

英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 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 2020 年 9 月 24 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	8
2.1 基金基本情况.....	8
2.2 基金产品说明.....	8
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较.....	10
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较.....	11
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.....	12
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验.....	13
4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介.....	13
4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况.....	15
注：无.....	15
4.1.4 基金经理薪酬机制.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.3.1 公平交易制度和控制方法.....	15
4.3.2 公平交易制度的执行情况.....	15
4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况.....	16
4.3.3 异常交易行为的专项说明.....	16
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.....	16
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析.....	16
4.4.2 报告期内基金的业绩表现.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	18
4.10 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.....	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19

§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§ 7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
7.4.1 基金基本情况.....	26
7.4.2 会计报表的编制基础.....	27
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明.....	27
7.4.4 重要会计政策和会计估计.....	27
7.4.4.1 会计年度.....	27
7.4.4.2 记账本位币.....	28
7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类.....	28
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.....	28
7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则.....	29
7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销.....	30
7.4.4.7 实收基金.....	30
7.4.4.8 损益平准金.....	30
7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量.....	30
7.4.4.10 费用的确认和计量.....	31
7.4.4.11 基金的收益分配政策.....	31
7.4.4.12 分部报告.....	31
7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计.....	31
7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明.....	32
7.4.5.1 会计政策变更的说明.....	32
7.4.5.2 会计估计变更的说明.....	32
7.4.5.3 差错更正的说明.....	32
7.4.6 税项.....	32
7.4.7 重要财务报表项目的说明.....	34
7.4.7.1 银行存款.....	34
7.4.7.2 交易性金融资产.....	34
7.4.7.3 衍生金融资产/负债.....	34
7.4.7.4 买入返售金融资产.....	34
7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额.....	34
7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券.....	34
7.4.7.5 应收利息.....	34
7.4.7.6 其他资产.....	35
7.4.7.7 应付交易费用.....	35
7.4.7.8 其他负债.....	35
7.4.7.9 实收基金.....	36
7.4.7.10 未分配利润.....	36
7.4.7.11 存款利息收入.....	36
7.4.7.12 股票投资收益.....	37

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入.....	37
7.4.7.13 债券投资收益.....	37
7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成.....	37
7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入.....	37
7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入.....	37
7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入.....	37
7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益.....	37
7.4.7.14 贵金属投资收益.....	37
7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成.....	37
7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入.....	37
7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入.....	38
7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入.....	38
7.4.7.15 衍生工具收益.....	38
7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入.....	38
7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益.....	38
7.4.7.16 股利收益.....	38
7.4.7.17 公允价值变动收益.....	38
7.4.7.18 其他收入.....	38
7.4.7.19 交易费用.....	38
7.4.7.20 其他费用.....	38
7.4.7.21 分部报告.....	38
7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明.....	39
7.4.8.1 或有事项.....	39
7.4.8.2 资产负债表日后事项.....	39
7.4.9 关联方关系.....	39
7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易.....	39
7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易.....	39
7.4.10.1.1 股票交易.....	39
7.4.10.1.2 债券交易.....	39
7.4.10.1.3 债券回购交易.....	40
7.4.10.1.4 权证交易.....	40
7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金.....	40
7.4.10.2 关联方报酬.....	40
7.4.10.2.1 基金管理费.....	40
7.4.10.2.2 基金托管费.....	40
7.4.10.2.3 销售服务费.....	41
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.....	41
7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明.....	41
7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况.....	41
7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况.....	41
7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况.....	41
7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况.....	41
7.4.10.5.2 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.....	41
7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入.....	42
7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况.....	42

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明.....	42
7.4.11 利润分配情况.....	42
7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券.....	42
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.....	42
7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票.....	43
7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券.....	43
7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购.....	43
7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购.....	43
7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券.....	43
7.4.13 金融工具风险及管理.....	43
7.4.13.1 风险管理政策和组织架构.....	43
7.4.13.2 信用风险.....	44
7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资.....	44
7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资.....	44
7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资.....	44
7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资.....	44
7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资.....	44
7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资.....	44
7.4.13.3 流动性风险.....	44
7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析.....	45
7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析.....	45
7.4.13.4 市场风险.....	45
7.4.13.4.1 利率风险.....	46
7.4.13.4.1.1 利率风险敞口.....	46
7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析.....	48
7.4.13.4.2 外汇风险.....	49
7.4.13.4.3 其他价格风险.....	49
7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口.....	49
7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析.....	49
7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险.....	50
7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项.....	50
§ 8 投资组合报告.....	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合.....	52
8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细.....	52
8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细.....	52
8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	53
8.7 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	53
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	53

