

英大现金宝货币市场基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	441,161,036.40 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

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	http://www.ydamc.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公

	地址
--	----

§ 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	9,871,325.92
本期利润	9,871,325.92
本期净值收益率	1.8193%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	441,161,036.40
期末基金份额净值	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

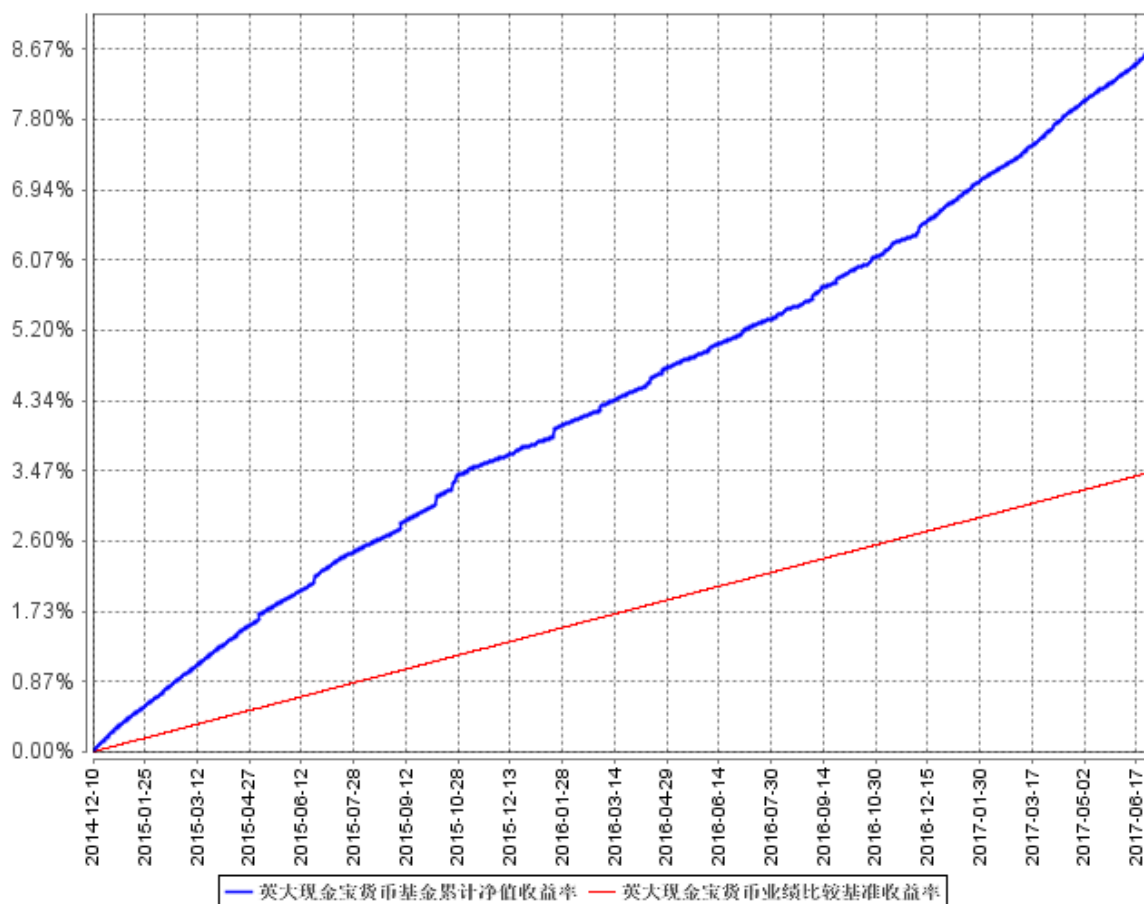
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.3308%	0.0035%	0.1110%	0.0000%	0.2198%	0.0035%
过去三个月	0.9493%	0.0035%	0.3366%	0.0000%	0.6127%	0.0035%
过去六个月	1.8193%	0.0035%	0.6695%	0.0000%	1.1498%	0.0035%
过去一年	3.3691%	0.0069%	1.3500%	0.0000%	2.0191%	0.0069%
自基金合同生效起至今	8.6711%	0.0083%	3.4545%	0.0000%	5.2166%	0.0083%

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



§ 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）	证券从业年	说明
----	----	---------------	-------	----

		期限		限	
		任职日期	离任日期		
易祺坤	本基金基金经理	2017 年 3 月 2 日	-	5	北京大学理学学士，5 年以上证券从业经历。2011 年 8 月至 2013 年 8 月就职于寰富投资咨询(上海)有限公司，任衍生品交易员。2013 年 10 月加入英大基金管理有限公司，历任公司交易管理部交易员和交易管理部副总经理(主持工作)。
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：基金经理张琳娜的任职日期为基金合同生效的日期，基金经理易祺坤的任职日期为该基金经理经监管机构审核通过后公司公开披露的日期。

