

英大现金宝货币市场基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 30 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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.....	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 其他指标.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	9
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.....	9
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 债券回购融资情况.....	37
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
8.6 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.....	39

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	40
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	40
8.9 投资组合报告附注	40
§9 基金份额持有人信息.....	41
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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的情况	42
§10 开放式基金份额变动.....	42
§11 重大事件揭示.....	42
11.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
11.4 基金投资策略的改变	43
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	44
11.9 其他重大事件	44
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	错误！未定义书签。
§13 备查文件目录.....	45
13.1 备查文件目录	45
13.2 存放地点	45
13.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	英大现金宝货币市场基金
基金简称	英大现金宝货币
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	562, 806, 153. 16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下, 追求超过业绩比较基准的投资收益。
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。

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		英大基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宗宽广	田青
	联系电话	010-59112066	010-67595096
	电子邮箱	zongkg@ydamc.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-890-5288	010-67595096
传真		010-59112222	010-66275853
注册地址		北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100020	100033
法定代表人		张传良	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ydamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层
注册登记机构	英大基金管理有限公司	北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201

§ 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	2016 年	2015 年	2014 年 12 月 10 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	13,529,564.66	5,526,539.33	842,251.45
本期利润	13,529,564.66	5,526,539.33	842,251.45
本期净值收益率	2.8404%	3.4743%	0.2970%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	562,806,153.16	733,186,126.71	256,264,852.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
累计净值收益率	6.7294%	3.7816%	0.2970%

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) 本基金无持有人认购\申购或交易基金的各项费用。

(3) 本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

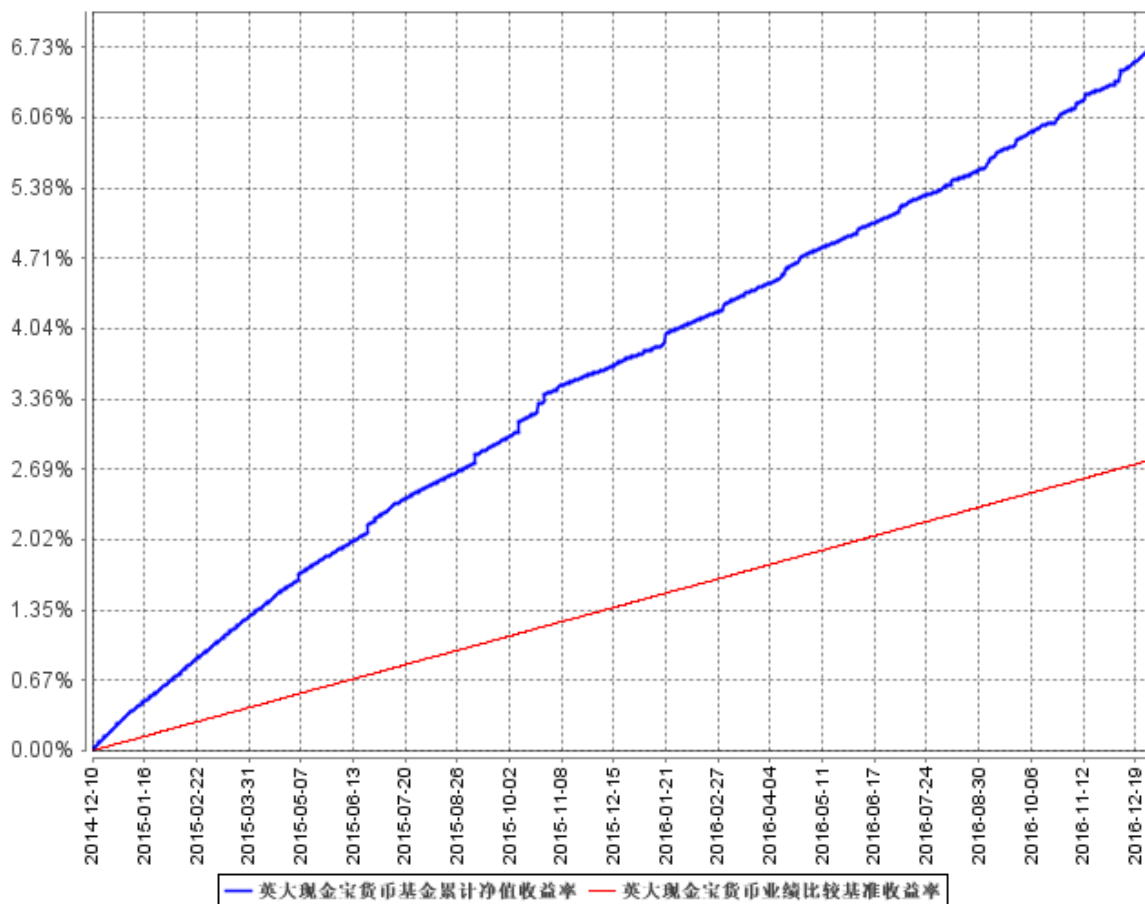
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.8114%	0.0093%	0.3403%	0.0000%	0.4711%	0.0093%
过去六个月	1.5221%	0.0090%	0.6805%	0.0000%	0.8416%	0.0090%
过去一年	2.8404%	0.0090%	1.3537%	0.0000%	1.4867%	0.0090%
自基金合同生效起至今	6.7294%	0.0091%	2.7851%	0.0000%	3.9443%	0.0091%

