

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:2016年3月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会在报告期间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和连带的法律责任。基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的财产。基金管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金合同由基金管理人和基金托管人订立，经国务院证券监督管理机构备案后生效。基金合同是规定基金当事人之间权利义务的基本法律文件，其他与本基金相关的协议、文件不得与基金合同的内容相冲突，因其他与本基金相关的协议、文件而产生的对基金合同的任何修改、变更或补充，均以在国务院证券监督管理机构备案的基金合同为准。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人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。

本基金合同自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

基金名称 中海货币A

基金代码 302001

基金运作方式 灵活配置开放式

基金合同生效日 2010年1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 6,957,108,442.00份

报告期末基金份额总额 6,957,108,442.00份

基金合同的延续期 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： 302001 392002

报告期末下属分级基金的份额总额 3,008,676,104.64份 5,648,432,639.64份

2.2 基金产品说明

在保证资金安全、资产流动性前提下，追求高于业绩比较基准的收益率，为基金份额持有人创造价值的定期理财。

4.1 利率预测策略

根据宏观经济和利率走势的分析，本基金将制定定期预测策略，如预测利率下降，将增加组合比例；反之，则降低组合的久期。

2.3 阶段性配置策略

各类资产在市场结构中的定位是本基金选择的收益率曲线策略的资产配置组合的

具体体现，本基金采用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.类配置策略

根据不同类型收益类金融工具的市场规模、收益性和流动性，决定不同期限类别的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、到期期限调整以及其他措施），保证基金资产的流动性。

5.套利策略

本基金的套利策略主要是利用不同市场、不同时间和不同品种之间的收益率差异，通过买入和卖出的金融产品，获取无风险的利润。

业绩比较基准 同时7天银行存款利率(税后)

风险收益特征 本基金属于货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。

基金经理和基金经理化人员

项目 基金经理人 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 侯晓

信息披露负责人 联系电话 021-38428008 010-66106799

电子邮箱 wling@zifufund.com custody@icbc.com.cn

客户服务电话 400-888-0708,021-38789788 95538

传真 021-69419625 010-66106798

2.4 基金资产估值

基金经理对报告文学管理的代理人互联网网址 www.zifufund.com

基金年度报告置臵地点 上海市浦东新区银城中路6号2906-2908室及30层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1.1 本期利润数据 2015年 2014年 2013年

和折价 1. 中海货币A 中海货币B 中海货币A 中海货币B

本期已实现收益 118,241.51 15,427,881.21 79,406,218.23 10,142,739.07 70,185,789.21

利息收入 0.1036

本期利润 116,990,396.00 15,427,881.21 79,406,218.23 10,142,739.07 70,185,789.21

利息收入 0.1036

本期净收益 3,999.00 1,000.00 1,0000 1,0000 1,0000

和折价 4.2761% 4.2620% 5.0726% 3.8570% 4.1074%

3.1.2 末期数据 2015年末 2014年末 2013年末

期初基金资产 306,676,564.32 289,299,296,653.00 235,006,1,493,556.00

净值 104.64 93.007 91.96 97.65 92.05

期末基金份额 1,0000 1,0000 1,0000 1,0000 1,0000

和折价 4.2761% 4.2620% 5.0726% 3.8570% 4.1074%

注:本基金于2010年1月20日开始生效。

注:本期实现收益扣除非经常性损益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额,本期利润即为本期的可供分配利润。

注:本基金按摊余成本法核算。

注:本基金的期末可供分配利润,为资产负债表中未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润的孰小值,即:当期末未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润孰小者。

3.2 基金份额净值收益率及其与同期业绩基准收益率的比较

中海货币A

阶段 份额净值收益 累计份额净值 收益率比较基准 收益率比较基准收益 率差额(%) 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0760% 0.0069% 0.3216% 0.0000% 0.3844% 0.0009%

