

# 中海货币市场证券投资基金 2015 年半年度 报告

2015 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：2015 年 8 月 26 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 2015 年 8 月 21 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	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.....	12
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 债券回购融资情况.....	34
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	35
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	37
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 投资组合报告附注.....	38
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	39
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>39</b>

<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	41
10.9 其他重大事件.....	41
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>44</b>
11.1 备查文件目录.....	44
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	45

## § 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	1,870,541,687.56 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	377,850,345.18 份	1,492,691,342.38 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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>5、套利策略</p> <p>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	蒋松云
	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、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金半年度报告备置地点	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
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( 2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日 )	报告期( 2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,985,603.58	39,789,306.02
本期利润	9,985,603.58	39,789,306.02
本期净值收益率	2.5424%	2.6901%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	377,850,345.18	1,492,691,342.38
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	21.2516%	22.7267%

注 1: 本报告期指自 2015 年 1 月 1 日至 2015 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

#### 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	0.2447%	0.0054%	0.1124%	0.0000%	0.1323%	0.0054%
过去三个月	1.0263%	0.0162%	0.3202%	0.0000%	0.7061%	0.0162%
过去六个月	2.5424%	0.0162%	0.6389%	0.0000%	1.9036%	0.0162%
过去一年	4.8495%	0.0137%	1.2967%	0.0000%	3.5528%	0.0137%
过去三年	13.6055%	0.0100%	3.9943%	0.0000%	9.6111%	0.0099%
自基金合同生效起至今	21.2516%	0.0090%	6.9224%	0.0002%	14.3292%	0.0088%

#### 中海货币 B

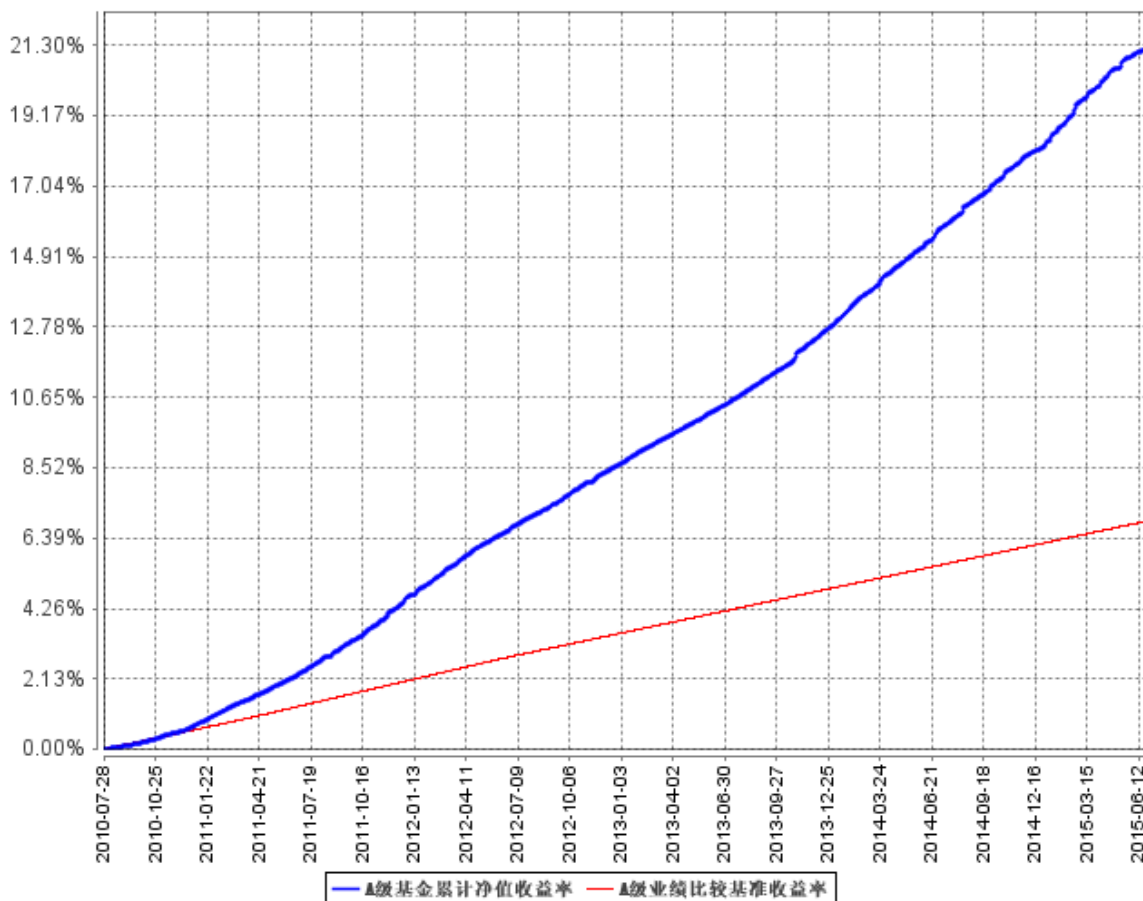
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2660%	0.0054%	0.1124%	0.0000%	0.1536%	0.0054%
过去三个月	1.0869%	0.0162%	0.3202%	0.0000%	0.7667%	0.0162%
过去六个月	2.6901%	0.0164%	0.6389%	0.0000%	2.0513%	0.0164%
过去一年	5.1278%	0.0138%	1.2967%	0.0000%	3.8310%	0.0138%
过去三年	14.4554%	0.0100%	3.9943%	0.0000%	10.4611%	0.0100%
自基金合同	22.7267%	0.0091%	6.9224%	0.0002%	15.8043%	0.0089%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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 2015 年 6 月 30 日

