

# 中原英石货币市场基金2014年年度报告

2014年12月31日

基金管理人：中原英石基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年三月二十七日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月19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。

本报告期自2014年9月11日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况	41
8.2 债券回购融资情况	42
8.3 基金投资组合平均剩余期限	42
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
8.5 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	44
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	44
8.7 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	44
8.8 投资组合报告附注	44
§9 基金份额持有人信息	45
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
9.3 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	46
§10 开放式基金份额变动	46
§11 重大事件揭示	47
11.1 基金份额持有人大会决议	47

11.2	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 .....	47
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
11.4	基金投资策略的改变 .....	47
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	47
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
11.8	偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	48
11.9	其他重大事件 .....	49
§12	备查文件目录 .....	49
12.1	备查文件目录 .....	49
12.2	存放地点 .....	49
12.3	查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中原英石货币市场基金	
基金简称	中原英石货币	
基金主代码	000732	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年9月11日	
基金管理人	中原英石基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	75,753,378.99份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中原英石货币A	中原英石货币B
下属分级基金的交易代码	000732	000733
报告期末下属分级基金的份额总额	25,751,861.77份	50,001,517.22份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求保持基金资产安全性和高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金通过对短期金融工具的积极投资管理，在有效控制投资风险和保持流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对货币政策、宏观经济运行状况、利率走势、资金供求变化情况进行深入研究，评估各类投资品种的流动性和风险收益特征，确定各类投资品种的配置比例及期限组合，并适时进行动态调整。</p> <p>2、利率预期策略</p> <p>本基金通过跟踪和分析各类宏观经济指标、资金供求状况等因素，对短期利率变化趋势进行评估并形成合理预期，动态配置货币资产。</p> <p>3、期限配置策略</p>

	<p>本基金在短期利率期限结构分析的基础上，分析和评估各类投资品种的收益性和流动性，构建合理期限结构的投资组合。如预期市场利率水平上升，适度缩短投资组合的平均剩余期限；如预期市场利率水平下降，适度延长投资组合的平均剩余期限。</p> <p>4、流动性管理策略</p> <p>本基金将会紧密关注申购/赎回现金流变化情况、市场资金流动状况等影响货币市场基金流动性管理的因素，动态调整并有效分配本基金的现金流，以满足基金资产的日常流动性需求。</p>
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金预期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		中原英石基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈吟绮	汤嵩彦
	联系电话	021-38556782	95559
	电子邮箱	disclosure@acfund.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-38874600	95559
传真		021-38556677	021-62701216
注册地址		上海市虹口区邯郸路135号5幢101室	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		周小全	牛锡明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.acfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中原英石基金管理有限公司	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年9月11日（基金合同生效日）-2014年12月31日	
	中原英石货币A	中原英石货币B
本期已实现收益	863,812.57	1,060,657.47
本期利润	863,812.57	1,060,657.47
本期净值收益率	0.9594%	1.0352%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	
期末基金资产净值	25,751,861.77	50,001,517.22
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2014年末	
累计净值收益率	0.9594%	1.0352%

注：1、本基金基金合同生效日为2014年9月11日，至本报告期末不满一年。

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，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；

3、本基金收益分配是按日结转份额；

4、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1、中原英石货币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
过去三个月	0.8300%	0.0028%	0.3450%	0.0000%	0.4850%	0.0028%
自基金合同生效日起至今	0.9594%	0.0028%	0.4200%	0.0000%	0.5394%	0.0028%

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本基金基金合同生效日为2014年9月11日，至本报告期末不满一年。

##### 2、中原英石货币B

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
过去三个月	0.8921%	0.0028%	0.3450%	0.0000%	0.5471%	0.0028%
自基金合同生效日起至今	1.0352%	0.0028%	0.4200%	0.0000%	0.6152%	0.0028%

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本基金基金合同生效日为2014年9月11日，至本报告期末不满一年。