过去六个月 1.4213% 0.0073% 0.6453% 0.0000% 0.7760% 0.0007%

过去一年 3.9999% 0.0120% 1.2893% 0.0000% 2.7116% 0.0129%

过去三年 13.2179% 0.0100% 3.9672% 0.0000% 9.2508% 0.0109%

过去五年 22.1104% 0.0091% 6.9826% 0.0002% 16.1278% 0.0099%

自基金合同生效日至如今 22.0750% 0.0089% 7.6124% 0.0002% 16.3626% 0.0088%

注:本基金于2010年1月20日开始生效。

注:本期实现收益扣除非经常性损益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额,本期利润即为本期的可供分配利润。

注:本基金按摊余成本法核算。

注:本基金的期末可供分配利润,为资产负债表中未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润的孰小值,即:当期末未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润孰小者。

3.2.1 与同期业绩基准收益率的比较

中海货币A

阶段 份额净值收益 累计份额净值 收益率比较基准 收益率比较基准收益 率差额(%) 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07672% 0.0069% 0.3216% 0.0000% 0.3844% 0.0009%

过去六个月 1.4261% 0.0073% 0.6453% 0.0000% 0.7760% 0.0007%

过去一年 3.9999% 0.0120% 1.2893% 0.0000% 2.7116% 0.0129%

过去三年 13.2179% 0.0100% 3.9672% 0.0000% 9.2508% 0.0109%

过去五年 22.1104% 0.0091% 6.9826% 0.0002% 16.1278% 0.0099%

自基金合同生效日至如今 22.0750% 0.0089% 7.6124% 0.0002% 16.3626% 0.0088%

注:本基金于2010年1月20日开始生效。

注:本期实现收益扣除非经常性损益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额,本期利润即为本期的可供分配利润。

注:本基金按摊余成本法核算。

注:本基金的期末可供分配利润,为资产负债表中未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润的孰小值,即:当期末未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润孰小者。

3.2.2 过去五周净值增长率及其与同期业绩基准收益率的比较

中海货币B

阶段 份额净值收益 累计份额净值 收益率比较基准 收益率比较基准收益 率差额(%) 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07672% 0.0069% 0.3216% 0.0000% 0.3844% 0.0009%

过去六个月 1.4261% 0.0073% 0.6453% 0.0000% 0.7760% 0.0007%

过去一年 3.9999% 0.0120% 1.2893% 0.0000% 2.7116% 0.0129%

过去三年 13.2179% 0.0100% 3.9672% 0.0000% 9.2508% 0.0109%

过去五年 22.1104% 0.0091% 6.9826% 0.0002% 16.1278% 0.0099%

自基金合同生效日至如今 22.0750% 0.0089% 7.6124% 0.0002% 16.3626% 0.0088%

注:本基金于2010年1月20日开始生效。

注:本期实现收益扣除非经常性损益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额,本期利润即为本期的可供分配利润。

注:本基金按摊余成本法核算。

注:本基金的期末可供分配利润,为资产负债表中未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润的孰小值,即:当期末未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润孰小者。

3.2.3 过去五周净值增长率及其与同期业绩基准收益率的比较

中海货币B

阶段 份额净值收益 累计份额净值 收益率比较基准 收益率比较基准收益 率差额(%) 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.07672% 0.0069% 0.3216% 0.0000% 0.3844% 0.0009%

过去六个月 1.4261% 0.0073% 0.6453% 0.0000% 0.7760% 0.0007%

过去一年 3.9999% 0.0120% 1.2893% 0.0000% 2.7116% 0.0129%

过去三年 13.2179% 0.0100% 3.9672% 0.0000% 9.2508% 0.0109%

过去五年 22.1104% 0.0091% 6.9826% 0.0002% 16.1278% 0.0099%

自基金合同生效日至如今 22.0750% 0.0089% 7.6124% 0.0002% 16.3626% 0.0088%

注:本基金于2010年1月20日开始生效。

注:本期实现收益扣除非经常性损益、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额,本期利润即为本期的可供分配利润。

注:本基金按摊余成本法核算。

注:本基金的期末可供分配利润,为资产负债表中未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润的孰小值,即:当期末未分配利润与未分配利润中表述的可供分配利润孰小者。

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B

年度 已按季披露部分 转卖现金部分 直接通过应付 应付利息部分 年度利润部分 备注

2015年 16,890,396.00 - - -