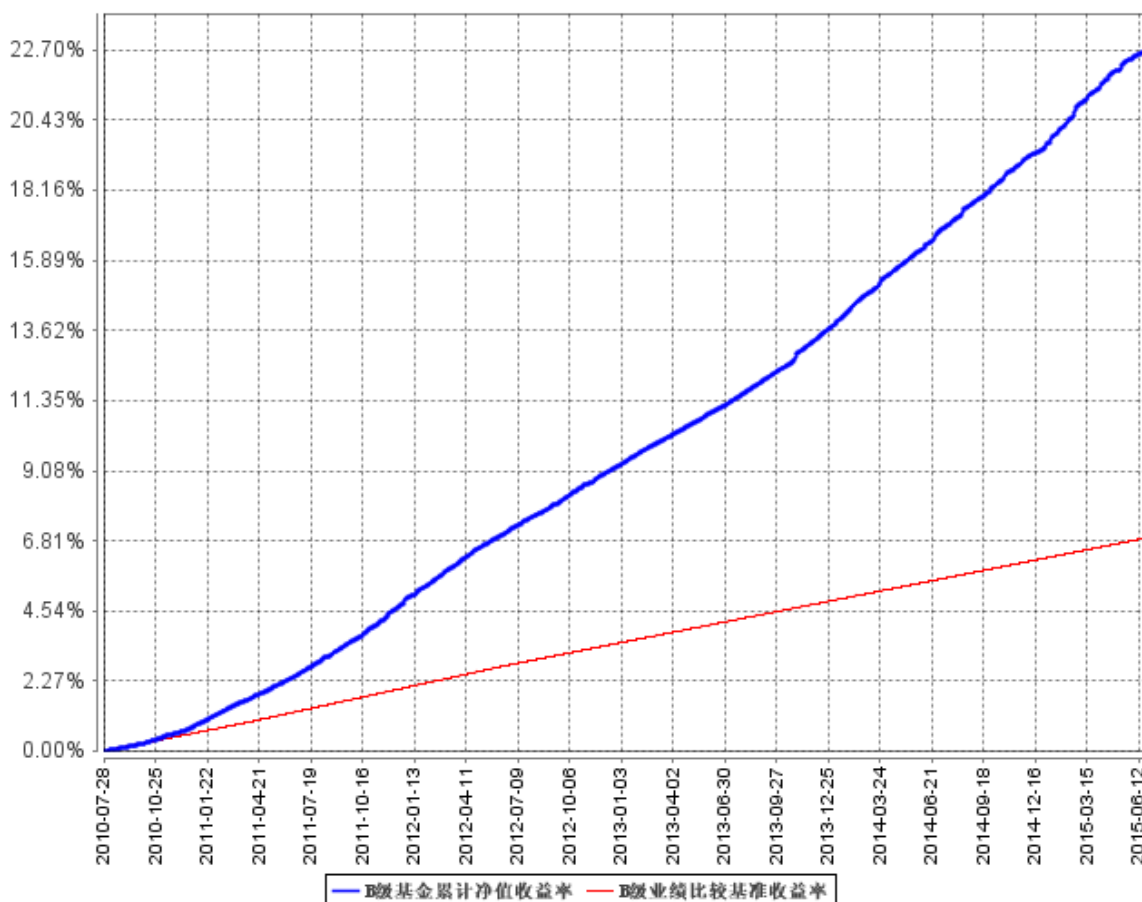
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**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 2015 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 26 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、中海纯债	2012 年 10 月 26 日	-	13 年	冯小波先生，上海交通大学

