中海货币市场证券投资基金 2011 年年度报告

2011 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

报告送出日期：二〇一二年三月二十七日

§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 2012 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。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....1
1.1 重要提示.....1
§2 基金简介.....4
2.1 基金基本情况.....4
2.2 基金产品说明.....4
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....5
2.5 其他相关资料.....5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....5
3.1 主要会计数据和财务指标.....5
3.2 基金净值表现.....7
3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....10
§4 管理人报告.....10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11
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.....12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....15
§5 托管人报告.....15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....15
5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....15
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.....15
§6 审计报告.....15
6.1 管理层对财务报表的责任.....16
6.2 注册会计师的责任.....16
6.3 审计意见.....16
§7 年度财务报表.....17
7.1 资产负债表.....17
7.2 利润表.....18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....19
7.4 报表附注.....20
§8 投资组合报告.....37
8.1 期末基金资产组合情况.....37
8.2 债券回购融资情况.....37
8.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明.....38
8.4 基金投资组合平均剩余期限.....38
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....39
8.6 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.....39
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....40
8.8 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.....40

8.9 投资组合报告附注.....40
§9 基金份额持有人信息.....41
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....41
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....41
§10 开放式基金份额变动.....41
§11 重大事件揭示.....42
11.1 基金份额持有人大会决议.....42
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.....42
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....42
11.4 基金投资策略的改变.....42
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....42
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.....42
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....42
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....43
11.9 其他重大事件.....43
§12 备查文件目录.....46
12.1 备查文件目录.....46
12.2 存放地点.....46
12.3 查阅方式.....47

§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	1,280,455,859.10 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 类	中海货币 B 类
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	504,680,920.97 份	775,774,938.13 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
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、上海证券报、证券时报
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
会计师事务所	江苏公证天业会计师事务所有限公司	无锡市梁溪路28号
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、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年		2010 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日		2009 年	
	中海货币 A 类	中海货币 B 类	中海货币 A 类	中海货币 B 类	中海货币 A 类	中海货币 B 类
本期已实现收益	8,374,004.86	52,814,103.29	618,053.40	11,840,020.80	-	-
本期利润	8,374,004.86	52,814,103.29	618,053.40	11,840,020.80	-	-
本期基金份额净值收益率	3.8521%	4.1012%	0.7081%	0.8134%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
	中海货币 A 类	中海货币 B 类	中海货币 A 类	中海货币 B 类	中海货币 A 类	中海货币 B 类
期末基金资产净值	504,680,920.97	775,774,938.13	84,772,041.35	4,504,522,196.99	-	-
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00	1.00	-	-
3.1.3 累计期末指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
	中海货币 A 类	中海货币 B 类	中海货币A类	中海货币 B 类	中海货币 A 类	中海货币 B 类
基金份额累计净值收益率	4.5875%	4.9480%	0.7081%	0.8134%	-	-

注 1：本基金合同于 2010 年 7 月 28 日生效。

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 基金净值表现

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

1. 中海货币 A 类

阶段	份额净值收益率①	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
过去三个月	1.2591%	0.0104%	0.3745%	0.0000%	0.8846%	0.0104%
过去六个月	2.2414%	0.0099%	0.7517%	0.0000%	1.4897%	0.0099%
过去一年	3.8521%	0.0075%	1.4713%	0.0001%	2.3808%	0.0074%
自基金合同生效起至今	4.5875%	0.0070%	2.0687%	0.0002%	2.5188%	0.0068%

2. 中海货币 B 类

阶段	份额净值收益率①	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
过去三个月	1.3201%	0.0104%	0.3745%	0.0000%	0.9456%	0.0104%
过去六个月	2.3642%	0.0099%	0.7517%	0.0000%	1.6125%	0.0099%
过去一年	4.1012%	0.0075%	1.4713%	0.0001%	2.6299%	0.0074%
自基金合同生效起至今	4.9480%	0.0070%	2.0687%	0.0002%	2.8793%	0.0068%

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 2011 年 12 月 31 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