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本基金无基金经理助理。

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。

4.3.2 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非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

2017 年上半年从数据来看宏观经济增速略有上升、CPI 企稳、年内通胀无忧，监管层去杠杆政策持续发力，央行维持中性偏紧的货币政策基调，债券市场收益率震荡上行；同时，2017 年以来信用风险事件频发，成为扰动债券市场的因素之一。

本基金上半年调整了债券结构，增加了高评级短融和存单的投资，保持流动性的同时，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 1.8193%，同期业绩比较基准收益率为 0.6696%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，在美联储持续稳步加息并预计下半年开始收缩资产负债表，欧央行、日央行持续表态结束宽松货币政策的外部背景环境下，央行将在金融去杠杆和经济基本面复苏乏力之间保持动态平衡，货币政策料将维持中性偏紧但边际宽松的状态。2017 年三季度债券市场最大的不确定性在于监管层有关去杠杆政策口径的反复以及资金面的松紧。

结合我们目前的持仓，展望 2017 年三季度，本基金将持续关注经济基本面、监管动向和央行的后续操作，保持适度的组合久期，在流动性风险可控的前提下，力争为持有人持续实现理想的回报。

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。

4.7 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 9,871,325.92 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 9,871,325.92 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

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		11,175,714.22	45,644,772.14
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		388,811,570.56	139,993,314.21
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		388,811,570.56	139,993,314.21
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		119,007,858.51	368,697,073.05
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,582,857.88	3,564,608.98
应收股利		-	-
应收申购款		147,332.01	5,554,194.07
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		521,725,333.18	563,453,962.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		79,999,760.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		122,626.28	135,212.97
应付托管费		37,159.46	40,973.63
应付销售服务费		92,898.65	102,434.08
应付交易费用		22,804.94	15,961.84
应交税费		-	-
应付利息		5,932.05	-
应付利润		100,935.95	125,185.67
递延所得税负债		-	-
其他负债		182,179.45	228,041.10
负债合计		80,564,296.78	647,809.29
所有者权益：			
实收基金		441,161,036.40	562,806,153.16
未分配利润		-	-
所有者权益合计		441,161,036.40	562,806,153.16
负债和所有者权益总计		521,725,333.18	563,453,962.45

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，英大现金宝货币基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 441,161,036.40 份。

6.2 利润表

会计主体：英大现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		12,488,411.47	9,198,079.92
1.利息收入		12,408,087.37	8,116,551.47
其中：存款利息收入		813,137.85	522,504.16
债券利息收入		6,978,408.05	5,506,970.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,616,541.47	2,087,076.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		80,324.10	1,081,528.45
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		80,324.10	1,081,528.45
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、费用		2,617,085.55	2,275,056.20
1. 管理人报酬		917,649.81	906,843.33
2. 托管费		278,075.64	274,801.04
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	695,189.17	687,002.70
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		586,068.53	268,108.41
其中：卖出回购金融资产支出		586,068.53	268,108.41
6. 其他费用		140,102.40	138,300.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,871,325.92	6,923,023.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,871,325.92	6,923,023.72

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	562,806,153.16	-	562,806,153.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	9,871,325.92	9,871,325.92
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）	-121,645,116.76	-	-121,645,116.76

其中：1.基金申购款	655,902,110.93	-	655,902,110.93
2.基金赎回款	-777,547,227.69	-	-777,547,227.69
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）	-	-9,871,325.92	-9,871,325.92
五、期末所有者权益（基金净值）	441,161,036.40	-	441,161,036.40
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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）	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（本期净利润）	-	6,923,023.72	6,923,023.72
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）	459,547,358.16	-	459,547,358.16
其中：1.基金申购款	1,782,369,780.04	-	1,782,369,780.04
2.基金赎回款	-1,322,822,421.88	-	-1,322,822,421.88
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）	-	-6,923,023.72	-6,923,023.72
五、期末所有者权益（基金净值）	1,192,733,484.87	-	1,192,733,484.87

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：

朱志
基金管理人负责人

朱志
主管会计工作负责人

耿义辉
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 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。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况及 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止期间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。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报告所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

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

本基金本报告期不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。

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
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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2017年1月1日至2017年6月	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
----	-------------------------	---------------------------------

	30日	
当期发生的基金应支付的管理费	917,649.81	906,843.33
其中：支付销售机构的客户维护费	84,962.74	10,893.25

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	278,075.64	274,801.04

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。

6.4.8.2.3 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 2017年1月1日至2017年6月30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	562,370.48
中国建设银行股份有限公司	112,902.13
合计	675,272.61
获得销售服务费	上年度可比期间