	<p>债券型证券投资基金基金经理、中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金基金经理、中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金经理</p>			<p>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，2014年4月至今任中海纯债债券型证券投资基金基金经理，2015年5月至今任中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金基金经理，2015年5月至今任中海惠利</p>
--	--	--	--	--

					纯债分级 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》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，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的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司风险管理部对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

### 4.3.2 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

2015 年上半年，GDP 增长 7.0%，增速比去年同期回落 0.4%；工业增加值增长 6.3%，增速比去年同期回落 2.5%；固定资产投资增长 11.4%，增速比去年同期回落 5.9%；社会消费品零售总额增长 10.4%，增速比去年同期回落 1.7%；进出口总值下降 6.9%，出口增长 0.9%，进口下降 15.5%，贸易顺差 1.61 万亿元；CPI 涨 1.3%，PPI 下降 4.6%。1-6 月的 PMI 指数持续在 50 附近徘徊。总体而言，全球经济依旧处于深度调整之中，复苏乏力，需求不振，前景仍不明朗，国内经济面临下行压力，通胀压力较小。由于经济增长尚未企稳，央行上半年出台多项刺激性措施支持经济增长。首先是降低利率，3 月、5 月和 6 月各宣布降息一次。其次是向市场提供流动性，2 月和 4 月各进行了一次全面降准，还通过定向降准对特定机构提供流动性支持；对到期的 MLF 进行了续作，并且在持续追加 MLF 操作金额；春节期间公开市场通过 7 天、14 天、28 天逆回购投放了 3980 亿元；春节后，公开市场操作重在引导货币市场利率下行，公开市场 7 天逆回购利率从上月的 3.85% 连续下调至 3.55%，并且在 6 月份进一步引导下调至 2.50%。

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。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，报告期内本基金 A 净值收益率为 2.5424%，高于业绩比较基准 1.9036 个百分点；报告期内本基金 B 净值收益率为 2.6901%，高于业绩比较基准 2.0513 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

2015 年下半年，国内外环境相当复杂，不稳定不确定因素依然较多，经济发展仍面临较大挑战，宏观经济下行的压力仍然较大。货币政策方面，由于经济下行警报尚未解除，预计宽松的货币格局将得以维持。债券市场方面，由于供给压力仍然较大，预计下半年债券收益率维持窄幅区间内波动的走势。