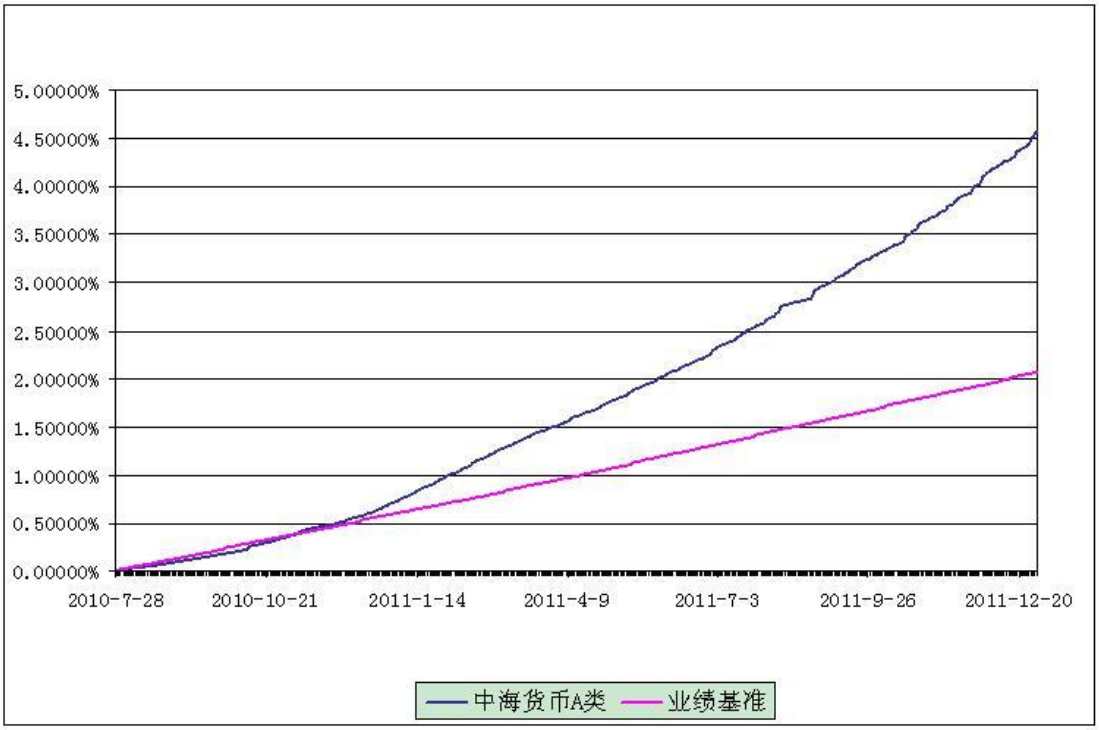
中海货币市场证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010 年 7 月 28 日至 2011 年 12 月 31 日）

