

# 英大现金宝货币市场基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 26 日

## §1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 25 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	英大现金宝货币
交易代码	000912
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 10 日
报告期末基金份额总额	635,374,544.20 份
投资目标	本基金投资于固定收益类资产，在有效控制投资组合风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金投资策略将结合现金需求安排和货币市场利率预测，在保证基金资产安全性和流动性的基础上，获取较高的收益。
业绩比较基准	同期 7 天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	3,094,719.84
2. 本期利润	3,094,719.84
3. 期末基金资产净值	635,374,544.20

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

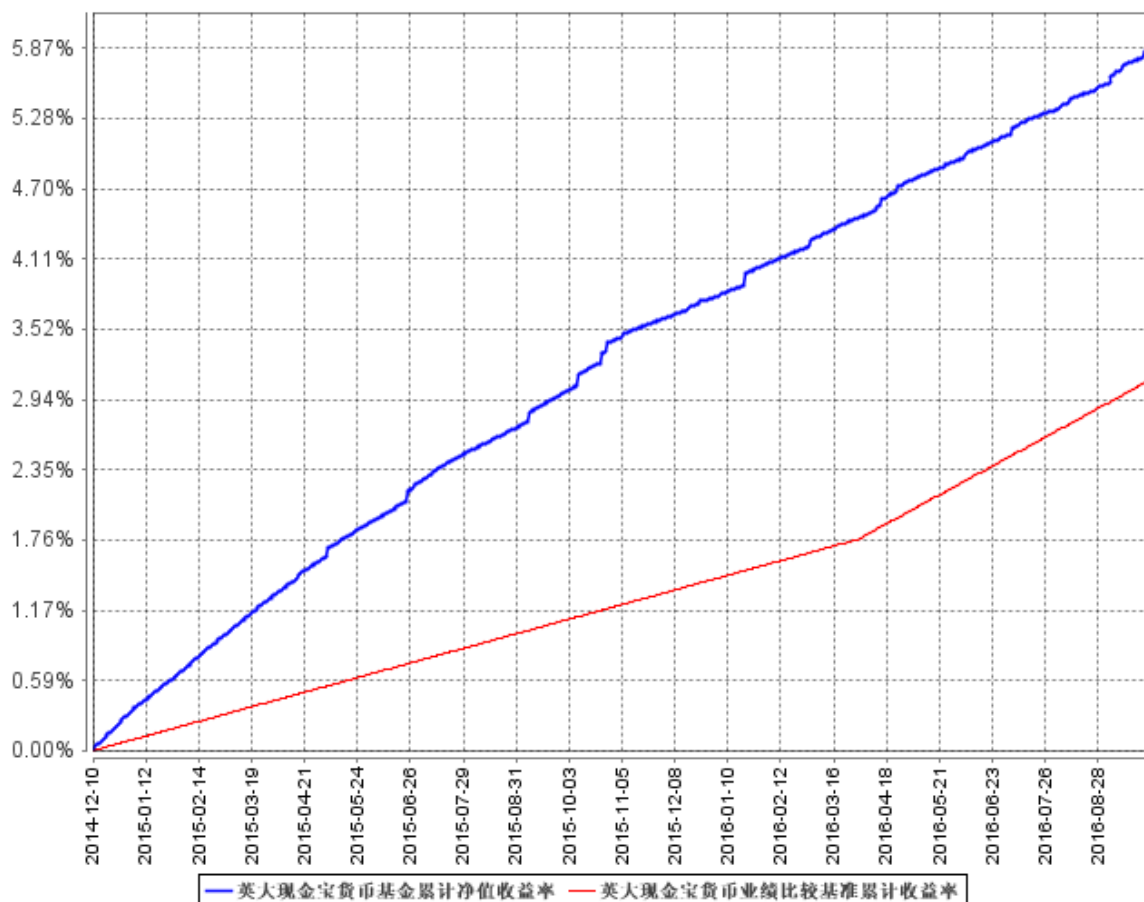
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

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	0.7049%	0.0087%	0.3403%	0.0000%	0.3646%	0.0087%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

英大现金宝货币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



## §4 管理人报告

### 4.1 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		
张琳娜	本基金基金经理	2014年12月10日	-	9	对外经济贸易大学金融学硕士，9年基金从业经历。先后任益民基金管理有限公司集中交易部交易员、副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限公司，曾任公司交易管理部副总经理（主持工作），现任固定收益部总经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《英大现金宝货币市场基金基金合同》、《英大现金宝货币市场基金招募说明书》的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过公司新上线的公平交易系统监测和人工复核等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在参与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%的情况，且不存在其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年三季度资金面保持了平稳的走势，但是出现了很多次偶发性资金紧张，央行保持了平抑资金波动的公开市场操作和定向工具的使用，尚未启动降准操作。从短端价格来看，机会仅出现在资金紧张时点。

本基金三季度调整了债券结构，维持了较高比例的短融占比，保持流动性的同时，收益较为稳定。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金本报告期的份额净值收益率为 0.7049%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	281,929,415.95	44.34
	其中：债券	281,929,415.95	44.34
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	348,001,602.00	54.73
	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	2,605,317.52	0.41
4	其他资产	3,301,748.51	0.52
5	合计	635,838,083.98	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

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	2.66	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	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

本基金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%。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 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	35
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	77
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	64.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	7.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	22.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	1.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	3.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.55	-

### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	29,860,305.14	4.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	252,069,110.81	39.67
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	281,929,415.95	44.37
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

**5.6 报告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**

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	011698495	16 龙源电力 SCP012	320,000	31,991,491.66	5.04
2	011699970	16 国航股 SCP007	250,000	25,033,136.84	3.94
3	011698014	16 中车 SCP002	250,000	25,031,691.87	3.94
4	011699392	16 南汇 SCP002	200,000	20,046,923.78	3.16
5	041562072	15 陆家嘴 CP001	200,000	20,014,485.57	3.15
6	011699215	16 沪华信 SCP001	200,000	19,998,371.91	3.15
7	071621006	16 渤海证券 CP006	200,000	19,997,969.55	3.15
8	011699453	16 新兴际华 SCP002	200,000	19,995,372.02	3.15
9	169927	16 贴现国债 27	200,000	19,906,368.01	3.13
10	011698071	16 巨石 SCP003	100,000	9,999,861.76	1.57

**5.7 “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	20
报告期内偏离度的最高值	0.4158%
报告期内偏离度的最低值	0.0491%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2128%

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

**5.8 报告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**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.9 投资组合报告附注****5.9.1**

本报告期内，未发现本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。



## 5.9.2 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,301,748.51
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,301,748.51

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,192,733,484.87
报告期期间基金总申购份额	1,412,552,101.47
报告期期间基金总赎回份额	1,969,911,042.14
报告期期末基金份额总额	635,374,544.20

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期末基金管理人未持有本基金份额。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会批准英大现金宝货币市场基金设立的文件

《英大现金宝货币市场基金基金合同》

《英大现金宝货币市场基金托管协议》

基金管理人业务资格批件和营业执照

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

## 9.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

英大基金管理有限公司  
2016 年 10 月 26 日