

# 中海货币市场证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 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

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日至 6 月 30 日。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                        | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                 | 2         |
| 1.2 目录                                   | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                           | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                               | 5         |
| 2.2 基金产品说明                               | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                          | 6         |
| 2.4 信息披露方式                               | 6         |
| 2.5 其他相关资料                               | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                          | 6         |
| 3.2 基金净值表现                               | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b>                          | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                         | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明               | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                  | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明              | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望              | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                 | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                  | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明        | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b>                          | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                   | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  | 12        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                                | 13        |
| 6.2 利润表                                  | 14        |
| 6.3 净资产变动表                               | 15        |
| 6.4 报表附注                                 | 18        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                         | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                           | 38        |
| 7.2 债券回购融资情况                             | 38        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                         | 39        |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明          | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                     | 40        |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 40        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....                | 41        |
| 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资<br>明细 ..... | 41        |
| 7.9 投资组合报告附注 .....                                      | 41        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                               | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                             | 42        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                            | 42        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                          | 43        |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....                  | 43        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                               | <b>43</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                                 | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                                  | 43        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....                  | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                       | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                                    | 44        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                             | 44        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....                     | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                            | 44        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                             | 45        |
| 10.9 其他重大事件 .....                                       | 45        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                         | <b>46</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....                | 46        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                               | 47        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                                 | <b>47</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                                       | 47        |
| 12.2 存放地点 .....   | 47        |
| 12.3 查阅方式 .....   | 47        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 中海货币市场证券投资基金       |                    |
| 基金简称            | 中海货币               |                    |
| 基金主代码           | 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       |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 2,462,579,500.80 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 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     | 392001             | 392002             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 180,895,511.74 份   | 2,281,683,989.06 份 |

### 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   | <p>1、利率预期策略</p> <p>根据对宏观经济和利率走势的分析，本基金将制定利率预期策略。如果预期利率下降，将增加组合的久期；反之，如果预期利率将上升，则缩短组合的久期。</p> <p>2、期限结构配置策略</p> <p>各类债券资产在期限结构上的配置是本基金所选择的收益率曲线策略在资产配置过程中的具体体现，本基金采用总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。</p> <p>3、类属配置策略</p> <p>根据各类短期固定收益类金融工具的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。</p> <p>4、流动性管理策略</p> <p>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、剩余期限管理或以其他措施），保证基金资产的高流动性。</p> <p>5、套利策略</p> <p>本基金的套利策略主要是利用不同市场、不同期限和不同品种之间的收益率差异，通过融入和融出的资金安排，获取无风险的利差收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 同期 7 天通知存款利率（税后）   |

|        |   |
|--------|---|
| 风险收益特征 | 本基金属货币市场证券投资基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |
|--------|---|

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          | 基金管理人                                    | 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          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                                       | 黄乐军                   |
|             | 联系电话                                     | 021-38429808          |
|             | 电子邮箱                                     | huanglejun@zhfund.com |
| 客户服务电话      | 400-888-9788、021-38789788                | 95588                 |
| 传真          | 021-68419525                             | 010-66105798          |
| 注册地址        | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号     |
| 办公地址        | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层       | 北京市西城区复兴门内大街 55 号     |
| 邮政编码        | 200120                                   | 100140                |
| 法定代表人       | 曾杰                                       | 廖林                    |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                                    |
|---------------------|------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报                              |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.zhfund.com                     |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                               |
|--------|------------|------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中海基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据<br>和指标 | 报告期(2024年1月1日-2024年6月30日) |               |
|-------------------|---------------------------|---------------|
|                   | 中海货币 A                    | 中海货币 B        |
| 本期已实现收益           | 1,466,482.73              | 27,675,422.10 |
| 本期利润              | 1,466,482.73              | 27,675,422.10 |
| 本期净值收益率           | 0.7484%                   | 0.8689%       |
| 3.1.2 期末数据        | 报告期末(2024年6月30日)          |               |

|              |                  |                  |
|--------------|------------------|------------------|
| 和指标          |                  |                  |
| 期末基金资产净值     | 180,895,511.74   | 2,281,683,989.06 |
| 期末基金份额净值     | 1.00             | 1.00             |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) |                  |
| 累计净值收益率      | 49.1109%         | 54.2235%         |

注：1、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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中海货币 A

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一个月      | 0.1049%  | 0.0005%     | 0.0944%    | 0.0000%       | 0.0105%  | 0.0005% |
| 过去三个月      | 0.3426%  | 0.0010%     | 0.2870%    | 0.0000%       | 0.0556%  | 0.0010% |
| 过去六个月      | 0.7484%  | 0.0011%     | 0.5756%    | 0.0000%       | 0.1728%  | 0.0011% |
| 过去一年       | 1.5934%  | 0.0020%     | 1.1643%    | 0.0000%       | 0.4291%  | 0.0020% |
| 过去三年       | 4.8745%  | 0.0030%     | 3.5695%    | 0.0000%       | 1.3050%  | 0.0030% |
| 自基金合同生效起至今 | 49.1109% | 0.0068%     | 19.2524%   | 0.0001%       | 29.8585% | 0.0067% |

中海货币 B

| 阶段 | 份额净 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①—③ | ②—④ |
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|

|                | 值收益<br>率①    | 收益率标<br>准差② | 准收益率③    | 收益率标准差<br>④ |              |             |
|----------------|--------------|-------------|----------|-------------|--------------|-------------|
| 过去一个月          | 0.1247%      | 0.0005%     | 0.0944%  | 0.0000%     | 0.0303<br>%  | 0.0005<br>% |
| 过去三个月          | 0.4025%      | 0.0010%     | 0.2870%  | 0.0000%     | 0.1155<br>%  | 0.0010<br>% |
| 过去六个月          | 0.8689%      | 0.0011%     | 0.5756%  | 0.0000%     | 0.2933<br>%  | 0.0011<br>% |
| 过去一年           | 1.8380%      | 0.0020%     | 1.1643%  | 0.0000%     | 0.6737<br>%  | 0.0020<br>% |
| 过去三年           | 5.6327%      | 0.0030%     | 3.5695%  | 0.0000%     | 2.0632<br>%  | 0.0030<br>% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 54.2235<br>% | 0.0068%     | 19.2524% | 0.0001%     | 34.971<br>1% | 0.0067<br>% |