#### 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

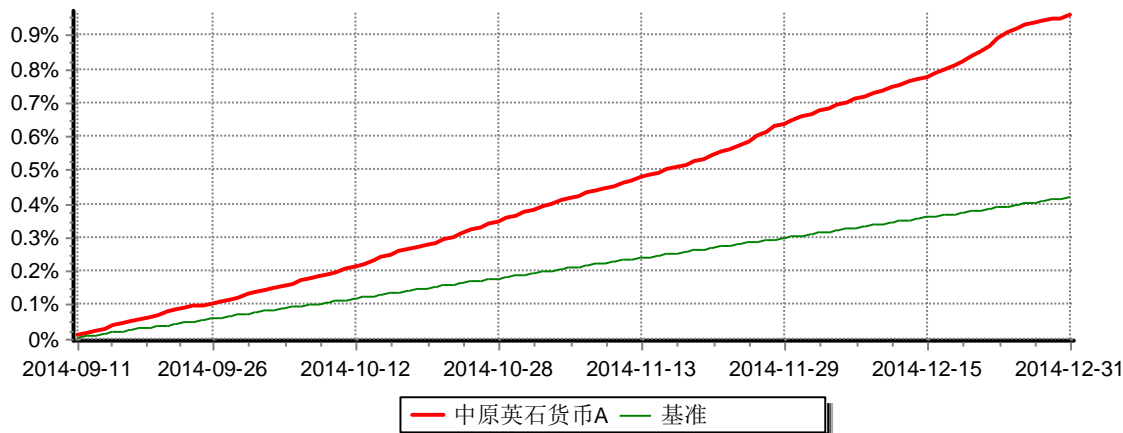
中原英石货币市场基金

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

(2014年9月11日-2014年12月31日)

##### 1、中原英石货币A

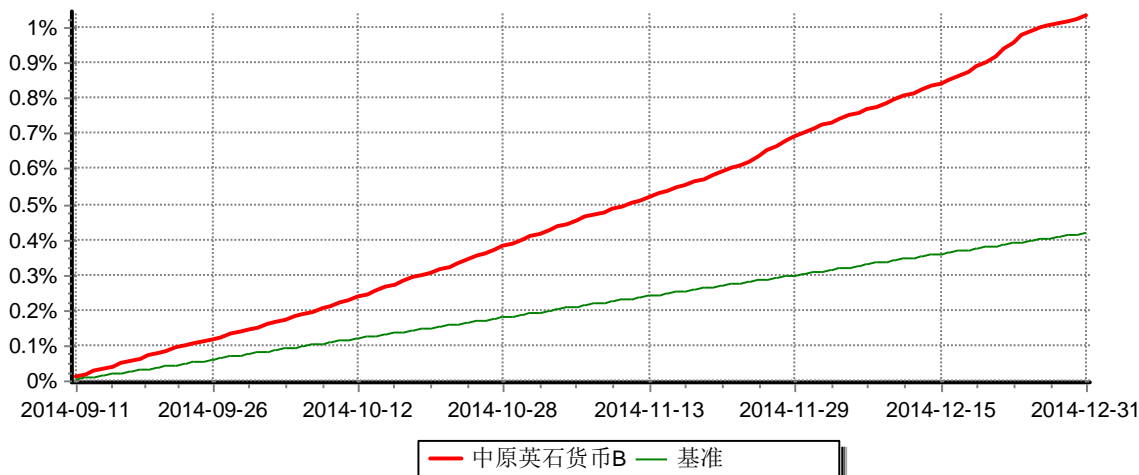




注：1、本基金基金合同生效日为2014年9月11日，至本报告期末不满一年；

2、按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，截至本报告期末本基金尚处于建仓期。

## 2、中原英石货币B



注：1、本基金基金合同生效日为2014年9月11日，至本报告期末不满一年；

2、按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，截至本报告期末本基金尚处于建仓期。

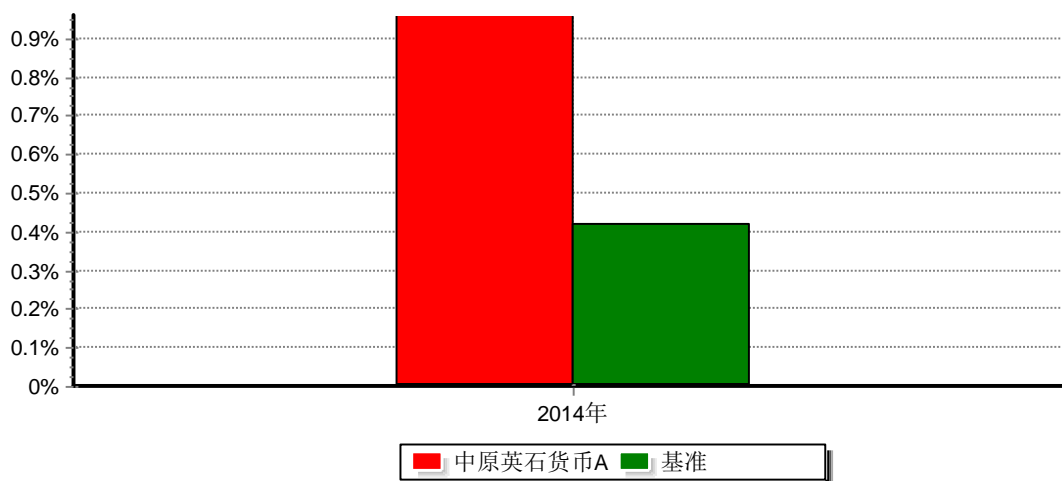
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 中原英石货币市场基金

