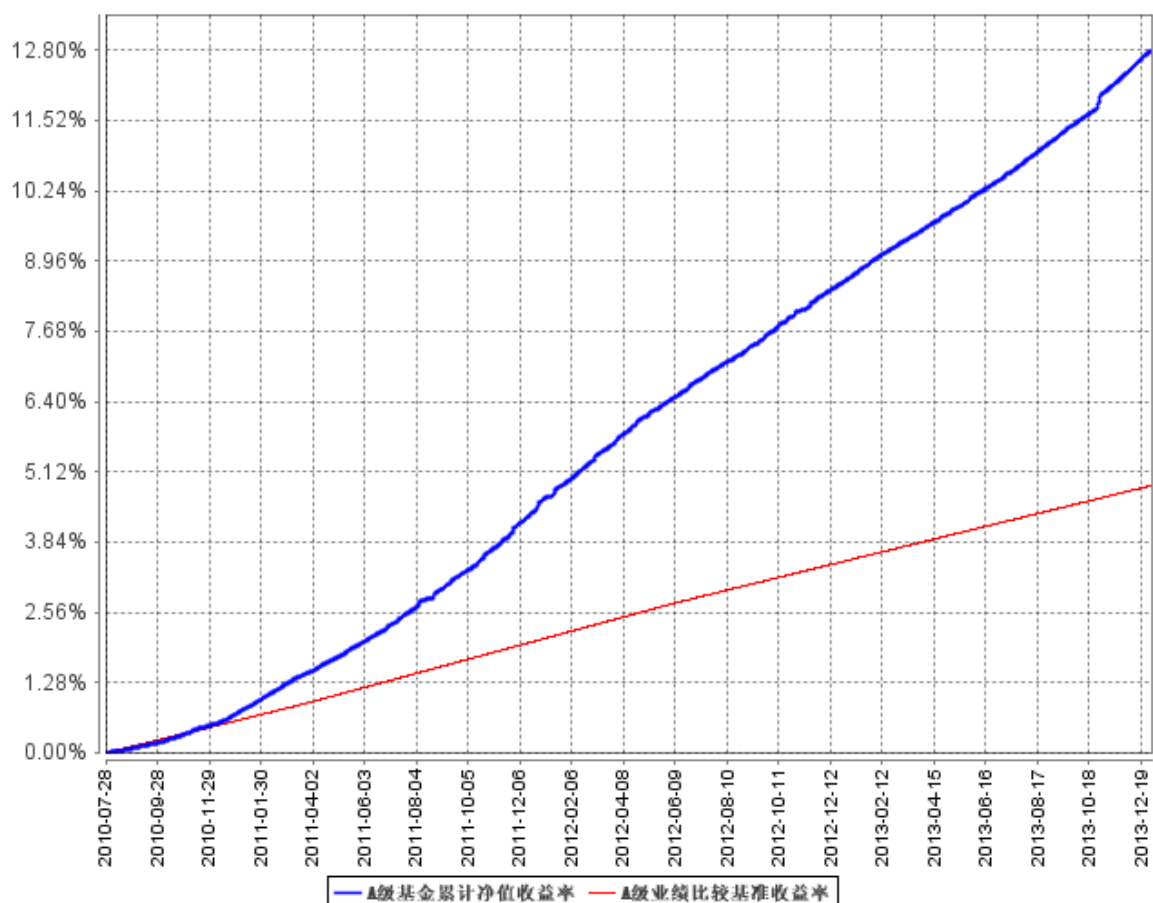
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.2698%	0.0098%	0.3300%	0.0000%	0.9398%	0.0098%
过去六个月	2.2892%	0.0074%	0.6623%	0.0000%	1.6269%	0.0074%
过去一年	4.1074%	0.0059%	1.3224%	0.0000%	2.7850%	0.0059%
过去三年	12.8243%	0.0070%	4.2611%	0.0002%	8.5632%	0.0068%
自基金合同生效日起至 今	13.7421%	0.0069%	4.8749%	0.0002%	8.8672%	0.0067%

