

英大现金宝货币市场基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 26 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 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	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	2,487,057,654.08 份

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	刘轶	田青
	联系电话	010-59112020	010-67595096
	电子邮箱	liuyi@ydamc.com	tianqing1.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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	13,629,190.37
本期利润	13,629,190.37
本期净值收益率	1.3440%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末基金资产净值	2,487,057,654.08
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。

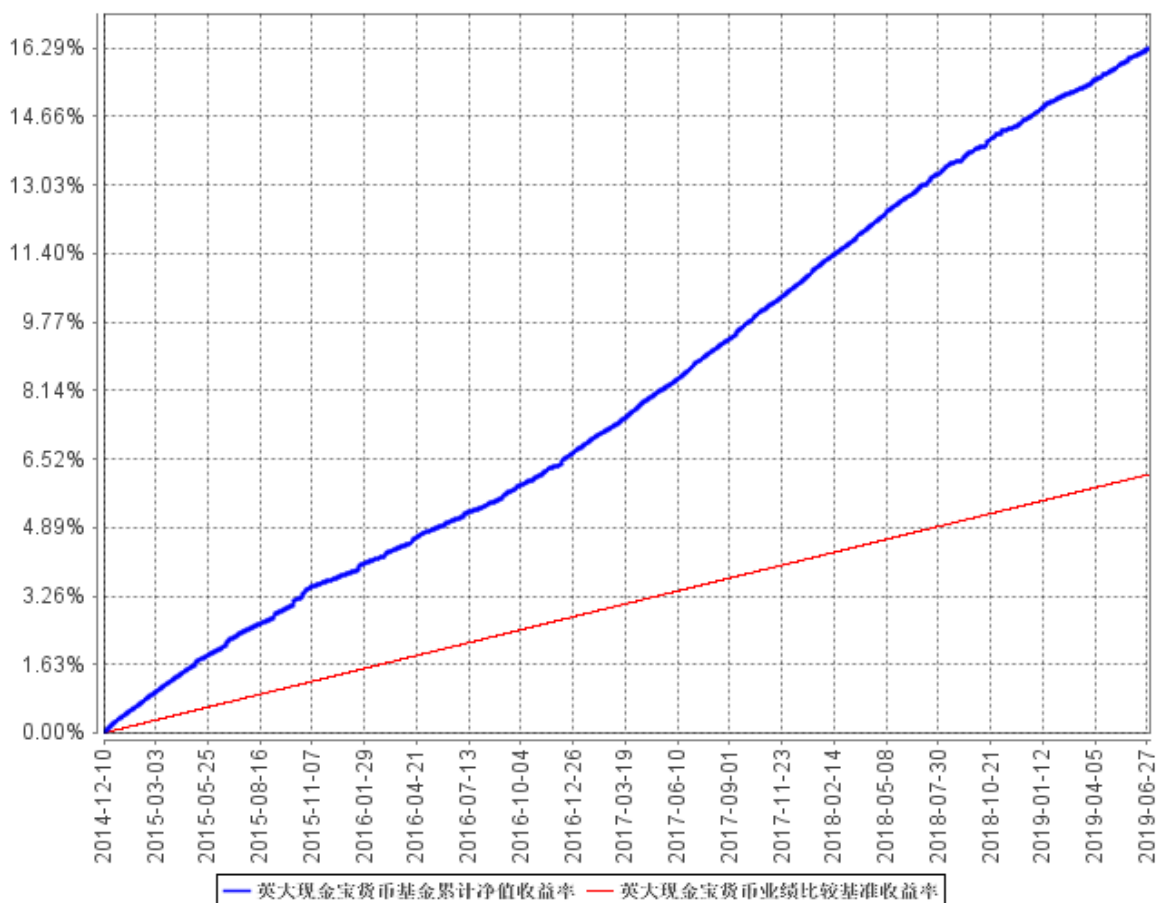
3.2 基金净值表现

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	0.2026%	0.0037%	0.1110%	0.0000%	0.0916%	0.0037%
过去三个月	0.7015%	0.0071%	0.3366%	0.0000%	0.3649%	0.0071%
过去六个月	1.3440%	0.0062%	0.6695%	0.0000%	0.6745%	0.0062%
过去一年	2.9332%	0.0080%	1.3500%	0.0000%	1.5832%	0.0080%
过去三年	10.6153%	0.0068%	4.0500%	0.0000%	6.5653%	0.0068%
自基金合同生效起至今	16.2890%	0.0077%	6.1545%	0.0000%	10.1345%	0.0077%

