

2012年3月31日

合计	109.92	10.72
----	--------	-------

2012年3月31日

图 1 基金自成立以来的基金份额净值走势

注：本基金自 2013 年 9 月 1 日起实施新的估值程序，估值程序变更前后基金份额净值连续。

资料来源：基金管理人，数据截至 2013 年 9 月 1 日。

注：本基金自 2013 年 9 月 1 日起实施新的估值程序，估值程序变更前后基金份额净值连续。

资料来源：基金管理人，数据截至 2013 年 9 月 1 日。

注：本基金自 2013 年 9 月 1 日起实施新的估值程序，估值程序变更前后基金份额净值连续。

资料来源：基金管理人，数据截至 2013 年 9 月 1 日。

注：本基金自 2013 年 9 月 1 日起实施新的估值程序，估值程序变更前后基金份额净值连续。

资料来源：基金管理人，数据截至 2013 年 9 月 1 日。

注：本基金自 2013 年 9 月 1 日起实施新的估值程序，估值程序变更前后基金份额净值连续。

资料来源：基金管理人，数据截至 2013 年 9 月 1 日。

注：本基金自 2013 年 9 月 1 日起实施新的估值程序，估值程序变更前后基金份额净值连续。

资料来源：基金管理人，数据截至 2013 年 9 月 1 日。

注：本基金自 2013 年 9 月 1 日起实施新的估值程序，估值程序变更前后基金份额净值连续。

资料来源：基金管理人，数据截至 2013 年 9 月 1 日。

其中:封闭式固定收益资产			
1. 项目	金额		占基金资产净值的比例 (%)
2. 报告期末未赎回的固定收益余额	123,499,494.75		10.72
其中:封闭式固定收益资产	-		-
(3)报告期内封闭式固定收益资产余额占基金资产净值的比例及报告期内每期末交易日封闭式资产占资产净值的简单平均值 报告期内,本基金余额超过基金资产净值的20%的说明 报告期内,本基金未持有封闭式基金资产,因此期间的资金余额未超过资产净值的20%。 3. 基金投资组合平均剩余期限			
3.1 投资组合平均剩余期限的基本信息	项目	天数	
期末投资组合平均剩余期限		86	
期内投资组合平均剩余期限最高值		108	
期内投资组合平均剩余期限最低值		49	
(4)报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明 报告期内,本基金未持有投资组合平均剩余期限超过180天的情况。 3. 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。下列: 3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例			
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	30 天以内	17.85	10.72
2	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	30 天 < 60 天	55.54	-
4	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	60 天 < 90 天	7.85	-
6	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.75	-
7	90 天 < 180 天	8.70	-
8	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
9	180 天 < 397 天	19.99	-
10	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		109.92	10.72

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	14,853,646.64
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	233,319.87
7	其他	-
8	合计	15,086,966.51

5.8.5 投资银行帮君附注的其他文本描述部分
 本基金由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金业绩变动

项目	中海货币A类	中海货币B类	单位(元)
报告期期初基金份额总额	504,680,920.97	775,774,938.13	
报告期期间基金总申购份额	2,142,680,576.64	1,289,711,285.13	
报告期期间基金总赎回份额	2,177,089,969.59	1,383,369,750.75	
报告期期末基金份额总额	470,271,522.02	682,116,472.51	

§7 筹备文件目录

1. 中国证监会批准募集中海货币市场证券投资基金的文件
2. 中海货币市场证券投资基金合同
3. 中海货币市场证券投资基金托管协议
4. 中海货币市场证券投资基金财务报表及报表附注
5. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告
6. 办公地址
 上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
7. 联系方式
 投资者对本报告有任何疑问,可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。
 咨询电话: 021 38879788或400-888-9788
 公司网址: <http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司
 二〇一二年四月二十日