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	53
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
8.10.1 本期国债期货投资政策.....	54
8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细.....	54
8.10.3 本期国债期货投资评价.....	54
8.11 投资组合报告附注.....	54
8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明.....	54
8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明.....	54
8.11.3 期末其他各项资产构成.....	54
8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细.....	54
8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明.....	54
8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分.....	54
§ 9 基金份额持有人信息.....	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	55
§ 10 开放式基金份额变动.....	56
§ 11 重大事件揭示.....	57
11.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
11.4 基金投资策略的改变.....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
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.....	58
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.....	58
11.8 其他重大事件.....	58
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§ 13 备查文件目录.....	64
13.1 备查文件目录.....	64
13.2 存放地点.....	64
13.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	英大安鑫 66 个月定期开放债券
场内简称	-
基金主代码	009770
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 24 日
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,999,027,982.39 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金封闭期内采用买入并持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	1. 封闭期配置策略：持有到期策略、资产配置策略、信用债券投资策略、杠杆投资策略、现金管理策略、资产支持证券投资策略； 2. 开放期投资策略：开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化，因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日中国人民银行公布的三年期定期存款利率（税后）+1.25%
风险收益特征	本基金为定期开放债券型基金，其预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘康喜	田东辉
	联系电话	010-59112026	010-68858113

	电子邮箱	liukx@ydamc.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		400-890-5288	95580
传真		010-59112222	010-68858120
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3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		100020	100808
法定代表人		马晓燕	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8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	2020年9月24日 (基金合同生效日)-2020年12月31日	2019年	2018年
本期已实现收益	70,216,230.61	-	-
本期利润	70,216,230.61	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0088	-	-
本期加权平均净值利润率	0.87%	-	-
本期基金份额净值增长率	0.88%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	70,216,230.61	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0088	-	-
期末基金资产净值	8,069,244,213.00	-	-
期末基金份额净值	1.0088	-	-
3.1.3 累计期末指标	2020年末	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	0.88%	-	-

3.2 基金净值表现

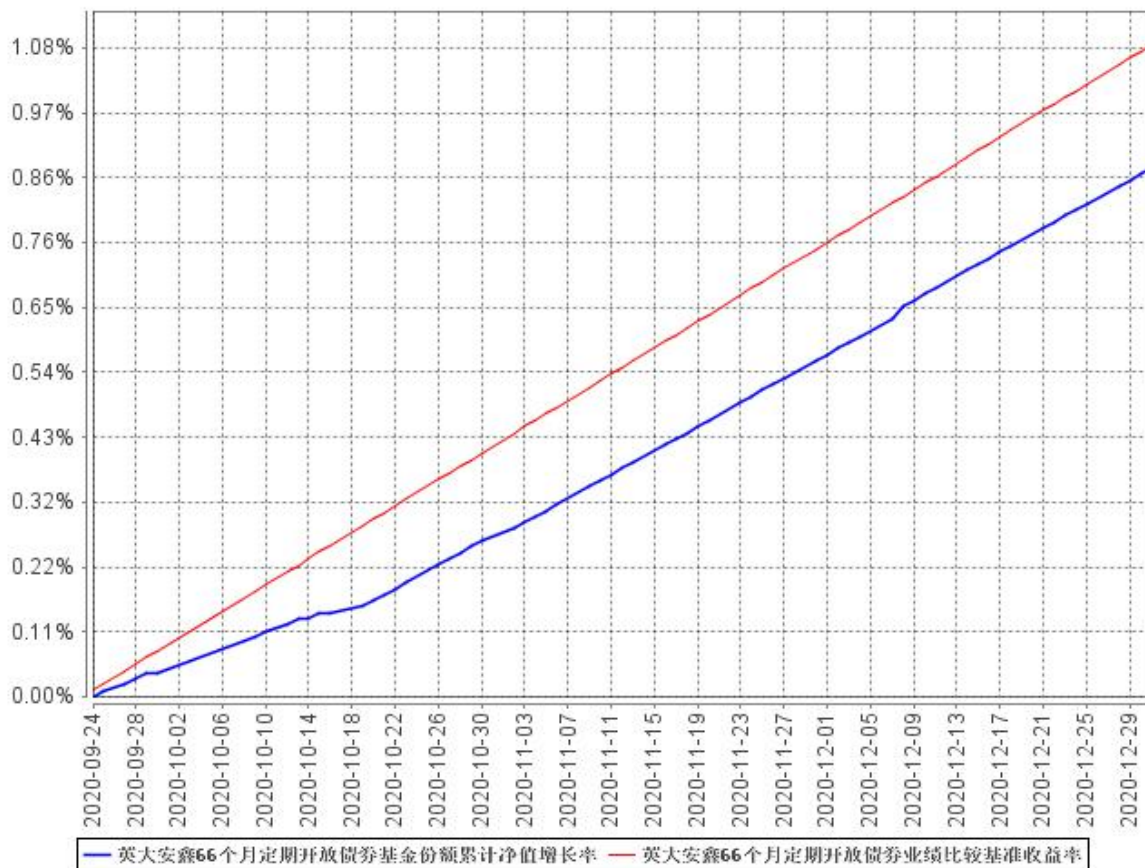
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.84%	0.01%	1.01%	0.01%	-0.17%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.88%	0.01%	1.08%	0.01%	-0.20%	0.00%