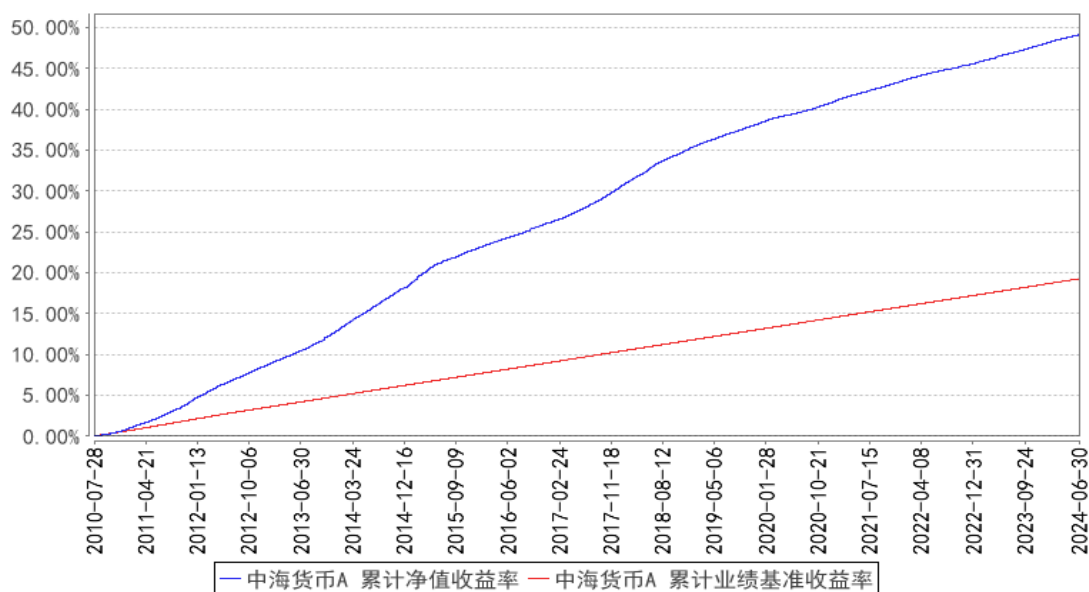
注：1：“自基金合同生效起至今”指 2010 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日。

2：本基金业绩比较基准：同期 7 天通知存款利率（税后）。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期 7 天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

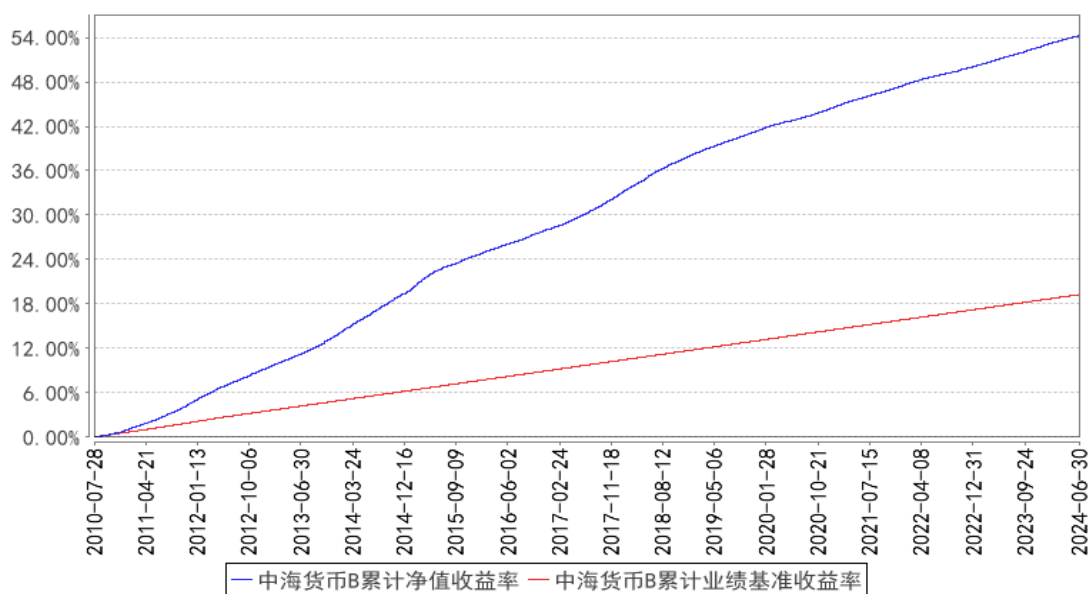


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中海货币A 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中海货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2024 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 33 只。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                          | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|-----------------------------|-----------------|------|--------|--|
|     |                             | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 王萍莉 | 本基金基金经理、中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理 | 2019年2月19日      | -    | 9年     | 王萍莉女士，上海交通大学金融专业硕士。历任中海基金管理有限公司助理债券研究员、债券分析师，兴证证券资产管理有限公司固定收益部研究员、投资主办助理。2018年9月进入本公司工作，现任基金经理。2019年2月至今任中海货币市场证券投资基金基金经理，2020年8月至今任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理。 |
| 赵雨濛 | 本基金基金经理                     | 2022年9月30日      | -    | 8年     | 赵雨濛女士，上海财经大学教育经济与管理学硕士。历任交银施罗德基金管理有限公司机构业务助理、光大保德信基金管理有限公司债券交易员、投资经理助理、投资经理助理兼研究员。2021年9月进入本公司工作，曾任基金经理助理，现任基金经理。2022年9月至今任中海货币市场证券投资基金基金经理。             |

