

中原英石货币市场基金 2014 年第 4 季度报告

目录全部展开 目录全部收拢

- 重要提示
- 基金产品概况
- 基金基本情况
- 主要财务指标和基金净值表现
 - 主要财务指标
 - 基金净值表现
 - 本报告期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
 - 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
 - 其他指标
- 管理人报告
 - 基金经理（或基金经理小组）简介
 - 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
 - 公平交易专项说明
 - 公平交易专项说明
 - 公平交易制度和控制方法
 - 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
 - 异常交易行为的专项说明
 - 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
 - 报告期内基金的业绩表现
 - 报告期内基金投资策略和运作分析
 - 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 - 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
- 投资组合报告
 - 报告期末基金资产组合情况
 - 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
 - 报告期债券回购融资情况
 - 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明
 - 投资组合平均剩余期限基本情况
 - 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明
 - 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例
 - 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细
 - “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
 - 报告期末按公允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
 - 投资组合报告附注
 - 基金计价方法说明
 - 本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券说明
 - 受到调查以及处罚情况
 - 其他资产构成
 - 投资组合报告附注的其他文字描述部分
- 开放式基金份额变动
- 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

- 影响投资者决策的其他重要信息
- 备查文件目录

重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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1月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

基金基本情况

项目 数值

基金简称 中原英石货币

场内简称 -

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 2014-09-11

报告期末基金份额总额 75,753,378.99

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 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。1、资产配置策略 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

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。

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

下属2级基金的基金简称 中原英石货币A 中原英石货币B

下属2级基金的场内简称 - -

下属2级基金的交易代码 000732 000733

报告期末下属2级基金的份额总额 25751861.77 50001517.22

下属2级基金的风险收益特征 - -

主要财务指标

单位：人民币元

项目	主基金(元)	A(元)	B(元)
本期已实现收益	-	388,529.42	896,046.75
本期利润	-	388,529.42	896,046.75
期末基金资产净值	-	25,751,861.77	50,001,517.22
期末还原后基金份额累计净值	-	-	-

注：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，公允价值变动为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

基金净值表现

本报告期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

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

注：本基金的收益分配是按日结转份额

本报告期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 A

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.83% 0.0028% 0.345% 0% 0.485% 0.0028%

本基金的收益分配是按日结转份额。

本报告期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 B

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.8921% 0.0028% 0.345% 0% 0.5471% 0.0028%

本基金的收益分配是按日结转份额。

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 A

1、本基金基金合同于 2014 年 9 月 11 日生效，至报告期末不满一年； 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。

自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 B

1、本基金基金合同于 2014 年 9 月 11 日生效，至报告期末不满一年； 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。

其他指标

单位：元

序号 其他指标 报告期（2014-10-01 至 2014-12-31）

序号 其他指标 报告期（2014-12-31）

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明
任职日期 离任日期

赵梓峰 本基金的基金经理、投资副总监、研究总监 2014-09-11 - 21 上海交通大学工学学士，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。

翁锡贇 本基金的基金经理、固定收益总监 2014-09-11 - 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任日期一般情况下指公司对外公告之日；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。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

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，不存在违法违规或未履行基金合同的情形。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及有关法规，建立公司内部的公平交易管理制度体系，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，以确保公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，防范不公平交易和利益输送行为。

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人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，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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 0.8300%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%。中原英石货币 B 净值收益率为 0.8921%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%。

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。12 月份的经济工作会议定下了稳增长的基调。尽管经济增速预期下滑，但通胀无忧，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。

本基金第四季度中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。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

-

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。

报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额（元）	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	金融衍生品投资	-	-
3	买入返售金融资产	11,000,000	14.13
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
4	银行存款和结算备付金合计	56,194,475.4	72.18
5	其他资产	645,499.42	0.83
6	合计	77,854,652.54	100

报告期债券回购融资情况

金额单位：元

序号	项目	占基金总资产的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	0.12
	其中：买断式回购融资	-

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
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

金额单位：元

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
----	------	-------------------	----	-----

注：在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%。

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	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
----	------	--------	----	-----

注：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。

报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	82.1	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	6.6	-
	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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	140410	14 农发	10,100,000	10,014,677.72	13.22

“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 0

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 0.0052%

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

序号	债券品种	摊余成本 (元)	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	可转债	-	-

8	其他	-	-
9	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	-	-

报告期末按公允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

单位：元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

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。

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券说明

本基金本报告期内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。

受到调查以及处罚情况

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。

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例	原因	调整期
----	------	-----------------	----	-----

其他资产构成

单位：元

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	418,499.42
5	应收申购款	227,000
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	645,499.42

投资组合报告附注的其他文字描述部分

—

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目	中原英石货币	中原英石货币 A	中原英石货币 B
基金合同生效日的基金份额总额	-	-	-
报告期期初基金份额总额	-	135,964,262.3	74,645,416.17
报告期期间基金总申购份额	-	13,206,670.68	116,177,956.51
报告期期间总赎回份额	-	123,419,071.21	140,821,855.46
报告期期末基金份额总额	75,753,378.99	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份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
合计	-	-	-	-	-

注：本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。
影响投资者决策的其他重要信息

—

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