## 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证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供证券交易所及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 2015 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	470,851,124.02	222,742,709.24
结算备付金		3,304,000.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,452,582,870.93	1,402,315,882.45
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,452,582,870.93	1,402,315,882.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	34,200,000.00	925,890,308.83
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	31,030,291.99	35,291,010.73
应收股利		-	-
应收申购款		38,617,874.63	1,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,030,586,161.57	2,586,240,911.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		157,899,601.05	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		919,151.05	404,893.89
应付管理人报酬		755,717.83	504,058.69
应付托管费		229,005.40	152,745.05
应付销售服务费		108,846.11	97,885.22
应付交易费用	6.4.7.7	32,396.84	38,710.02
应交税费		-	-
应付利息		5,365.67	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	94,390.06	89,309.35
负债合计		160,044,474.01	1,287,602.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,870,541,687.56	2,584,953,309.03
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,870,541,687.56	2,584,953,309.03
负债和所有者权益总计		2,030,586,161.57	2,586,240,911.25

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 1,870,541,687.56 份，其中 A 级基金份额总额 377,850,345.18 份，B 级基金份额总额 1,492,691,342.38 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		57,171,919.62	52,220,857.41
1.利息收入		39,547,840.51	44,258,515.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,521,858.03	12,488,674.29
债券利息收入		22,140,072.46	24,132,041.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,885,910.02	7,637,798.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,604,079.11	7,962,342.40
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	17,604,079.11	7,962,342.40
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	20,000.00	-
<b>减：二、费用</b>		7,397,010.02	6,212,861.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,820,076.69	3,061,227.39

2. 托管费	6.4.10.2.2	1,157,599.05	927,644.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	682,753.13	431,538.05
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		1,618,797.99	1,642,080.41
其中：卖出回购金融资产支出		1,618,797.99	1,642,080.41
6. 其他费用	6.4.7.20	117,783.16	150,371.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		49,774,909.60	46,007,995.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		49,774,909.60	46,007,995.65

### 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	2,584,953,309.03	-	2,584,953,309.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,774,909.60	49,774,909.60
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）	-714,411,621.47	-	-714,411,621.47
其中：1. 基金申购款	10,604,554,187.27	-	10,604,554,187.27
2. 基金赎回款	-11,318,965,808.74	-	-11,318,965,808.74
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）	-	-49,774,909.60	-49,774,909.60
五、期末所有者权益（基金净值）	1,870,541,687.56	-	1,870,541,687.56
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	1,688,562,218.00	-	1,688,562,218.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	46,007,995.65	46,007,995.65
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)	115,965,622.77	-	115,965,622.77
其中：1. 基金申购款	6,804,221,519.93	-	6,804,221,519.93
2. 基金赎回款	-6,688,255,897.16	-	-6,688,255,897.16
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)	-	-46,007,995.65	-46,007,995.65
五、期末所有者权益(基金净值)	1,804,527,840.77	-	1,804,527,840.77

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

基金管理人负责人

宋宇

主管会计工作负责人

周琳

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;基金合同与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,经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公W[2010]B076号验资报告予以验证。

本基金根据基金份额持有人持有本基金的份额数量进行基金份额等级划分，若持有人持有本基金份额数量小于 500 万份，则所持有基金份额归为 A 级基金份额；若持有人持有本基金份额数量大于或等于 500 万份，则所持有基金份额归为 B 级基金份额。

本基金的投资范围包括现金、通知存款、短期融资券、一年以内(含一年)的银行定期存款和 大额存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金投资组合平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天。投资过程按照平衡组合流动性和最大化投资收益的原则对品种的投资比例进行动态调整。本基金的业绩比较基准为：同期 7 天通知存款利率(税后)。

#### 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(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会于 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 6.4.4 所列示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，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。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，自 2015 年 3 月 26 日起，本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除上述会计估计变更事项外，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。

#### 6.4.4.1 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。

#### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.4.3 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。

