

# 英大现金宝货币市场基金 2017 年年度报告

2017 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：2018 年 3 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 2018 年 3 月 29 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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 债券回购融资情况.....	46
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	47
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.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	49

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 .....	49
8.9 投资组合报告附注 .....	49
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	51
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
9.4 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 .....	52
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
11.4 基金投资策略的改变 .....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	56
11.9 其他重大事件 .....	56
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
12.1 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 .....	58
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
13.1 备查文件目录 .....	59
13.2 存放地点 .....	59
13.3 查阅方式 .....	59

## § 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	593,424,572.98 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	朱志	田青
	联系电话	010-59112189	010-67595096
	电子邮箱	zhuzhi@ydamc.com	tianqing1.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	孔旺	田国立

## 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	<a href="http://www.ydamc.com">http://www.ydamc.com</a>
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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	22,023,558.82	13,529,564.66	5,526,539.33
本期利润	22,023,558.82	13,529,564.66	5,526,539.33
本期净值收益率	3.8400%	2.8404%	3.4743%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末基金资产净值	593,424,572.98	562,806,153.16	733,186,126.71
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
累计净值收益率	10.8278%	6.7294%	3.7816%

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

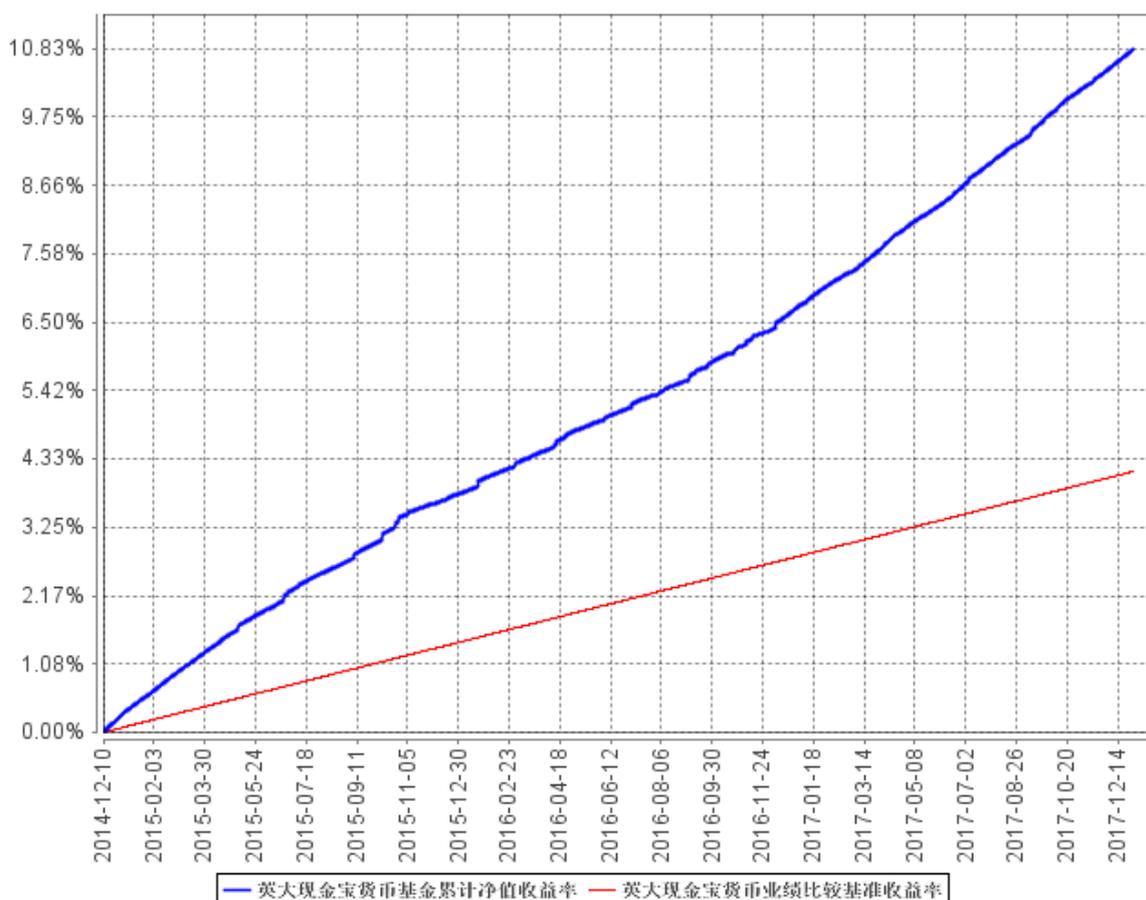
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.9646%	0.0037%	0.3403%	0.0000%	0.6243%	0.0037%
过去六个月	1.9846%	0.0046%	0.6805%	0.0000%	1.3041%	0.0046%
过去一年	3.8400%	0.0041%	1.3500%	0.0000%	2.4900%	0.0041%
过去三年	10.4997%	0.0079%	4.0537%	0.0000%	6.4460%	0.0079%
自基金合同生效起至今	10.8278%	0.0079%	4.1351%	0.0000%	6.6927%	0.0079%

