

# 中海货币市场证券投资基金

## 2013 年度 报告 摘要

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。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者了解详细情况,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

基金简称	中海货币
基金代码	392001
基金运作方式	契约开放式
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
报告期末基金份额总额	1,698,562,218.00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
下属分级基金合同生效日	202002
报告期末下属分级基金的份额总额	526,006,697.95份

2.2 基金产品说明

投资目标	在确保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,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,如果预期利率上升,则缩短组合的久期。 2.期限结构策略 根据债券资产在期限结构上的配置是本基金所选择的收益曲线策略在资产配置过程中所采用的具体体现。本基金采用总收益法在子组合、组合层、整体组合等三个基础层面上进行资产配置。 3.流动性管理策略 根据各类期限结构收益类金融工具的市场规模、收益性、流动性,设定各类资产的配置比例,通过召开投资决策委员会的流动性和收益性讨论,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,通过基金资产变现(包括现金库存、资产变现、基金到期赎回或其他措施),保证基金资产的高流动性。 5.风险控制 本基金的基本策略是追求利不损本,不同期限的不同品种之间的收益率差异,通过大额申购和赎回资金安排,有效控制风险敞口。 业绩比较基准 同期7天通知存款利率(税后) 跟踪偏离度 本基金货币市场证券投资基金为,本基金基金中的低风险基金、债券型基金。

基金管理人	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
姓名	王明	赵建春
联系电话	021-38428888	010-66106799
电子邮箱	wangm@zhonghai.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-9788,021-38789788	95588
网址	021-68419525	010-66106798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的网站网址	www.zhzhfund.com
-----------------	------------------

基金年度报告备置地点 上海市浦东新区陆家嘴世纪大道100号2808-2809室及30

### §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

项目	2013年	2012年	2013年	2012年	2013年	2012年
本期已实现收益	10,142,738.77	70,186,789.21	22,403,833.72	46,584,688.22	8,374,004.86	52,814,103.29
本期利润	10,142,738.77	70,186,789.21	22,403,833.72	46,584,688.22	8,374,004.86	52,814,103.29
本期净收益	3.8670%	4.1074%	3.8637%	4.1036%	3.8621%	4.1012%
3.1.2 期末基金净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
期末资产	225,006,697.96	1,463,566,520.06	670,926,191.46	2,863,893,812.42	504,680,920.97	775,774,928.13
期末负债	10,000	10,000	10,000	10,000	10,000	10,000

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。

3.2.1 基金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	1.2689%	0.0068%	0.5300%	0.0000%	0.6789%	0.0068%
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%
自基金合同生效以来至今	12.8073%	0.0069%	4.8749%	0.0002%	7.9324%	0.0067%

注:“自基金合同生效起至今”指2010年7月20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

“本基金累计净值增长率”指:本基金净值增长率减去业绩比较基准收益率后的差额。



图1: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

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

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%。

各该基金份额的销售服务费的计提计算公式为:

H=E×R/当年天数(H为每日应支付的该级基金份额的销售服务费,E为前一日该级基金份额的基金资产净值,R为该级基金份额的销售费率)

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费