

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、董事会、报告机构和督察长不承担虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金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”根据本基金合同的规定，于2014年3月20日复函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当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，应阅读年度报告全文。

报告期为2013年1月1日起至2013年12月31日。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中海货币	
基金代码	392001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年7月20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	
报告期末基金资产总额	1,688,562,180.00	
基金合同的存续期	不长期	
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	236,006,697.96	1,403,566,520.00

2.2 基金产品说明

投资目标	在保证资产安全与资产在充分流动的前提下,追求高于业绩比较基准的收益率,为基金份额持有人创造价值。
投资策略	1.资产配置策略 根据宏观经济和利率走势的分析,本基金制定利率预期策略,如预期利率下降,将增加组合久期;如预期利率上升,则缩短组合久期。 2.债券投资策略 各类券种资产在本基金的组合配置是本基金选择的收益曲线策略。资产配置过程中具体体现,本基金采用资产配置分析法进行资产的合理组合,根据资产配置过程中对股票、债券、可转债的一级市场申购、二级市场交易等投资管理进行综合的公平交易策略。 3.类属配置策略 本基金在资产配置中主要考虑不同期限、不同期限和不同品种之间的收益率差,通过资产配置来获得资产的绝对收益。
业绩比较基准	同期天道银行利率
风险收益特征	本基金是一只低风险、低收益的货币市场基金,适合风险偏好较低的投资者。
23.基金管理人和基金托管人	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

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.zhtfund.com
基金年度报告备查文件目录	上海市浦东新区陆家嘴环路68号2000-2008室及30

5.3 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

期间	2013年		2012年		2011年	
	本期	上期	本期	上期	本期	上期
中海货币A	10,142,739.77	70,185,789.21	22,493,833.72	45,584,688.22	8,374,004.86	52,814,103.29
中海货币B	3.8870%	4.1074%	3.8537%	4.1038%	3.8521%	4.1012%
中海货币资产净值	1,463,556.62	670,926,191.46	2,863,893,812.42	504,689,920.97	775,774,038.13	
中海货币B份额	10,000.00	10,000.00	10,000.00	10,000.00	10,000.00	

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。

3.2 基金表现

3.2.1 份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 率(%)	份额净值增 长率标准差(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.2088%	0.0009%	0.3200%	0.0000%	0.0780%	0.0009%
过去六个月	2.1666%	0.0074%	0.6622%	0.0000%	1.5032%	0.0074%
过去一年	3.8708%	0.0039%	1.3234%	0.0000%	2.5346%	0.0039%
过去三年	12.0142%	0.0070%	4.2611%	0.0002%	7.7531%	0.0006%
自基金合同生 效之日起至今	12.8073%	0.0069%	4.0749%	0.0002%	7.9324%	0.0067%

注:“基金合同生效日起至今”指2010年7月28日(基金合同生效日)至2013年12月31日,相关数据未按自然年度进行折算。

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

中海货币A
阶段
份额净值增长 率(%)
过去三个月
过去六个月
过去一年
过去三年
自基金合同生 效之日起至今

注:“基金合同生效日起至今”指2010年7月28日(基金合同生效日)至2013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
已按摊余成本法 确认的应收利息
直接通过应付 银行存款转出的 本年变动
应付利息
年度利润 分配合计
备注

中海货币B
年度
已按摊余成本法 确认的应收利息
直接通过应付 银行存款转出的 本年变动
应付利息
年度利润 分配合计
备注

中海货币A
年度
已按摊余成本法 确认的应收利息
直接通过应付 银行存款转出的 本年变动
应付利息
年度利润 分配合计
备注

中海货币B
年度
已按摊余成本法 确认的应收利息
直接通过应付 银行存款转出的 本年变动
应付利息
年度利润 分配合计
备注

中海货币A
年度
已按摊余成本法 确认的应收利息
直接通过应付 银行存款转出的 本年变动
应付利息
年度利润 分配合计
备注

中海货币B
年度
已按摊余成本法 确认的应收利息
直接通过应付 银行存款转出的 本年变动
应付利息
年度利润 分配合计
备注

中海货币A
年度
已按摊余成本法 确认的应收利息
直接通过应付 银行存款转出的 本年变动
应付利息
年度利润 分配合计
备注

中海货币B
年度
已按摊余成本法 确认的应收利息
直接通过应付 银行存款转出的 本年变动
应付利息
年度利润 分配合计
备注

中海货币A
年度
已按摊余成本法 确认的应收利息
直接通过应付 银行存款转出的 本年变动
应付利息
年度利润 分配合计
备注

中海货币B