#### 6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

##### 6.4.6.2

对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

##### 6.4.6.3

对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

##### 6.4.6.4

基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	10,851,124.02
定期存款	460,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	460,000,000.00
其他存款	-
合计：	470,851,124.02

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 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	1,452,582,870.93	1,460,156,000.00	7,573,129.07	0.4049%
	合计	1,452,582,870.93	1,460,156,000.00	7,573,129.07	0.4049%

### 6.4.6.3 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。

### 6.4.6.4 买入返售金融资产

#### 6.4.6.4.1 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 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	34,200,000.00	-
合计	34,200,000.00	-

**6.4.6.4.2 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。

**6.4.6.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	4,351.28
应收定期存款利息	1,456,111.11
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,486.80
应收债券利息	29,433,537.80
应收买入返售证券利息	134,805.00
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	31,030,291.99

**6.4.6.6 其他资产**

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

**6.4.6.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2015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	32,396.84
合计	32,396.84

**6.4.6.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,046.90
预提费用	88,343.16
合计	94,390.06

## 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

中海货币 A		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	289,299,993.07	289,299,993.07
本期申购	2,563,152,626.54	2,563,152,626.54
本期赎回(以“-”号填列)	-2,474,602,274.43	-2,474,602,274.43
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	377,850,345.18	377,850,345.18

金额单位：人民币元

中海货币 B		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,295,653,315.96	2,295,653,315.96
本期申购	8,041,401,560.73	8,041,401,560.73
本期赎回(以“-”号填列)	-8,844,363,534.31	-8,844,363,534.31
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,492,691,342.38	1,492,691,342.38

## 6.4.6.10 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	9,985,603.58	-	9,985,603.58
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	-9,985,603.58	-	-9,985,603.58
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	39,789,306.02	-	39,789,306.02
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	-39,789,306.02	-	-39,789,306.02
本期末	-	-	-

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	158,607.16
定期存款利息收入	11,357,477.55
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,773.32
其他	-
合计	11,521,858.03

#### 6.4.6.12 股票投资收益

注：本基金在本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	17,604,079.11
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	17,604,079.11

**6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,891,152,476.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,791,734,601.80
减：应收利息总额	81,813,796.00
买卖债券差价收入	17,604,079.11

**6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

**6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

**6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.6.14 贵金属投资收益****6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

**6.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

**6.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

**6.4.6.15 衍生工具收益****6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金在本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。



**6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金在本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

**6.4.6.16 股利收益**

注：本基金在本报告期无股利收益。

**6.4.6.17 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。

**6.4.6.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	20,000.00
合计	20,000.00

**6.4.6.19 交易费用**

注：本基金在本报告期无交易费用。

**6.4.6.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	39,671.58
其他	50.00
银行汇划费用	20,390.00
债券帐户维护费	18,000.00
合计	117,783.16

**6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.7.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.7.2 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：

2015 年度

宣告日

分配收益所属期间

—第 7 号收益支付公告      2015/07/15      2015/6/15-2015/7/14

—第 8 号收益支付公告      2015/08/17      2015/7/15-2015/8/16

## 6.4.8 关联方关系

### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 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
农业银行	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

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 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。

#### 6.4.9.1.2 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。

#### 6.4.9.1.3 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

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,820,076.69	3,061,227.39
其中：支付销售机构的客户维护费	437,333.43	338,523.98

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。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,157,599.05	927,644.72

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。

#### 6.4.9.2.3 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		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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	49,668.24	74,997.80	124,666.04
工商银行	151,878.93	1,006.88	152,885.81
国联证券	1,247.20	79.47	1,326.67
合计	202,794.37	76,084.15	278,878.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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	22,953.41	69,057.63	92,011.04
工商银行	93,883.70	2,679.09	96,562.79
国联证券	107.06	0.00	107.06

合计	116,944.17	71,736.72	188,680.89
----	------------	-----------	------------

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。

#### 6.4.9.3 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。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 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。