注：1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2：证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3：赵雨濛女士因个人原因（休产假）暂停履行职务，本公司根据有关法规和公司制度批准赵雨濛女士自2024年5月6日开始休产假。在休假期间，赵雨濛女士所管理的中海货币市场证券投资基金由该基金另一名基金经理王萍莉女士继续管理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《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的行为。

#### 4.3 管理人对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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，

使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，公司均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场资金面总体维持平稳，市场资金利率围绕 7 天公开市场操作利率波动。资金价格方面，一季度在内外均衡和防空转诉求下，DR007 和 R007 均值分别为 1.87% 和 2.13%。4 月以来，监管机构对资金套利和空转、银行手工补息等现象加大监管，使得此前虚增的、低贷高存的、不规范的存款减少，部分真实存款需求在进行收益比价之后投资于银行理财；由于债券静态收益偏低，杠杆策略能增厚的收益大幅压缩，非银主动降杠杆，资金分层局面大幅缓解，DR007 均值为 1.87%，与一季度持平；R007 均值下降 19bp 至 1.94%。资产荒推动下存单供不应求，1 年期 AAA 存单收益率下行至 2% 以下。

投资操作方面，本基金上半年以流动性管理为主，在操作上，各资产比例严格按照法规要求，未出现流动性风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金 A 类净值增长率为 0.7484%，高于业绩比较基准 0.1728 个百分点；B 类净值增长率为 0.8689%，高于业绩比较基准 0.2933 个百分点。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着美国经济高频数据特别是通胀和就业数据走软，美联储三季度降息落地的

概率很高，意味着国内降准降息面临的外部掣肘降低。7 月国内降息落地后，预计后续仍有降准降息空间。国内经济来看，随着特别国债和地方债券发行提速，财政政策加力提效，有望提升基建投资，但从金融数据等前瞻指标来看，经济复苏力度依旧偏弱。当前资金、存单和债券之间的期限利差被极限压缩，8 月、9 月随着地方政府债券供给放量，资金面短期波动可能引发存单等资产的收益率低位调整，届时将出现较好的配置机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风险控制总监、合规管理负责人、基金会计负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值委员会会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供证券交易所及银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对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全额分配给基金份额持有人。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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，完全尽职尽责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

本报告期内，本基金的管理人——中海基金管理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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合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

会计主体：中海货币市场证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                        |                          |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 585,973,964.06         | 615,226,376.11           |
| 结算备付金         |            | -                      | -                        |
| 存出保证金         |            | -                      | -                        |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 988,816,520.18         | 2,682,586,173.45         |
| 其中：股票投资       |            | -                      | -                        |
| 基金投资          |            | -                      | -                        |
| 债券投资          |            | 988,816,520.18         | 2,682,586,173.45         |
| 资产支持证券投资      |            | -                      | -                        |
| 贵金属投资         |            | -                      | -                        |
| 其他投资          |            | -                      | -                        |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | 627,016,857.82         | 2,040,513,968.78         |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                      | -                        |
| 其中：债券投资       |            | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资      |            | -                      | -                        |
| 其他投资          |            | -                      | -                        |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                      | -                        |
| 应收清算款         |            | -                      | -                        |
| 应收股利          |            | -                      | -                        |
| 应收申购款         |            | 261,739,472.00         | 35,809,879.43            |
| 递延所得税资产       |            | -                      | -                        |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                      | -                        |
| 资产总计          |            | 2,463,546,814.06       | 5,374,136,397.77         |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>             | <b>上年度末</b>              |

|               |          | 2024 年 6 月 30 日  | 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| <b>负 债：</b>   |          |                  |                  |
| 短期借款          |          | -                | -                |
| 交易性金融负债       |          | -                | -                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3  | -                | -                |
| 卖出回购金融资产款     |          | -                | -                |
| 应付清算款         |          | -                | -                |
| 应付赎回款         |          | 99.99            | 11,468.02        |
| 应付管理人报酬       |          | 633,596.86       | 612,704.62       |
| 应付托管费         |          | 95,999.54        | 92,834.02        |
| 应付销售服务费       |          | 55,819.77        | 63,653.81        |
| 应付投资顾问费       |          | -                | -                |
| 应交税费          |          | 4,575.70         | 669.72           |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.9  | 177,221.40       | 255,282.35       |
| 负债合计          |          | 967,313.26       | 1,036,612.54     |
| <b>净 资 产：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.10 | 2,462,579,500.80 | 5,373,099,785.23 |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11 | -                | -                |
| 未分配利润         | 6.4.7.12 | -                | -                |
| 净资产合计         |          | 2,462,579,500.80 | 5,373,099,785.23 |
| 负债和净资产总计      |          | 2,463,546,814.06 | 5,374,136,397.77 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，中海货币 A 基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 180,895,511.74 份；中海货币 B 基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 2,281,683,989.06 份。中海货币基金份额总额合计为 2,462,579,500.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海货币市场证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目            | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b> |          | 36,140,860.29                            | 16,679,676.70                                 |
| 1. 利息收入        |          | 18,026,586.25                            | 8,140,380.09                                  |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.13 | 5,709,240.90                             | 2,243,476.57                                  |
| 债券利息收入         |          | -  | -   |
| 资产支持证券利息收入     |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入     |          | 12,317,345.35                            | 5,896,903.52                                  |