注：本基金成立于 2014 年 12 月 10 日，业绩比较基准是同期七天通知存款利率（税后）。

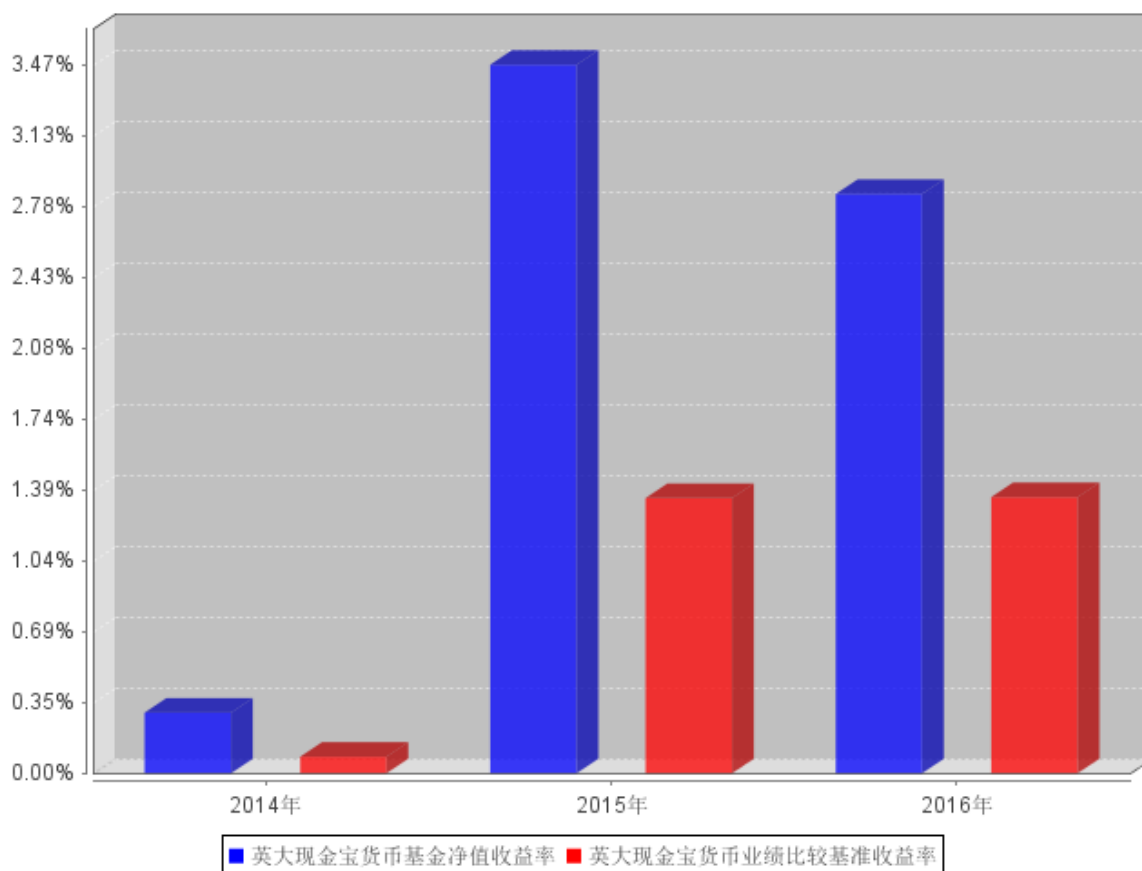
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