注：同期业绩比较基准为该封闭期起始日中国人民银行公布的三年期定期存款利率(税后)+1.25%。

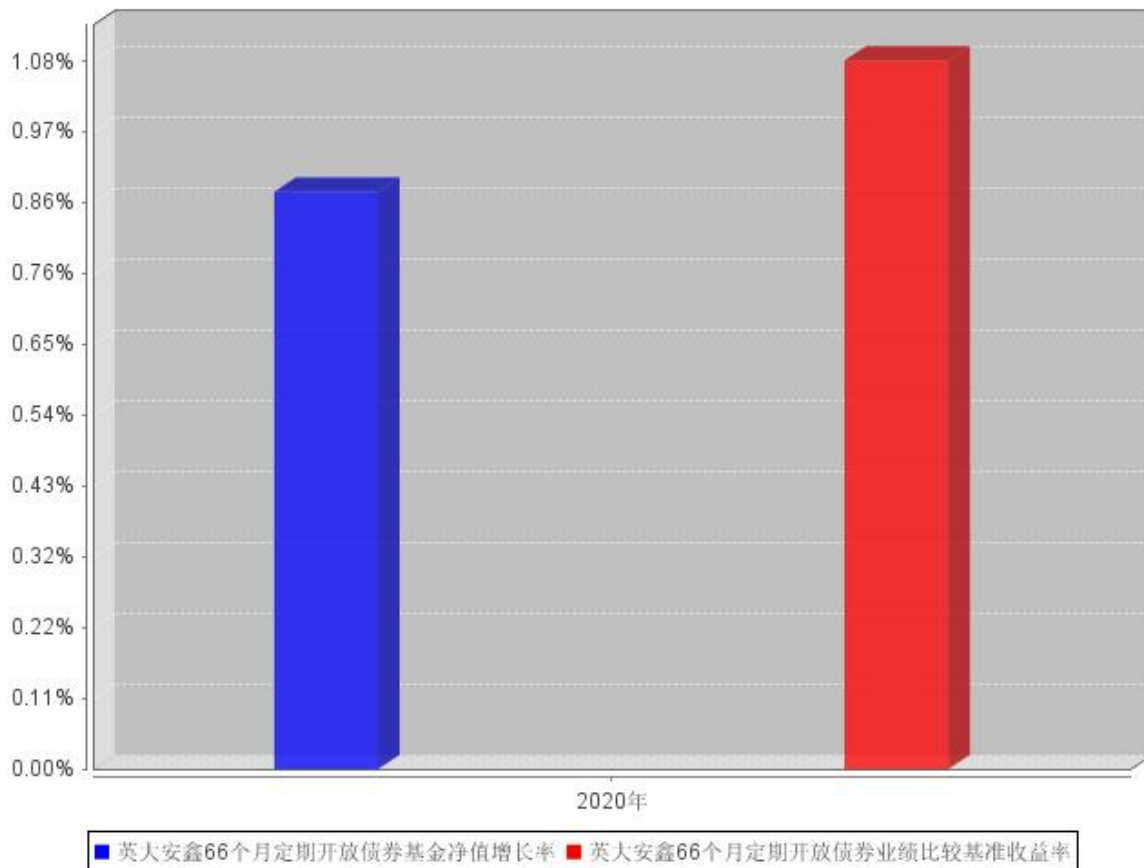
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

