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:二〇一五年八月二十六日

中原英石货币市场基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	21,741,054.71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	3,556,011.94份	18,185,042.77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	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。 2.利率预期策略 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。 3.期限配置策略 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。 4.流动性管理策略 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。
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	陈吟倚	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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.acfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

§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 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日-2015年6月30日)	
	中原英石货币A	中原英石货币B
本期已实现收益	78,679.08	227,048.31
本期利润	78,679.08	227,048.31
本期净值收益率	1.00%	1.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末基金资产净值	3,556,011.94	18,185,042.77
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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、本基金利润分配是按日结转份额。

3、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 基金份额净值收益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
过去一个月	0.1224%	0.0022%	0.1125%	0.0000%	0.0099%	0.0022%
过去三个月	0.3697%	0.0022%	0.3413%	0.0000%	0.0284%	0.0022%
过去六个月	1.0012%	0.0030%	0.6788%	0.0000%	0.3224%	0.0030%
自基金合同生效日起至今	1.9701%	0.0033%	1.0988%	0.0000%	0.8713%	0.0033%

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
过去一个月	0.1423%	0.0022%	0.1125%	0.0000%	0.0298%	0.0022%
过去三个月	0.4301%	0.0022%	0.3413%	0.0000%	0.0888%	0.0022%
过去六个月	1.1081%	0.0032%	0.6788%	0.0000%	0.4293%	0.0032%
自基金合同生效日起至今	2.1548%	0.0034%	1.0988%	0.0000%	1.0560%	0.0034%

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。

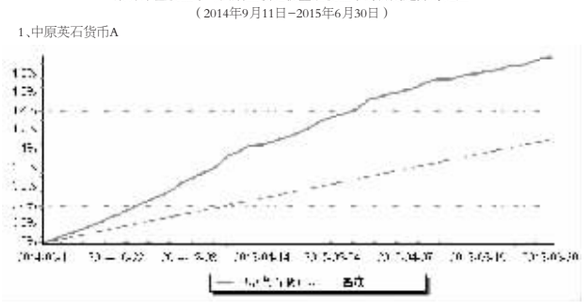
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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-2015年6月30日)

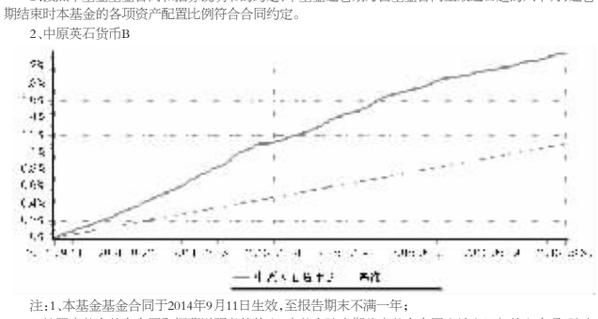
1、中原英石货币A



注: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,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

2、中原英石货币B



注: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,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。截至本报告期末,公司共管理两只证券投资基金:中原英石货币市场基金和中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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、兼任中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、投资副总监、研究总监	2014年9月11日	-	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月起曾在流打证券公司上海代表处、法国兴业证券公司上海代表处、光富证券公司上海代表处、凯基(北京)管理咨询公司研究员、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。
翁锡赟	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遵规守信情况的说明

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非公平交易的情况。

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。

4.3.2 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,美联储预期今年9月后甚至明年加息。美元指数先强后弱再震荡,美国经济复苏带动欧洲和日本经济企稳,但是新兴市场经济仍不容乐观,世界银行下调了全球经济增长预期。大宗商品走弱,希腊可能退出欧元区。

在国内,两会给出了全年的经济目标,也定下了"稳增长、调结构、促转型、强改革"的基调。经济进入新常态,基建、制造、地产出现滑坡。经济向下压力逐步增大,制造业产能过剩,企业利润下滑,或可能产生通缩的预期,发电耗煤呈现负增长。PMI有所回升,工业增加值回升但依然低位,消费在相对低位徘徊,进出口呈现负增长。社会融资数据不理想。另一方面,财政政策积极,货币政策宽松。2月5日,降准50BP;3月1日,降息25BP;4月20日,降准1%;5月11日,降息25BP;6月27日,降息25BP且定向降准。亚投行(AIIB)战略打破国际金融霸权。国务院通过草案取消存贷比75%规定。发改委允许企业"借新还旧"。人民币预期或将出现小幅贬值的可能性。

债券市场受财政部两个季度各1万亿地方政府债券置换消息影响供需预期。利率债收益率先降后升,期限利差第二季度开始扩大,信用利差先缩后扩。央行两个季度各四次下调公开市场回购利率。交易所IPO从每月1次调整为每月2次;回购利率也随之波动。个别债券的违约概率在上升,个别中票都出现了不同程度的危机。短期内信用风险或未消除。

本基金上半年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,积极把握回购利率高点,为投资者带来了一定的收益,符合货币基金总体的风险收益特征。