##### 6.4.9.4.2 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

注：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。

#### 6.4.9.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	10,851,124.02	158,607.16	5,831,813.60	77,402.01

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。

#### 6.4.9.6 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。

#### 6.4.10 利润分配情况

##### 6.4.10.1 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
9,985,603.58	-	-	9,985,603.58	-

## 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
39,789,306.02	-	-	39,789,306.02	-

**6.4.11 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.11.1 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。

**6.4.11.2 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因持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购**

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
041453118	14 酒钢 CP002	2015年7月1日	100.93	300,000	30,279,000.00
110221	11 国开 21	2015年7月1日	99.99	500,000	49,995,000.00
130215	13 国开 15	2015年7月1日	99.96	400,000	39,984,000.00
159901	15 贴现国债 01	2015年7月1日	99.46	400,000	39,784,000.00
合计				1,600,000	160,042,000.00

**6.4.11.3.2 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。

**6.4.12 金融工具风险及管理****6.4.12.1 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，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，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、风控稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 6.4.12.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行；其他定期存款存放在具有基金托管资格的广发银行股份有限公司和民生银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.12.2.1 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	861,971,791.27	901,815,258.14
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	500,323,671.04	290,185,695.42
合计	1,362,295,462.31	1,192,000,953.56

注：本期末按短期信用评级为“未评级”的债券为清算所超短融及银行间国债；上年度末按短期信用评级为“未评级”的债券为清算所超短融及银行间政策性金融债。

**6.4.12.2 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	90,287,408.62	210,314,928.89
合计	90,287,408.62	210,314,928.89

注：本期末及上年度末按长期信用评级为“未评级”的债券投资均为银行间政策性金融债。

**6.4.12.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还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，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2015 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 157,899,601.05 元将在 2015 年 7 月 1 日到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.12.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

下表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	470,851,124.02	-	-	-	-	-	470,851,124.02
结算备付金	3,304,000.00	-	-	-	-	-	3,304,000.00
交易性金融资产	250,452,632.93	331,769,020.57	870,361,217.43	-	-	-	1,452,582,870.93
买入返售金融资产	-	34,200,000.00	-	-	-	-	34,200,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	-31,030,291.99	31,030,291.99
应收申购款	-	-	-	-	-	-38,617,874.63	38,617,874.63
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	724,607,756.95	365,969,020.57	870,361,217.43	-	-	-69,648,166.62	2,030,586,161.57
负债							
卖出回购金融资产款	157,899,601.05	-	-	-	-	-	157,899,601.05
应付赎回款	-	-	-	-	-	919,151.05	919,151.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	755,717.83	755,717.83
应付托管费	-	-	-	-	-	229,005.40	229,005.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	108,846.11	108,846.11



应付交易费用	-	-	-	-	-	32,396.84	32,396.84
应付利息	-	-	-	-	-	5,365.67	5,365.67
其他负债	-	-	-	-	-	94,390.06	94,390.06
负债总计	157,899,601.05	-	-	-	-	2,144,872.96	160,044,474.01
利率敏感度缺口	566,708,155.90	365,969,020.57	870,361,217.43	-	-	-67,503,293.66	1,870,541,687.56
上年度末 2014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	122,742,709.24	100,000,000.00	-	-	-	-	222,742,709.24
交易性金融资产	491,288,805.43	310,739,052.34	600,288,024.68	-	-	-	1,402,315,882.45
买入返售金融资产	925,890,308.83	-	-	-	-	-	925,890,308.83
应收利息	-	-	-	-	-	-35,291,010.73	35,291,010.73
应收申购款	-	-	-	-	-	1,000.00	1,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,539,921,823.50	410,739,052.34	600,288,024.68	-	-	-35,292,010.73	2,586,240,911.25
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	404,893.89	404,893.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	504,058.69	504,058.69
应付托管费	-	-	-	-	-	152,745.05	152,745.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	97,885.22	97,885.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	38,710.02	38,710.02
其他负债	-	-	-	-	-	89,309.35	89,309.35
负债总计	-	-	-	-	-	1,287,602.22	1,287,602.22
利率敏感度缺口	1,539,921,823.50	410,739,052.34	600,288,024.68	-	-	-34,004,408.51	2,584,953,309.03