英大安鑫66个月定期开放债券基金份额累计净值增长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

英大安鑫66个月定期开放债券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对比图



3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2020 年 9 月 24 日成立，本报告期内未进行利润分配。

§ 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 91,600 万元人民币，是国网英大国际控股集团有限公司全资子公司。公司总部设立于北京，全资子公司北京英大资本管理有限公司，同时在上海设立了分公司。

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。公司员工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。

公司以建设“特色型、专业化、精品类基金公司”为目标，确立了以“梦想、真诚、专业、稳健”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、专户协同发展、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 2020 年 12 月 31 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、英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金 12 只证券投资基金，同时，管理多个特定客户资产投资组合。

近年来，公司、产品屡获殊荣，公司先后荣获“2019 东方财富风云榜”“最具潜力基金公司”奖、新浪财经 2020 基金行业“金麒麟”奖项“最具成长基金公司”、国网英大国际控股集团有限公司 2020 年度“先进集体”，产品多次被上海证券报、证券时报、济安金信等专业基金评价机构评为“金基金”、“三年持续回报普通债券型明星基金”、“五年持续回报普通债券型明星基金”、“连续五年稳回报基金”。

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	2020 年 9 月 24 日	-	9	北京大学理学学士。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，英大现金宝货币市场基金、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、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金基金经理
张大铮	本基金基金经理	2020 年 9 月 24 日	-	18	张大铮先生，香港中文大学工商管理硕士。历任中银国际证券有限责任公司高级分析员，中国国际金融有限公司固定收益部副总经理、资产管理部副总经理，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司助理总经理、固定收益投资部总监，民生基金管理有限公司（筹）副总裁。2019 年 5 月加入英大基金，曾任总经理助理（投资总监），现任副总经理兼固定收益部总经理，英大策略优选混合型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

4.1.4 基金经理薪酬机制

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，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，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作无重大违法违规行为，无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《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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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、私募资产管理计划、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、私募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。

风险管理部定期对公司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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

-

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 5% 的情况，且未发现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

2020 年初以来，新冠肺炎疫情持续发酵，消费、出口、投资均受到疫情显著影响，为对冲经济下行压力，央行宽货币政策更加宽松，通过降准、降息等方式向货币市场释放流动性，货币市场流动性合理充裕，资金利率一路走低。进入 5 月，国内疫情防控工作取得重大进展，央行注意到流动性并未进入实体经济，金融空转和套利进一步加大了金融风险，央行货币政策重心聚焦“把握稳增长与防风险的有效平衡”，宽松节奏出现微调，货币政策边际收紧，资金利率开始一路震荡上行，直到 11 月底央行为稳定市场情绪意外新增 2000 亿 MLF 操作才有所好转。

受资金利率 V 型反转、经济基本面企稳复苏、利率债一级供给持续压制、永煤违约造成流动性冲击等因素影响，利率债各期限收益率在 4 月底下探至历史低点后开始一路震荡上行，1 年期国开债最多由低点反弹 190bp，5 年期国开债低点反弹 145bp，10 年期国开债低点反弹 93bp。信用债高评级跟随无风险利率上行出现调整，中低评级由于成交较少，收益率上行幅度反而较小，评级利差被动收缩。

本基金成立于 2020 年 9 月 24 日，四季度处在建仓期，在收益率调整过程中精准布局配置券种、合理把握建仓时机，保持高杠杆、适度久期运作，由于本基金采用摊余成本法估值，净值表现较为稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0088 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.88%，业绩比较基准收益率为 1.08%。