自基金合同生效以来基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图

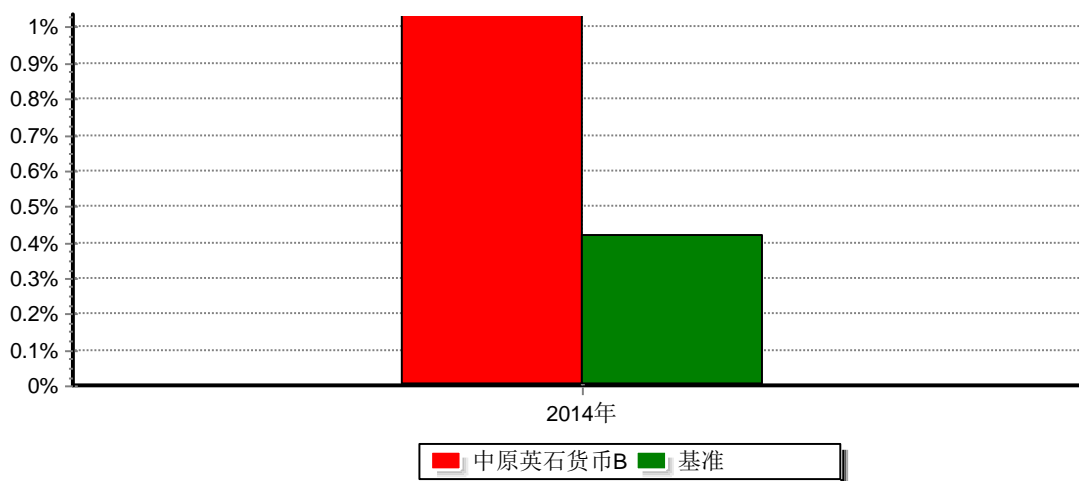
(2014年9月11日-2014年12月31日)

#### 1、中原英石货币A



注：1、本基金基金合同生效日为2014年9月11日，至本报告期末未满5年。  
2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 2、中原英石货币B



注：1、本基金基金合同生效日为2014年9月11日，至本报告期末未满5年。  
2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

### 1、中原英石货币A

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注

		额			
2014年	861,146.08	—	2,666.49	863,812.57	—
合计	861,146.08	—	2,666.49	863,812.57	—

## 2、中原英石货币B

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	1,055,154.17	—	5,503.30	1,060,657.47	—
合计	1,055,154.17	—	5,503.30	1,060,657.47	—

## § 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

中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会2012年12月20日证监许可[2012]1719号文件《关于核准设立中原英石基金管理有限公司的批复》批准，由中原证券股份有限公司和安石投资管理有限公司共同发起设立。公司于2013年1月23日在上海市工商行政管理局注册成立，并于2013年1月29日取得中国证券监督管理委员会核发的《基金管理资格证书》。公司注册资本为人民币2亿元，其中中原证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的49%。

目前公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等，在投资管理、策略设计、产品设计、客户服务等方面配置了专业团队及集中了优势资源，力求为客户创造长期持续稳健的回报。截至2014年12月31日，公司共管理一只证券投资基金：中原英石货币市场基金。

#### 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		
赵梓峰	本基金	2014年9月	—	21	上海交通大学工学学士，

	的基金 经理、投 资副总 监、研究 总监	11日			具有证券投资基金从业资格。1993年8月起曾在渣打证券公司上海代表处、法国兴业证券公司上海代表处、元富证券公司上海代表处、凯基（北京）管理咨询公司任研究员、研究主管等职，在上投摩根基金管理有限公司任研究总监、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金基金经理（任职期间：2007年3月20日至2011年5月25日）等职。中国国籍。
翁锡赞	本基金的基金 经理、固 定收益 总监	2014年9月 11日	—	11	复旦大学金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2004年1月起曾在兴业基金管理有限公司（现兴业全球基金管理有限公司）任首席交易员和债券研究员，万家基金管理有限公司任基金经理助理，国泰基金管理有限公司任国泰货币市场证券投资基金基金经理（任职期间：2008年8月23日至2011年6月15日）、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金经理（任职期间：2010年6月10日至2011年6月15日）、社保409、709组合投资经理，东吴证券股份有限公司任债券投资部副总经理，国泰君安（香港）

					有限公司任国泰君安巨龙中国固定收益基金（RQFII）基金经理（任职期间：2012年3月9日至2013年11月22日）、高级副总裁等职。中国国籍。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期和离职离任日期一般情况下指为公司对外公告之日；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，未发生违法违规或未履行基金合同的情形。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

