英大现金宝货币市场基金 2018年半年度报告摘要

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8月28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2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	英大现金宝货币
基金主代码	000912
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月10日
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,050,575,042.25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	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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	14,505,123.56
本期利润	14,505,123.56
本期净值收益率	1.9376%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	1,050,575,042.25
期末基金份额净值	1.0000

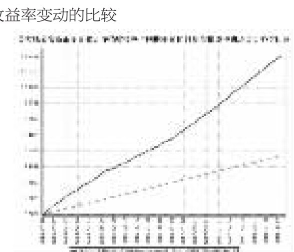
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。 (2) 本基金无持有人认购\申购或交易基金的各项费用。(3)本基金收益分配按日结转份额。

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	0.2949%	0.0026%	0.1110%	0.0000%	0.1839%	0.0026%
过去三个月	0.9489%	0.0042%	0.3366%	0.0000%	0.6123%	0.0042%
过去六个月	1.9376%	0.0050%	0.6695%	0.0000%	1.2681%	0.0050%
过去一年	3.9607%	0.0048%	1.3500%	0.0000%	2.6107%	0.0048%
过去三年	10.5035%	0.0077%	4.0537%	0.0000%	6.4498%	0.0077%
自基金合同生效起至今	12.9752%	0.0076%	4.8045%	0.0000%	8.1707%	0.0076%

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



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

经中国证监会批准,英大基金管理有限公司(简称本公司或本基金管理人)于2012年8月17日在北京成立,经营范围包括基金募集、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等。本公司注册资本2亿元人民币,股东为国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和航天科工财务有限责任公司,持股比例分别为49%、36%、15%。本公司于2015年9月16日设立全资子公司英大资本管理有限公司,主营特定客户资产管理业务以及法律法规和中国证监会许可的其他业务。

截至2018年6月30日,本公司管理7只开放式证券投资基金,同时,本公司及子公司分别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。

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《英大现金宝货币市场基金基金合同》、《英大现金宝货币市场基金招募说明书》的约定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,去杠杆政策对经济的负作用开始体现,中美贸易战摩擦持续发酵,供给与需求数据出现背离,经济基本面边际走弱压力愈来愈大。政策方面,央行由“去杠杆”转变为“稳杠杆”,货币政策边际放松,采用“宽货币,紧信用”的政策,公开市场操作“削峰填谷”,维护市场流动性“合理充裕”,债券市场收益率震荡下行,收益率曲线陡峭化;同时,上半年信用违约事件频发,开始蔓延到上市公司和中高评级主体,使得机构投资风险偏好急剧下降,信用利差大幅走阔。

本基金上半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

本报告期基金份额净值增长率为1.9376%,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2018年下半年,在强监管、宽货币、紧信用的政策基调下,实体融资需求受到抑制,经济基本面边际下滑,中美贸易战等地缘政治风险持续发酵将带动避险情绪升温,债券市场收益率将在多重利多和利空因素下震荡下行。而下半年是地产、化工类产业债到期高峰期,各类发债主体融资压力巨大,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历。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14,505,123.56元。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有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14,505,123.56元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:英大现金宝货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		938,088.90	373,900.96
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		726,189,181.39	505,065,088.55
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		726,189,181.39	505,065,088.55
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		419,033,108.55	114,235,691.36
应收证券清算款		-	-
应收利息		4,968,754.16	4,492,316.24
应收股利		-	-
应收申购款		513,263.31	80,576.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	9.50
资产总计		1,151,642,396.31	624,247,582.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		99,985,750.01	29,969,835.04
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		268,088.81	184,131.76
应付托管费		81,239.01	55,797.48
应付销售服务费		203,097.54	139,493.76
应付交易费用		38,568.66	26,336.11
应交税费		14,653.30	-
应付利息		23,177.14	16,516.20
应付利润		270,175.14	202,848.68
递延所得税负债		-	-
其他负债		182,604.45	228,050.60
负债合计		101,067,354.06	30,823,009.63
所有者权益:			
实收基金		1,050,575,042.25	593,424,572.98
未分配利润		-	-
所有者权益合计		1,050,575,042.25	593,424,572.98
负债和所有者权益总计		1,151,642,396.31	624,247,582.61

注:报告截止日2018年6月30日,英大现金宝货币基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,050,575,042.25份。

6.2 利润表

会计主体:英大现金宝货币市场基金

本报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		17,826,568.87	12,488,411.47
1.利息收入		17,564,961.43	12,408,087.37
其中:存款利息收入	6.4.7.11	280,128.43	813,137.85
债券利息收入		11,834,295.93	6,978,408.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,450,537.07	4,616,541.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		261,607.44	80,324.10
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	261,607.44	80,324.10
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		3,321,445.31	2,617,085.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,244,030.11	917,649.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	376,978.87	278,075.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	942,446.92	695,189.17
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		607,355.71	586,068.53
其中:卖出回购金融资产支出		607,355.71	586,068.53
6. 税金及附加		13,700.05	-
7. 其他费用	6.4.7.20	136,933.65	140,102.40
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		14,505,123.56	9,871,325.92
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		14,505,123.56	9,871,325.92

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:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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(本期净利润)	-	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
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	562,806,153.16	-	562,806,153.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	9,871,325.92	9,871,325.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-121,645,116.76	-	-121,645,116.76
其中:1.基金申购款	655,902,110.93	-	655,902,110.93
2.基金赎回款	-777,547,227.69	-	-777,547,227.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-9,871,325.92	-9,871,325.92
五、期末所有者权益(基金净值)	441,161,036.40	-	441,161,036.40