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 2021 年，经济基本面修复进入尾声，实体经济预计在二季度以后重回下行通道，央行货

币政策预计将继续保持“灵活精准、合理适度”，短端货币市场将维持总量宽松但结构性收紧的状态，一年期同业存单利率在 MLF 政策利率附近窄幅波动。利率债中短端预计将维持震荡下行走势，在目前的收益率水平有较好的配置价值；长端因经济复苏程度、新冠肺炎疫情第二波冲击是否到来和收益率的绝对水平偏低而存在尾部风险，不确定性较大。

随着央行“非常规货币政策适时退出”，中长期看融资政策的收紧将对中低评级发行人的融资环境造成冲击，2021 年信用违约事件预计将继续保持高发态势。目前高评级信用债随着无风险利率上行出现调整，中低评级产业债和城投因活跃度不高而成交较少，评级利差被动压缩，整体来看短期限的高评级信用债有较好的投资价值。

本基金采用买入并持有到期策略投资，2021 年将持续关注央行货币政策、公开市场操作以及资金面走势，根据市场情况适时调整融资结构、稳定融资利率水平，力争为持有人持续实现正收益。

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，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，及时识别合规风险，有效进行风险控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求，研究法规变化对公司业务的影响，督促责任部门落实各项法规要求，使得公司从业人员知法、守法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制；三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性。公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核；四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决。通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是持续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，采用法规解读加案例演示的方式，加深员工对法律法规和 risk 的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和运营等内部制度建设情况、内部制度执行情况、各项业务开展的合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情

况。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作；二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形；三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。

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进行披露。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。估值委员会主任由公司总经理担任；成员包括督察长、投资总监、运营分管领导、各基金经理、研究部、交易部、监察稽核部、风险管理部、基金运营部的主要负责人；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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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	毕马威华振审字第 2101984 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	英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2020 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、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中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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，我们独立于该基金，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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人英大基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金自 2020 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间报告中涵盖的信息，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责任	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</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>(1) 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>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的</p>

	<p>并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人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>(4) 对基金管理人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，就可能导致对该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得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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>我们与基金管理人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>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	左艳霞	卜建平
会计师事务所的地址	中国北京市东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	621,404.75	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	287,540,143.13	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	10,554,402,057.67	-
资产总计		10,842,563,605.55	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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		2,769,853,285.21	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,023,550.82	-
应付托管费		341,183.58	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	110,622.64	-
应交税费		-	-
应付利息		1,890,750.30	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	100,000.00	-
负债合计		2,773,319,392.55	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,999,027,982.39	-
未分配利润	7.4.7.10	70,216,230.61	-
所有者权益合计		8,069,244,213.00	-
负债和所有者权益总计		10,842,563,605.55	-

注：1. 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0088 元，基金份额总额 7,999,027,982.39 份。

2. 资产负债表中其他资产为分类为持有至到期投资的债券投资。

7.2 利润表

会计主体：英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 9 月 24 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		87,022,180.11	-
1. 利息收入		87,022,180.11	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,664,485.91	-
债券利息收入		74,412,672.16	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		945,022.04	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-	-
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	-	-
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		16,805,949.50	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,225,476.67	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,075,158.88	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		12,404,913.95	-
其中：卖出回购金融资产支出		12,404,913.95	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	100,400.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,216,230.61	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,216,230.61	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 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）	7,999,027,982.39	-	7,999,027,982.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,216,230.61	70,216,230.61
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,999,027,982.39	70,216,230.61	8,069,244,213.00

大基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，应开放期流动性需要，为保护持有人利益，本基金开放期开始前 3 个月、开放期以及开放期结束后的 3 个月内，本基金的债券资产的投资比例可不受上述限制。开放期内，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，封闭期内不受上述 5% 的限制，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。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，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况、自 2020 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金的会计年度自公历 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自 2020 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产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和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金采用买入并持有至到期的投资策略，因此将所持有的债权投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。持有至到期投资按照摊余成本进行计量，在其他资产中进行核算。

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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项及持有至到期投资以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