今						
---	--	--	--	--	--	--

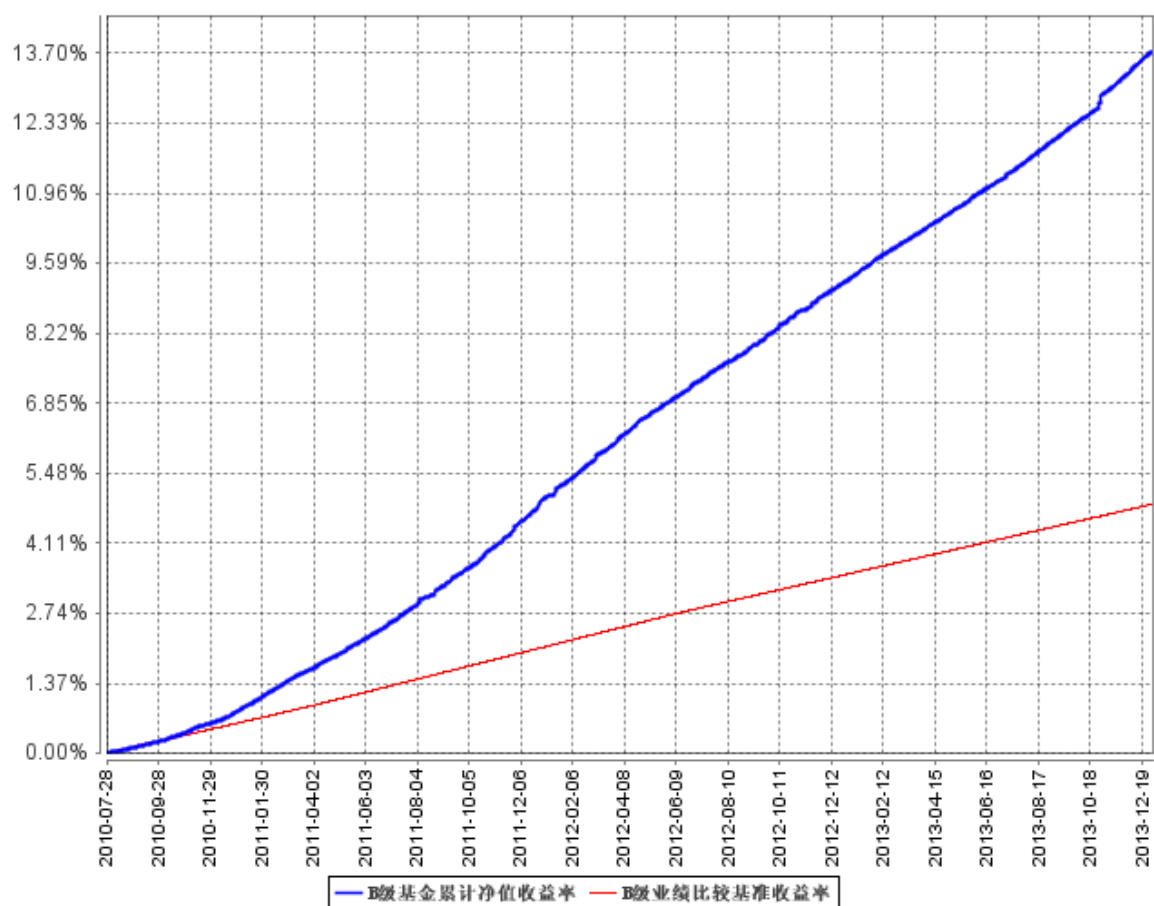
注：“自基金合同生效起至今”指 2010 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日。