在内控制度方面，公司根据相关法律法规制订了规范的投资管理制度和公平交易管理制度，以确保公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，研究团队为公司所有投资组合提供平等、公平的研究支持，所有投资组合共享公司统一的投资研究平台；严格实行各类资产管理业务之间的业务隔离和人员隔离制度，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，各投资组合的持仓及交易信息等均有效隔离。在交易执行方面，实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，保证交易在各投资组合间的公正实施。在监控和稽核方面，交易部门在交易执行过程中对公平交易实施一线监控与报告，稽核与风控部对投资交易行为进行持续监督和评估，定期进行公平交易的内部稽核工作，每季度和每年度对不同投资组合的收益率差异以及同向交易和反向交易情况进行分析，加强对公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，未发生本基金管理人管理的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超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### **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**

在国际上，美国退出量化宽松并预期明年加息。美元走强，大宗商品走弱，新兴市场面临股债汇三杀的局面。此外，受经济制裁和石油价格走低，俄罗斯卢布大幅贬值。

在国内，经济上进入三期叠加的新常态。2014年底的经济工作会议定下了稳增长的基调。2014年全年经济增速平稳下滑，通胀从2区间落入1区间，CPI长期低位，PPI持续为负，经济上可能更为担心通缩。消费稳定，进出口增长较为乏力，主要靠投资拉动，但另一方面工业增加值和固定资产投资增速放缓。M2增速从第二季度的高位有所回落。央行于2014年11月22日非对称降息，并扩大存款利率上浮倍数，人民币略有贬值。

债券市场受中登企业债回购事件影响，收益率曲线表现出先“牛陡”后“熊平”的趋势，信用利差先缩后扩。回购利率呈现高位震荡，受IPO影响较大。年末资金价格高企，短融抛压较大，呈现收益率短端倒挂的状态。

本基金于2014年9月初开始运作，在对市场资金和利率走势判断的基础上，在遵守基金合同、控制风险的前提下，充分利用协议存款获取收益，积极把握回购利率高点，为投资者带来了一定的收益。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

本报告期内，中原英石货币A净值收益率为0.9594%，同期业绩比较基准收益率为0.4200%。中原英石货币B净值收益率为1.0352%，同期业绩比较基准收益率为0.4200%。

### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

2015年的宏观经济可能呈现出新常态，很大可能是经济向下、通胀无忧，货币政策期待降准降息。在宽货币、宽信贷的情况下，利率债可能尚有空间，此外信用债方面还需关注黑天鹅事件。

本基金将积极依托本基金管理人内外部研究力量，密切关注资金供求变化和收益率变化对市场产生的影响，并据此完善投资策略，努力控制市场变化带来的投资风险，努

力抓住市场存在的投资机会，力争为基金持有人带来长期稳定的收益。

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况**

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。

在内控制度建设方面，公司持续完善内控制度建设，并时刻关注法规的新变化、结合行业发展的新动态、围绕业务开展的新需要，适时组织更新相关业务制度。在公司合规文化建设方面，公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，不断增强全体员工的合规自觉与风控意识，为公司业务的规范开展和健康发展创造良好的内控环境。在稽核检查方面，公司稽核与风控部在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对基金的投资运作、基金销售、基金运营等公司各项业务活动进行监督、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，定期对各类业务开展情况以及公司整体运营情况进行覆盖全面、重点突出的检查、总结和反馈，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

报告期内，本基金管理人严格按照《中原英石基金管理有限公司基金估值定价与评估制度》和《中原英石基金管理有限公司基金会计业务管理制度》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员由营运总监负责，成员包括投资组合经理、行业研究员、风控人员、金融工程研究员及基金会计等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金基金合同的有关约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日进行支付。

本报告期内，中原英石货币A累计收益分配金额863,812.57元，中原英石货币B累计收益分配金额1,060,657.47元。

#### 4.9 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

本报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形，也未发生连续六十个工作日出现上述情形。

### § 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

2014年度，托管人在中原英石货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

2014年度，中原英石基金管理有限公司在中原英石货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向份额持有人分配利润：1,924,470.04元。

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

2014年度，由中原英石基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中原英石货币市场基金的年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中原英石货币市场基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的中原英石货币市场基金财务报表，包括2014年12月31日的资产负债表，2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人中原英石



	<p>基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中原英石货币市场基金2014年12月31日的财务状况以及2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	汤骏、许培菁
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2015年3月20日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中原英石货币市场基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	49,091,954.29
结算备付金		7,102,521.11
存出保证金		—
交易性金融资产	7.4.7.2	10,014,677.72
其中：股票投资		—
基金投资		—
债券投资		10,014,677.72
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	11,000,000.00
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	418,499.42
应收股利		—
应收申购款		227,000.00
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		77,854,652.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年12月31日</b>