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



注：本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

§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

英大基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2012 年 8 月 17 日，注册资本为 20,000 万元人民币。现有三家股东，分别是网英大国际控股集团有限公司、中国交通建设股份有限公司、航天科工财务有限责任公司，持股比例分别为 49%、36%和 15%。

公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司 90%以上的员工来自于基金公司等金融机构，平均行业从业时间超过 10 年，硕士以上学历的员工占员工总数 70%以上，核心团队拥有丰富的经验和行业影响力。

公司自成立就秉承了国有企业诚信、责任、奉献的优良传统，确立了以“诚信、责任、专业、创新”为核心的企业文化，坚持以维护基金持有人利益为经营原则，坚持公募、私募协同发展、两翼齐飞的战略，坚持以市场为导向，坚持价值投资、长期投资理念，注重发展和创新，建立了科学、专业的投研体系和严谨的风控体系，力争成为具有核心竞争力、受人尊敬、业内领先的专业财富管理公司。

截至 2019 年 6 月 30 日，本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、英大睿盛混合型证券投资基金 8 只开放式证券投资基金，同时，管理过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	-	8	北京大学理学学士，8 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，历任交

					易管理部交易员、交易管理部副总经理（主持工作）。现任固定收益部基金经理，英大纯债债券型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2019 年上半年，央行继续维持稳健的货币政策，通过降准和公开市场操作等方式对冲流动性缺口，维护货币市场流动性“合理充裕”。经济数据方面，在宽货币宽信用政策持续发力、

地方债提前发行以及更大规模减税降费政策落地的背景下，一季度信贷、社融增速开始企稳，各项经济数据降幅收窄，经济基本面出现短期企稳迹象；随后中美贸易冲突出现反复，制造业投资、消费、进出口数据乏力带动基本面重归下行通道。债券市场短端收益率受资金面难再宽松影响低位徘徊，一年期 AAA 同业存单在 2.95%-3.30%之间波动。

同时，上半年信用违约事件持续高发，尤其是包商银行信用风险事件对市场产生了深远的影响，机构投资者风险偏好重归下行，债市流动性将长期维持“总量宽松但结构性紧张”的状态，流动性分层现象将长期存在。

本基金上半年对持仓组合的剩余期限和杠杆控制较为稳健，在高等级信用债、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

本报告期基金份额净值增长率为 1.3440%，业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，三季度通胀压力在高基数效应的影响下有所弱化，海外央行转向宽松将为中国货币政策宽松打开空间，中美贸易冲突将持续反复。经济基本面方面，基建投资受地方债发行高峰前置影响全年预计将前高后低，制造业、房地产投资、消费和进出口等数据将温和下行。

包商银行信用风险事件使得市场风险偏好有所下降，同时经济基本面下行和货币政策宽松等诸多利好将为债市收益率打开下行空间。另外下半年是地产债到期和回售高峰期，在地产融资政策收紧的背景下，房地产公司融资压力巨大，预计信用违约事件将出现一定程度的蔓延。

本基金三季度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、严控信用风险的前提下，力争为持有人持续实现稳定的回报。

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。估值委员会主任由分管投资的副总经理或实际履行上述职务的其他人员担任；成员包括基金运营部、监察稽核部的负责人及其他根据议题需要指定的相关人员；委员会秘书由基金运营部负责人担任。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 13,629,190.37 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元的情形。

§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 13,629,190.37 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,557,331.01	286,989.59
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,445,399,630.83	529,107,660.39
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,445,399,630.83	529,107,660.39
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	990,052,285.09	330,938,456.41
应收证券清算款		30,224,250.00	-
应收利息	6.4.7.5	9,661,261.48	7,317,615.37
应收股利		-	-
应收申购款		22,347,863.17	14,365,356.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,508,242,621.58	882,016,078.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		19,999,870.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		306,112.20	237,854.83
应付托管费		92,761.29	72,077.24
应付销售服务费		231,903.12	180,193.07
应付交易费用	6.4.7.7	41,006.38	25,921.27

应交税费		26,010.18	39,905.97
应付利息		2,924.52	-
应付利润		380,144.31	370,974.19
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,235.50	228,261.10
负债合计		21,184,967.50	1,155,187.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,487,057,654.08	880,860,890.35
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,487,057,654.08	880,860,890.35
负债和所有者权益总计		2,508,242,621.58	882,016,078.02

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,487,057,654.08 份，基金份额净值

1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：英大现金宝货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		17,445,674.51	17,826,568.87
1.利息收入		16,534,081.14	17,564,961.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	234,429.33	280,128.43
债券利息收入		11,152,381.63	11,834,295.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,147,270.18	5,450,537.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		911,593.37	261,607.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	911,593.37	261,607.44
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-