英大现金宝货币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对比图



注：本基金成立于 2014 年 12 月 10 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2016	13,431,875.60	-	97,689.06	13,529,564.66	
2015	5,533,742.91	-	-7,203.58	5,526,539.33	
2014	807,551.26	-	34,700.19	842,251.45	
合计	19,773,169.77	-	125,185.67	19,898,355.44	

§ 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

2012 年 8 月 17 日，经中国证监会批准，英大基金管理有限公司在北京正式成立。公司由英大国际信托有限责任公司（简称英大信托）、中国交通建设股份有限公司（简称中交股份）和航天科工财务有限责任公司（简称航天科工财务）三家股东发起成立。英大基金注册资金 2 亿元人民币，其中英大信托出资比例为 49%，中交股份出资比例为 36%，航天科工财务出资比例为 15%。

截至报告期末，本公司管理 7 只开放式证券投资基金，同时，管理多个特定客户资产投资组合。

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		
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。

注：①任职日期说明：基金经理的任职日期为基金合同生效的日期。

②证券从业年限的计算标准：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。

③本公司于 2017 年 3 月 6 日公告增聘易祺坤先生为该基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 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

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等国家法律法规和监管部门的规定，公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》，适用于公司所管理的全部公募基金、特定客户资产管理组合、社保基金、企业年金等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括公司的投资决策实行投资决策委员会领导下的基金经理/投资经理负责制，明确各自的投资权限，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，交易执行部门与投资决策部门严格分离，业绩与风险评估以数量分析为基础，对投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程，明确投资各环节的业务职责，防范投资风险。公司的所有投资组合共享公司统一的投资研究平台，投资研究团队使用同一研究报告系统，确保公募基金、特定客户资产管理组合等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括公司建立交易分配公平的内部控制流程，将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并确保公平交易可操作、可稽核、可持续。公司在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，以技术措施保障公平交易的实现。

监察稽核部定期对公司的不同投资组合（尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合）在连续四个季度期间内、不同时间窗下（1日内、3日内、5日内等）的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

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，通过系统和人工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违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 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

2016 年资金价格波动剧烈，由上半年的季度末资金紧张过渡到十一月末十二月的资金价格异常高企，央行增加公开市场操作力度和 MPA 考核一直左右市场走势。

本基金在 2016 年上半年保持了较高的债券占比，下半年切换至回购和存款占比提高，基本把握住了市场转变的方向和时间，在控制住产品持债信用风险的前提下，保持产品流动性，收益较为稳定。

4.4.2 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 2.8404%，同期业绩比较基准收益率为 2.0130%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场结构从 2016 年调整以来，监管层更多的注意到银行理财积累的风险，银行理财在市场中占比较大，监管政策的变化将左右银行理财的配置思路，更加左右着市场走向，叠加央行公开市场操作力度放大，各种政策工具更加丰富，对市场的控制较以往更加强烈，因此，总体判断 2017 年不确定性风险较大。

在操作上，我们更加倾向于灵活，选择顺势而为，增加流动性资产占比，提高持债信用等级，全年保持谨慎的投资策略，在保持产品流动性的同时，提高产品收益率水平。

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，本基金管理人管理的基金整体运作合法合规，依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度，在督察长的指导和监察稽核部的努力下，开展了一系列监察稽核工作。采取的主要措施如下：