以摊余成本计量的金融资产按下述原则评估减值损失：

- 本基金在资产负债表日对以摊余成本计量的金融资产的账面价值进行检查，有客观证据表明该金融资产发生减值的，计提减值准备；

- 当以摊余成本计量的金融资产的预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)按原实际利率折现的现值低于其账面价值时，本基金将该以摊余成本计量的金融资产的账面价值减记至该现值，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益；

- 在以摊余成本计量的金融资产确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，本基金将原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。该转回后的账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

-

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用 如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式仅为现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后均不能低于面值；本基金每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期

审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。

持有至到期投资已发生减值的证据包括下列可观察信息：

- 发行方或债务人发生严重财务困难；
- 债务人违反了合同条款，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 债务人很可能倒闭或进行其他财务重组；
- 因发行方发生重大财务困难，该金融资产无法在活跃市场继续交易。

在进行判断的过程中，本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

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

本基金在本期末未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、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：

(a)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。

(b)资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品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，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。

(c)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。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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。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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按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。

(e)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。

(f)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。

(g)对基金在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。

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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	621,404.75	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	621,404.75	-

7.4.7.2 交易性金融资产

注：本基金于本报告期末未持有任何交易性金融资产。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本年末及上年末均未持有任何衍生金融资产 / (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

注：本基金于本期末未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期内无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	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	110.46	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	287,540,032.67	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	287,540,143.13	-

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
持有至到期投资	10,554,402,057.67	-
合计	10,554,402,057.67	-

注：本基金持有的持有至到期投资均为银行间市场债券投资。于 2020 年 12 月 31 日，上述持有至到期投资无需计提减值准备。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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	110,622.64	-
合计	110,622.64	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-

预提费用	100,000.00	-
合计	100,000.00	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年9月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	7,999,027,982.39	7,999,027,982.39
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	7,999,027,982.39	7,999,027,982.39

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	70,216,230.61	-	70,216,230.61
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	-	-	-
本期末	70,216,230.61	-	70,216,230.61

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年9月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
	活期存款利息收入	621,285.91
定期存款利息收入	11,043,200.00	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	11,664,485.91	-

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

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

注：本基金在本报告期内无基金投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期内无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期内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：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期内无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无贵金属申购差价收入。

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：本基金在本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金在本报告期内无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金在本报告期内无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

注：本基金在本报告期内无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

注：本基金在本报告期内无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年9月24日(基金合同 生效日)至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
审计费用	70,000.00	-
信息披露费	30,000.00	-
证券出借违约金	-	-
其他费用	400.00	-
合计	100,400.00	-

7.4.7.21 分部报告

无。

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，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

2021 年 3 月 23 日，本基金管理人发布《英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年第一次收益分配公告》，对权益登记日在基金管理人登记在册的本基金全体基金份额持有人分配收益。本次分配的收益分配基准日为 2021 年 3 月 19 日，权益登记日、除息日为 2021 年 3 月 24 日，现金红利发放日为 2021 年 3 月 25 日，收益分配方案为按每 10 份基金份额派发红利人民币 0.1 元。

除上述情况外，截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需要披露的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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
邮储银行	基金托管人
国网英大国际控股集团有限公司	基金管理人股东
北京英大资本管理有限公司	基金管理人全资子公司
国网英大国际控股集团有限公司控股子公司	受国网英大国际控股集团有限公司看更多的企业

注：1. 国网英大国际控股集团有限公司控股子公司包括国网国际融资租赁有限公司、英大国际信托有限责任公司、英大证券有限责任公司、英大泰和财产保险股份有限公司、英大泰和人寿保险股份有限公司和英大长安保险经纪有限公司等。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过交易。

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：本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期内未通过关联方的交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期内未通过关联方的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：本基金在本报告期内没有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
	2020年9月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,225,476.67	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1.96	-

注：支付基金管理人英大基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

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
	2020年9月24日(基金合同生效日)至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,075,158.88	-

注：支付基金托管人邮政储蓄银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费**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：本基金在本报告期内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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况****7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况****7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2020年9月24日(基金合同 生效日)至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
基金合同生效日(2020年 9月24日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	300,000.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总 份额	-	-
报告期末持有的基金份额	300,000.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	-