#### 6.4.12.4.1.2 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。

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 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	1,452,582,870.93	71.54
	其中：债券	1,452,582,870.93	71.54
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	34,200,000.00	1.68
	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	474,155,124.02	23.35
4	其他各项资产	69,648,166.62	3.43
5	合计	2,030,586,161.57	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	4.92	
	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	157,899,601.05	8.44
	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

序号	发生日期	融资余额 占基金资 产净值比 例 (%)	原因	调整期
1	2015 年 6 月 19 日	25.45	连续遭遇巨额赎回	1 天

## 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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	148
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

### 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	2015 年 1 月 26 日	131	巨额赎回	10
2	2015 年 1 月 28 日	122	巨额赎回	9
3	2015 年 1 月 29 日	123	巨额赎回	8
4	2015 年 1 月 30 日	128	巨额赎回	7
5	2015 年 2 月 2 日	123	巨额赎回	6
6	2015 年 2 月 3 日	124	巨额赎回	5
7	2015 年 2 月 4 日	130	巨额赎回	4
8	2015 年 2 月 5 日	129	巨额赎回	3
9	2015 年 2 月 6 日	128	巨额赎回	2
10	2015 年 2 月 9 日	124	巨额赎回	1
11	2015 年 3 月 25 日	123	巨额赎回	4
12	2015 年 3 月 26 日	123	巨额赎回	3
13	2015 年 3 月 27 日	125	巨额赎回	2
14	2015 年 3 月 31 日	126	巨额赎回	1
15	2015 年 4 月 1 日	137	巨额赎回	10
16	2015 年 4 月 2 日	137	巨额赎回	9
17	2015 年 4 月 3 日	135	巨额赎回	8
18	2015 年 4 月 7 日	140	巨额赎回	7
19	2015 年 4 月 8 日	148	巨额赎回	6
20	2015 年 4 月 9 日	148	巨额赎回	5

21	2015 年 4 月 10 日	143	巨额赎回	4
22	2015 年 4 月 14 日	136	巨额赎回	3
23	2015 年 4 月 15 日	130	巨额赎回	2
24	2015 年 4 月 16 日	129	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	38.74	8.44
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	5.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	14.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	32.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.83	8.44

### 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	39,745,755.44	2.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,287,408.62	4.83
	其中：政策性金融债	90,287,408.62	4.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,322,549,706.87	70.70
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,452,582,870.93	77.66

9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-
---	----------------------	---	---

### 7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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	041452038	14 云煤化 CP002	1,200,000	121,005,841.53	6.47
2	011473008	14 鲁高速 SCP008	1,100,000	110,110,882.26	5.89
3	041469048	14 山钢 CP004	1,000,000	100,534,061.33	5.37
4	011599153	15 山钢 SCP004	1,000,000	100,284,617.21	5.36
5	011481006	14 淮南矿 SCP006	800,000	80,119,804.08	4.28
6	041564008	15 博源 CP001	800,000	80,002,171.23	4.28
7	041560021	15 龙煤控 CP001	800,000	79,991,776.59	4.28
8	011580003	15 兖矿 SCP003	700,000	70,004,319.44	3.74
9	041558004	15 同煤 CP002	600,000	60,074,954.16	3.21
10	041562002	15 同煤 CP001	600,000	60,046,533.70	3.21

### 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	61
报告期内偏离度的最高值	0.4553%
报告期内偏离度的最低值	0.0978%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2560%

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期

### 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	31,030,291.99
4	应收申购款	38,617,874.63
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	69,648,166.62