注：①本基金合同于 2014 年 12 月 10 日生效；

②本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

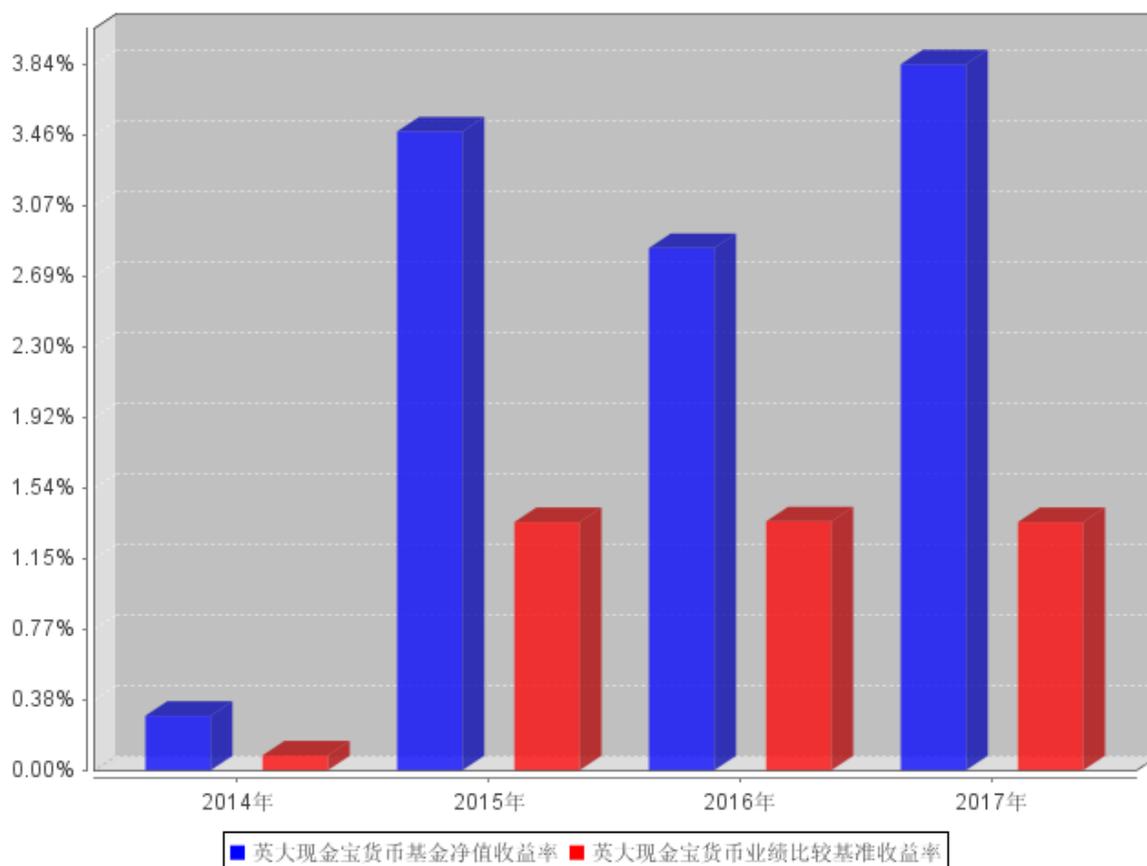
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 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
2017	21,945,895.81	-	77,663.01	22,023,558.82	
2016	13,431,875.60	-	97,689.06	13,529,564.66	
2015	5,533,742.91	-	-7,203.58	5,526,539.33	
合计	40,911,514.32	-	168,148.49	41,079,662.81	