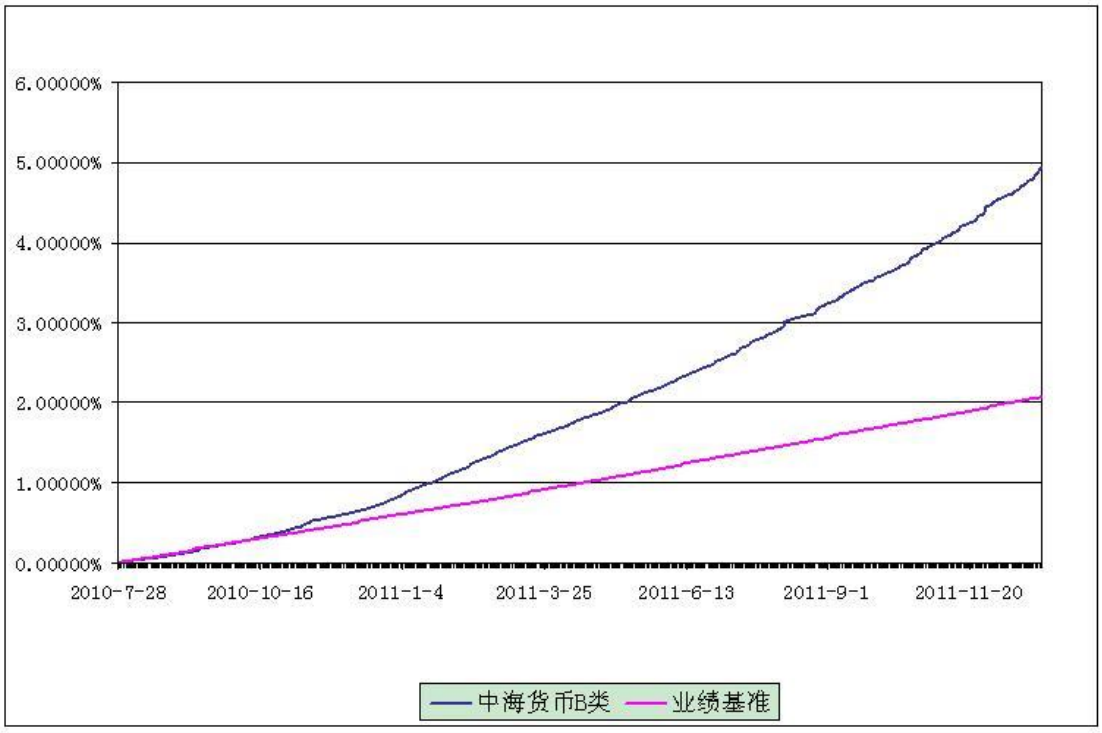
1、中海货币 A 类

（2010 年 7 月 28 日至 2011 年 12 月 31 日）



2、中海货币 B 类

（2010 年 7 月 28 日至 2011 年 12 月 31 日）



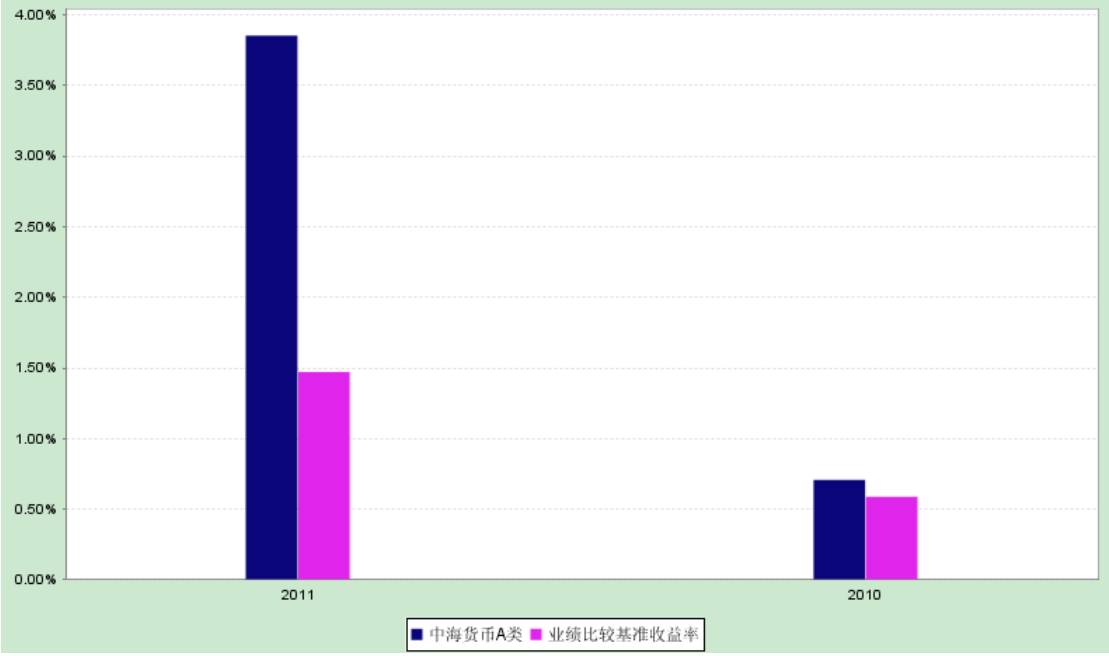
注：根据法律法规及基金合同规定，本基金建仓期为自基金合同生效日起六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 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比较

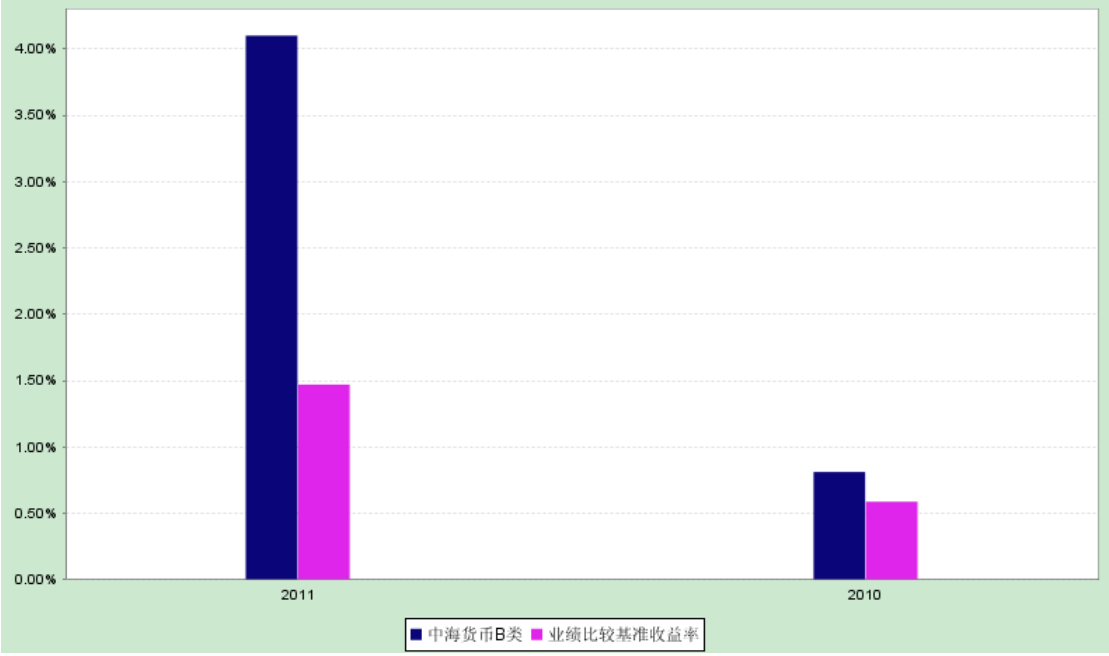
中海货币市场证券投资基金

自基金合同生效以来每年净值收益率图

1、中海货币 A 类



2、中海货币 B 类



注：上图中 2010 年度指的是 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 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

1、中海货币 A 类

单位：人民币元

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
2011 年	8,374,004.86	-	-	8,374,004.86	-
2010 年	618,053.40	-	-	618,053.40	-
合计	8,992,058.26	-	-	8,992,058.26	-