1) 据国家法律法规的变化和公司业务发展的需要，按照规定程序对公司基本管理制度进行全面梳理，对内部控制大纲、风险控制制度等基本制度进行修订，进一步完善公司的内部控制体系；

2) 保持与监管机构的联系，以“守住三条底线”、防控内幕交易为基础，多次组织各业务条线学习最新的监管要求和法律法规，加强全体员工的合规和风险意识；

3) 监督检查基金资产运作，就资产运作的合法合规性和有效性进行独立、客观的分析，并向督察长汇报；

4) 根据监管机构的要求以及基金资产运作情况开展公司的监察稽核工作，出具监察稽核报告，

并按照规定程序上报督察长、公司董事和监管机构；

5) 对基金投资与专户投资的公平交易、异常交易情况进行分析，并出具交易分析报告；

6) 按照公司的内部管理制度开展反洗钱、反不正当竞争和商业贿赂、反内幕交易等工作，并按照公司《信息披露管理制度》的有关规定开展信息披露工作；

7) 对基金合同、宣传推介材料、涉及基金份额持有人和公司利益的对外言论等进行审查，并出具合规意见，有效防范风险，规避违法违规行为的发生；

8) 配合监管部门和外聘会计师事务所开展本基金的审计事务，并向公司员工提供法律咨询服务。

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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以电子形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后以电子签名形式返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会。估值委员会主任由主管运营公司领导担任，成员包括投资总监、基金经理，研究、交易、监察稽核部门负责人，基金运营部相关负责人。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自基金合同生效日起，本基金份额采用“每日分配，按日结转”的方式，即根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行结转。

本基金报告期内向份额持有人分配利润 13,529,564.66 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 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金报告期内向份额持有人分配利润 13,529,564.66 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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	瑞华审字【2017】01390113

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	英大现金宝货币市场基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的英大现金宝货币市场基金(以下简称“英大现金宝基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度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英大现金宝基金的基金管理人英大基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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。

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管理层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，上述英大现金宝基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了英大纯债基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	张琴	石文余
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：英大现金宝货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	45,644,772.14	2,447,899.19
结算备付金		-	577,142.86
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	139,993,314.21	259,743,850.55
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		139,993,314.21	259,743,850.55

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	368,697,073.05	465,001,657.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,564,608.98	5,846,440.93
应收股利		-	-
应收申购款		5,554,194.07	3,221.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		563,453,962.45	733,620,212.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		135,212.97	153,756.46
应付托管费		40,973.63	46,592.85
应付销售服务费		102,434.08	116,482.16
应付交易费用	7.4.7.7	15,961.84	11,716.20
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		125,185.67	27,496.61
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	228,041.10	78,041.10
负债合计		647,809.29	434,085.38
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	562,806,153.16	733,186,126.71
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		562,806,153.16	733,186,126.71
负债和所有者权益总计		563,453,962.45	733,620,212.09

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 562,806,153.16 份，基金份额净值 1.0000 元。

7.2 利润表

会计主体：英大现金宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入		17,670,477.67	7,032,563.51
1.利息收入		15,891,956.14	6,212,678.69
其中：存款利息收入	7.4.7.11	614,215.90	2,206,179.14
债券利息收入		9,449,096.75	2,321,032.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,828,643.49	1,685,467.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,778,521.53	819,884.82
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	1,778,521.53	819,884.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		4,140,913.01	1,506,024.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,700,640.81	592,579.20
2. 托管费	7.4.10.2.2	515,345.73	179,569.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,288,364.27	448,923.52
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		362,564.31	17,904.28
其中：卖出回购金融资产支出		362,564.31	17,904.28
6. 其他费用	7.4.7.20	273,997.89	267,047.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,529,564.66	5,526,539.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,529,564.66	5,526,539.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：英大现金宝货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	733,186,126.71	-	733,186,126.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,529,564.66	13,529,564.66
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）	-170,379,973.55	-	-170,379,973.55
其中：1. 基金申购款	3,610,423,322.22	-	3,610,423,322.22
2. 基金赎回款	-3,780,803,295.77	-	-3,780,803,295.77
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）	-	-13,529,564.66	-13,529,564.66
五、期末所有者权益（基金净值）	562,806,153.16	-	562,806,153.16
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	256,264,852.00	-	256,264,852.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,526,539.33	5,526,539.33
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）	476,921,274.71	-	476,921,274.71
其中：1. 基金申购款	981,026,547.21	-	981,026,547.21
2. 基金赎回款	-504,105,272.50	-	-504,105,272.50
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）	-	-5,526,539.33	-5,526,539.33
五、期末所有者权益（基金净值）	733,186,126.71	-	733,186,126.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