减：二、费用		3,816,484.14	3,321,445.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,667,157.17	1,244,030.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	505,199.21	376,978.87
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,262,997.85	942,446.92
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		237,898.04	607,355.71
其中：卖出回购金融资产支出		237,898.04	607,355.71
6. 税金及附加		22,103.90	13,700.05
7. 其他费用	6.4.7.20	121,127.97	136,933.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,629,190.37	14,505,123.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,629,190.37	14,505,123.56

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	880,860,890.35	-	880,860,890.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,629,190.37	13,629,190.37
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）	1,606,196,763.73	-	1,606,196,763.73
其中：1.基金申购款	2,606,233,375.44	-	2,606,233,375.44
2.基金赎回款	-1,000,036,611.71	-	-1,000,036,611.71
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“-”	-	-13,629,190.37	-13,629,190.37

”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	2,487,057,654.08	-	2,487,057,654.08
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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)	593,424,572.98	-	593,424,572.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,505,123.56	14,505,123.56
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)	457,150,469.27	-	457,150,469.27
其中:1.基金申购款	1,088,280,089.67	-	1,088,280,089.67
2.基金赎回款	-631,129,620.40	-	-631,129,620.40
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)	-	-14,505,123.56	-14,505,123.56
五、期末所有者权益(基金净值)	1,050,575,042.25	-	1,050,575,042.25

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:

马晓燕

朱志

李婷

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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：1. 现金；2. 期限在一年以内（含一年）的银行定期存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；3. 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；4. 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

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证券监督管理委员会（以下简称“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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况及 2019 年 1 月 1 日起至 2019 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

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

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《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〔2015〕101号《财政部国家税务总局证监会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〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《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〔2016〕36号文《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〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(2)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；

对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。免征增值税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
北京英大资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
英大国际信托有限责任公司	基金管理人股东的控股子公司
英大泰和财产保险股份有限公司	基金管理人股东的控股子公司
英大泰和人寿保险股份有限公司	基金管理人股东的控股子公司
英大长安保险经纪有限公司	基金管理人股东的控股子公司
中国电力财务有限公司	基金管理人股东重要成员单位
华夏银行股份有限公司	基金管理人股东联营企业、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

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 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,667,157.17	1,244,030.11
其中：支付销售机构的客户维护费	111,651.27	82,886.59

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	505,199.21	376,978.87

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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	1,081,537.60
中国建设银行股份有限公司	120,211.37
合计	1,201,748.97
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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	811,663.94
中国建设银行股份有限公司	119,170.69
合计	930,834.63

注：销售服务费主要用于本基金的持续销售以及基金份额持有人的服务。支付基金托管人的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费计算公式为：日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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

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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月

	6 月 30 日	30 日
期初持有的基金份额	6,868.49	-
期间申购/买入总份额	131,401,846.26	14,437,652.53
减：期间赎回/卖出总份额	3,000,000.00	4,000,000.00
期末持有的基金份额	128,408,714.75	10,437,652.53
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.1600%	0.9900%

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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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
北京英大资本管理有限公司	61,462,924.72	2.4700%	27,110,347.69	3.0800%
英大泰和人寿保险股份有限公司	31,465,662.62	1.2700%	1,439,961.54	0.1600%
中国电力财务有限公司	500,070,290.53	20.1100%	0.00	0.0000%
英大长安保险经纪有限公司	201,532,361.62	8.1000%	80,000,000.00	9.0800%
英大泰和财产保险股份有限公司	70,706,336.86	2.8400%	20,416,469.12	2.3200%
英大国际信托有限责任公司	250,044,277.52	10.0500%	246,662,177.25	28.0000%
华夏银行股份有限公司	200,051,507.96	8.0400%	-	-
合计	1,315,333,361.83	52.8900%	375,628,955.60	42.6400%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	557,331.01	4,613.31	286,989.59	11,146.08
------------------	------------	----------	------------	-----------

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2019 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 0.00 元。

（2018 年 6 月 30 日：人民币 0.00 元）

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2019 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

注：本报告期末，本基金未持有因认购新发/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

注：本报告期末，本基金未持有需披露的暂时停牌股票。

6.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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 19,999,870.00 元。

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
111909154	19 浦发银行 CD154	2019 年 8 月 1 日	99.54	213,000	21,201,847.33
合计				213,000	21,201,847.33