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份额净值收益率为1.0012%,同期的业绩比较基准收益率为0.6788%。中原英石货币B份额净值收益率为1.1081%,同期的业绩比较基准收益率为0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对2015年下半年的宏观经济判断,总体上依然是新常态。很大可能是经济向下、通胀无忧,财政政策可能依然为稳增长托底,货币政策或将继续降准降息。宽货币、宽信贷。利率债向下,信用债黑天鹅事件需要关注,回购利率也可能维持在相对低位。

本基金将积极依托公司内外部研究力量,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。

4.7 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78,679.08元,中原英石货币B累计收益分配金额227,048.31元。

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

本报告期内,本基金存在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,时间范围为:2015年2月10日至4月6日,2015年1月7日至3月30日。

本报告期内,本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形,本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

§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

2015年上半年度,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

2015年上半年度,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:305,727.39元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015年上半年度,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半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:中原英石货币市场基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	177,373.38	49,091,954.29
结算备付金		2,343,891.26	7,102,521.11
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	-	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	17,300,000.00	11,000,000.00
应收证券清算款		2,002,537.50	-
应收利息	6.4.7.5	5,029.94	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	6.4.7.6	-	-
资产总计		21,828,832.08	77,854,652.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
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		-	-
应付证券清算款		-	2,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,495.95	32,193.12
应付托管费		1,968.47	9,755.45
应付销售服务费		955.47	5,799.74
应付交易费用	6.4.7.7	-	855.45
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		538.68	8,169.79
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	77,818.80	44,500.00
负债合计		87,777.37	2,101,273.55
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	21,741,054.71	75,753,378.99
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		21,741,054.71	75,753,378.99
负债和所有者权益总计		21,828,832.08	77,854,652.54

注:1、报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额21,741,054.71份。其中中原英石货币A的份额总额为3,556,011.94份,中原英石货币B的份额总额为18,185,042.77份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体:中原英石货币市场基金

本报告期:2015年1月1日-2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日-2015年6月30日
一、收入		457,431.20
1.利息收入		457,431.20
其中:存款利息收入	6.4.7.11	75,024.15
债券利息收入		58,352.42
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		324,054.63
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-
减:二、费用		151,703.81
1.管理人报酬		43,543.33
2.托管费		13,194.98
3.销售服务费		9,846.15
4.交易费用	6.4.7.18	-
5.利息支出		4,130.47
其中:卖出回购金融资产支出		4,130.47
6.其他费用	6.4.7.19	80,988.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		305,727.39
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		305,727.39

注:本基金基金合同生效日为2014年9月11日,因此无上年度可比期间数据(下同)。

6.3 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:2015年1月1日-2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日-2015年6月30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)	75,753,378.99	-	75,753,378.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	305,727.39	305,727.39
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)	-54,012,324.28	-	-54,012,324.28
其中:1.基金申购款	65,866,066.23	-	65,866,066.23
2.基金赎回款	-119,878,390.51	-	-119,878,390.51
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)	-	-305,727.39	-305,727.39
五、期末所有者权益(基金净值)	21,741,054.71	-	21,741,054.71

注:本基金基金合同生效日为2014年9月11日,因此无上年度可比期间数据(下同)。

6.3 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:2015年1月1日-2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日-2015年6月30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)	75,753,378.99	-	75,753,378.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	305,727.39	305,727.39
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)	-54,012,324.28	-	-54,012,324.28
其中:1.基金申购款	65,866,066.23	-	65,866,066.23
2.基金赎回款	-119,878,390.51	-	-119,878,390.51
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)	-	-305,727.39	-305,727.39
五、期末所有者权益(基金净值)	21,741,054.71	-	21,741,054.71

注:本基金基金合同生效日为2014年9月11日,因此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6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 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)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表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则》、《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。

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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间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 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。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本报告期内,本基金与关联方无股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本报告期内,本基金与关联方无权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本报告期内,本基金与关联方无债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

关联方名称	本期 2015年1月1日-2015年6月30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	490,800,000.00	100%

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	43,543.33
其中:应支付销售机构的客户维护费	5,862.30

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,194.98

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=前一日的基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.8.2.3 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 2015年1月1日-2015年6月30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
中原英石基金管理有限公司	235.53	963.70	1,199.23
中原证券股份有限公司	100.44	-	100.44
交通银行股份有限公司	7,369.30	-	7,369.30
合计	7,705.27	963.70	8,668.97

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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月30日	
	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)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	25, 185,042.77
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	7,000,000.00
期末持有的基金份额	-	18,185,042.77
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	100.00%

注:1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、本基金管理人按照本基金基金合同、招募说明书的约定费率进行认购、申购和赎回,不享有比其他投资人更优惠的费率。

6.4.8.4.2 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

本期末(2015年6月30日)及上年度末(2014年12月31日),其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5 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 2015年1月1日-2015年6月30日	
	期末余额	当期存款利息收入
交通银行股份有限公司	177,373.38	1,498.24

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,2015年1月1日至2015年6月30日止期间获得的备付金利息收入为人民币24,455.61元,2015年6月30日结算备付金余额为人民币2,343,891.26元。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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(2015年6月30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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末(2015年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30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。

6.4.10 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末发生变动。

2