注：2010 年度是指自 2010 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日。

2、中海货币 B 类

单位：人民币元

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
2011 年	52,814,103.29	-	-	52,814,103.29	-
2010 年	11,840,020.80	-	-	11,840,020.80	-
合计	64,654,124.09	-	-	64,654,124.09	-

注：2010 年度是指自 2010 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日。

§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 2011 年 12 月 31 日，共管理开放式证券投资基金 11 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
江小震	固定收益小组负责人，本基金、中海增强收益债券型证券投资基金基金经理	2010-07-28	-	13	江小震先生，复旦大学金融学专业硕士。历任长江证券股份有限公司投资经理、中维资产管理有限责任公司部门经理、天安人寿保险股份有限公司（原名恒康天安保险有限责任公司）投资部经理、太平洋资产管理有限责任公司高级经理。2009 年 11 月进入本公司工作，现任固定收益小组负责人。2010 年 7 月至今任中海货币市场证券投资基金基金经理，2011 年 3 月至今任中海增强收益债券型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 2011 年修订了《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、监察稽核和信息披露四个方面对股票、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。（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阀值的流程，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阀值。完成该交易后，风险管理部立即启动暂停的投资风控阀值。

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 2011 年全年所有组合在日内，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 分布检验。大多数样本通过相关检验。（3）对 2011 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，公司未满足交易占优比 45%-55%的比例分别为 25%、28%、28%。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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 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

过去的一年，在国家对房地产进行调控以及坚决防通胀的大背景下，货币政策明显偏紧，除多次上调法定存款准备金率之外，还于上半年三次提高了基准利率。在这一政策导向下，全年市场的资金整体偏紧，平均的回购利率较前年有了明显的抬升，债券收益率出现了阶段

性的明显上升。在报告期内，本基金严格遵循了契约的规定，把满足投资人的流动性作为基金管理的首要目标，同时兼顾投资收益的提高。因此，本基金在报告期内大量地投资高流动性的标的，包括可提前支取的定期存款、央票和金融债等。在选择信用产品方面也较为谨慎，多为评级较高且剩余期限较短的短期融资券。在保证持有人赎回要求的前提下，利用市场资金较紧的时候进行适量的逆回购，以提高组合的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金 A 类每万份收益 1.1515 元，7 日年化收益率 9.291%，报告期内本基金 A 类净值收益率为 3.8521%，高于业绩比较基准 2.3808 个百分点；本基金 B 类每万份收益 1.2172 元，7 日年化收益率 9.558%，报告期内本基金 B 类净值收益率为 4.1012%，高于业绩比较基准 2.6299 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

展望 2012 年，虽然物价会较 2011 年有明显回落，但政府对随时可能的反弹不会掉以轻心；而房地产调控仍将延续过往的政策，看不到明显松动的迹象。国内的投资依旧是支撑经济向前的最大动力，出口不容乐观，消费的增长也不会有明显的变化。而结构转型在今年也不会一蹴而就。整个宏观经济会在平稳中渡过，但不排除一些阶段性的波动和事件发生。

由于经济下滑和企业盈利预期的变差，2012 年的证券市场也不容乐观。欧债危机的持续发酵，国内地产调控以及出口更差的多重压力都将成为证券市场的负面因素。但经济的见底回升以及货币政策的阶段性放松有可能成为证券市场短期行情的催化剂。虽然全年政策不会如去年紧，但是要想资金利率出现大幅回落的概率也较低，除非通胀明显回落并成为常态。债券市场需要注意的就是一些可能发生的违约事件，低评级品种需要加强风险管理。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由监察稽核部门遵守独立、客观、公正的原则，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方法对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行检查，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

管理人各项业务能遵循国家法律法规、中国证监会规章制度、管理人内部的规章制度以及各项业务规范流程，运行符合合法性、合规性的要求，主要内控制度基本有效。

在本报告期内，管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

（1）根据基金监管法律法规的不断更新与完善，推动各部门加强内部制度建设，确保制度对各项业务和管理环节的全覆盖、提高制度和流程的合规性、合理性和可操作性。

（2）开展基金法律法规和管理人内部各项基本制度的培训学习工作，树立员工规范意识、合规意识和风险意识，形成员工主动、自觉进行内部控制的风险管理文化，构建主动进行管理人内部风险控制和自觉接受监察稽核的平台。

（3）全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金销售、投资的合法合规。通过电脑监控、现场检查、人员询问、重点抽查等方法开展工作，不断提高全体员工的风险意识，保证了基金的合法合规运作。

（4）按照中国证监会的要求，在管理内部严格推行风险控制自我评估制度。通过各部门的参与和自我评估，明确了各部门的风险点，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。

（5）根据监管部门的要求，完成与基金投资业务相关的定期监察报告，报送中国证监会和董事会。

管理人自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。2012 年我们将继续紧紧抓住风险控制和合规性两条主线，构建一个制度修订规范化、风险责任岗位化、风险检测细致化、风险评估科学化的长效风险控制机制，提高内部监察工作的计划性、科学性和有效性，实现基金合法合规运作。

4.7 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。

4.8 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

2011 年，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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年，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 2011 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