张传良
基金管理人负责人

赵照
主管会计工作负责人

刘伟娜
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

英大现金宝货币市场基金(以下简称“本基金”)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]927号《关于核准英大现金宝货币市场基金募集的批复》核准,由英大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大现金宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 361,961,464.66 元,已经瑞华会计师事务所验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《英大现金宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 12 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 361,983,745.08 份,本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大现金宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于货币市场工具,主要包括现金、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单和通知存款、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、期限在一年以内(含一年)的央行票据和债券回购、短期融资券,以及中国证监会、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。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他产品,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 41 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《英大现金宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注四中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2016 年 12 月 31 日的财务状况及 2016 年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。此外,本财务报表在所有重大方面符合中国证监会颁布的《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>》中

有关财务报表及其附注的披露要求。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且

本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。卖出股票、基金、债券等金融资产的成本按移动加权平均法逐日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其接近于公允价值。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，按银行实际利率逐日计提利息；

(2) 债券投资

基金持有的附息债券、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

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在回购期内逐日计提利息；

基金持有的买断式回购以成本列示，所产生的利息在回购期内逐日计提。回购期满，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) 其他

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；

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 0.5%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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 损益平准金

无。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金及适用利率逐日计提。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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采用合同利率）在回购期内逐日计提。

(2) 投资收益

债券投资收益于交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

(3) 其他收入

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时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 本基金的管理人报酬按照前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率逐日计提。
- (2) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率逐日计提。
- (3) 本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提。
- (4) 其他费用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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，自基金合同生效日起，份额采用“每日分配、按日结转”的方式，即根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行结转，当日收益均参与下一日的收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21 号《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》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定

期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

1、增值税

根据财政部、国家税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 号）的规定，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入，免征增值税。

2、企业所得税

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税 [2008]1 号）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。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局《关于证券投资基金有关税收问题的通知》（财税[1998]55 号）的规定，对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税，基金向个人投资者分配股息、红利、利息时，不再代扣个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、证监会《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有

关问题的通知》(财税[2012]85 号)和《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税[2015]101 号)的规定,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税;持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券(股票)交易印花税,调整为单边征税,即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	644,772.14	2,447,899.19
定期存款	45,000,000.00	-
其中:存款期限 1-3 个月	45,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计:	45,644,772.14	2,447,899.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2016 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	139,993,314.21	140,237,000.00	243,685.79	0.0433%
	合计	139,993,314.21	140,237,000.00	243,685.79	0.0433%
项目	上年度末 2015 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	259,743,850.55	260,496,700.00	752,849.45	0.1027%

	合计	259,743,850.55	260,496,700.00	752,849.45	0.1027%
--	----	----------------	----------------	------------	---------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本期末及上年度末，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 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	368,697,073.05	-
合计	368,697,073.05	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	465,001,657.50	-
合计	465,001,657.50	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本期末及上年度末，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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,032.15	1,632.30
应收定期存款利息	18,750.00	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	285.67
应收债券利息	2,816,932.45	5,176,651.49
应收买入返售证券利息	715,092.23	667,050.11
应收申购款利息	12,802.15	821.36
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	3,564,608.98	5,846,440.93

7.4.7.6 其他资产

注：本期末及上年度末，本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	15,961.84	11,716.20
合计	15,961.84	11,716.20