|                                 |            |               |               |
|---------------------------------|------------|---------------|---------------|
| 其他利息收入                          |            | -             | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）               |            | 18,114,274.04 | 8,539,296.61  |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.14   | -             | -             |
| 基金投资收益                          |            | -             | -             |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.15   | 18,114,274.04 | 8,539,296.61  |
| 资产支持证券投资<br>收益                  | 6.4.7.16   | -             | -             |
| 贵金属投资收益                         | 6.4.7.17   | -             | -             |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.18   | -             | -             |
| 股利收益                            | 6.4.7.19   | -             | -             |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>收益   |            | -             | -             |
| 其他投资收益                          |            | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）      | 6.4.7.20   | -             | -             |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）          |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）          | 6.4.7.21   | -             | -             |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 6,998,955.46  | 3,515,910.77  |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 5,565,173.30  | 2,442,161.73  |
| 其中：暂估管理人报酬                      |            | -             | -             |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 843,208.11    | 566,412.23    |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | 402,585.91    | 337,514.58    |
| 4. 投资顾问费                        |            | -             | -             |
| 5. 利息支出                         |            | 44,308.53     | 34,550.49     |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |            | 44,308.53     | 34,550.49     |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.22   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                        |            | 1,613.28      | 1,451.03      |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.23   | 142,066.33    | 133,820.71    |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |            | 29,141,904.83 | 13,163,765.93 |
| 减：所得税费用                         |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |            | 29,141,904.83 | 13,163,765.93 |
| <b>五、其他综合收益的税后<br/>净额</b>       |            | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | 29,141,904.83 | 13,163,765.93 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中海货币市场证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |        |                |                        |
|--|---------------------------------------|--------|----------------|------------------------|
|  | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计                  |
| 一、上期期末净资产                                | 5,373,099,785.<br>23                  | -      | -              | 5,373,099,785.2<br>3   |
| 加：会计政策变更                                 | -                                     | -      | -              | -                      |
| 前期差错更正                                   | -                                     | -      | -              | -                      |
| 其他                                       | -                                     | -      | -              | -                      |
| 二、本期期初净资产                                | 5,373,099,785.<br>23                  | -      | -              | 5,373,099,785.2<br>3   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -2,910,520,284<br>.43                 | -      | -              | -2,910,520,284.<br>43  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                     | -      | 29,141,904.83  | 29,141,904.83          |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -2,910,520,284<br>.43                 | -      | -              | -2,910,520,284.<br>43  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 15,501,948,209<br>.20                 | -      | -              | 15,501,948,209.<br>20  |
| 2. 基金赎回款                                 | -18,412,468,49<br>3.63                | -      | -              | -18,412,468,493<br>.63 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                     | -      | -29,141,904.83 | -29,141,904.83         |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                     | -      | -              | -                      |
| 四、本期期末净资产                                | 2,462,579,500.                        | -      | -              | 2,462,579,500.8        |



|  | 80   |        |                | 0                 |
|--|--|--------|----------------|-------------------|
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |        |                |                   |
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 3,176,873,251.02                           | -      | -              | 3,176,873,251.02  |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -              | -                 |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -              | -                 |
| 其他                                       | -  | -      | -              | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 3,176,873,251.02                           | -      | -              | 3,176,873,251.02  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -1,646,706,425.25                          | -      | -              | -1,646,706,425.25 |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | 13,163,765.93  | 13,163,765.93     |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -1,646,706,425.25                          | -      | -              | -1,646,706,425.25 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 5,688,170,153.16                           | -      | -              | 5,688,170,153.16  |
| 2. 基金赎回款                                 | -7,334,876,578.41                          | -      | -              | -7,334,876,578.41 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -  | -      | -13,163,765.93 | -13,163,765.93    |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -  | -      | -              | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 1,530,166,825.77                           | -      | -              | 1,530,166,825.77  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>曾杰</u> | <u>李俊</u> | <u>周琳</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中海货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定,经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]872号《关于核准中海货币市场证券投资基金募集的批复》核准募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人和注册登记机构均为中海基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司;有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于2010年7月28日生效,该日的基金份额总额为2,958,869,207.75份,其中A类基金份额总额784,590,763.21份,B类基金份额总额2,174,278,444.54份,经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公W[2010]B076号验资报告予以验证。

本基金的投资范围包括现金、期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:同期7天通知存款利率(税后)。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计

税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 131,424.13             |
| 等于：本金          | 131,199.00             |
| 加：应计利息         | 225.13                 |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | 585,842,539.93         |
| 等于：本金          | 584,000,000.00         |
| 加：应计利息         | 1,842,539.93           |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 194,137,627.79         |
| 存款期限 1-3 个月    | 130,342,541.92         |

|             |                |
|-------------|----------------|
| 存款期限 3 个月以上 | 261,362,370.22 |
| 其他存款        | -              |
| 等于：本金       | -              |
| 加：应计利息      | -              |
| 减：坏账准备      | -              |
| 合计          | 585,973,964.06 |

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |                |            |            |
|--------|-------|------------------------|----------------|------------|------------|
|        |       | 按实际利率计算的<br>账面价值       | 影子定价           | 偏离金额       | 偏离度<br>(%) |
| 债券     | 交易所市场 | -                      | -              | -          | -          |
|        | 银行间市场 | 988,816,520.18         | 989,168,103.78 | 351,583.60 | 0.0143     |
|        | 合计    | 988,816,520.18         | 989,168,103.78 | 351,583.60 | 0.0143     |
| 资产支持证券 |       | -                      | -              | -          | -          |
| 合计     |       | 988,816,520.18         | 989,168,103.78 | 351,583.60 | 0.0143     |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金在本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金在本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                      | -         |
| 银行间市场 | 627,016,857.82         | -         |
| 合计    | 627,016,857.82         | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金在本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金在本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金在本报告期无债权投资，不需计提减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金在本报告期末无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金在本报告期无其他债权投资，不需计提减值准备。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 0.01              |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 73,439.73         |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | 73,439.73         |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 103,781.66        |
| 合计          | 177,221.40        |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 中海货币 A

| 项目             | 本期                              |                 |
|----------------|---------------------------------|-----------------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                 |
|                | 基金份额 (份)                        | 账面金额            |
| 上年度末           | 237,816,584.11                  | 237,816,584.11  |
| 本期申购           | 153,011,835.76                  | 153,011,835.76  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -209,932,908.13                 | -209,932,908.13 |
| 基金拆分/份额折算前     | -                               | -               |
| 基金拆分/份额折算调整    | -                               | -               |
| 本期申购           | -                               | -               |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -                               | -               |
| 本期末            | 180,895,511.74                  | 180,895,511.74  |

