中海货币市场证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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8月27日

§1 重要提示

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2014年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30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	1,804,527,840.77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	292,666,828.71份	1,511,861,012.06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

登载基金半年度报告报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金半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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	6,755,015.24	39,252,980.41
本期利润	6,755,015.24	39,252,980.41
本期净值收益率	2.5141%	2.6362%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	292,666,828.71	1,511,861,012.06
期末基金份额净值	1.00	1.00

注1:本报告期指自2014年1月1日至2014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

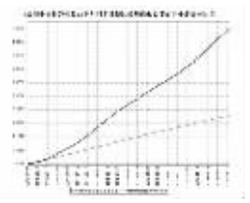
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.4471%	0.0158%	0.1067%	0.0000%	0.3404%	0.0158%
过去三个月	1.1654%	0.0099%	0.3243%	0.0000%	0.8411%	0.0099%
过去六个月	2.5141%	0.0087%	0.6472%	0.0000%	1.8669%	0.0087%
过去一年	4.7342%	0.0082%	1.3138%	0.0000%	3.4204%	0.0082%
过去三年	13.0495%	0.0078%	4.1917%	0.0002%	8.8577%	0.0076%
自基金合同生效日起至今	15.6435%	0.0073%	5.5537%	0.0002%	10.0898%	0.0071%

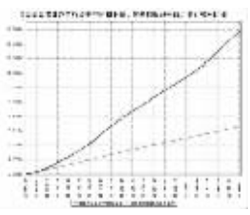
中海货币B

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	0.4670%	0.0158%	0.1067%	0.0000%	0.3603%	0.0158%
过去三个月	1.2262%	0.0099%	0.3243%	0.0000%	0.9018%	0.0099%
过去六个月	2.6362%	0.0087%	0.6472%	0.0000%	1.9890%	0.0087%
过去一年	4.9858%	0.0082%	1.3138%	0.0000%	3.6720%	0.0082%
过去三年	13.8665%	0.0078%	4.1917%	0.0002%	9.6748%	0.0076%
自基金合同生效日起至今	16.7405%	0.0073%	5.5537%	0.0002%	11.1869%	0.0071%

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2014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





§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2014年6月30日,共管理证券投资基金20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、中海纯债债券型证券投资基金基金经理	2012年10月26日	-	12	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,2014年4月至今任中海纯债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批露的任免日期填写。

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》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

2014年上半年,经济增长面临较大的下行压力,第一季度GDP增速为7.4%,这是自2012年三季度以来的最低增速,季度年化增速为5.7%,创记录新低。外部环境复杂严峻,外需增长乏力,一季度甚至出现负增长,2月出口同比降幅达到18.1%;3月中国进出口数据双双下跌,出口同比下降6.6%,进口同比下滑11.3%。投资需求相对较弱,投资增长后劲相对不足,反映在新开工投资项目上仅增长13.6%,而过去常态一般是20%左右。房地产形势也不容乐观,土地购置下降,销售下降,库存攀升。

在政府微刺激政策作用下,尤其是国务院明确要求降低实体企业及银行的融资成本,债券市场走出阴霾、强劲上扬,各期限收益率均明显下降,10年国债收益率下降接近50bp,政策性金融债与信用债的利率下降幅度则更大。

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。策略上,二季度初基金规模增长较快时增加了债券资产的配置,较好分享了债券牛市的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,报告期内本基金A净值收益率为2.5141%,高于业绩比较基准1.8669个百分点;报告期内本基金B净值收益率为2.6362%,高于业绩比较基准1.9890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。

尽管经济下行压力依然存在,但是已经很难继续刺激债券市场。相反,由于M2居高不下,只要增长数据不进一步恶化,央行没有理由继续大幅放水。央行态度实际已经发生变化,7月份资金较为紧张时,央行并没有启动SLO或SLF工具,听任7天回购和1M回购处于4%和5%附近的相对高位。可见央行可容忍的资金成本底线在抬升,这点值得警惕。在经济下行压力已经不是新鲜事物的情况下,缺少央行关照的债券市场很难有较好表现。

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2014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:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		605,831,813.60	526,223,146.30
结算备付金		425,000.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		960,241,420.71	965,804,538.48
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		960,241,420.71	965,804,538.48
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		351,001,046.50	293,600,767.90
应收证券清算款		-	-
应收利息		18,760,863.15	17,398,254.15
应收股利		-	-
应收申购款		87,781,578.75	169,880,391.53
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,024,041,722.71	1,972,907,098.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		218,199,442.20	282,898,815.65
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		23,192.76	4,857.17
应付管理人报酬		626,265.22	519,242.64
应付托管费		189,777.35	157,346.25
应付销售服务费		88,294.46	79,007.37
应付交易费用		35,544.46	23,708.11
应交税费		-	-
应付利息		161,230.83	576,902.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		190,134.66	85,000.72
负债合计		219,513,881.94	284,344,880.36
所有者权益:			
实收基金		1,804,527,840.77	1,688,562,218.00
未分配利润		-	-
所有者权益合计		1,804,527,840.77	1,688,562,218.00
负债和所有者权益总计		2,024,041,722.71	1,972,907,098.36