苏公 W[2012]A368 号

中海货币市场证券投资基金份额全体持有人：

我们审计了后附的中海货币市场证券投资基金（以下简称货币市场基金）财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表，2011 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动

表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是货币市场基金的管理人中海基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括:(1)按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,货币市场基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了货币市场基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。

江苏公证天业会计师事务所有限公司　　注册会计师 夏正曙 华可天

无锡市梁溪路 28 号

2012-03-23

§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：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	525,244,956.80	1,212,005,852.93
结算备付金		1,104,545.45	1,377,272.73
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	400,728,787.71	401,176,512.21
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		400,728,787.71	401,176,512.21
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	310,143,312.21	3,026,602,855.60
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	10,059,935.15	8,479,277.91
应收股利		-	-
应收申购款		55,647,410.06	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	310,524.27	620,190.27
资产总计		1,303,239,471.65	4,650,261,961.65
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2011年12月31日**	**上年度末 2010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		-	-
应付证券清算款		22,000,000.00	59,966,193.89
应付赎回款		63.08	-

应付管理人报酬		418,452.89	663,207.82
应付托管费		126,803.93	200,972.05
应付销售服务费		128,068.80	28,936.13
应付交易费用	7.4.7.7	15,723.49	13,913.42
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	94,500.36	94,500.00
负债合计		22,783,612.55	60,967,723.31
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,280,455,859.10	4,589,294,238.34
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,280,455,859.10	4,589,294,238.34
负债和所有者权益总计		1,303,239,471.65	4,650,261,961.65

注 1：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 1,280,455,859.10 份，其中 A 级基金份额总额 504,680,920.97 份，B 级基金份额总额 775,774,938.13 份。

注 2：本基金合同生效日为 2010 年 7 月 28 日。

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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年7月28日（基金合同生效日）至2010年12月31日
一、收入		**69,888,306.12**	**15,448,724.65**
1.利息收入		61,678,269.64	15,534,627.62
其中：存款利息收入	7.4.7.11	22,086,902.27	4,889,750.22
债券利息收入		12,246,540.51	4,181,853.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,344,826.86	6,463,024.38

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,210,036.48	-85,902.97
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	8,210,036.48	-85,902.97
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-	-
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
减：二、费用		**8,700,197.97**	**2,990,650.45**
1．管理人报酬		5,316,569.02	1,945,354.67
2．托管费		1,623,505.82	589,501.37
3．销售服务费		635,841.41	183,956.39
4．交易费用	7.4.7.17	-	-
5．利息支出		653,825.53	26,412.99
其中：卖出回购金融资产支出		653,825.53	26,412.99
6．其他费用	7.4.7.18	470,456.19	245,425.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**61,188,108.15**	**12,458,074.20**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		61,188,108.15	12,458,074.20

注：上年度可比期间指 2010 年 7 月 28 日（基金合同生效日）起至 2010 年 12 月 31 日，下同。

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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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）	4,589,294,238.34	-	4,589,294,238.34
二、本期经营活动产生的基金净值变	-	61,188,108.15	61,188,108.15

动数（本期利润）			
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）	-3,308,838,379.24	-	-3,308,838,379.24
其中：1.基金申购款	6,790,778,969.08	-	6,790,778,969.08
2.基金赎回款	-10,099,617,348.32	-	-10,099,617,348.32
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）	-	-61,188,108.15	-61,188,108.15
五、期末所有者权益（基金净值）	1,280,455,859.10	-	1,280,455,859.10
项目	**上年度可比期间** 2010年7月28日（基金合同生效日）至2010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）	2,958,869,207.75	-	2,958,869,207.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,458,074.20	12,458,074.20
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）	1,630,425,030.59	-	1,630,425,030.59
其中：1.基金申购款	4,549,512,393.08	-	4,549,512,393.08
2.基金赎回款	-2,919,087,362.49	-	-2,919,087,362.49
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）	-	-12,458,074.20	-12,458,074.20
五、期末所有者权益（基金净值）	4,589,294,238.34	-	4,589,294,238.34

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：黄鹏，主管会计工作负责人：宋宇，会计机构负责人：曹伟

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 2007 年 5 月 15 日颁布的《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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期为 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

7.4.4.3.1 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

7.4.4.3.2 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其

他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

7.4.4.4.1 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

7.4.4.4.2 债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格(附注 7.4.4.5)，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

7.4.4.4.3 当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

7.4.4.5.1 为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

7.4.4.5.2 计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

7.4.4.5.2.1 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

7.4.4.5.2.2 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

7.4.4.5.2.3 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额初始面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

不适用。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。在计算实际利率时，扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税因素。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式为红利再投资；

“每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资者记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资者记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资者不记收益；

本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额。若投资者赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资者赎回基金款中扣除；

当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益。

本基金收益每月集中支付一次；

本基金同一级别的每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

7.4.5.3 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	25,244,956.80	62,005,852.93
定期存款	500,000,000.00	1,150,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	500,000,000.00	1,150,000,000.00
其他存款	-	-
合计	525,244,956.80	1,212,005,852.93