## 中海货币 B

| 项目             | 本期                              |                    |
|----------------|---------------------------------|--------------------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                    |
|                | 基金份额 (份)                        | 账面金额               |
| 上年度末           | 5,135,283,201.12                | 5,135,283,201.12   |
| 本期申购           | 15,348,936,373.44               | 15,348,936,373.44  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -18,202,535,585.50              | -18,202,535,585.50 |
| 基金拆分/份额折算前     | -                               | -                  |
| 基金拆分/份额折算调整    | -                               | -                  |
| 本期申购           | -                               | -                  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -                               | -                  |
| 本期末            | 2,281,683,989.06                | 2,281,683,989.06   |

注：其中本期申购包含红利再投、转换入份额，本期赎回包含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金在本报告期无其他综合收益。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 中海货币 A

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 加：会计政策变更       | -             | -     | -             |
| 前期差错更正         | -             | -     | -             |
| 其他             | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 1,466,482.73  | -     | 1,466,482.73  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | -     | -             |
| 其中：基金申购款       | -             | -     | -             |
| 基金赎回款          | -             | -     | -             |
| 本期已分配利润        | -1,466,482.73 | -     | -1,466,482.73 |

| 本期末            | -              | -     | -              |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 中海货币 B         |                |       |                |
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | -              | -     | -              |
| 加：会计政策变更       | -              | -     | -              |
| 前期差错更正         | -              | -     | -              |
| 其他             | -              | -     | -              |
| 本期期初           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 27,675,422.10  | -     | 27,675,422.10  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -     | -              |
| 基金赎回款          | -              | -     | -              |
| 本期已分配利润        | -27,675,422.10 | -     | -27,675,422.10 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 19,869.83            |
| 定期存款利息收入  | 5,689,371.07         |
| 其他存款利息收入  | -                    |
| 结算备付金利息收入 | -                    |
| 其他        | -                    |
| 合计        | 5,709,240.90         |

#### 6.4.7.14 股票投资收益

注：根据基金合同规定，本基金不参与股票投资交易。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                   |
|------------------------------|----------------------|
|                              | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 17,270,675.62        |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 843,598.42           |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                    |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                    |
| 合计                           | 18,114,274.04        |

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元



| 项目                     | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 8,410,990,059.87           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 8,385,483,132.39           |
| 减：应计利息总额               | 24,663,329.06              |
| 减：交易费用                 | -                          |
| 买卖债券差价收入               | 843,598.42                 |

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

注：根据基金合同规定，本基金不参与股票投资交易。

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

注：本基金在本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.21 其他收入

注：本基金在本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金在本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 34,809.32                  |
| 信息披露费   | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行费用    | 28,984.67                  |
| 账户维护费   | 18,600.00                  |
| 合计      | 142,066.33                 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系           |
|--------------------|-------------------|
| 中海基金管理有限公司（“中海基金”） | 基金管理人、注册登记机构、直销机构 |

|                      |               |
|----------------------|---------------|
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人、代销机构    |
| 国联证券股份有限公司（“国联证券”）   | 基金管理人的股东、代销机构 |

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

注：根据基金合同规定，本基金不参与股票投资交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 5,565,173.30               | 2,442,161.73                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 968,685.77                 | 419,414.37                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 4,596,487.53               | 2,022,747.36                    |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----|----------------------------|---------------------------------|
|----|----------------------------|---------------------------------|

|                |            |            |
|----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 843,208.11 | 566,412.23 |
|----------------|------------|------------|

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

2、2023 年 4 月 1 日起托管费率由 0.10%/年调整为 0.05%/年。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |           |            |
|----------------|---------------------------------|-----------|------------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |           |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |           |            |
|                | 中海货币 A                          | 中海货币 B    | 合计         |
| 工商银行           | 64,878.86                       | 316.55    | 65,195.41  |
| 国联证券           | 52.78                           | 0.00      | 52.78      |
| 中海基金           | 15,404.63                       | 60,720.87 | 76,125.50  |
| 合计             | 80,336.27                       | 61,037.42 | 141,373.69 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |           |            |
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |           |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |           |            |
|                | 中海货币 A                          | 中海货币 B    | 合计         |
| 工商银行           | 81,333.99                       | 318.47    | 81,652.46  |
| 国联证券           | 175.09                          | 0.00      | 175.09     |
| 中海基金           | 14,495.68                       | 28,957.51 | 43,453.19  |
| 合计             | 96,004.76                       | 29,275.98 | 125,280.74 |

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%。计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应支付的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

R 为该类基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

中海货币 B

| 关联方名称            | 本期末<br>2024年6月30日 |                                 | 上年度末<br>2023年12月31日 |                                 |
|------------------|-------------------|---------------------------------|---------------------|---------------------------------|
|                  | 持有的<br>基金份额       | 持有的基金份额<br>占基金总份<br>额的比例<br>(%) | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份<br>额的比例<br>(%) |
| 中海恒信资产管理（上海）有限公司 | 28,871,167.59     | 1.2653                          | 30,612,693.78       | 0.5961                          |
| 中海信托股份有限公司       | 171,362,624.66    | 7.5104                          | 120,108,005.77      | 2.3389                          |

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |          |
|-------|----------------------------|-----------|---------------------------------|----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 工商银行  | 131,424.13                 | 19,869.83 | 364,470.10                      | 3,391.88 |

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2024 半年度获得的利息收入为人民币 0.00 元（2023 半年度：人民币 159.93 元），2024 半年末结算备付金余额为人民币 0.00 元（2023 半年末：人民币 0.00 元）。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

单位：人民币元

|        |
|--------|
| 中海货币 A |
|--------|

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计  | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 1,466,482.73     | -                 | -            | 1,466,482.73  | -  |
| 中海货币 B           |                   |              |               |    |
| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计  | 备注 |
| 27,675,422.10    | -                 | -            | 27,675,422.10 | -  |