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	228,041.10	78,041.10
合计	228,041.10	78,041.10

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	733,186,126.71	733,186,126.71
本期申购	3,610,423,322.22	3,610,423,322.22
本期赎回(以“-”号填列)	-3,780,803,295.77	-3,780,803,295.77
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	562,806,153.16	562,806,153.16

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

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	13,529,564.66	-	13,529,564.66
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	-13,529,564.66	-	-13,529,564.66
本期末	-	-	-

注：本表涉及报告期内未分配利润的变动项目中，如为利润减少或亏损，以“-”号填列。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	50,997.63	35,521.21
定期存款利息收入	550,055.55	2,164,706.83
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,181.93	5,129.82
其他	11,980.79	821.28
合计	614,215.90	2,206,179.14

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	1,778,521.53	819,884.82
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	1, 778, 521. 53	819, 884. 82
----	-----------------	--------------

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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	2, 167, 713, 224. 42	203, 734, 437. 99
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	2, 148, 388, 205. 91	198, 354, 747. 55
减：应收利息总额	17, 546, 496. 98	4, 559, 805. 62
买卖债券差价收入	1, 778, 521. 53	819, 884. 82

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本期末及上年度末，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间收益金 额 2015年1月1日至2015 年12月31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	-

7.4.7.16 股利收益

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无公允价值变动收益。

7.4.7.18 交易费用

注：本报告期及上年度可比期间，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 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	150,000.00	150,000.00
中债登账户维护费	18,000.00	16,500.00
银行汇划费用	27,997.89	25,543.17
上清所账户维护费	18,000.00	15,000.00
其他费用	-	4.50
合计	273,997.89	267,047.67

7.4.7.20 分部报告

本报告期及上年度可比期间，本基金无分部报告。

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
英大基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
英大国际信托有限责任公司	对基金管理人具有重大影响的股东

注：①下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

②本报告期本基金关联方未发生变化。

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

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

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 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,700,640.81	592,579.20
其中：支付销售机构的客户维护费	41,587.11	33,521.38

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	515,345.73	179,569.51

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
英大基金管理有限公司	1,225,959.98
中国建设银行股份有限公司	55,333.15
合计	1,281,293.13
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
英大基金管理有限公司	393,965.62
中国建设银行股份有限公司	51,826.54
合计	445,792.16

注：本基金的年销售服务费率为 0.25%，基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

注：本报告期及上年度可比期间，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**

注：本报告期及上年度可比期间，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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
英大国际信托有限 责任公司	201,535,601.07	35.8100%	-	-

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 2016年1月1日至2016年12月31 日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有 限公司	644,772.14	50,997.63	2,447,899.19	35,521.21

注：本基金的活期银行存款由基金托管人建设银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期及上年度可比期间，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

本期末及上年度末，本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金**

金额单位：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
13,431,875.60	-	97,689.06	13,529,564.66	-

7.4.12 (2016 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

注：本基金本报告期末（2016 年 12 月 31 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末（2016 年 12 月 31 日）未持有需披露的暂时停牌股票。

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 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末及上年度末，本基金未持有交易所市场债券正回购。

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

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

7.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，建立债券投资库，同时追踪持仓债券发行人的相关风

险事件，以控制可能出现的信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	39,984,430.46	222,620,540.26
A-1 以下	-	-
未评级	60,002,742.18	-
合计	99,987,172.64	222,620,540.26

注：表中列示的未评级债券投资为超短期融资券。

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	40,006,141.57	37,123,310.29
合计	40,006,141.57	37,123,310.29