<b>负 债：</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		2,000,000.00
应付赎回款		—
应付管理人报酬		32,193.12
应付托管费		9,755.45
应付销售服务费		5,799.74
应付交易费用	7.4.7.7	855.45
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		8,169.79
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	44,500.00
负债合计		2,101,273.55
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	75,753,378.99
未分配利润	7.4.7.10	—
所有者权益合计		75,753,378.99
负债和所有者权益总计		77,854,652.54

注：1、报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额75,753,378.99份。其中中原英石货币A的份额总额为25,751,861.77份，中原英石货币B的份额总额为50,001,517.22份。

2、本基金基金合同生效日为2014年9月11日，因此本报告实际报告期间为2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日，无上年度末数据（下同）。

## 7.2 利润表

会计主体：中原英石货币市场基金

本报告期：2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日
<b>一、收入</b>		2,413,423.48
1.利息收入		2,413,633.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,661,221.51
债券利息收入		62,845.11
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		689,566.86
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-210.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	-210.00
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	—
股利收益	7.4.7.15	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	—
<b>减：二、费用</b>		488,953.44
1. 管理人报酬		212,235.21
2. 托管费		64,313.64
3. 销售服务费		84,767.45

4. 交易费用	7.4.7.18	—
5. 利息支出		1,296.96
其中：卖出回购金融资产支出		1,296.96
6. 其他费用	7.4.7.19	126,340.18
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,924,470.04
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,924,470.04

注：本基金基金合同生效日为2014年9月11日，因此本报告实际报告期间为2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日，无上年度可比期间数据（下同）。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中原英石货币市场基金

本报告期：2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月 31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	567,653,833.12	—	567,653,833.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	1,924,470.04	1,924,470.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-491,900,454.13	—	-491,900,454.13
其中：1.基金申购款	130,194,174.87	—	130,194,174.87
2.基金赎回款	-622,094,629.00	—	-622,094,629.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	-1,924,470.04	-1,924,470.04
五、期末所有者权益（基金净值）	75,753,378.99	—	75,753,378.99

注：本基金基金合同生效日为2014年9月11日，因此本报告实际报告期间为2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日，无上年度可比期间数据（下同）。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

林伟萌

黄竹平

何晶晶

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中原英石货币市场基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]596号文《关于核准中原英石货币市场基金募集的批复》的核准,由基金管理人中原英石基金管理有限公司于2014年8月25日至2014年9月5日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014)验字第60466941\_B22号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。本基金基金合同于2014年9月11日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币567,554,279.94元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币99,553.18元,以上实收基金(本息)合计为人民币567,653,833.12元,折合567,653,833.12份基金份额。本基金的基金管理人、注册登记机构均为中原英石基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金根据投资人持有基金份额数量的不同,分别设置不同类别的基金份额,每类基金份额按照不同的费率计提费用。本基金目前分设两类基金份额:A类基金份额和B类基金份额。其中,投资人在单个基金账户保留的基金份额小于500万份的为A类份额,大于或等于500万份的为B类份额。当投资人在单个基金账户保留的A类基金份额达到B类基金份额的最低份额要求时,基金的注册登记机构自动将投资人在该基金账户保留的A类基金份额全部升级为B类基金份额。当投资人在单个基金账户保留的B类基金份额不能满足该类基金份额的最低份额要求时,基金的注册登记机构自动将投资人在该基金账户保留的B类基金份额全部降级为A类基金份额。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,以及中国证监会及/或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

本基金通过对短期金融工具的积极投资管理,在有效控制投资风险和保持流动性的

基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。

本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款利率（税后）。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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2号《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<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.3 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2014年12月31日的财务状况以及2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2014年9月11日（基金合同生效日）起至2014年12月31日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

##### (2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息；

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；本基金金融工具的估值方法具体如下：

##### (1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

##### (2) 债券投资

基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

##### (3) 回购协议

1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若



融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

#### (4) 资产支持证券投资

1)在交易所交易的资产支持证券，以成本列示，按票面利率在实际持有期间内逐日计提利息；

2)在全国银行间债券市场交易的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

#### (5) 其他

1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

2)为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过0.50%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

3)如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知[2006]22号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2)债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付

价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.9 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；

(3) 对于中原英石货币A，基金销售服务费按前一日该类基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；对于中原英石货币B，基金销售服务费按前一日该类基金资产净值的0.01%的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响每万份基金净收益小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.10 基金的收益分配政策**

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理。因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零时，则为投资人增加相应的基金份额；若当日净收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，则缩减投资人基金份额；

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的

基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期未发生重大会计差错的内容和更正金额。

### **7.4.6 税项**

#### **(1)营业税、企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，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，继续免征营业税和企业所得税。