## § 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 2017 年 12 月 31 日，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		
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）。现任固定收益部基金经理。
张琳娜	本基金基	2014 年 12 月	2017 年 12 月 29 日	9	对外经济贸易大学

	金经理、 固定收益 部总经理	10 日			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）、固定收益部总经理。
--	----------------------	------	--	--	--

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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合规守信情况的说明

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/专户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 年供给侧改革持续发力，宏观经济企稳，全年 GDP 增速 6.9%，超过市场预期，CPI 企稳，PPI 边际回落，整体基本面表现不弱。政策面方面，去杠杆政策频频发力，央行为配合强监管维持中性偏紧的货币政策基调，公开市场操作“削峰填谷”，债券市场收益率大幅上行，收益率曲线平坦化；同时，2017 年全年信用风险事件频发，成为扰动债券市场的重要因素之一。

本基金全年对持仓组合的平均剩余期限和杠杆控制较为稳健，在高等级信用债、同业存款、同业存单和质押式回购之间灵活调整配置比例，在保证产品流动性的同时，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 3.8400%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，在 2017 年高基数因素和债券市场大幅调整导致实体经济融资利率上行的影响下，经济基本面存在边际走弱倾向。美联储持续稳步加息并收缩资产负债表，欧央行、日央行亦将退出宽松货币政策，央行将在金融去杠杆、维持汇率稳定和经济基本面复苏乏力之间保持动态平衡，货币政策料将保持稳健中性。预计 2018 年债券市场长端维持高位震荡，短端跟随资金面波动，信用利差和等级利差存在走阔压力。

结合我们目前的持仓，展望 2018 年，本基金将持续关注央行货币政策、公开市场操作以及资金面走势，择机灵活配置短期货币市场工具，在保持产品流动性的前提下，力争为持有人持续实现稳定的回报。

#### 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) 根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。

(9)组织对公司在报告期内离职的基金经理进行离任审查。

#### **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 22,023,558.82 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 22,023,558.82 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【2018】01390021 号

### 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
审计意见	<p>我们审计了英大现金宝货币市场基金（以下简称“英大现金宝基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附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，公允反映了英大现金宝基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于英大现金宝基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>英大现金宝基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的	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（以下

责任	<p>简称管理层)负责按照企业会计准则和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,使其实现公允反映,并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估英大现金宝基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非管理层计划清算英大现金宝基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序。</p> <p>(三)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对英大领先回报基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获</p>

	<p>得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致英大领先回报基金不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> <p>我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明，并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项，以及相关的防范措施。</p>
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张琴   束成林
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	2018 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	373,900.96	45,644,772.14
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	505,065,088.55	139,993,314.21
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		505,065,088.55	139,993,314.21
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	114,235,691.36	368,697,073.05
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	4,492,316.24	3,564,608.98
应收股利		-	-
应收申购款		80,576.00	5,554,194.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	9.50	-
资产总计		624,247,582.61	563,453,962.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
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		29,969,835.04	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		184,131.76	135,212.97
应付托管费		55,797.48	40,973.63
应付销售服务费		139,493.76	102,434.08
应付交易费用	7.4.7.7	26,336.11	15,961.84
应交税费		-	-
应付利息		16,516.20	-
应付利润		202,848.68	125,185.67
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	228,050.60	228,041.10
负债合计		30,823,009.63	647,809.29
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	593,424,572.98	562,806,153.16
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		593,424,572.98	562,806,153.16
负债和所有者权益总计		624,247,582.61	563,453,962.45

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 593,424,572.98 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		27,765,795.26	17,670,477.67
1. 利息收入		27,400,994.97	15,891,956.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,046,173.53	614,215.90
债券利息收入		16,734,941.35	9,449,096.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,619,880.09	5,828,643.49
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		364,800.29	1,778,521.53
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	364,800.29	1,778,521.53
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		5,742,236.44	4,140,913.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,953,637.50	1,700,640.81
2. 托管费	7.4.10.2.2	592,011.31	515,345.73
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,480,028.31	1,288,364.27
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		1,436,520.49	362,564.31
其中：卖出回购金融资产支出		1,436,520.49	362,564.31