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

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

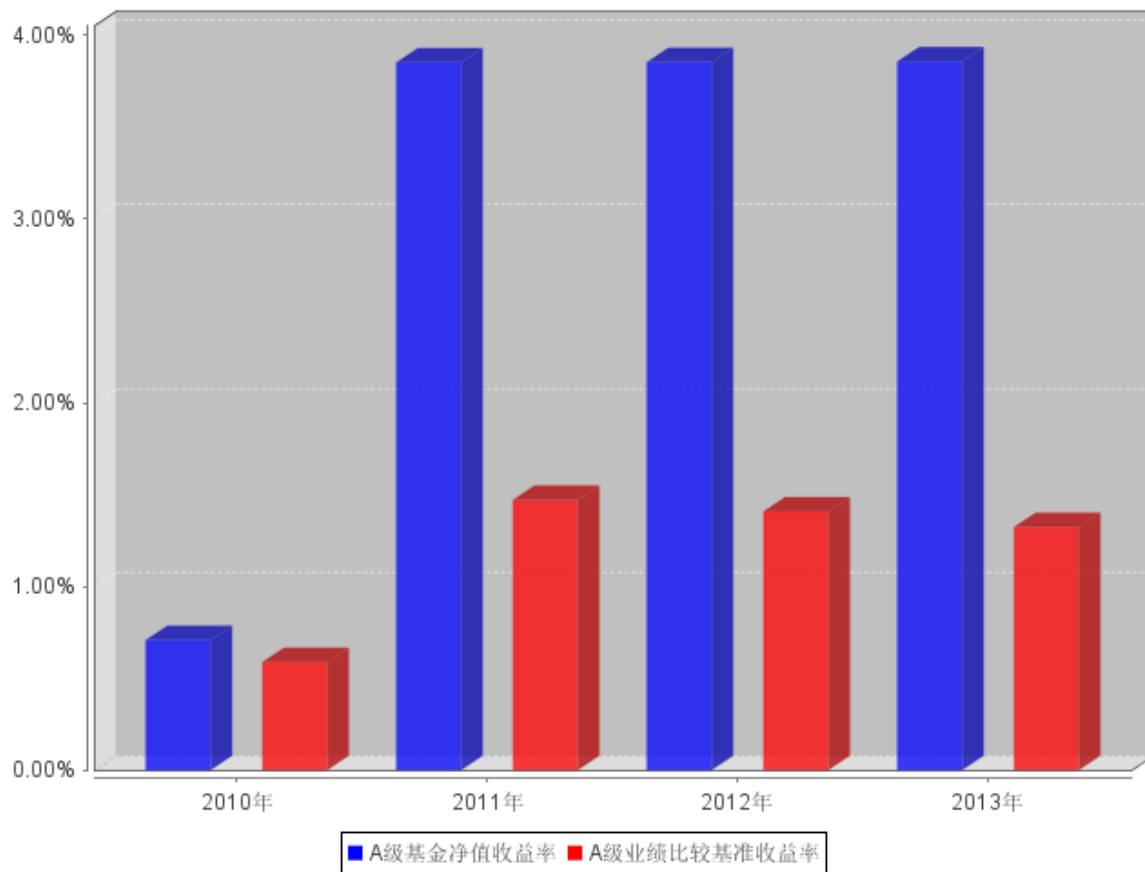


B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

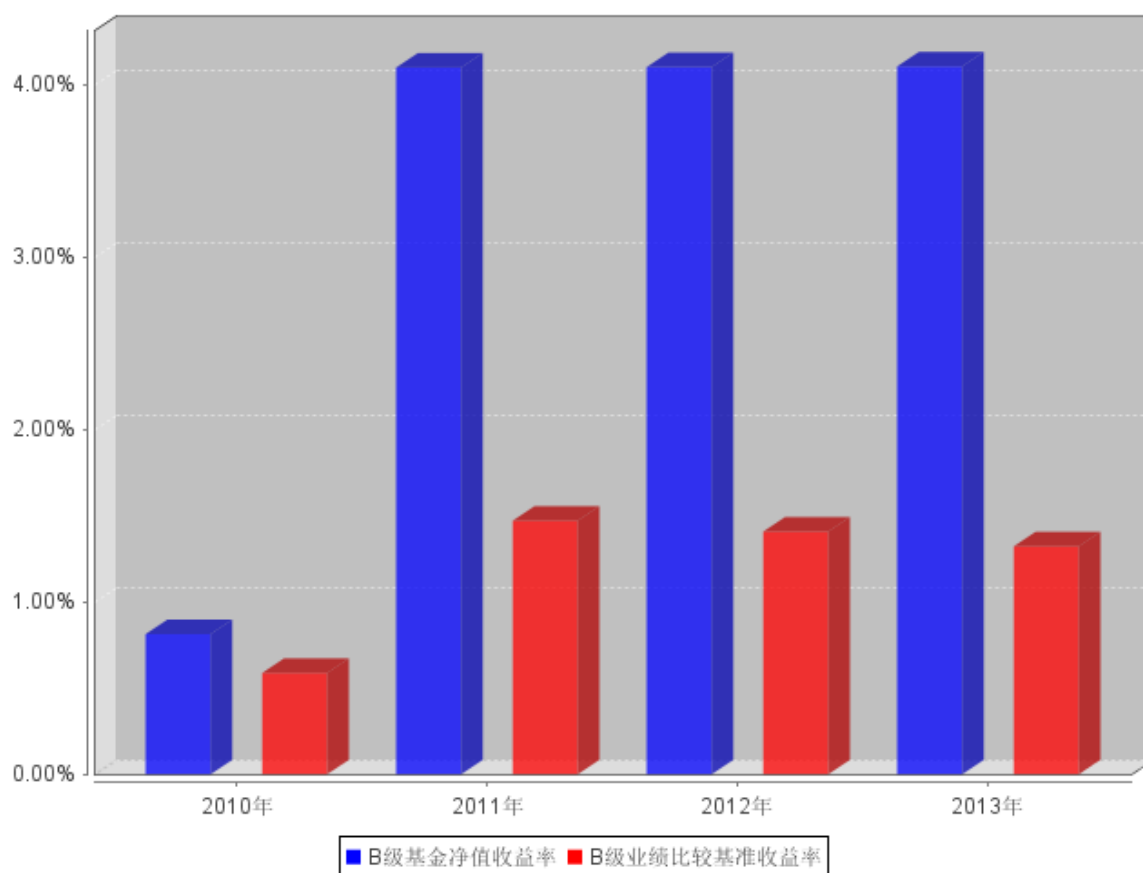


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上图中 2010 年度是指 2010 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日，相关数据未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

中海货币 A					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2013	10,142,739.77	-	-	10,142,739.77	
2012	22,493,833.72	-	-	22,493,833.72	
2011	8,374,004.86	-	-	8,374,004.86	
合计	41,010,578.35	-	-	41,010,578.35	

单位：人民币元

中海货币 B					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2013	70,185,789.21	-	-	70,185,789.21	
2012	45,584,688.22	-	-	45,584,688.22	

2011	52,814,103.29	-	-	52,814,103.29	
合计	168,584,580.72	-	-	168,584,580.72	

§ 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 12 月 31 日，共管理证券投资基金 18 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《证券业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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司 2011 年修订了《中海基金公平交易管理办法》，从投研决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估、监察稽核和信息披露等方面对股票、债券、可转债的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动进行全程公平交易管理。