注：表中列示的未评级债券投资为国家债券、央行票据及国家政策性金融债。

7.4.13.3 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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，均能够及时变现。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债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。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。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	45,644,772.14	-	-	-	-	-	45,644,772.14
交易性金融资产	90,024,009.23	19,984,381.09	29,984,923.89	-	-	-	139,993,314.21
买入返售金融资产	368,695,000.00	-	-	-	-	2,073.05	368,697,073.05
应收利息	-	-	-	-	-	3,564,608.98	3,564,608.98
应收申购款	29,059,000.00	-	-	-	-	-23,504,805.93	5,554,194.07
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	533,422,781.37	19,984,381.09	29,984,923.89	-	-	-19,938,123.90	563,453,962.45
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	135,212.97	135,212.97
应付托管费	-	-	-	-	-	40,973.63	40,973.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	102,434.08	102,434.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,961.84	15,961.84
应付利润	-	-	-	-	-	125,185.67	125,185.67
其他负债	-	-	-	-	-	228,041.10	228,041.10
负债总计	-	-	-	-	-	647,809.29	647,809.29
利率敏感度缺口	533,422,781.37	19,984,381.09	29,984,923.89	-	-	-20,585,933.19	562,806,153.16

上年度末 2015 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	2,447,899.19	-	-	-	-	-	2,447,899.19
结算备付金	577,142.86	-	-	-	-	-	577,142.86
交易性金融 资产	130,465,793.05	57,239,208.23	72,038,849.27	-	-	-	259,743,850.55
买入返售金 融资产	465,000,000.00	-	-	-	-	-	465,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	5,846,440.93	5,846,440.93
应收申购款	30,000,000.00	-	-	-	-	-29,996,778.94	3,221.06
其他资产	-	-	-	-	-	1,657.50	1,657.50
资产总计	628,490,835.10	57,239,208.23	72,038,849.27	-	-	-24,148,680.51	733,620,212.09
负债							
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	153,756.46	153,756.46
应付托管费	-	-	-	-	-	46,592.85	46,592.85
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	116,482.16	116,482.16
应付交易费 用	-	-	-	-	-	11,716.20	11,716.20
应付利润	-	-	-	-	-	27,496.61	27,496.61
其他负债	-	-	-	-	-	78,041.10	78,041.10
负债总计	-	-	-	-	-	434,085.38	434,085.38
利率敏感 度缺口	628,490,835.10	57,239,208.23	72,038,849.27	-	-	-24,582,765.89	733,186,126.71

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产公允价值产生的影响。在“影子定价”机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产公允价值不会发生重大变动。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要是市场价格风险，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，且以摊余成本进行后续计量，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价格风险进行监控，因此无重大市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	140,237,000.00	24.92	260,496,700.00	35.53
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	140,237,000.00	24.92	260,496,700.00	35.53

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	139,993,314.21	24.85
	其中：债券	139,993,314.21	24.85
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	368,697,073.05	65.44
	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	45,644,772.14	8.10
4	其他各项资产	9,118,803.05	1.62
5	合计	563,453,962.45	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	2.51

	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2016 年 4 月 6 日	31.02	大额赎回	1 天
2	2016 年 4 月 8 日	20.26	大额赎回	3 天
3	2016 年 4 月 9 日	20.26	大额赎回	2 天
4	2016 年 4 月 10 日	20.26	大额赎回	1 天
5	2016 年 4 月 12 日	29.53	大额赎回	1 天
6	2016 年 10 月 20 日	23.71	大额赎回	1 天

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	18
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
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：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 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	89.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	3.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	1.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	98.49	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

8.5 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	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	40,006,141.57	7.11
	其中：政策性金融债	40,006,141.57	7.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	99,987,172.64	17.77
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	139,993,314.21	24.87
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

8.6 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	011699633	16 京能集 SCP002	200,000	20,020,408.83	3.56
2	140201	14 国开 01	200,000	20,008,382.06	3.56
3	071621007	16 渤海证券	200,000	19,997,850.12	3.55

		CP007			
4	160401	16 农发 01	200,000	19,997,759.51	3.55
5	011698958	16 沪华信 SCP005	100,000	10,000,448.21	1.78
6	041662004	16 鲁宏桥 CP002	100,000	9,999,608.71	1.78
7	011698065	16 中融新大 SCP004	100,000	9,997,961.91	1.78
8	011697002	16 南航股 SCP012	100,000	9,997,409.46	1.78
9	041660013	16 百业源 CP001	100,000	9,986,971.63	1.77
10	011698129	16 中航租赁 SCP004	100,000	9,986,513.77	1.77