6.4.9.2.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

-

§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	1,445,399,630.83	57.63
	其中:债券	1,445,399,630.83	57.63
2	买入返售金融资产	990,052,285.09	39.47
3	银行存款和结算备付金合计	10,557,331.01	0.42
4	其他各项资产	62,233,374.65	2.48
5	合计	2,508,242,621.58	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	2.09	
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	19,999,870.00	0.80

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

注:本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

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	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

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。

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	58.73	0.80
2	30 天(含)—60 天	14.86	-
3	60 天(含)—90 天	9.23	-
4	90 天(含)—120 天	3.62	-
5	120 天(含)—397 天 (含)	13.12	-
合计		99.56	0.80

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

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。

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 (%)
3	金融债券	100,127,403.90	4.03
	其中：政策性金融债	100,127,403.90	4.03
5	企业短期融资券	420,947,167.77	16.93
7	同业存单	924,325,059.16	37.17
9	合计	1,445,399,630.83	58.12

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	111916158	19 上海银行 CD158	600,000	59,919,376.22	2.41
2	011802276	18 鲁钢铁 SCP019	500,000	50,273,972.03	2.02
3	011900579	19 天成租赁	500,000	50,049,283.75	2.01

		SCP002			
4	111809316	18 浦发银行 CD316	500,000	49,940,716.01	2.01
5	111995982	19 宁波银行 CD063	500,000	49,932,895.47	2.01
6	111809340	18 浦发银行 CD340	500,000	49,924,713.08	2.01
7	111981270	19 天津银行 CD139	500,000	49,905,476.25	2.01
8	111812163	18 北京银行 CD163	500,000	49,887,489.16	2.01
9	111803190	18 农业银行 CD190	500,000	49,887,088.00	2.01
10	111888255	18 宁波银行 CD222	500,000	49,882,198.56	2.01

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
报告期内偏离度的最高值	0.2165%
报告期内偏离度的最低值	0.0423%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1426%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

注：本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明

注：本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

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

注：本基金本报告期末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

经查询上海证券交易所、深圳证券交易所、中国货币网等公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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
2	应收证券清算款	30,224,250.00
3	应收利息	9,661,261.48
4	应收申购款	22,347,863.17
8	合计	62,233,374.65

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
30,318	82,032.38	2,316,271,936.11	93.13%	170,785,717.97	6.87%

8.2 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	其他类机构	500,070,290.53	20.11%
2	基金类机构	301,735,752.72	12.13%
3	信托类机构	250,044,277.52	10.05%
4	保险类机构	201,532,361.62	8.10%
5	银行类机构	200,051,507.96	8.04%
6	基金类机构	140,613,141.98	5.65%
7	券商类机构	100,025,753.99	4.02%
8	银行类机构	100,000,000.00	4.02%
9	保险类机构	70,706,336.86	2.84%
10	其他类机构	61,462,924.72	2.47%

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	861,664.64	0.0346%

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	0~10

§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	880,860,890.35
本报告期期间基金总申购份额	2,606,233,375.44
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,000,036,611.71
本报告期期末基金份额总额	2,487,057,654.08

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

-

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 2019 年 5 月 24 日发布公告，自 2019 年 5 月 22 日起，孔旺先生不再担任英大基金管理有限公司董事长职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 5 月 24 日发布公告，自 2019 年 5 月 22 日起，马晓燕女士担任英大基金管理有限公司董事长职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 6 月 29 日发布公告，英大基金管理有限公司总经理助理（投资总监）张大铮自 2019 年 6 月 28 日开始履行高级管理人员职务。

本报告期内，托管人中国建设银行于 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘请蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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，本基金管理人有三起劳动争议案件尚未了结，该类案件不涉及本基金。此外，无涉及基金财产、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

报告期内本基金未变更审计的会计师事务所。

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到稽查或处罚。

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	-	-	4,500,000.00	100.00%	-	-

10.8 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 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	-	2019.01.01-2019.06.24	246,662,177.25	3,382,100.27	0.00	250,044,277.52	10.05%
	-	2019.05.31-2019.06.20	150,747,516.19	91,040,663.79	40,255,818.36	201,532,361.62	8.10%
	-	2019.06.27-2019.06.28	0.00	500,070,290.53	0.00	500,070,290.53	20.11%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

(1) 赎回申请延期办理的风险

持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。

(2) 基金净值大幅波动的风险

当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金采用影子定价确定的资产净值发生波动，引起偏离度发生较大变化。

(3) 基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。

(4) 提前终止基金合同的风险

高比例投资者赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

(5) 对重大事项进行投票表决时面临的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

英大基金管理有限公司

2019 年 8 月 26 日