投研决策内部控制方面：（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业务管理的需要外，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，根据公司制度规定应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，如有特殊情况，制度规定需书面留痕。

（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，力求保证时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡交易原则得以落实。（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。（5）在特殊情况下，投资组合因合规性或应对大额赎回等原因需要进行特定交易时，由投资组合经理发起暂停投资风控阈值的流程，在获得相关审批后，由风险管理部暂时关闭投资风控系统的特定阈值。完成该交易后，风险管理部立即启动暂停的投资风控阈值。

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）公司对所有组合在 2013 年全年日内，3 日，5 日同向交易数据进行了采集，并进行两两比对，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 分布检验。

（3）对于不同时间期间的同组合反向交易及公司制度规定的异常交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时机等进行综合分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

2013 年全年，公司遵循《中海基金公平交易管理办法》相关要求，整体上贯彻执行制度约定，加强了对投资组合公平交易的事后分析，

（1）对于两两组合的同向交易，我们从日内、3 日、5 日三个时间区间进行假设价差为零，T 分布的检验，对于未通过假设检验的情况，公司结合比较两两组合间的交易占优比、采集的样本

数量是否达到一定水平从而具有统计学意义、模拟利益输送金额的绝对值、模拟利益输送金额占组合资产平均净值的比例、模拟利益的贡献率占组合收益率的比例、两两组合的持仓相似度及两两组合收益率差的比较等多方面进行综合比较。