6. 其他费用	7. 4. 7. 20	280, 038. 83	273, 997. 89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22, 023, 558. 82	13, 529, 564. 66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22, 023, 558. 82	13, 529, 564. 66

### 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	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（本期利润）	-	22, 023, 558. 82	22, 023, 558. 82
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）	30, 618, 419. 82	-	30, 618, 419. 82
其中：1. 基金申购款	1, 710, 690, 154. 67	-	1, 710, 690, 154. 67
2. 基金赎回款	-1, 680, 071, 734. 85	-	-1, 680, 071, 734. 85
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）	-	-22, 023, 558. 82	-22, 023, 558. 82
五、期末所有者权益（基金净值）	593, 424, 572. 98	-	593, 424, 572. 98

项目	上年度可比期间		
	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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

\_\_\_\_\_  
苗强

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 42 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况及 2017 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

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。

##### 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 基金持有的付息债券、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试用利率逐日计提。

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

股票投资收益于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

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。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### (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的时候确认。

#### 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，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告【2017】13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	373,900.96	644,772.14
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：	373,900.96	45,644,772.14

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 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	505,065,088.55	505,073,500.00	8,411.45	0.0014%
	合计	505,065,088.55	505,073,500.00	8,411.45	0.0014%
项目		上年度末 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%

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 2017 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	114,235,691.36	-
合计	114,235,691.36	-
项目	上年度末 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	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,025.13	1,032.15
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	-	-
应收债券利息	4,121,843.31	2,816,932.45
应收买入返售证券利息	353,052.10	715,092.23
应收申购款利息	14,395.70	12,802.15
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-

合计	4,492,316.24	3,564,608.98
----	--------------	--------------

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
其他应收款	9.50	-
待摊费用	-	-
合计	9.50	-

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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	26,336.11	15,961.84
合计	26,336.11	15,961.84

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
其他应付款	9.50	-
预提费用	228,041.10	228,041.10
合计	228,050.60	228,041.10

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	562,806,153.16	562,806,153.16
本期申购	1,710,690,154.67	1,710,690,154.67
本期赎回(以“-”号填列)	-1,680,071,734.85	-1,680,071,734.85
- 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	593,424,572.98	593,424,572.98

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	22,023,558.82	-	22,023,558.82
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	-22,023,558.82	-	-22,023,558.82
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	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	32,724.39	50,997.63
定期存款利息收入	1,011,291.67	550,055.55
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	563.92	1,181.93
其他	1,593.55	11,980.79
合计	1,046,173.53	614,215.90

#### 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

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 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	364,800.29	1,778,521.53
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	364,800.29	1,778,521.53

##### 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 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
卖出债券(债转股及债券到 期兑付)成交总额	2,099,299,293.01	2,167,713,224.42
减:卖出债券(债转股及债 券到期兑付)成本总额	2,083,927,469.87	2,148,388,205.91
减:应收利息总额	15,007,022.85	17,546,496.98
买卖债券差价收入	364,800.29	1,778,521.53

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

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

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

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

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

本报告期及上年度可比期间,本基金无其他衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

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

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

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 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	18,000.00
银行汇划费用	33,638.83	27,997.89
上清所账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他费用	400.00	-
合计	280,038.83	273,997.89

#### 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	基金管理人的股东

中国交通建设股份有限公司	基金管理人的股东
航天科工财务有限责任公司	基金管理人的股东
深圳英大资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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

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

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

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

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

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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,953,637.50	1,700,640.81
其中：支付销售机构的客户维护费	194,548.03	41,587.11

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	592,011.31	515,345.73

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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	1,169,250.62
中国建设银行股份有限公司	268,753.83
合计	1,438,004.45
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 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

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

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自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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		上年度末	
	2017 年 12 月 31 日		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	209,249,193.64	35.2600%	201,535,601.07	35.8100%
深圳英大资本管 理有限公司	52,124,827.78	8.7800%	0.00	0.0000%

**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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	373,900.96	32,724.39	644,772.14

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**

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**

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
21,945,895.81	-	77,663.01	22,023,558.82	-

**7.4.12 ( 2017 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**

本基金本报告期末(2017 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**

本基金本报告期末(2017 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 2017 年 12 月 31 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 29,969,835.04 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
011760044	17 晋煤 SCP004	2018 年 1 月 4 日	100.04	300,000	30,010,899.40
合计				300,000	30,010,899.40