注：报告期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入、非交易过户份额；报告期间赎回/卖出总份额：含转换出、非交易过户份额。

基金管理人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。

7.4.10.5.2 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 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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
中国 邮 政 储 蓄 银 行 股 份 有 限 公 司	2,399,699,000.00	30.0000%	-	-

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。

7.4.10.6 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 2020 年 9 月 24 日(基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 邮 政 储 蓄 银 行 股 份 有 限 公 司	621,404.75	621,285.91	-	-

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2020 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：于 2020 年 12 月 31 日，本基金无因认购新发或增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

于 2020 年 12 月 31 日，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 2,769,853,285.21 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
160303	16 进出 03	2021 年 1 月 4 日	98.82	10,985,000	1,085,537,700.00
160303	16 进出 03	2021 年 1 月 5 日	98.82	7,369,000	728,204,580.00
160303	16 进出 03	2021 年 1 月 6 日	98.82	6,631,000	655,275,420.00
160303	16 进出 03	2021 年 1 月 7 日	98.82	4,233,000	418,305,060.00
合计				29,218,000	2,887,322,760.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

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、风险管理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之内。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国邮政储蓄银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。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；本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并采用券款对付交割方式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

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之匹配。本基金的基金管理人可在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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。

本基金所持有的证券均在银行间本币市场交易，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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金流动性受限资产比例、持仓集中度等指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。在开放期，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本报告期末，本基金主要持有政策性金融债和现金资产，除应收利息按约定期限变现外，其余各项资产均具有良好的市场流动性。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、部分应收申购款、债券投资及买入返售金融资产等。生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年 12月 31日	1个月以内	1-3个月-1年	3-12个月	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	621,404.75	-	-	-	-	-	621,404.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-287,540,143.13	287,540,143.13
其他	-	-	-	1,303,542,833.40	9,250,859,224.27	0.00	10,554,402,057.67

资产							
资产总计	621,404.75	-	-	1,303,542,833.49	9,250,859,224.22	287,540,143.13	10,842,563,605.55
负债							
卖出回购金融资产款	2,769,853,285.21	-	-	-	-	-	2,769,853,285.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,023,550.82	1,023,550.82
应付托管费	-	-	-	-	-	341,183.58	341,183.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	110,622.64	110,622.64
应付利息	-	-	-	-	-	1,890,750.30	1,890,750.30
其他负债	-	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债	2,769,853,285.21	-	-	-	-	3,466,107.34	2,773,319,392.55

总计						
利率 敏 感 度 缺 口	-2,769,231,880.46	-	-1,303,542,833.40	49,250,859,224.27	2284,074,035.79	8,069,244,213.00
上 年 度 末 201 9 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						
资 产 总 计	-	-	-	-	-	-
负 债						
负 债 总 计	-	-	-	-	-	-
利 率 敏 感 度 缺 口	-	-	-	-	-	-

注：本表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	利率下降 25 个基点	121,573,750.85	-
	利率上升 25 个基点	-118,125,113.59	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金债券资产占基金资产的比例不低于 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：其他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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准的公允价值发生变化，其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）

	业绩比较基准的公允价值上升 5%	263,867,136.44	-
	业绩比较基准的公允价值下降 5%	-263,867,136.44	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位:人民币元)	本期末(2020年12月31日)	上年度末(2019年12月31日)
	-	-	-
	合计	-	-

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值: 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(a) 持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日, 本基金无持续的以公允价值计量的金融工具。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括持有至到期投资、应收款项、卖出回购金融资产款。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持有至到期投资均为银行间市场债券投资，账面价值为人民币 10,554,402,057.67 元，公允价值为人民币 10,693,201,000.00 元。本基金持有的其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

除特别声明外，本基金按下述原则确认公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

§ 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,554,402,057.67	97.34
	其中：债券	10,554,402,057.67	97.34
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	621,404.75	0.01
8	其他各项资产	287,540,143.13	2.65
9	合计	10,842,563,605.55	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：报告期末，本基金未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：报告期末（2020 年 12 月 31 日），本基金未持有港股通股票

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期内未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

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	10,554,402,057.67	130.80
	其中：政策性金融债	10,554,402,057.67	130.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,554,402,057.67	130.80