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：根据基金合同规定，本基金不进行股票投资交易。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金管理有限公司投资决策委员会议事规则》、《中海基金管理有限公司公募基金投资管理团队管理办法》、《中海基金管理有限公司研究部管理办法》、《中海基金管理有限公司基金债券库管理办法》、《中海基金管理有限公司投资组合信用债业务运作管理办法》、《中海基金管理有限公司基金流动性风险及巨额赎回管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理部门、合规管理部门、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人管理的托管户中，其他定期存款存放在具有基金托管资格的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下及长期信用评级在 AA+级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 131,667,598.98    | 452,681,724.94      |
| 合计     | 131,667,598.98    | 452,681,724.94      |

注：本期末按短期信用评级为“未评级”的债券为政策性金融债和短期融资券，上年度末按短期信用评级为“未评级”的债券为国债、政策性金融债和短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 745,924,339.90    | 2,065,147,781.29    |
| 合计     | 745,924,339.90    | 2,065,147,781.29    |

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
|--------|-------------------|---------------------|

|        |                   |                   |
|--------|-------------------|-------------------|
| AAA    | -                 | -                 |
| AAA 以下 | -                 | -                 |
| 未评级    | 111, 224, 581. 30 | 164, 756, 667. 22 |
| 合计     | 111, 224, 581. 30 | 164, 756, 667. 22 |

注：本期末和上年度末按长期信用评级为“未评级”的债券为政策性金融债。

#### 6. 4. 13. 2. 5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6. 4. 13. 2. 6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6. 4. 13. 3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6. 4. 13. 3. 1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6. 4. 13. 3. 2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国家政策性金融债、短期融资券及同业存单等，均在银行间同业市场交易；因此，本报告期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。



### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

下表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年<br>6月30日 | 1个月以内          | 1-3个月          | 3个月-1年         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计             |
|-----------------------|----------------|----------------|----------------|------|------|-----|----------------|
| 资产                    |                |                |                |      |      |     |                |
| 货币资金                  | 395,241,402.20 | 90,432,728.00  | 100,299,833.86 | -    | -    | -   | 585,973,964.06 |
| 交易性金融资产               | 202,014,866.35 | 499,497,318.83 | 287,304,335.00 | -    | -    | -   | 988,816,520.18 |
| 买入返售                  | 627,016,857.82 | -              | -              | -    | -    | -   | 627,016,857.82 |

|         |                  |                |                |   |   |                |                  |
|---------|------------------|----------------|----------------|---|---|----------------|------------------|
| 金融资产    |                  |                |                |   |   |                |                  |
| 应收申购款   | -                | -              | -              | - | - | 261,739,472.00 | 261,739,472.00   |
| 资产总计    | 1,224,273,126.37 | 589,930,046.83 | 387,604,168.86 | - | - | 261,739,472.00 | 2,463,546,814.06 |
| 负债      |                  |                |                |   |   |                |                  |
| 应付赎回款   | -                | -              | -              | - | - | 99.99          | 99.99            |
| 应付管理人报酬 | -                | -              | -              | - | - | 633,596.86     | 633,596.86       |
| 应付托管费   | -                | -              | -              | - | - | 95,999.54      | 95,999.54        |
| 应付销售服务费 | -                | -              | -              | - | - | 55,819.77      | 55,819.77        |
| 应交税费    | -                | -              | -              | - | - | 4,575.70       | 4,575.70         |
| 其他      | -                | -              | -              | - | - | 177,221.40     | 177,221.40       |

|                             |                  |                  |                |      |      |                |                  |
|-----------------------------|------------------|------------------|----------------|------|------|----------------|------------------|
| 负债                          |                  |                  |                |      |      |                |                  |
| 负债总计                        | -                | -                | -              | -    | -    | 967,313.26     | 967,313.26       |
| 利率敏感度缺口                     | 1,224,273,126.37 | 589,930,046.83   | 387,604,168.86 | -    | -    | 260,772,158.74 | 2,462,579,500.80 |
| 上年度末<br>2023年<br>12月<br>31日 | 1个月以内            | 1-3个月            | 3个月-1年         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计               |
| 资产                          |                  |                  |                |      |      |                |                  |
| 货币资金                        | 373,982,365.08   | 150,967,947.16   | 90,276,063.87  | -    | -    | -              | 615,226,376.11   |
| 交易性金融资产                     | 1,513,648,001.63 | 1,168,938,171.82 | -              | -    | -    | -              | 2,682,586,173.45 |
| 买入返售金融资产                    | 2,040,513,968.78 | -                | -              | -    | -    | -              | 2,040,513,968.78 |
| 应                           | -                | -                | -              | -    | -    | 35,809,879.43  | 35,809,879.43    |

|         |                  |                  |               |   |   |               |                  |
|---------|------------------|------------------|---------------|---|---|---------------|------------------|
| 收申购款    |                  |                  |               |   |   |               |                  |
| 资产总计    | 3,928,144,335.49 | 1,319,906,118.98 | 90,276,063.87 | - | - | 35,809,879.43 | 5,374,136,397.77 |
| 负债      |                  |                  |               |   |   |               |                  |
| 应付赎回款   | -                | -                | -             | - | - | 11,468.02     | 11,468.02        |
| 应付管理人报酬 | -                | -                | -             | - | - | 612,704.62    | 612,704.62       |
| 应付托管费   | -                | -                | -             | - | - | 92,834.02     | 92,834.02        |
| 应付销售服务费 | -                | -                | -             | - | - | 63,653.81     | 63,653.81        |
| 应交税费    | -                | -                | -             | - | - | 669.72        | 669.72           |
| 其他负债    | -                | -                | -             | - | - | 255,282.35    | 255,282.35       |
| 负债总计    | -                | -                | -             | - | - | 1,036,612.54  | 1,036,612.54     |