#### 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	19,997,906.19	39,984,430.46
A-1 以下	-	-
未评级	160,000,505.30	60,002,742.18
合计	179,998,411.49	99,987,172.64

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告，以上按短期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。表中列示的未评级债券为超短期融资券。

**7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本报告期内无按长期信用评级列示的债券投资。

长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

**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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，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的债券资产的公允价值。

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。

**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

在投资端，报告期末，本基金主要持有政策性金融债、短期融资券、银行同业存单、逆回购和现金资产，在持有债券不发生重大违约事件、逆回购交易对手不发生交收违约及不发生重大系统性资金短缺的情况下，除应收利息和逆回购按约定期限变现外，其余各项资产均具有良好的市

场流动性，报告期末 7 个交易日可变现资产占净值比例 96%。

在份额端，报告期末，本基金第一大份额持有人持有份额占比 35.26%，前十大份额持有人持有份额占比合计 82.27%，存在单一机构巨额赎回的可能性。在发生巨额赎回时，本基金将在维护存量持有人和申请赎回持有人利益公平的原则下，审慎确认赎回申请，适当使用《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》中规定的流动性风险管理工具，防范流动性风险发生。

#### 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 2017 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	373,900.96	-	-	-	-	-	373,900.96
交易性金融 资产	286,392,078.76	79,689,976.49	138,983,033.30	-	-	-	505,065,088.55
买入返售金 融资产	114,235,691.36	-	-	-	-	-	114,235,691.36
应收利息	-	-	-	-	-	4,492,316.24	4,492,316.24
应收申购款	1,210,000.00	-	-	-	-	-1,129,424.00	80,576.00
其他资产	-	-	-	-	-	9.50	9.50
资产总计	402,211,671.08	79,689,976.49	138,983,033.30	-	-	3,362,901.74	624,247,582.61
负债							
卖出回购金 融资产款	29,969,835.04	-	-	-	-	-	29,969,835.04
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	184,131.76	184,131.76
应付托管费	-	-	-	-	-	55,797.48	55,797.48
应付销售服	-	-	-	-	-	139,493.76	139,493.76

务费							
应付交易费用						26,336.11	26,336.11
应付利息						16,516.20	16,516.20
应付利润						202,848.68	202,848.68
其他负债						228,050.60	228,050.60
负债总计	29,969,835.04					853,174.59	30,823,009.63
利率敏感度缺口	372,241,836.04	79,689,976.49	138,983,033.30			2,509,727.15	593,424,572.98
上年度末 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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2017年12月31日		上年度末 2016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	505,073,500.00	85.11	140,237,000.00	24.92
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	505,073,500.00	85.11	140,237,000.00	24.92

#### 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	505,065,088.55	80.91
	其中: 债券	505,065,088.55	80.91
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	114,235,691.36	18.30
	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	373,900.96	0.06
4	其他各项资产	4,572,901.74	0.73
5	合计	624,247,582.61	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	8.44	
	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	29,969,835.04	5.05
	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	2017 年 2 月 27 日	23.26	大额赎回	1 天
2	2017 年 6 月 14 日	20.14	应付赎回	1 天
3	2017 年 8 月 23 日	20.87	市场波动	1 天
4	2017 年 11 月 16 日	38.80	大额赎回	3 天

5	2017 年 11 月 17 日	28.51	大额赎回	2 天
6	2017 年 11 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	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
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。

#### 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	63.04	5.05
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	11.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	6.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	10.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	13.37	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.42	5.05

#### 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

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	40,013,545.81	6.74
	其中：政策性金融债	40,013,545.81	6.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	179,998,411.49	30.33
6	中期票据	-	-
7	同业存单	285,053,131.25	48.04
8	其他	-	-
9	合计	505,065,088.55	85.11
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	111787202	17 宁波银行 CD197	500,000	49,829,311.14	8.40
2	011760044	17 晋煤 SCP004	300,000	30,010,899.40	5.06
3	150201	15 国开 01	300,000	30,001,094.58	5.06

4	111795703	17 河北银行 CD039	300,000	29,613,029.72	4.99
5	111709317	17 浦发银行 CD317	270,000	26,898,732.87	4.53
6	011751094	17 中航租赁 SCP009	200,000	20,001,981.37	3.37
7	011769043	17 鲁钢铁 SCP006	200,000	20,000,956.36	3.37
8	011764127	17 格力 SCP005	200,000	20,000,053.70	3.37
9	071721011	17 渤海证券 CP011	200,000	19,997,906.19	3.37
10	011769020	17 同方 SCP003	200,000	19,996,623.70	3.37