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。

#### **(2)个人所得税**

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

### **7.4.7 重要财务报表项目的说明**

#### **7.4.7.1 银行存款**

单位：人民币元

项目	本期末
	2014年12月31日
活期存款	91,954.29
定期存款	49,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	5,000,000.00
存款期限7天	44,000,000.00
其他存款	—
合计	49,091,954.29

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2014年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	10,014,677.72	10,005,000.00	-9,677.72	-0.0128
	合计	10,014,677.72	10,005,000.00	-9,677.72	-0.0128

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2014年12月31日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	11,000,000.00	—
合计	11,000,000.00	—

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2014年12月31日）本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
应收活期存款利息	165.64
应收定期存款利息	7,702.77
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	4,797.27
应收债券利息	402,969.86
应收买入返售证券利息	1,488.88
应收申购款利息	1,375.00
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	418,499.42

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末（2014年12月31日）本基金未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	855.45
合计	855.45

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	—

应付赎回费	—
预提费用	44,500.00
合计	44,500.00

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 中原英石货币A

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	436,431,128.67	436,431,128.67
本期申购	13,856,987.92	13,856,987.92
本期赎回（以“-”号填列）	-424,536,254.82	-424,536,254.82
本期末	25,751,861.77	25,751,861.77

注：1、申购含红利再投份额；

2、本基金基金合同生效日为2014年9月11日。本基金于2014年8月25日至2014年9月5日向社会公开募集，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币567,554,279.94元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币99,553.18元，以上实收基金（本息）合计为人民币567,653,833.12元，折合567,653,833.12份基金份额。其中，中原英石货币A募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币436,344,279.94元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币86,848.73元，以上实收基金（本息）合计为人民币436,431,128.67元，折合436,431,128.67份基金份额。

##### 中原英石货币B

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	131,222,704.45	131,222,704.45
本期申购	116,337,186.95	116,337,186.95
本期赎回（以“-”号填列）	-197,558,374.18	-197,558,374.18
本期末	50,001,517.22	50,001,517.22

注：1、申购含红利再投份额；

2、本基金基金合同生效日为2014年9月11日。本基金于2014年8月25日至2014年9月5日向社会公开募集，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币567,554,279.94元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币99,553.18元，以上实收基金（本息）合计为人民币567,653,833.12元，折合567,653,833.12份基金份额。其中，中原英石货币B募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币131,210,000.00元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币12,704.45元，以上实收基金（本息）合计为人民币131,222,704.45元，折合131,222,704.45份基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 中原英石货币A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	863,812.57	—	863,812.57
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	-863,812.57	—	-863,812.57
本期末	—	—	—

##### 中原英石货币B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	1,060,657.47	—	1,060,657.47
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	-1,060,657.47	—	-1,060,657.47
本期末	—	—	—

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日
活期存款利息收入	2,905.17
定期存款利息收入	1,463,600.55
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	190,155.66
其他	4,560.13
合计	1,661,221.51

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本报告期内本基金无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-210.00
债券投资收益——赎回差价收入	0
债券投资收益——申购差价收入	0
合计	-210.00

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,105,495.02



减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,009,070.50
减：应收利息总额	96,634.52
买卖债券差价收入	-210.00

#### 7.4.7.13.3债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日
赎回基金份额对价总额	—
减：现金支付赎回款总额	—
减：赎回债券成本总额	—
减：赎回债券应收利息总额	—
赎回差价收入	—

#### 7.4.7.13.4债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日
申购基金份额对价总额	—
减：现金支付申购款总额	—
减：申购债券成本总额	—
减：申购债券应收利息总额	—
申购差价收入	—

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本报告期内本基金无股利收益。

#### 7.4.7.16公允价值变动收益

本报告期内本基金无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.17其他收入

本报告期内本基金无其他收入。

#### 7.4.7.18交易费用

本报告期内本基金无交易费用。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	80,000.00
开户费	900.00
银行汇划费	940.18
其他	—
账户维护费	4,500.00
银行间交易费用	—
合计	126,340.18

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中原英石基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中原证券股份有限公司	基金管理人的股东
安石投资管理有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本报告期内，本基金与关联方无股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本报告期内，本基金与关联方无权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本报告期内，本基金与关联方无债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

关联方名称	本期 2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中原证券股份有限公司	1,676,200,000.00	100%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金无支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	212,235.21
其中：支付销售机构的客户维护费	62,265.14

注：支付基金管理人中原英石基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	64,313.64

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

### 7.4.10.2.3 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		
	2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中原英石货币A	中原英石货币B	合计
交通银行股份有限公司	70,547.91	322.29	70,870.20
中原英石基金管理有限公司	509.87	2,686.70	3,196.57
中原证券股份有限公司	1,481.92	—	1,481.92
合计	72,539.70	3,008.99	75,548.69