(2) 对于两两组合的反向交易，公司采集同一组合对同一投资品种 3 日内反向交易；两两组合对同一投资品种 3 日内反向交易；并结合市场该投资品种的总成交量进行综合分析。

(3) 对于公司制度规定的异常交易，相关组合经理均根据制度要求提交审批单并书面留痕。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未发现组合存在有可能导致重大不公平交易和利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，风险管理部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

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，中国面临的外部环境总体好于 2012 年，美国经济在 QE 的货币刺激下房地产持续升温，总体保持复苏态势，失业率总体上也呈下降趋势。后危机时代的欧洲并未给全球经济带来超预期的拖累，总体上呈现不温不火的状态。在外需稳定和投资拉动下，中国经济止住下滑势头，实现了 7.5% 的增长目标，但经济内生动力依旧不足，私人投资和消费热情仍未被点燃，政府债务泡沫和地产泡沫越吹越大，总体上来看仍然处于增长中枢趋势性下移的过程中。总需求不振的情况下，通胀也基本保持在温和状态。

2013 年的债券市场，彻底完成了一波牛熊转换的行情，上半年在宽松的资金面推动下，债券牛市一路高歌猛进。进入二季度，外汇占款高速增长趋势突然逆转，市场流动性迅速枯竭，导致 6 月 20 日银行间隔夜回购利率飙涨至 30%，以及以此为标志的钱荒事件。下半年，银行间市场资金面未见明显改善，而债券市场供求不平衡格局发展到一定极限，导致 11 月份债券收益率急速飙升，10 年期国债收益率一度突破 4.70%。

2013 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 12 月 31 日,报告期内本基金 A 类净值收益率为 3.8570%, 高于业绩比较基准 2.5346 个百分点;报告期内本基金 B 类净值收益率为 4.1074%, 高于业绩比较基准 2.7850 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

2014 年,全球经济进入复苏期,对中国的影响总体上利大于弊。预计中国经济仍然能够维持 7.6%左右的实际增速,外贸将走出低迷并呈现回升;消费再度下行的空间有限,可望维持 13%增速。不宜高估 2014 年通胀压力,预计 2014 年通胀水平与 2013 年持平,约为 2.7%左右。从季度分布上看,二季度可能为 CPI 高点。

货币政策方面,预计明年货币政策仍将延续偏紧基调,但到下半年,在经济下行压力下,或是金融体系风险加大,或是外部冲击形成,央行有可能再度改变政策取向。

债券市场方面,上半年资金成本仍将居高不下,债券市场很难有趋势性的行情,但目前的利率水平下,不宜盲目做空,而应积极把握市场冲动带来的小波段的操作机会。下半年资金成本有望下行,有机会带动债券收益率下行。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

本基金管理人设有估值委员会,公司分管运营副总担任估值委员会主任委员,其他委员有风险控制总监、监察稽核负责人、基金会计负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值委员会会议,提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题,参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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 审计报告

江苏公证天业会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款		526,223,146.30	1,643,156,908.37
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		965,804,538.48	1,160,130,163.80
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		965,804,538.48	1,160,130,163.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		293,600,767.90	715,202,432.80
应收证券清算款		-	-
应收利息		17,398,254.15	17,484,438.57
应收股利		-	-
应收申购款		169,880,391.53	12,550.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,972,907,098.36	3,535,986,493.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 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		-	-
卖出回购金融资产款		282,898,815.65	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,857.17	-
应付管理人报酬		519,242.64	697,602.82
应付托管费		157,346.25	211,394.82
应付销售服务费		79,007.37	168,193.45
应付交易费用		23,708.11	29,298.58
应交税费		-	-
应付利息		576,902.45	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		85,000.72	60,000.00
负债合计		284,344,880.36	1,166,489.67
所有者权益：			
实收基金		1,688,562,218.00	3,534,820,003.87
未分配利润		-	-
所有者权益合计		1,688,562,218.00	3,534,820,003.87
负债和所有者权益总计		1,972,907,098.36	3,535,986,493.54