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1298%
报告期内偏离度的最低值	-0.0231%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0500%

#### 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。

### 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

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。

**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	4,492,316.24
4	应收申购款	80,576.00
5	其他应收款	9.50
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,572,901.74

**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
12,317	48,179.31	478,792,695.29	80.68%	114,631,877.69	19.32%

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	信托类机构	209,249,193.64	35.26%
2	信托类机构	57,154,354.60	9.63%
3	基金类机构	52,124,827.78	8.78%
4	保险类机构	49,021,746.43	8.26%
5	基金类机构	31,205,330.21	5.26%
6	保险类机构	30,113,393.82	5.07%
7	保险类机构	30,109,949.79	5.07%
8	其他机构	19,267,313.42	3.25%
9	个人	7,503,555.25	1.26%
10	个人	2,484,195.34	0.42%

### 9.3 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	619,753.28	0.1044%

**9.4 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

## § 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	562,806,153.16
本报告期基金总申购份额	1,710,690,154.67
减:本报告期基金总赎回份额	1,680,071,734.85
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	593,424,572.98

## § 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 2017 年 3 月 6 日发布公告，易祺坤先生自 2017 年 3 月 2 日起担任英大现金宝货币市场基金基金经理。

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并代行总经理职务，原董事长张传良先生自 2017 年 6 月 14 日起不再担任董事长及代行总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2017 年 7 月 3 日发布公告，赵照先生自 2017 年 6 月 30 日起不再担任英大基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2017 年 7 月 13 日发布公告，朱志先生自 2017 年 7 月 12 日起担任英大基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2017 年 7 月 28 日发布公告，朱志先生自 2017 年 7 月 25 日起担任英大基金管理有限公司总经理职务，董事长孔旺先生自 2017 年 7 月 25 日起不再代任总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 1 月 3 日发布公告，张琳娜女士自 2017 年 12 月 29 日起不再担任英大现金宝货币市场基金基金经理。

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

### 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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

### 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 5 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，北京证监局对本基金管理人下发了两项责令改正并暂停办理相关业务措施。本基金管理人高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性地制定、实施整改措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力。中国证监会于 2017 年 12 月 12 日决定对公司立案调查。调查事项不涉及基金财产和基金管理业务。

## 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	-	-	15,500,000.00	100.00%	-	-

**11.8 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。

**11.9 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	英大现金宝货币市场基金招募说明书（更新）及摘要（2016 年第 2 号）	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2017 年 1 月 17 日
2	英大现金宝货币市场基金 2016 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	2017 年 1 月 20 日
3	英大现金宝货币市场基金增聘基金经理的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2017 年 3 月 6 日
4	英大现金宝货币市场基金 2016 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	2017 年 3 月 31 日
5	英大基金管理有限公司关于基金经理休产假由他人代为履行职责的公告	公司网站、中证报	2017 年 4 月 13 日
6	英大现金宝货币市场基金 2017 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	2017 年 4 月 21 日
7	英大基金管理有限公司董事长及总经理变更公告	中国证券报及公司网站	2017 年 6 月 16 日
8	英大基金管理有限公司高级管理人	中国证券报及公司网站	2017 年 7 月 3 日

	员变更公告		
9	英大基金关于旗下基金 2017 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	2017 年 7 月 3 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	2017 年 7 月 13 日
11	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报及公司网站	2017 年 7 月 13 日
12	英大现金宝货币市场基金 2017 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	2017 年 7 月 21 日
13	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报及公司网站	2017 年 7 月 28 日
14	英大现金宝货币市场基金 2017 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	2017 年 8 月 29 日
15	英大现金宝货币市场基金 2017 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	2017 年 10 月 26 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	349,922,053.29	349,922,053.29	0.00	0.00%
	2	2017. 1. 1-2017. 12. 31	201,535,601.07	7,713,592.57	0.00	209,249,193.64	35.26%
	3	2017. 9. 29-2017. 11. 16	0.00	301,440,900.48	301,440,900.48	0.00	0.00%

## § 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

2018 年 3 月 30 日