|                             |                  |                  |               |   |   |               |                  |
|-----------------------------|------------------|------------------|---------------|---|---|---------------|------------------|
| 计                           |                  |                  |               |   |   |               |                  |
| 利率<br>敏<br>感<br>度<br>缺<br>口 | 3,928,144,335.49 | 1,319,906,118.98 | 90,276,063.87 | - | - | 34,773,266.89 | 5,373,099,785.23 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本报告期末及上年度末，在“影子定价”机制有效的前提下，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降少量基点，对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于银行间的固定收益品种，其风险为利率风险和信用风险，因此其他市场因素对本基金资产净值不会产生直接影响。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
|               |                   |                     |

|      |                |                  |
|------|----------------|------------------|
| 第一层次 | -              | -                |
| 第二层次 | 988,816,520.18 | 2,682,586,173.45 |
| 第三层次 | -              | -                |
| 合计   | 988,816,520.18 | 2,682,586,173.45 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金在本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                    | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资                | 988,816,520.18   | 40.14         |
|    | 其中：债券                 | 988,816,520.18   | 40.14         |
|    | 资产支持证<br>券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产              | 627,016,857.82   | 25.45         |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                | -             |
| 3  | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 585,973,964.06   | 23.79         |
| 4  | 其他各项资产                | 261,739,472.00   | 10.62         |
| 5  | 合计                    | 2,463,546,814.06 | 100.00        |

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%) |                |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 0.17           |                |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              |                |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | -              | -              |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              | -              |

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：本基金在本报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 54 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 60 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 18 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金在本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 7.3.2 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                 | 46.33               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 21.89               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 5.27                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 4.86                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 10.86               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 89.21               | -                   |

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本基金在本报告期内无投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 按实际利率计算的账面价值   | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|----------------|---------------|
| 1  | 国家债券                 | -              | -             |
| 2  | 央行票据                 | -              | -             |
| 3  | 金融债券                 | 151,832,532.29 | 6.17          |
|    | 其中：政策性金融债            | 151,832,532.29 | 6.17          |
| 4  | 企业债券                 | -              | -             |
| 5  | 企业短期融资券              | 91,059,647.99  | 3.70          |
| 6  | 中期票据                 | -              | -             |
| 7  | 同业存单                 | 745,924,339.90 | 30.29         |
| 8  | 其他                   | -              | -             |
| 9  | 合计                   | 988,816,520.18 | 40.15         |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -              | -             |

## 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称            | 债券数量(张) | 按实际利率计算的账面价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|-----------------|---------|-----------------|---------------|
| 1  | 210409    | 21 农发 09        | 600,000 | 60,148,413.95   | 2.44          |
| 2  | 112315345 | 23 民生银行 CD345   | 600,000 | 59,833,701.49   | 2.43          |
| 3  | 072310174 | 23 国金证券 CP012   | 500,000 | 50,921,174.15   | 2.07          |
| 4  | 112383526 | 23 西安银行 CD049   | 500,000 | 49,935,876.65   | 2.03          |
| 5  | 112419039 | 24 恒丰银行 CD039   | 500,000 | 49,921,640.89   | 2.03          |
| 6  | 112491863 | 24 北京农商银行 CD029 | 500,000 | 49,907,334.95   | 2.03          |
| 7  | 112384455 | 23 成都银行 CD170   | 500,000 | 49,902,362.67   | 2.03          |
| 8  | 112415184 | 24 民生银行 CD184   | 500,000 | 49,895,775.23   | 2.03          |
| 9  | 112497972 | 24 南京银行 CD110   | 500,000 | 49,895,220.11   | 2.03          |
| 10 | 112492376 | 24 长沙银行         | 500,000 | 49,884,657.88   | 2.03          |



|  |  |       |  |  |  |
|--|--|-------|--|--|--|
|  |  | CD031 |  |  |  |
|--|--|-------|--|--|--|

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况    |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | 0       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0253% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0006% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0139% |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金在本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金在本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占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

注：本基金在本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提收益。

#### 7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。西安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局陕西监管局的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局江苏省分局的处罚。北京农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。

本基金投资上述发行主体的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。本基金管理人的投研团队对上述发行主体受处罚事件进行了及时分析和跟踪研究，认为该事件对相关标的投资价值未产生实质性影响。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

## 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额             |
|----|-------|----------------|
| 1  | 存出保证金 | -              |
| 2  | 应收清算款 | -              |
| 3  | 应收利息  | -              |
| 4  | 应收申购款 | 261,739,472.00 |
| 5  | 其他应收款 | -              |
| 6  | 待摊费用  | -              |
| 7  | 其他    | -              |
| 8  | 合计    | 261,739,472.00 |

## 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别   | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额     | 持有人结构            |           |                |           |
|--------|----------|---------------|------------------|-----------|----------------|-----------|
|        |          |               | 机构投资者            |           | 个人投资者          |           |
|        |          |               | 持有份额             | 占总份额比例（%） | 持有份额           | 占总份额比例（%） |
| 中海货币 A | 46,764   | 3,868.26      | 46,137,653.32    | 25.51     | 134,757,858.42 | 74.49     |
| 中海货币 B | 93       | 24,534,236.44 | 2,275,294,532.13 | 99.72     | 6,389,456.93   | 0.28      |
| 合计     | 46,857   | 52,555.21     | 2,321,432,185.45 | 94.27     | 141,147,315.35 | 5.73      |

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）        | 占总份额比例（%） |
|----|-------|----------------|-----------|
| 1  | 信托类机构 | 171,384,712.12 | 6.96      |
| 2  | 券商类机构 | 100,687,657.22 | 4.09      |
| 3  | 保险类机构 | 100,227,187.22 | 4.07      |
| 4  | 保险类机构 | 100,020,814.67 | 4.06      |
| 5  | 信托类机构 | 100,020,814.67 | 4.06      |
| 6  | 信托类机构 | 100,012,889.31 | 4.06      |
| 7  | 信托类机构 | 78,016,235.45  | 3.17      |
| 8  | 券商类机构 | 53,715,555.19  | 2.18      |
| 9  | 券商类机构 | 50,544,020.35  | 2.05      |
| 10 | 保险类机构 | 50,458,122.58  | 2.05      |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 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基金 | 中海货币 A | 261,547.43 | 0.1446      |
|                  | 中海货币 B | 0.00       | 0.0000      |
|                  | 合计     | 261,547.43 | 0.0106      |

