

# 中海货币市场证券投资基金管理

## [2015] 第四季度报告

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  
报告送出日期:2016年1月22日

净值收益率为0.7672%,高于业绩比较基准0.404个百分点。

\$ 投资组合报告

| 6.1 报告期末基金资产组合情况  |                  |                  |
|-------------------|------------------|------------------|
| 序号                | 项目               | 金额(元)            |
| 1                 | 固定收益投资           | 4,014,622,559.76 |
| 其中:债券投资           | 4,014,622,559.76 |                  |
| 资产支持证券            | -                |                  |
| 2                 | 买入返售金融资产         | -                |
| 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     | 2,761,460,910.76 |
| 4                 | 其他资产             | 79,049,021.17    |
| 5                 | 合计               | 6,855,132,091.00 |

注:本基金在货币市场类资产中的配置比例是本基金所选择的收益率曲线策略在所选品种中的具体体现。本基金管理人已按照基金合同的规定,将定期披露货币市场类资产的配置比例,并根据实际情况进行调整。投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202002

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00

投资目标 在充分考虑安全性前提下,追求货币市场类资产的绝对收益。

投资策略 考虑对宏观经济和货币走势的分析,本基金管理人将定期利差预测模型、期限结构预测模型、流动性预测模型等,判断不同期限的货币类资产的预期收益、风险和流动性的变化趋势,通过综合运用久期策略、期限结构策略、流动性策略等,在货币市场类资产中进行资产配置。

风险收益特征 本基金属于货币市场的低风险品种,但并不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理未对本基金进行评级。

基金名称 中海货币

基金代码 202001

交易代码 202001

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

基金合同生效日 2010年7月20日

报告期末基金份额总额 5,967,106,744.00