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 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	400,728,787.71	400,994,000.00	265,212.29	0.0207
	合计	400,728,787.71	400,994,000.00	265,212.29	0.0207
项目		上年度末 2010 年 12 月 31 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	401,176,512.21	401,288,000.00	111,487.79	0.0024
	合计	401,176,512.21	401,288,000.00	111,487.79	0.0024

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	288,143,312.21	-
交易所市场买入返售金融资产	22,000,000.00	-
合计	310,143,312.21	-
项目	上年度末 2010年12月31日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	1,521,602,855.60	-
交易所市场买入返售金融资产	1,505,000,000.00	-
合计	3,026,602,855.60	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	4,456.89	23,582.66
应收定期存款利息	3,215,878.69	1,814,222.35
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	546.70	530.20
应收债券利息	5,171,349.45	3,353,522.22
应收买入返售证券利息	1,667,703.42	3,287,420.48
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	10,059,935.15	8,479,277.91

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	310,524.27	620,190.27
合计	310,524.27	620,190.27

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	15,723.49	13,913.42
合计	15,723.49	13,913.42

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.36	-
预提费用	94,500.00	94,500.00
合计	94,500.36	94,500.00

7.4.7.9 实收基金

中海货币 A 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	84,772,041.35	84,772,041.35
本期申购	2,920,377,060.78	2,920,377,060.78
本期赎回（以“-”号填列）	-2,500,468,181.16	-2,500,468,181.16
本期末	504,680,920.97	504,680,920.97

中海货币 B 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	4,504,522,196.99	4,504,522,196.99
本期申购	3,870,401,908.30	3,870,401,908.30
本期赎回（以“-”号填列）	-7,599,149,167.16	-7,599,149,167.16
本期末	775,774,938.13	775,774,938.13

注：本基金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。

7.4.7.10 未分配利润

中海货币 A 类

单位：人民币元

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	8,374,004.86	-	8,374,004.86
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	8,374,004.86	-	8,374,004.86
本期末	-	-	-

中海货币 B 类

单位：人民币元

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	52,814,103.29	-	52,814,103.29
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	52,814,103.29	-	52,814,103.29
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年7月28日（基金合同生效日）至2010年12月31日
活期存款利息收入	399,569.75	363,560.84
定期存款利息收入	21,560,313.48	4,461,447.34
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	92,477.69	54,703.42
其他	34,541.35	10,038.62
合计	22,086,902.27	4,889,750.22

7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年7月28日（基金合同生效日）至2010年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,628,694,836.49	598,120,097.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,588,297,829.03	591,297,572.47

减：应收利息总额	32,186,970.98	6,908,428.09
债券投资收益	8,210,036.48	-85,902.97

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金在本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.14 股利收益

本基金在本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.15 公允价值变动收益

本基金在本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.16 其他收入

本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.17 交易费用

本基金在本报告期及上年度可比期间均无交易费用。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年7月28日（基金合同生效日）至2010年12月31日
审计费用	90,000.00	90,000.00
信息披露费	309,666.00	129,809.73
债券帐户维护费	18,000.00	6,000.00
银行汇划费用	52,226.19	19,190.30
其他	564.00	25.00
开户费	-	400.00
合计	470,456.19	245,425.03

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金在本报告期内无需要说明的或有事项。

7.4.8.2 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：

2012 年度	宣告日	分配收益所属期间
－第 1 号收益支付公告	2012/01/16	2011/12/15-2012/01/15
－第 2 号收益支付公告	2012/02/15	2012/01/16-2012/02/14

－第 3 号收益支付公告　　2012/03/16　　2012/02/15-2012/03/14

7.4.9 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
华英证券有限责任公司	基金管理人股东的控股子公司

注：华英证券有限责任公司为基金管理人股东国联证券的控股子公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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。

7.4.10.1.2 权证交易

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。

7.4.10.1.3 债券交易

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。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年7月28日（基金合同生效日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,316,569.02	1,945,354.67
其中：支付销售机构的客户维护费	467,418.12	98,538.96

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×0.33%/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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年7月28日（基金合同生效日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,623,505.82	589,501.37

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×0.10%/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。

7.4.10.2.3 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 2011年1月1日至2011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 类	中海货币 B 类	合计
中海基金	24,831.10	132,061.64	156,892.74
工商银行	226,269.76	6,012.74	232,282.50
国联证券	2,259.55	0.00	2,259.55
合计	253,360.41	138,074.38	391,434.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年7月28日（基金合同生效日）至2010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类	中海货币B类	合计
中海基金	692.15	46,165.56	46,857.71
工商银行	81,639.56	1,177.77	82,817.33
国联证券	2,721.83	-	2,721.83
合计	85,053.54	47,343.33	132,396.87

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×R/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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年7月28日（基金合同生效日）至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
工商银行	-	10,085,600.00	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中海货币 A 类

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。

中海货币 B 类

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。

7.4.10.4.2 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 类

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

中海货币 B 类

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2010 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	25,244,956.80	399,569.75	62,005,852.93	363,560.84

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.11 利润分配情况

1、中海货币 A 类

单位：人民币元

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
8,374,004.86	-	-	8,374,004.86	-

