

报告期内投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	148
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

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。

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
----	--------	-----------------	-----------------

1.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	---------	------	--------------

6	0415540Z7	15年度 CP001	1,400,000	140,716,943.78	2.36
		15年度 化学工業			

7	041555007	FORN EX. CP001	1,400,000	140,338,234.23	2.36
		15,000,000			

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2389%
------------------------	---------

4.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

项目	名称	金额
----	----	----

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	

投资组合报告附注的其他文字描述部分

§ 9 基金份额持有人信息

合计	13,772	432,552.19	5,576,227,604.57	93.61%	380,881,139.71	6.39%
----	--------	------------	------------------	--------	----------------	-------

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本	中海货币A	1,019,938.52	0.3304%

§ 10 开放式基金份额变动

	中海货币A	中海货币B
--	-------	-------

本报告期内,托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

4. 报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

[illegible]

申万宏源	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注1:本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准,具体评分指标分为研究支持和服务支持,研究支持包括券商研究报告质

				比例		例
922,800.						

甲力宏源	-	-	000.00	100.00%	-	-
------	---	---	--------	---------	---	---

注:本基金本报告期偏离度绝对值未超过0.5%。