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.00元,基金份额总额1,804,527,840.77份,其中A级基金份额总额292,666,828.71份,B级基金份额总额1,511,861,012.06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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一.收入		52,220,857.41	52,388,862.08
1.利息收入		44,258,515.01	48,821,489.95
其中:存款利息收入		12,488,674.29	21,912,431.57
债券利息收入		24,132,041.80	22,004,651.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,637,798.92	4,904,406.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		7,962,342.40	3,567,372.13
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		7,962,342.40	3,567,372.13
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)		-	-
减:二.费用		6,212,861.76	7,687,056.99
1.管理人报酬		3,061,227.39	4,237,159.23
2.托管费		927,644.72	1,283,987.67
3.销售服务费		431,538.05	519,157.75
4.交易费用		-	-
5.利息支出		1,642,080.41	1,482,490.35
其中:卖出回购金融资产支出		1,642,080.41	1,482,490.35
6.其他费用		150,371.19	164,261.99
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		46,007,995.65	44,701,805.09
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		46,007,995.65	44,701,805.09

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:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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(本期净利润)	-	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
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	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(本期净利润)	-	44,701,805.09	44,701,805.09
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)	-2,062,638,525.81	-	-2,062,638,525.81
其中:1.基金申购款	4,183,353,572.24	-	4,183,353,572.24
2.基金赎回款	-6,245,992,098.05	-	-6,245,992,098.05
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)	-	-44,701,805.09	-44,701,805.09
五.期末所有者权益(基金净值)	1,472,181,478.06	-	1,472,181,478.06

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_____ _____宋宇_____ _____周琳_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 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。

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。

6.4.4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。

6.4.5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。

6.4.6 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:

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。

6.4.6.2

基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

6.4.6.3

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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
工商银行	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
中国石油财务有限责任公司	基金管理人的关联方

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

注:本基金本期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,061,227.39	4,237,159.23
其中:支付销售机构的客户维护费	338,523.98	332,723.68

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	927,644.72	1,283,987.67

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。

6.4.8.2.3 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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	23,115.74	96,087.11	119,202.85
工商银行	141,107.53	3,875.33	144,982.86
国联证券	1,409.39	0.00	1,409.39
合计	165,632.66	99,962.44	265,595.10

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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: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。

6.4.8.4.2 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 2014年6月30日		上年度末 2013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
中国海洋石油总公司	-	-	758,831,349.21	58.6200%
中海石油财务有限责任公司	105,301,818.74	6.9700%	100,172,841.11	7.7400%

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。

6.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	5,831,813.60	77,402.01	2,465,769.85	91,607.11

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。

6.4.8.6 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未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2014年6月30日止,本基金从事银行间市场正回购交易形成的卖出回购证券款余额218,199,442.20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
041458021	14山钢CP001	2014年7月1日	100.88	895,000	90,287,600.00
120227	12国开27	2014年7月3日	98.77	300,000	29,631,000.00
130306	13进出06	2014年7月3日	99.44	1,000,000	99,440,000.00
合计				2,195,000	219,358,600.00

6.4.9.3.2 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。

§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	960,241,420.71	47.44
	其中:债券	960,241,420.71	47.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	351,001,046.50	17.34
	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	606,256,813.60	29.95
4	其他各项资产	106,542,441.90	5.26
5	合计	2,024,041,722.71	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	5.77	
	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	218,199,442.20	12.09
	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	2014年1月21日	20.33	遭遇巨额赎回	5个交易日
2	2014年1月22日	22.67	遭遇巨额赎回	4个交易日
3	2014年1月23日	22.72	遭遇巨额赎回	3个交易日
4	2014年1月24日	22.43	遭遇巨额赎回	2个交易日
5	2014年1月26日	22.42	遭遇巨额赎回	1个交易日
6	2014年1月29日	20.74	遭遇巨额赎回	2个交易日
7	2014年1月30日	20.74	遭遇巨额赎回	1个交易日
8	2014年3月13日	21.18	遭遇巨额赎回	2个交易日
9	2014年3月14日	21.18	遭遇巨额赎回	1个交易日

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????????	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	128
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

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	2014年4月10日	121	正回购到期	1
2	2014年5月27日	123	正回购到期	5
3	2014年5月28日	122	正回购到期	4
4	2014年5月29日	128	正回购到期	3
5	2014年5月30日	124	正回购到期	2
6	2014年6月3日	120	正回购到期	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	37.48	12.09
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.49	-
2	30天(含)—60天	13.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	9.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	16.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.64	-
5	180天(含)—397天(含)	28.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.26	12.09

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	158,576,608.12	8.79
	其中:政策性金融债	158,576,608.12	8.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	801,664,812.59	44.43
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8