2、中海货币B类

单位：人民币元

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
52,814,103.29	-	-	52,814,103.29	-

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金在本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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》、《中海基金研究管理办法》、《中海基金股票库管理办法》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、

相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

7.4.13.2 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且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。

7.4.13.2.1 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 2011 年 12 月 31 日	上年末 2010 年 12 月 31 日
A-1	310,511,517.54	220,226,022.69
A-1 以下	0.00	-
未评级	49,816,548.51	49,894,157.27
合计	360,328,066.05	270,120,179.96

注：本期末按短期信用评级为“未评级”的债券为中央银行票据；上年度末按短期信用评级为“未评级”的债券为中央银行票据及政策性金融债。

7.4.13.2.2 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 2011 年 12 月 31 日	上年末 2010 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	40,400,721.66	131,056,332.25
合计	40,400,721.66	131,056,332.25

注：本期末及上年度末按长期信用评级为“未评级”的债券投资为政策性金融债。

7.4.13.3 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。2011 年 12 月 31 日本基金债券持仓比例为 31.30%，提前支取不损失利息的“定期存款”持仓比例为 39.05%；2010 年 12 月 31 日，本基金债券资产持仓比例为 8.74%，定期存款持仓比例为 25.06%。

7.4.13.4 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组合久期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。

7.4.13.4.1 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 2011 年 12 月 31 日与 2010 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 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	525,244,956.80	-	-	-	-	-	525,244,956.80
结算备付金	1,104,545.45	-	-	-	-	-	1,104,545.45

交易性金融资产	30,040,151.53	79,844,218.18	270,699,849.20	20,144,568.80	0.00	0.00	400,728,787.71
买入返售金融资产	126,320,516.48	135,822,603.73	48,000,192.00	0.00	0.00	0.00	310,143,312.21
应收利息	-	-	-	-	-	10,059,935.15	10,059,935.15
应收申购款	-	-	-	-	-	55,647,410.06	55,647,410.06
其他资产	-	-	-	-	-	310,524.27	310,524.27
资产总计	682,710,170.26	215,666,821.91	318,700,041.20	20,144,568.80	0.00	66,017,869.48	1,303,239,471.65
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	22,000,000.00	22,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	63.08	63.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	418,452.89	418,452.89
应付托管费	-	-	-	-	-	126,803.93	126,803.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	128,068.80	128,068.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,723.49	15,723.49
其他负债	-	-	-	-	-	94,500.36	94,500.36
负债总计	-	-	-	-	-	22,783,612.55	22,783,612.55
利率敏感度缺口	682,710,170.26	215,666,821.91	318,700,041.20	20,144,568.80	0.00	43,234,256.93	1,280,455,859.10
上年度末2010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	1,212,005,852.93	-	-	-	-	-	1,212,005,852.93
结算备付金	1,377,272.73	-	-	-	-	-	1,377,272.73
交易性金融资产	39,942,016.26	201,117,956.87	160,116,539.08	-	-	-	401,176,512.21
买入返售金融资产	1,816,600,707.40	1,210,002,148.20	-	-	-	-	3,026,602,855.60
应收利息	-	-	-	-	-	8,479,277.91	8,479,277.91
其他资产	-	-	-	-	-	620,190.27	620,190.27
资产总计	3,069,925,849.32	1,411,120,105.07	160,116,539.08	-	-	9,099,468.18	4,650,261,961.65
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	59,966,193.89	59,966,193.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	663,207.82	663,207.82
应付托管费	-	-	-	-	-	200,972.05	200,972.05

应付销售服务费	-	-	-	-	-	28,936.13	28,936.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,913.42	13,913.42
其他负债	-	-	-	-	-	94,500.00	94,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	60,967,723.31	60,967,723.31
利率敏感度缺口	3,069,925,849.32	1,411,120,105.07	160,116,539.08	-	-	-51,868,255.13	4,589,294,238.34

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

§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	400,728,787.71	30.75
	其中：债券	400,728,787.71	30.75
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	310,143,312.21	23.80
	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	526,349,502.25	40.39
4	其他各项资产	66,017,869.48	5.07
	合计	1,303,239,471.65	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）

1	报告期内债券回购融资余额	1.54	
	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	-	-
	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。

8.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

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%。

8.4 基金投资组合平均剩余期限

8.4.1 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	83
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

注：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。

8.4.2 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	25.11	1.72
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	23.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	28.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.57	-

4	90 天(含)—180 天	4.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	14.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	96.62	1.72

8.5 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	49,816,548.51	3.89
3	金融债券	40,400,721.66	3.16
	其中：政策性金融债	40,400,721.66	3.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	310,511,517.54	24.25
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	400,728,787.71	31.30
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	20,144,568.80	1.57