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

8.7 “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	22
报告期内偏离度的最高值	0.4158%
报告期内偏离度的最低值	-0.0095%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1428%

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不存在偏离度绝对值在 0.25%（含）以上的情况。

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不存在偏离度绝对值在 0.5%（含）以上的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本期末本基金未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.0000 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限按实际利率法摊销，每日计提收益或损失。

8.9.2

本期内未发现本基金投资的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。

8.9.3 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	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,564,608.98
4	应收申购款	5,554,194.07
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,118,803.05

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§ 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

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
6,460	87,121.70	454,935,891.60	80.83%	107,870,261.56	19.17%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	842,596.27	0.1497%

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的情况

项目	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 12 月 10 日）基金份额总额	361,983,745.08
本报告期期初基金份额总额	733,186,126.71
本报告期基金总申购份额	3,610,423,322.22
减:本报告期基金总赎回份额	3,780,803,295.77
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	562,806,153.16

§ 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

本报告期内，基金管理人于 2016 年 3 月 17 日发布公告，宗宽广先生自 2016 年 3 月 16 日起担任英大基金管理有限公司督察长，副总经理赵照先生自 2016 年 3 月 16 日起不再代任督察长职务。相关变更事项已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

本报告期内，基金管理人于 2016 年 9 月 5 日发布公告，杨峰先生自 2016 年 9 月 2 日起不再担任英大基金管理有限公司总经理职务，董事长张传良先生自 2016 年 9 月 2 日起代任总经理职务。相关变更事项已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

本报告期内，本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

本报告期内无涉及本基金管理人、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

报告期内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

报告期内本基金未变更为本基金审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用人民币 60,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 年。

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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 公司财务状况良好，经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iii 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究质量评价进行评估：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的行业研究的前瞻性、深度及广度进行评估，初步划定范围；

ii 对交易单元候选券商的研究服务进行评估：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和服务效果进行估，确定选用交易单元的券商。

iii 协议签署及通知托管人 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本表“佣金”指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易合计支付该等券商的佣金合计。

11.7.2 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
中信证券	-	-	114,131,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在 0.5%（含）以上的情况。

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	英大基金关于旗下基金 2015 年年度最后一个市场交易日资产净值的公告	《中国证券报》及公司网站	2016 年 1 月 1 日
2	英大现金宝货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》及公司网站	2016 年 1 月 22 日
3	英大现金宝货币市场基金招募说明书更新及摘要	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》及公司网站	2016 年 1 月 25 日
4	英大现金宝货币市场基金 2016 年春节假期暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》及公司网站	2016 年 2 月 4 日
5	英大基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》及公司网站	2016 年 3 月 17 日
6	英大现金宝货币市场基金 2015 年年度报告及摘要	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》及公司网站	2016 年 3 月 30 日
7	英大现金宝货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》及公司网站	2016 年 4 月 21 日
8	英大基金关于旗下基金 2016 年半年度最后一个市场交易日资产净值的公告	《中国证券报》及公司网站	2016 年 7 月 1 日
9	英大现金宝货币市场基金 2016 年第 2 季度报告	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》及公司网站	2016 年 7 月 19 日
10	英大现金宝货币市场基金招募说明书更新及摘要	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》及公司网站	2016 年 7 月 22 日
11	英大现金宝货币市场基金 2016 年半年度报告及摘要	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》及公司网站	2016 年 8 月 25 日
12	英大基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《中国证券报》及公司网站	2016 年 9 月 6 日

13	关于英大现金宝货币市场基金 2016 年国庆节前暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》《证券时报》 《上海证券报》及公司网站	2016 年 9 月 27 日
14	英大现金宝货币市场基金 2016 年第 3 季度报告	《中国证券报》《证券时报》 《上海证券报》及公司网站	2016 年 10 月 26 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 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招募说明书》

《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

报告期内在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：<http://www.ydamc.com/>

英大基金管理有限公司
2017 年 3 月 31 日