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	160303	16 进出 03(总价)	61,900,000	6,116,914,469.60	75.81
2	160405	16 农发 05(总价)	10,700,000	1,058,168,776.69	13.11
3	190204	19 国开 04(总价)	10,400,000	1,044,887,792.47	12.95
4	160408	16 农发 08(总价)	10,400,000	1,030,888,185.51	12.78
5	200408	20 农发 08(总价)	7,500,000	747,423,934.42	9.26

8.7 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期内未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期内未持贵金属

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期内未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

-

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.10.3 本期国债期货投资评价

-

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金，本报告期内未持有股票。

8.11.3 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	应收股利	-
4	应收利息	287,540,143.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	287,540,143.13

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 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
310	25,803,316.07	7,998,995,000.00	100.00%	32,982.39	0.00%

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	1,409.21	0.0000%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年9月24日）基金份额总额	7,999,027,982.39
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	7,999,027,982.39

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 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 2020 年 12 月 10 日发布公告，自 2020 年 12 月 8 日起，权益投资总监汤戈先生开始履行高级管理人员职务。

本报告期内，基金管理人于 2020 年 12 月 10 日发布公告，自 2020 年 12 月 8 日起，张大铮先生新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 2020 年 12 月 10 日发布公告，自 2020 年 12 月 8 日起，岳喜伟先生新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 2020 年 12 月 29 日发布公告，因公司第二届董事会任期届满，经股东决定，马晓燕、张彤宇、马涛担任公司第三届董事会董事职务，马筱琳、贺强、宋国良担任公司第三届董事会独立董事职务。范育晖经公司工会选举为职工董事。马晓燕经公司第三届董事会第一次会议选举为董事长。原第二届董事会成员王利生、谭欣、刘少军、尹惠芳不再担任公司董事职务。

本报告期内，基金管理人于 2020 年 12 月 29 日发布公告，因公司第一届监事会任期届满，经股东决定，松芙蓉担任公司第二届监事会监事职务。李婷、许艳涛经公司工会选举为职工监事。松芙蓉经公司第二届监事会第一次会议选举为监事会主席。原第一届监事会成员李金明、耿帆不再担任公司监事职务。

本报告期内，基金托管人于 2020 年 12 月 30 日发布任职公告，韩笑微女士担任中国邮政储蓄银行托管业务部副总经理。

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

本报告期内，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

报告期内本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本年度审计费用

为 70,000 元。本次会计师事务所的聘任已经基金管理人董事会批准，并履行了必要的程序。

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

本报告期内本基金未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
东兴证券	2	-	-	-	-	-

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
东兴证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 14 日
2	英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同内容摘	基金管理人网站及中国证监会基金电	2020 年 7 月 14 日

	要	子披露网站	
3	英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 14 日
4	英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 14 日
5	英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 14 日
6	英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 14 日
7	关于英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金在募集期间暂停代销机构、网上直销系统认购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 21 日
8	英大基金管理有限公司关于增加民商基金销售（上海）有限公司为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 27 日
9	英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 31 日
10	英大基金管理有限公司关于股权变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人	2020 年 9 月 3 日

		网站及中国证监会 基金电子披露网站	
11	关于英大财富宝 APP 和微信公众号维护的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 9 月 12 日
12	关于英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金提前结束募集的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 9 月 24 日
13	关于英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 9 月 25 日
14	英大基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 9 月 30 日
15	英大基金关于系统升级暂停“T+0 赎回提现业务”服务的通知	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 27 日
16	英大基金管理有限公司关于终止中期时代基金销售（北京）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 30 日

17	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 10 日
18	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 10 日
19	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 10 日
20	英大基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 29 日
21	英大基金管理有限公司关于监事会成员换届变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 29 日
22	英大基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 31 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	20200924 - 20201231	3,598,999,000.00	-	-	3,598,999,000.00	44.99%
	2	20200924 - 20201231	2,399,999,000.00	-	300,000.00	2,399,699,000.00	30.00%
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，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。

(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。

12.2 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国企改革主题股票型证券投资基金设立的文件

《英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》

《英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》

《英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》

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

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.ydamc.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人英大基金管理有限公司，客户服务电话：010-57835666、400-890-5288。

英大基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日