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:

______ 孔 旺 ______ ______ 柴 元 春 ______ ____陈畅____

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,本基金投资于货币市场工具,主要包括现金、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单和通知存款、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、期限在一年以内(含一年)的央行票据和债券回购、短期融资券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他产品,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则 – 基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《英大纯债债券型证券投资基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况及2018年1月1日起至2018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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.4.3 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。

6.4.5 税项

1、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,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试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称“资管产品运营业务”),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、企业所得税

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税 [2008]1号)的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

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

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

4、印花税

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

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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

经中国证监会核准(证监许可[2018]872号),本公司原股东英大国际信托有限责任公司将所持本公司49%股权转让给国网英大国际控股集团有限公司,相关工商变更登记手续于2018年6月14日办结。

6.4.6.2 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
深圳英大资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,244,030.11	917,649.81
其中:支付销售机构的客户维护费	82,886.59	84,962.74

注:①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。

②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。

③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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	376,978.87	278,075.64

注:①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。

②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。

6.4.7.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
英大基金管理有限公司	562,370.48
中国建设银行股份有限公司	112,902.13
合计	675,272.61

注:①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。

②销售服务费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间,本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日(2014年12月10日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	14,437,652.53	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	4,000,000.00	-
期末持有的基金份额	10,437,652.53	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.9900%	-

注:报告期间申购/买入总份额:含红利再投、转换入份额;报告期间赎回/卖出总份额:含转换出份额。

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。

6.4.7.4.2 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 2018年6月30日		上年度末 2017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
深圳英大资本管理有限公司	36,005,645.13	36.7210%	0.00	0.0000%

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。

6.4.7.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	938,088.90	8,269.77	1,175,714.22	21,507.21

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按约定利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间,本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间,本基金无其他关联交易事项。

6.4.8 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末(2018年6月30日)未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末(2018年6月30日)未持有需披露的暂时停牌股票。

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018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99,985,750.01元,是以如下债券作为质押:

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
111810187	18兴业银行CD187	2018年7月2日	98.68	300,000	29,602,549.45
011800747	18大同煤矿SCP004	2018年7月2日	100.00	200,000	20,000,932.80
011800291	18鲁钢铁SCP004	2018年7月2日	100.12	300,000	30,036,914.96
011766034	17鲁钢铁SCP009	2018年7月2日	100.08	300,000	30,024,735.93
合计				1,100,000	109,665,133.14

6.4.8.3.2 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回购。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	726,189,181.39	63.06
	其中:债券	726,189,181.39	63.06
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	419,033,108.55	36.39
	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	938,088.90	0.08
4	其他各项资产	5,482,017.47	0.48
5	合计	1,151,642,396.31	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		5.63
	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	99,985,750.01	9.52
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的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	43
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	25

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	61.86	9.52
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	18.94	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	13.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	9.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	5.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	109.10	9.52

7.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过240天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,939,789.60	0.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,007,264.78	5.71
	其中:政策性金融债	50,008,173.85	4.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	190,151,787.15	18.10
6	中期票据	-	-
7	同业存单	466,090,339.86	44.37
8	其他	-	-
9	合计	726,189,181.39	69.12
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溢折价。

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	111813087	18浙商银行CD087	600,000	59,632,627.21	5.68
2	170207	17国开07	500,000	50,008,173.85	4.76
3	111719215	17恒丰银行CD215	500,000	49,919,774.22	4.75
4	111819211	18恒丰银行CD211	500,000	49,677,971.65	4.73
5	111809147	18浦发银行CD147	400,000	39,756,176.69	3.78
6	011800291	18鲁钢铁SCP004	300,000	30,036,914.96	2.86
7	011766034	17鲁钢铁SCP009	300,000	30,024,735.93	2.86
8	011800859	18大同煤矿SCP005	300,000	30,024,687.76	2.86
9	111810187	18兴业银行CD187	300,000	29,602,549.45	2.82
10	111819168	18恒丰银行CD168	300,000	28,986,593.38	2.76

注:上表中,债券的成本包括债券面值和溢折价。

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1978%
报告期内偏离度的最低值	0.0024%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0893%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金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

本报告期内本货币市场基金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

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
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,968,754.16
4	应收申购款	513,263.31
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,482,017.47

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
16,955	61,962.55	960,059,722.60	91.38%	90,515,319.65	8.62%

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	239,880.52	0.0228%

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	0~10
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	593,424,572.98
本报告期基金总申购份额	1,088,280,089.67
减:本报告期基金总赎回份额	631,129,620.40
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	1,050,575,042.25

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金管理人于2018年1月30日发布公告,宗宽广先生自2018年1月27日起不再担任英大基金管理有限公司督察长职务。 本报告期内,基金管理人于2018年2月23日发布公告,朱志先生自2018年2月14日起代任英大基金管理有限公司督察长职务。 本报告期内,基金管理人于2018年6月8日发布公告,柴元春先生自2018年6月6日起担任英大基金管理有限公司副总经理职务。

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,本基金管理人有两起涉及同一名原员工的劳动争议诉讼尚未了结,该诉讼不涉及本基金。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,本基金未变更为本基金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。

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	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本报告期内本货币市场基金偏离度的绝对值未达到0.5%。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018.1.1-2018.6.30	209,249,193.64	4,072,220.62	0.00	213,321,414.26	20.31%
	2	2018.4.4-2018.6.30	0.00	504,450,517.57	0.00	504,450,517.57	48.02%
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

2018年8月28日