注：1、中原英石货币A基金份额的年销售服务费率为0.25%。基金销售服务费每日计提，按月支付。其计算公式为：每日中原英石货币A基金份额应计提的基金销售服务费=前一日该类基金份额的基金资产净值×0.25%÷当年天数；

2、中原英石货币B基金份额的年销售服务费率为0.01%。基金销售服务费每日计提，按月支付。其计算公式为：每日中原英石货币B基金份额应计提的基金销售服务费=前一日该类基金份额的基金资产净值×0.01%÷当年天数；

3、对于由中原英石货币A基金份额升级为中原英石货币B基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受中原英石货币B基金份额的费率；对于由中原英石货币B基金份额降级为中原英石货币A基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用中原英石货币A基金份额的费率。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期内，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 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

报告期末，其他关联方均未投资本基金。

### 7.4.10.5 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
	2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月

	31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	91,954.29	2,905.17

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。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，2014年09月11日(合同生效日)至2014年12月31日止期间获得的备付金利息收入为人民币190,155.66元，2014年末结算备付金余额为人民币7,102,521.11元。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 中原英石货币A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
861,146.08	—	2,666.49	863,812.57	—

##### 中原英石货币B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
1,055,154.17	—	5,503.30	1,060,657.47	—

#### 7.4.12 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

本报告期末（2014年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末（2014年12月31日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2014年12月31日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2014年12月31日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金所投资的金融工具主要是具有良好流动性的货币市场工具。本基金在日常经营活动中涉及的主要风险包括信用风险、流动性风险和市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现在保证本金安全和资产流动性最大化的前提下，追求超过业绩比较基准的收益的投资目标。本基金管理人制定了相关政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过定性分析和定量分析相结合的方法去估测各种风险可能产生的损失，通过相应的管理措施及信息系统持续监督、检查和评估上述各类风险，力争将风险控制在可承受的范围内。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核与风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险主要指基金投资的债券类资产的发行主体信用状况恶化，到期不能履行合约进行兑付；以及发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于发行人信用资质降低导致债券价格下降的风险；信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估及分散化投资来控制证券发行人的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的债券、国债、央行票据等，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与其相关的信用风险较小。

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。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末，本基金未持有短期信用评级债券投资。

#### 7.4.13.2.2 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 2014年12月31日
AAA	—
AAA以下	—
未评级	10,014,677.72
合计	10,014,677.72

注：未评级债券为国债、政策性金融债及央行票据。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持证券资产变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资人的集中巨额赎回，另一方面来自于其投资组合或其中的部分资产变现能力减弱所产生的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃债券品种来实现。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、企业债及央行票据等，均在证券交易所上市或可在银行间同业市场交易；除在附注中列示本基金于期末持有的流通受限证券外，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。本基金的利率风险还表现在当投资组合的公允价值受市场利率的变动导致与其摊余成本发生重大差异时对损益的影响。

本基金持有的债券资产在一定程度上存在着利率风险，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，对债券资产的剩余期限及券种结构进行优化，从而达到有效降低利率风险的目的。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2014年12月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							
银行存款	44,091,954.29	5,000,000.00	—	—	—	—	49,091,954.29
结算备付金	7,102,521.11	—	—	—	—	—	7,102,521.11
交易性金融资产	—	10,014,677.72	—	—	—	—	10,014,677.72
买入返售金融资产	11,000,000.00	—	—	—	—	—	11,000,000.00
应收利息	—	—	—	—	—	418,499.42	418,499.42
应收申购款	—	—	—	—	—	227,000.00	227,000.00
资产总计	62,194,475.40	15,014,677.72	—	—	—	645,499.42	77,854,652.54
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	2,000,000.00	2,000,000.00



应付管理人报酬	—	—	—	—	—	32,193.12	32,193.12
应付托管费	—	—	—	—	—	9,755.45	9,755.45
应付销售服务费	—	—	—	—	—	5,799.74	5,799.74
应付交易费用	—	—	—	—	—	855.45	855.45
应付利润	—	—	—	—	—	8,169.79	8,169.79
其他负债	—	—	—	—	—	44,500.00	44,500.00
负债总计	—	—	—	—	—	2,101,273.55	2,101,273.55
利率敏感度缺口	62,194,475.40	15,014,677.72	—	—	—	-1,455,774.13	75,753,378.99

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2、该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动25个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3、银行存款以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响； 4、该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末2014年12月31日
	市场利率下降25个基点	3,751.65
	市场利率上升25个基点	-3,741.26

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

###### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### 1) 各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层级的余额为人民币10,014,677.72元，无属于第一层级和第三层级的余额。