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 1,688,562,218.00

份，其中 A 级基金份额总额 235,005,697.95 份，B 级基金份额总额 1,453,556,520.05 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入		94,273,464.92	78,983,096.44
1.利息收入		87,327,555.29	64,602,168.29
其中：存款利息收入		35,953,843.08	42,471,612.70
债券利息收入		44,960,921.81	14,947,658.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,412,790.40	7,182,896.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,945,909.63	14,380,914.65
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		6,945,909.63	14,380,914.65
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	13.50
减：二、费用		13,944,935.94	10,904,574.50
1.管理人报酬		6,871,063.38	5,797,494.70
2.托管费		2,082,140.46	1,770,255.83
3.销售服务费		865,470.85	1,624,203.12
4.交易费用		-	-
5.利息支出		3,768,705.82	1,268,571.52
其中：卖出回购金融资产支出		3,768,705.82	1,268,571.52
6.其他费用		357,555.43	444,049.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		80,328,528.98	68,078,521.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号		80,328,528.98	68,078,521.94

填列)			
-----	--	--	--

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	-	80,328,528.98	80,328,528.98
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）	-1,846,257,785.87	-	-1,846,257,785.87
其中：1. 基金申购款	8,925,383,165.05	-	8,925,383,165.05
2. 基金赎回款	-10,771,640,950.92	-	-10,771,640,950.92
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）	-	-80,328,528.98	-80,328,528.98
五、期末所有者权益（基金净值）	1,688,562,218.00	-	1,688,562,218.00
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	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）	-	68,078,521.94	68,078,521.94
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）	2,254,364,144.77	-	2,254,364,144.77
其中：1. 基金申购款	12,689,965,560.78	-	12,689,965,560.78
2. 基金赎回款	-10,435,601,416.01	-	-10,435,601,416.01

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）	-	-68,078,521.94	-68,078,521.94
五、期末所有者权益（基金净值）	3,534,820,003.87	-	3,534,820,003.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>黄鹏</u>	<u>宋宇</u>	<u>曹伟</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2012 年 11 月 16 日新修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 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，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 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：

7.4.6.1

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。

7.4.6.2

基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

7.4.6.3

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。

7.4.7 关联方关系

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
中海信托股份有限公司（“中海信托”）	基金管理人的股东
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
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司（“法国洛希尔银行”）	基金管理人的股东
中海恒信资产管理（上海）有限公司（以下简称“中海恒信”）	基金管理人的控股子公司
中国海洋石油总公司	基金管理人股东的实际控制人
中海石油财务有限责任公司	基金管理人的关联方

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期及上年度可比期间没有应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,871,063.38	5,797,494.70
其中：支付销售机构的客户维护费	528,237.55	1,213,940.12

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,082,140.46	1,770,255.83

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：

$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$ （H 为每日应支付的基金托管费，E 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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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	42,149.60	155,716.35	197,865.95
工商银行	216,607.72	4,417.59	221,025.31
国联证券	1,472.59	0.00	1,472.59
合计	260,229.91	160,133.94	420,363.85
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 12 月 31 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	37,513.84	91,781.55	129,295.39
工商银行	601,934.15	534.52	602,468.67
国联证券	5,577.50	8,644.44	14,221.94
合计	645,025.49	100,960.51	745,986.00

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：

$H = E \times R / \text{当年天数}$ （H 为每日该级基金份额应支付的基金销售服务费，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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内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。

7.4.8.4.2 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 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013 年 12 月 31 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	102, 597, 137. 56	7. 06%	302, 151, 331. 94	8. 55%
中国海洋石油 总公司	475, 338, 654. 97	32. 70%	-	-

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。

7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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	176, 223, 146. 30	1, 147, 953. 64	103, 156, 908. 37	444, 262. 19

注 1：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。

注 2：本期末由工商银行保管的银行存款余额含定期存款 170, 000, 000. 00 元，本期由工商银行保管的银行存款产生的利息收入含定期存款利息收入 1, 024, 166. 7 元。上年末由工商银行保管的银行存款余额含定期存款 100, 000, 000. 00 元，上年度可比期间，工商银行保管的银行存款产生的利息收入含定期存款利息收入 103, 055. 54 元。

