

中海货币市场证券投资基金管理有限公司

2015 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：2015年8月26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。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事签发。

基金管理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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年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A
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	1,879,541,687.56份
基金合同存续期	不定期
下一级基金的名称	中海货币B
下一级基金的交易代码	392002
报告期末下级基金的份额总额	397,850,345.18份
1,402,691,342.38份	

2.2 基金产品说明

在本基金资产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持续稳定的当期收益。

1. 资产配置策略
根据宏观经济和利率走势的分析，本基金将制定利差预期策略，如预期利差下降，则增加组合的久期，如预期利差上升，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构造上的配置是本基金所选择的收益曲线策略，在资产配置过程中具体体现，本基金采用收益分析方法在子弹组合、杠铃组合、梯形组合等三种基础模型中进行选择。

3. 类属配置策略
根据类别资产对收益类金融工具的市场规模、收益率和流动性，决定各类资产的配置比例并通过对各资产的流动性和收益性差异，确定不同类别资产的具体资产配置比例。

4. 流动性风险管理
在本基金资产申购、赎回的基金需求前提下，通过基金资产安排（包括现金库存、资产变现、申购限制或以其他措施），保证基金资产的高流动性。

5. 风险预警
本基金的薪酬管理主要是利率不同市场、不同期限和不同品种之间的收益率差异，通过组合的久期、利率、信用等风险因子，评估风险的利差收益。

业绩比较基准 同时7天通知存款利率(税后)

风险收益特征 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
姓名	王莉	蒋海云
联系电话	021-38428006	010-66106709
电子邮箱	wangli@zifund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-0708-201-38795798	96588
传真	021-69419626	010-66106709

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址 www.zifund.com

基金半年度报告备置地点 上海市浦东新区银城中路6号2906-2908室及30层

5.3 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

基金级别	中海货币A	中海货币B
报告期 2015年1月1日至 2015年6月30日 (月)	报告期 2015年1月1日至 2015年6月30日 (月)	报告期 2015年1月1日至 2015年6月30日 (月)
本期已实现收益	9,098,603,558	39,789,306,02
本期利润	9,098,603,558	39,789,306,02
本期可供分配利润	2,524,24%	2,69001%
报告期可供分配利润	qiMeiGongBenJiLiuJinYiLiuBu	2015年3月31日
期末可供分配利润	377,890,346.18	1,402,691,342.38
期末可供分配利润	10000	10000

金额单位：人民币元

注：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，由于货币市场基金未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：本基金日结日转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值及其与同期业绩比较基准收益率的比较

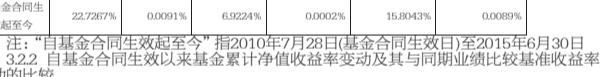
中海货币A



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

中海货币A



3.2.3 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



注：本基金在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377,890,345.18份，B级基金份额总额1,402,691,342.38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 元

注：本基金报告期指自2015年1月1日至2015年6月30日。

注2：本基金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，由于货币市场基金未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：本基金日结日转份额。

3.2.4 基金管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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体系和内部控制体系，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，其管理产品规模达26亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理助理）及基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理（助理）期间 证券从业年限 说明

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期间	证券从业年限	说明
王莉	基金经理	2010年7月20日至今	15年	具有15年证券从业经验，先后在国泰君安证券有限公司、平安证券有限公司、光大证券有限公司、华泰证券有限公司工作，具有丰富的证券从业经验，长期从事金融行业研究工作，2010年7月20日至今担任中海基金管理有限公司基金经理。

注1：任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任期计算填写。

注2：证券从业人员的含义遵从《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的合规性声明及说明

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》的约定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

根据《证券投资基金评价规则》及公司相关制度，公司从研究、投资、风险管理三个环节对公平交易制度进行了明确规定，对公平交易制度的执行效果进行了定期的反向抽样检测，对相关产品的投资交易行为进行了统计分析，多维度的公平交易监控机制确保公平交易事

项符合公司制度的规定，对不同组合不同时间段的同向交易进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对相关产品的投资交易行为进行了统计分析，多维度的公平交易监控机制确保公平交易事

项符合公司制度的规定，对不同组合不同时间段的同向交易进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对相关产品的投资交易行为进行了统计分析，