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别   | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|--------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 中海货币 A | 10~50             |
|                                | 中海货币 B | 0                 |
|                                | 合计     | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 中海货币 A | 0~10              |
|                                | 中海货币 B | 0                 |
|                                | 合计     | 0~10              |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                | 中海货币 A         | 中海货币 B            |
|-----------------------------------|----------------|-------------------|
| 基金合同生效日<br>(2010年7月28日)<br>基金份额总额 | 784,606,303.02 | 2,174,321,508.86  |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 237,816,584.11 | 5,135,283,201.12  |
| 本报告期基金总申购份额                       | 153,011,835.76 | 15,348,936,373.44 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 209,932,908.13 | 18,202,535,585.50 |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | -              | -                 |
| 本报告期末基金份额总额                       | 180,895,511.74 | 2,281,683,989.06  |

注：报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人于 2024 年 5 月 22 日发布公告，曹伟先生、祝康先生担任公司总经理助理。

本报告期内，本基金管理人于 2024 年 6 月 25 日发布公告，许定晴女士担任公司总经理助理。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施 1                  | 内容  |
|-----------------------|---|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 管理人及高级管理人员                                |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 02 月 27 日                          |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 中国证券监督管理委员会上海监管局                          |
| 受到的具体措施类型             | 公司：警示函；高级管理人员：警示函                         |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 在业务开展过程中存在违反《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》等相关法规的情形 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司已按照法律法规及监管要求，完成整改工作并向监管机构报送整改报告         |
| 其他                    | 此事项不影响公司业务的正常开展                           |

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 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量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司分别与券商进行商务谈判，签订协议后租用证券交易单元。

2. 本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |                 | 债券回购交易 |                   | 权证交易 |                 |
|------|------|-----------------|--------|-------------------|------|-----------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 申万宏源 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金在本报告期无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式  | 法定披露日期    |
|----|---|---------|-----------|
| 1  | 中海货币市场证券投资基金年度最后一日收益公告  | 报刊及规定网站 | 2024-1-1  |
| 2  | 中海货币市场证券投资基金收益支付公告  | 报刊及规定网站 | 2024-1-15 |
| 3  | 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务并参加费率优惠的公告 | 报刊及规定网站 | 2024-1-17 |
| 4  | 中海货币市场证券投资基金 2023 年第 4 季度报告                                       | 规定网站    | 2024-1-22 |
| 5  | 中海货币市场证券投资基金春节假期前暂停申购、转换转入、定期定额投资公告                               | 报刊及规定网站 | 2024-2-5  |
| 6  | 中海货币市场证券投资基金收益支付公告  | 报刊及规定网站 | 2024-2-19 |
| 7  | 中海货币市场证券投资基金（中海货币 B 份额）基金产品资料概要更新                                 | 规定网站    | 2024-2-29 |
| 8  | 中海货币市场证券投资基金（中海货币 A 份额）基金产品资料概要更新                                 | 规定网站    | 2024-2-29 |

|    |   |         |           |
|----|---|---------|-----------|
| 9  | 中海货币市场证券投资基金更新招募说明书（2024 年第 1 号）                              | 规定网站    | 2024-2-29 |
| 10 | 中海货币市场证券投资基金收益支付公告  | 报刊及规定网站 | 2024-3-15 |
| 11 | 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务并参加费率优惠的公告 | 报刊及规定网站 | 2024-3-25 |
| 12 | 中海货币市场证券投资基金 2023 年年度报告                                       | 规定网站    | 2024-3-29 |
| 13 | 中海货币市场证券投资基金收益支付公告  | 报刊及规定网站 | 2024-4-15 |
| 14 | 中海货币市场证券投资基金 2024 年第 1 季度报告                                   | 规定网站    | 2024-4-22 |
| 15 | 中海货币市场证券投资基金劳动节假期前暂停申购、转换转入、定期定额投资公告                          | 报刊及规定网站 | 2024-4-25 |
| 16 | 中海基金管理有限公司关于基金经理因休产假暂停履行职务的公告                                 | 报刊及规定网站 | 2024-4-29 |
| 17 | 中海货币市场证券投资基金收益支付公告  | 报刊及规定网站 | 2024-5-15 |
| 18 | 中海货币市场证券投资基金端午节假期前暂停申购、转换转入、定期定额投资公告                          | 报刊及规定网站 | 2024-6-4  |
| 19 | 中海货币市场证券投资基金收益支付公告  | 报刊及规定网站 | 2024-6-17 |
| 20 | 中海货币市场证券投资基金（中海货币 A 份额）基金产品资料概要更新                             | 规定网站    | 2024-6-27 |
| 21 | 中海货币市场证券投资基金（中海货币 B 份额）基金产品资料概要更新                             | 规定网站    | 2024-6-27 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |                |                | 报告期末持有基金情况 |          |
|---|----------------|-------------------------|----------------|----------------|----------------|------------|----------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额           | 赎回份额           | 持有份额       | 份额占比 (%) |
| 机构  | 1              | 2024-05-30 至 2024-06-05 | 100,006,501.73 | 331,862,747.19 | 431,869,248.92 | 0.00       | 0.00     |
| 产品特有风险  |                |                         |                |                |                |            |          |
| 1、持有人大会投票权集中的风险<br>当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大 |                |                         |                |                |                |            |          |

会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

#### 2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

#### 3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

#### 4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

#### 5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足广大投资者的投资理财需求，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定于 2024 年 7 月 17 日起对本基金的基金份额收益分配方式进行调整，基金收益分配的原则由“按月支付”改为“按日支付”，并修改本基金的相关法律文件，详见基金管理人于 2024 年 7 月 12 日发布的公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

### 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日