###### 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。

2014年度，对于以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

###### 3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

##### 2、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 3、其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	10,014,677.72	12.86
	其中：债券	10,014,677.72	12.86

	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	11,000,000.00	14.13
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	56,194,475.40	72.18
4	其他各项资产	645,499.42	0.83
5	合计	77,854,652.54	100.00

## 8.2 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	0.10	
	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	—	—

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	19
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	40
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

注：根据本基金合同规定，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。

### 8.3.2 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	82.10	2.64
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	13.22	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—180天	6.60	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)—397天(含)	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	101.92	2.64

### 8.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	10,014,677.72	13.22
	其中：政策性金融债	10,014,677.72	13.22
4	企业债券	—	—

5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	10,014,677.72	13.22
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

### 8.5 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

金额单位：人民币元

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 (%)
1	140410	14农发10	100,000	10,014,677.72	13.22

### 8.6 “影子定价”与“摊余成本法”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	—
报告期内偏离度的最高值	0.0043
报告期内偏离度的最低值	-0.0278
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0042

### 8.7 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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

### 8.8 投资组合报告附注

#### 8.8.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。本基金采用固定份额净值，使基金份额净值保持在人民币1.00元。

**8.8.2** 本报告期内，本基金不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

**8.8.3** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

#### 8.8.4 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	应收证券清算款	—
3	应收利息	418,499.42
4	应收申购款	227,000.00
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	645,499.42

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
中原 英石 货币 A	271	95,025.32	60,954.42	0.24%	25,690,907.35	99.76%
中原 英石 货币 B	1	50,001,517.22	50,001,517.22	100.00%	—	—

合计	272	278,505.07	50,062,471.64	66.09%	25,690,907.35	33.91%
----	-----	------------	---------------	--------	---------------	--------

### 9.2 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	中原英石货币A	173,140.58	0.67%
	中原英石货币B	—	—
	合计	173,140.58	0.23%

### 9.3 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	中原英石货币A	10~50
	中原英石货币B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中原英石货币A	10~50
	中原英石货币B	0
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中原英石货币A	中原英石货币B
基金合同生效日(2014年9月11日)基金份额总额	436,431,128.67	131,222,704.45
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	13,856,987.92	116,337,186.95
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	424,536,254.82	197,558,374.18
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	25,751,861.77	50,001,517.22

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投资份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

#### 1、基金管理人的重大人事变动情况

(1) 经中原英石基金管理有限公司第一届董事会2014年第四次会议审议通过，公司聘请周小全先生担任中原英石基金管理有限公司第一届董事会董事长（法定代表人）职务，石保上先生不再担任中原英石基金管理有限公司第一届董事会董事长（法定代表人）职务。上述事项已按规定向中国证券监督管理委员会和中国证券监督管理委员会上海监管局报告，并经中国证券监督管理委员会审核批准（证监许可[2014] 1087号），相关工商登记变更手续完成后于2014年10月30日发布了《中原英石基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

(2) 经中原英石基金管理有限公司第一届董事会2014年第七次会议审议通过，公司聘请宋卫华先生担任中原英石基金管理有限公司副总经理职务，付强先生不再担任中原英石基金管理有限公司副总经理职务。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会上海监管局报告，并于2014年10月31日发布了《中原英石基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用肆万元整，该审计机构自基金合同生效日（2014年9月11日）起向本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况



本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		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	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	佣金	占当期佣金总量的比例	
中原证券股份有限公司	2	—	—	—	—	1,676,200,000.00	100%	—	—	—

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

- (1) 市场形象及财务状况良好。
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (3) 内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (4) 研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

根据上述标准进行考察后，由基金管理人的投资决策委员会确定租用券商的交易单元，并由基金管理人与被选择的券商签订协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

上述交易单元均为在本报告期内新增。

### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本报告期内本基金未有偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## 11.9 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	中原英石基金管理有限公司关于中原英石货币市场基金基金合同生效的公告	证券时报、基金管理人网站	2014-09-12
2	中原英石货币市场基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2014-09-19
3	中原英石货币市场基金于2014年“国庆节”假期前暂停大额申购业务的公告	证券时报、基金管理人网站	2014-09-24
4	中原英石基金管理有限公司关于中原英石货币市场基金增加销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站	2014-11-14
5	中原英石基金管理有限公司关于中原英石货币市场基金增加销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站	2014-12-30

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准中原英石货币市场基金募集的批复
- 2、《中原英石货币市场基金基金合同》
- 3、《中原英石货币市场基金招募说明书》
- 4、《中原英石货币市场基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室）

### 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原英石基金管理有限公司；部

分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：021-38874600

公司网址：[www.acfund.com.cn](http://www.acfund.com.cn)

中原英石基金管理有限公司

二〇一五年三月二十七日