### 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

份额	持有人	户均持有的基	持有人结构

级别	户数 (户)	金份额	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	13,030	28,998.49	12,722,727.59	3.37%	365,127,617.59	96.63%
中海 货币 B	32	46,646,604.45	1,408,531,126.82	94.36%	84,160,215.56	5.64%
合计	13,062	143,204.85	1,421,253,854.41	75.98%	449,287,833.15	24.02%

### 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	135,373.84	0.0358%
	中海货币 B	-	-
	合计	135,373.84	0.0072%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	中海货币 A	0~10
	中海货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	中海货币 A	0
	中海货币 B	0
	合计	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	784,606,303.02	2,174,321,508.86
本报告期初基金份额总额	289,299,993.07	2,295,653,315.96
本报告期基金总申购份额	2,563,152,626.54	8,041,401,560.73
减:本报告期基金总赎回份额	2,474,602,274.43	8,844,363,534.31

本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	377,850,345.18	1,492,691,342.38

## § 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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，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	-	-	-	-	-



中信建投	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；报风控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。因申银万国证券与宏源证券合并，更名为申万宏源证券，但交易单元暂时不合并，仍分开使用。

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	-	-	892,800,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 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	中海基金管理有限公司旗下基金更换会计师事务所的公告	中国证券报	2015年1月5日
2	中海基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报	2015年1月10日
3	中海货币市场证券投资基金收	中国证券报	2015年1月15日

	益支付公告		日
4	中海货币市场证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报	2015 年 1 月 20 日
5	中海基金管理有限公司关于从 业人员在子公司兼任职务及领 薪情况的公告	中国证券报	2015 年 1 月 28 日
6	关于中海货币市场证券投资基 金春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	2015 年 2 月 11 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	2015 年 2 月 16 日
8	中海基金管理有限公司关于调 整旗下部分证券投资基金赎回、 转换及账户最低保留份额限制 等业务规则的公告	中国证券报	2015 年 3 月 6 日
9	中海货币市场证券投资基金更 新招募说明书(2015 年第 1 号)	中海基金网站	2015 年 3 月 13 日
10	中海货币市场证券投资基金更 新招募说明书摘要(2015 年第 1 号)	中国证券报	2015 年 3 月 13 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	2015 年 3 月 16 日
12	中海货币市场证券投资基金 2014 年年度报告	中海基金网站	2015 年 3 月 27 日
13	中海基金管理有限公司关于旗 下基金调整交易所固定收益品 种估值方法的公告	中国证券报	2015 年 3 月 27 日
14	中海货币市场证券投资基金	中国证券报	2015 年 3 月 27

	2014 年年度报告摘要		日
15	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	2015 年 3 月 30 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	2015 年 4 月 15 日
17	中海基金管理有限公司关于暂停官网直销支付宝渠道部分基金认购、申购及定期定额申购业务的公告	中国证券报	2015 年 4 月 17 日
18	中海货币市场证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报	2015 年 4 月 22 日
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	2015 年 4 月 24 日
20	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增中期资产管理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	2015 年 5 月 11 日
21	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报	2015 年 5 月 15 日
22	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江金观诚财富管理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	2015 年 5 月 22 日
23	中海基金管理有限公司关于旗	中国证券报	2015 年 6 月 1

	下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告		日
24	中海基金管理有限公司关于开通工商银行卡（借记卡）、农业银行卡（借记卡）、浦发银行卡（借记卡）及兴业银行卡（借记卡）APP 直销业务的公告	中国证券报	2015 年 6 月 4 日
25	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海汇付金融服务有限公司为销售机构并开通基金转换投资业务的公告	中国证券报	2015 年 6 月 6 日
26	中海货币市场证券投资基金收益支付公告	中国证券报	2015 年 6 月 15 日
27	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	2015 年 6 月 15 日
28	中海基金管理有限公司澄清公告	中国证券报	2015 年 6 月 27 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

## 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  
2015 年 8 月 26 日