各关联方名称	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	667,444.72
中国建设银行股份有限公司	16,801.24
合计	684,245.96

注：本基金的年销售服务率为 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。

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。

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

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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	205,200,662.20	46.5100%	201,535,601.07	35.8100%

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	1,175,714.22	21,507.21	5,713,604.36	20,790.72
--------------	--------------	-----------	--------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2017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

本基金本期末（2017年6月30日）未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末（2017年6月30日）未持有需披露的暂时停牌股票。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为79,999,760.00元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111711210	17 平安银行 CD210	2017 年 7 月 3 日	99.30	200,000	19,860,773.09
111719156	17 恒丰银行 CD156	2017 年 7 月 3 日	99.30	200,000	19,859,322.04
011697010	16 沪华信 SCP006	2017 年 7 月 3 日	100.27	200,000	20,054,471.66
111796473	17 天津农村商业银行 CD138	2017 年 7 月 3 日	99.69	200,000	19,938,368.85
合计				800,000	79,712,935.64

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

6.4.10 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	388,811,570.56	74.52
	其中: 债券	388,811,570.56	74.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	119,007,858.51	22.81
	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	11,175,714.22	2.14
4	其他各项资产	2,730,189.89	0.52
5	合计	521,725,333.18	100.00

7.2 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	8.09	
	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	79,999,760.00	18.13
	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

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	2017 年 2 月 27 日	23.25	大额赎回	1 天
2	2017 年 6 月 14 日	20.14	大额赎回	1 天

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	80
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	16

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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。

7.3.2 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	43.09	18.13
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	22.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	33.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	2.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	15.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	117.64	18.13

7.4 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。

7.5 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	50,062,898.82	11.35

	其中：政策性金融债	50,062,898.82	11.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	160,026,240.94	36.27
6	中期票据	-	-
7	同业存单	178,722,430.80	40.51
8	其他	-	-
9	合计	388,811,570.56	88.13
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。

7.6 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	150201	15 国开 01	300,000	30,089,136.97	6.82
2	011756013	17 中航租赁 SCP001	300,000	30,000,935.95	6.80
3	011698568	16 同方 SCP005	300,000	29,999,542.80	6.80
4	111719021	17 恒丰银行 CD021	300,000	29,821,172.86	6.76
5	011697010	16 沪华信 SCP006	200,000	20,054,471.66	4.55
6	111796473	17 天津农村商业银行 CD138	200,000	19,938,368.85	4.52
7	111711210	17 平安银行 CD210	200,000	19,860,773.09	4.50
8	111719156	17 恒丰银行 CD156	200,000	19,859,322.04	4.50
9	150207	15 国开 07	100,000	10,037,009.68	2.28
10	011758034	17 广州金融 SCP001	100,000	10,000,023.31	2.27

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1130%
报告期内偏离度的最低值	-0.0107%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0322%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

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

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。

7.8 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（2017 年 6 月 30 日），本基金未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

本期内未发现本基金投资的前十名证券的其他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。

7.9.3 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	2,582,857.88
4	应收申购款	147,332.01
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,730,189.89

7.9.4 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
6,736	65,493.03	337,616,070.82	76.53%	103,544,965.58	23.47%

8.3 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	1,433,856.38	0.3250%

8.4 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

§ 9 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	562,806,153.16
本报告期基金总申购份额	655,902,110.93

减:本报告期基金总赎回份额	777,547,227.69
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	441,161,036.40

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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 2017 年 6 月 15 日发布公告,孔旺先生自 2017 年 6 月 14 日起担任英大基金管理有限公司董事长,张传良先生自 2017 年 6 月 14 日起不再担任董事长职务。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 2017 年 6 月 15 日发布公告,孔旺先生自 2017 年 6 月 14 日起担任英大基金管理有限公司总经理,张传良先生自 2017 年 6 月 14 日起不再担任总经理职务。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,基金管理人于 2017 年 3 月 6 日发布公告,易祺坤先生自 2017 年 3 月 2 日起担任英大基金管理有限公司英大现金宝货币市场基金基金经理。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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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效果进行评估，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。

10.7.2 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	-	-	6,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

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 影响投资者决策的其他重要信息**11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况**

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017. 1. 13- 2017. 4. 6	0.00	349,000,000.00	349,922,053.29	0.00	0.00
	2	2017. 1. 1- 2017. 6. 30	201,535,601.07	0.00	0.00	205,200,662.20	46.51
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

英大基金管理有限公司
2017 年 8 月 29 日