7.4.8.6 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均未通过关联方购买其承销的证券。

7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 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 282, 898, 815. 65 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
130306	13 进出 06	2014 年 1 月 2 日	98.01	500,000	49,005,000.00
041351015	13 森工集 CP001	2014 年 1 月 2 日	100.10	350,000	35,035,000.00
041351012	13 雅砻江 CP001	2014 年 1 月 2 日	100.05	800,000	80,040,000.00
041352007	13 中 铝 CP001	2014 年 1 月 2 日	100.07	500,000	50,035,000.00
120227	12 国开 27	2014 年 1 月 6 日	97.41	300,000	29,223,000.00
130306	13 进出 06	2014 年 1 月 6 日	98.01	400,000	39,204,000.00
合计				2,850,000	282,542,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金在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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	965,804,538.48	48.95
	其中：债券	965,804,538.48	48.95
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	293,600,767.90	14.88
	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	526,223,146.30	26.67
4	其他各项资产	187,278,645.68	9.49
5	合计	1,972,907,098.36	100.00

8.2 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	4.86	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金

			资产净 值的比 例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	282,898,815.65	16.75
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	85
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	55

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 期限(天 数)	原因	调整期
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
12	2013 年 7 月 4 日	121	赎回造成份额减少	2
13	2013 年 7 月 5 日	122	赎回造成份额减少	1
14	2013 年 7 月 11 日	122	赎回造成份额减少	2
15	2013 年 7 月 12 日	122	赎回造成份额减少	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。

8.3.2 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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	62.08	16.75
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	7.61	-
2	30 天(含)—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	21.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.45	-
4	90 天(含)—180 天	3.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	18.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		105.75	16.75

8.4 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	286,719,834.54	16.98
	其中：政策性金融债	286,719,834.54	16.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	679,084,703.94	40.22
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	965,804,538.48	57.20
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	186,764,718.14	11.06

8.5 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	1,300,000	128,477,936.97	7.61
2	041355037	13 徐工 CP002	1,200,000	119,509,332.06	7.08
3	130201	13 国开 01	1,000,000	99,955,116.40	5.92
4	041351012	13 雅砻江 CP001	800,000	80,030,758.15	4.74
5	041364040	13 澄星 CP003	700,000	70,000,128.23	4.15
6	041361028	13 青铜峡 CP001	600,000	59,611,055.98	3.53
7	120227	12 国开 27	600,000	58,286,781.17	3.45
8	041360015	13 森工集 CP001	500,000	50,015,113.62	2.96
9	041352007	13 中铝 CP001	500,000	49,988,243.17	2.96
10	041351051	13 苏交通 CP007	500,000	49,956,772.58	2.96

8.6 “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	11
报告期内偏离度的最高值	0.2560%
报告期内偏离度的最低值	-0.3215%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1390%

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1

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。

8.8.2

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。

8.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.8.4 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	17,398,254.15
4	应收申购款	169,880,391.53
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	187,278,645.68

8.8.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
中海 货币 A	6,150	38,212.31	10,449,488.03	4.45%	224,556,209.92	95.55%
中海 货币 B	39	37,270,680.00	1,354,001,429.07	93.15%	99,555,090.98	6.85%
合计	6,189	272,832.80	1,364,450,917.10	80.81%	324,111,300.90	19.19%

9.2 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	355,476.15	0.1513%
	中海货币 B	—	—

	合计	355,476.15	0.0211%
--	----	------------	---------

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。

§ 10 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	1,200,858,420.11	7,724,524,744.94
减：本报告期基金总赎回份额	1,636,778,913.61	9,134,862,037.31
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	235,005,697.95	1,453,556,520.05

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请江苏公证天业会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期内已预提审计费 76,000 元，截至 2013 年 12 月 31 日暂未支付；本基金成立以来一直由该会计师事务所提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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，联合调研和各类投资研讨会。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。

11.7.2 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	-	-	3,708,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 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%。

中海基金管理有限公司
2014 年 3 月 29 日