8.6 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	070219	07 国开 19	200,000	20,256,152.86	1.58
2	041159005	11 闽能源 CP001	200,000	20,212,906.57	1.58
3	041169001	11 中节能 CP001	200,000	20,185,822.38	1.58
4	090407	09 农发 07	200,000	20,144,568.80	1.57
5	041166004	11 冀发展 CP002	200,000	20,023,873.11	1.56
6	1181081	11 美克 CP01	200,000	20,016,847.86	1.56
7	041153007	11 辽通 CP001	200,000	20,008,717.70	1.56
8	041154013	11 海翼 CP004	200,000	20,004,609.48	1.56
9	041159019	11 太阳 CP001	200,000	20,002,795.20	1.56

10	041160013	11 南航工 CP001	200,000	20,001,008.75	1.56

8.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2092%
报告期内偏离度的最低值	-0.0696%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0776%

8.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

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。

8.9.2 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。

8.9.3 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。

8.9.4 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	10,059,935.15
4	应收申购款	55,647,410.06
5	其他应收款	-
6	待摊费用	310,524.27
7	其他	-
8	合计	66,017,869.48

8.9.5 其他需说明的重要事项标题

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类	7,166	70,427.14	9,785,790.54	1.94%	494,895,130.43	98.06%
中海货币B类	26	29,837,497.62	627,601,893.00	80.90%	148,173,045.13	19.10%
合计	7,192	178,038.91	637,387,683.54	49.78%	643,068,175.56	50.22%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	中海货币A类	110,195.54	0.0218%
	中海货币B类	-	-
	合计	110,195.54	0.0086%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中海货币A类	中海货币B类
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	84,772,041.35	4,504,522,196.99
本报告期基金总申购份额	2,920,377,060.78	3,870,401,908.30
减：本报告期基金总赎回份额	2,500,468,181.16	7,599,149,167.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	504,680,920.97	775,774,938.13

§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，本基金管理人免去陈浩鸣先生总经理职务；聘请陈浩鸣先生担任董事长职务；聘请黄鹏先生担任总经理职务。

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。

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有限公司提供审计服务，本报告期内已预提审计费 90,000 元，截至 2011 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		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	-	-	13,185,900,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

11.9 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	中海基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-08
2	中海基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-15
3	中海基金管理有限公司关于旗下基金在天相投资顾问有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-17
4	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证	2011-01-18

		券报、证券时报	
5	中海货币市场证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-01-21
6	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、上海证券报、证券时报	2011-01-25
7	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-02-15
8	关于旗下部分基金新增中国建设银行股份有限公司为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-02-16
9	中海基金管理有限公司关于新增华宝证券有限责任公司为旗下开放式基金代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-11
10	中海货币市场证券投资基金更新招募说明书（2011 年第 1 号）	中海基金网站	2011-03-11
11	中海货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要（2011 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-11
12	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-15
13	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、上海证券报、证券时报	2011-03-25
14	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国银行股份有限公司为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-28
15	中海货币市场证券投资基金 2010 年年度报告	中海基金网站	2011-03-30
16	中海货币市场证券投资基金 2010 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-03-30
17	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-15
18	中海货币市场证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-21
19	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、上海证券报、证券时报	2011-04-22
20	中海基金管理有限公司关于增加注册资本及修改公司章程的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-04-27
21	中海基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-05-05
22	中海基金管理有限公司关于旗下基金在华	中国证券报、上海证	2011-05-05

	宝证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	券报、证券时报	
23	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增华夏银行股份有限公司为代销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、上海证券报、证券时报	2011-05-11
24	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-05-16
25	中海基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-05-16
26	关于中海货币市场证券投资基金端午节假期前暂停大额申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-05-27
27	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海农村商业银行股份有限公司为代销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、上海证券报、证券时报	2011-06-02
28	中海基金管理有限公司关于网上交易系统开通“多交易账户”业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-06-10
29	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-06-15
30	中海基金管理有限公司关于新增厦门证券有限公司为旗下开放式基金代销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、上海证券报、证券时报	2011-07-13
31	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-07-15
32	中海货币市场证券投资基金 2011 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-07-21
33	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-08-15
34	中海货币市场证券投资基金 2011 年半年度报告	中海基金网站	2011-08-26
35	中海货币市场证券投资基金 2011 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-08-26
36	关于中海货币市场证券投资基金中秋节假期前暂停大额申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-09-06
37	中海货币市场证券投资基金更新招募说明书（2011 年第 2 号）	中海基金网站	2011-09-09
38	中海货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要（2011 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-09-09
39	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-09-15
40	中海基金管理有限公司关于开通中国工商	中国证券报、上海证	2011-09-22

	银行卡（借记卡）、中国光大银行卡（借记卡）、平安银行卡（借记卡）网上直销业务的公告	券报、证券时报	
41	关于中海货币市场证券投资基金国庆节假期前暂停大额申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-09-23
42	中海基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-10-11
43	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-10-17
44	中海基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-10-20
45	中海货币市场证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-10-26
46	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-11-15
47	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-12-16
48	关于中海货币市场证券投资基金元旦节假期前暂停大额申购(含转换转入及定期定额投资)业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-12-23
49	中海基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-12-24
50	中海基金管理有限公司关于旗下基金代销机构变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-12-28

§12 备查文件目录

12.1 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托管协议

4、中海货币市场证券投资基金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

12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

12.3 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

二〇一二年三月二十七日