

基金管理人:中海基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年八月二十六日

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。

中海货币市场证券投资基金
2011 半年度 报告摘要
2011年6月30日

Table with 2 columns: 基金简称 (中海货币), 基金代码 (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 (中海基金管理股份有限公司), 基金托管人 (中国工商银行股份有限公司).

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, 2.期限结构配置策略, 3.类属配置策略, 4.流动性管理策略, 5.套利策略。

Table with 3 columns: 项目, 基金管理人 (中海基金管理股份有限公司), 基金托管人 (中国工商银行股份有限公司).

3.主要财务数据和财务指标

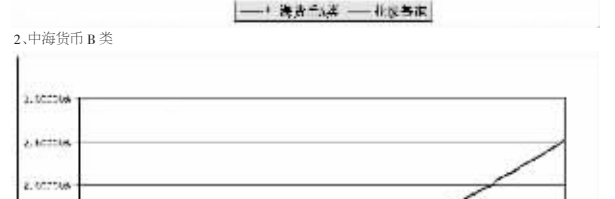
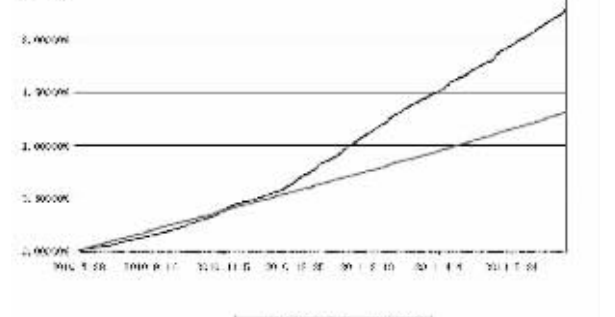
Table with 2 columns: 3.1 主要财务数据和财务指标, 3.2 基金份额净值表现. Includes data for 2011年1月1日至2011年6月30日.

注:1.本基金合同于2010年7月28日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。
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。

Table with 4 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 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.

Table with 4 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 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.

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2011年6月30日。
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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



注:1.本基金合同生效日为2010年7月28日,至报告期末不满一年。
注:2.根据法律法规及基金合同约定,本基金建仓期为自基金合同生效日起六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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,始终坚守“诚实守信、勤勉尽责”的原则,严格履行基金管理人的职责和义务。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介
姓名: 江小薇, 职务: 基金经理, 任本基金基金经理(助理)期限: 2010-07-28, 证券从业年限: 13.

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理(助理)期限, 证券从业年限, 说明.

注:本基金合同生效日为2010年7月28日,无去年同期比较数据,下同。
6.3 所有者权益(基金净值)变动表
基金管理人:中海货币市场证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

中海货币市场证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

注:1.上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。
2.2 基金合同生效以来基金资产净值(或基金份额)增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with 4 columns: 项目, 本期 (2011年1月1日至2011年6月30日), 上期可比期间 (2010年1月1日至2010年6月30日), 所有者权益合计.

注:1.上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。
2.2 基金合同生效以来基金资产净值(或基金份额)增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

4.3 管理人对外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
为进一步加强公平交易管理,防范和杜绝不公平交易行为,保护基金份额持有人的合法权益,公司建立了有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.4 基金管理人对外报告期内严格遵守相关法律法规、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。

4.5 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2011年上半年,在持续的货币紧缩下,市场资金面开始由极度宽松走向适当宽松;而在不断创出新高

4.5.2 报告期内基金业绩表现说明
截至2011年6月30日,本基金A类每万份收益2.9653元,7日年化收益率4.401%,报告期内本基金A类净值收益率为1.5753%,高于业绩比较基准0.8611个百分点;本基金B类每万份收益3.0314元,7日年化收益率4.6639%,报告期内本基金B类净值收益率为1.6968%,高于业绩比较基准0.9826个百分点。

4.6 管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人严格按照新准则、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。

4.7 基金管理人对外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金额分配给基金份额持有人。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况
2011年上半年,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,安全、完整、及时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
2011年上半年,中海货币市场证券投资基金的托管人——中海基金管理股份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,严格遵照《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基金财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对中海基金管理股份有限公司编制和披露的《中海货币市场证券投资基金2011年半年度报告》中财务数据、利润分配情况、财务会计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
资产总计: 2,121,005,852.93
负债和所有者权益总计: 2,121,005,852.93

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期 (2011年6月30日), 上年度末 (2010年12月31日).

注:1.本基金合同生效日为2010年7月28日,至报告期末不满一年。
注:2.根据法律法规及基金合同约定,本基金建仓期为自基金合同生效日起六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

6.2 利润表
资产总计: 2,121,005,852.93
负债和所有者权益总计: 2,121,005,852.93

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期 (2011年1月1日至2011年6月30日), 上期可比期间 (2010年1月1日至2010年6月30日).

注:1.本基金合同生效日为2010年7月28日,至报告期末不满一年。
注:2.根据法律法规及基金合同约定,本基金建仓期为自基金合同生效日起六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
基金管理人:中海货币市场证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期 (2011年1月1日至2011年6月30日), 上期可比期间 (2010年1月1日至2010年6月30日).

注:1.本基金合同生效日为2010年7月28日,无去年同期比较数据,下同。
6.3 所有者权益(基金净值)变动表
基金管理人:中海货币市场证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

6.4 所有者权益(基金净值)变动表
基金管理人:中海货币市场证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

6.5 所有者权益(基金净值)变动表
基金管理人:中海货币市场证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

6.6 所有者权益(基金净值)变动表
基金管理人:中海货币市场证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

6.7 所有者权益(基金净值)变动表
基金管理人:中海货币市场证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

6.8 所有者权益(基金净值)变动表
基金管理人:中海货币市场证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%).

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%).

注:报告期内申购的资金余额占基金资产净值的20%的说明
在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额超过资产净值的20%。

7.4 基金投资组合平均剩余期限
7.4.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with 2 columns: 项目, 天数.

7.4.2 投资组合平均剩余期限分布比例
7.4.3 投资组合平均剩余期限分布比例

Table with 4 columns: 序号, 平均剩余期限, 占基金资产净值的比例(%), 占基金总资产的比例(%).

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
7.5.1 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本, 占基金资产净值比例(%).

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 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(%).

7.7 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况.

7.8 报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数
7.9 报告期内偏离度的最高值
7.10 报告期内偏离度的最低值

7.11 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值
7.12 报告期内每个交易日基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.13 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.14 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.15 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.16 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.17 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.18 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.19 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.20 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.21 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.22 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.23 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.24 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.25 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.26 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.27 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.28 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.29 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.30 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.31 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.32 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.33 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.34 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.35 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.36 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.37 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.38 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.39 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.40 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.41 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.42 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.43 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.44 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.45 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.46 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.47 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.48 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.49 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.50 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.51 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.52 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.53 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
7.54 报告期内基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细