英大纯债债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期:2015年07月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
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2015年7月14日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大纯债债券	
基金主代码	650001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年04月24日	
报告期末基金份额总额	32,346,090.67份	
投资目标	本基金投资于固定收益类资产,在有效控制投资组合风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益,追求长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金依据宏观经济运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场收益特征,分析判断市场利率水平变动趋势,并预测下一阶段的利率水平,结合各类别资产的收益性、风险性和流动性特征,进行大类资产配置。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,该类基金长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,但高于货币市场基金,属于中低风险和收益水平的投资品种。	
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	
下属两级基金的基金简称	英大纯债债券A	英大纯债债券C
下属两级基金的交易代码	650001	650002
报告期末下属两级基金的份额总额	6,671,737.83份	25,674,352.84份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年04月01日-2015年06月30日)	
	英大纯债债券A	英大纯债债券C
1.本期已实现收益	360,364.13	1,520,704.82
2.本期利润	326,397.63	1,245,992.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0370	0.0349
4.期末基金资产净值	7,709,394.61	29,378,718.97
5.期末基金份额净值	1.1555	1.1443

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

英大纯债债券A

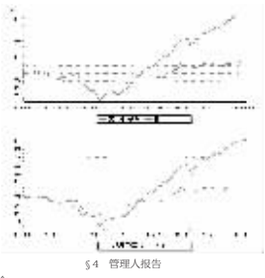
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.14%	0.08%	1.35%	0.10%	1.79%	-0.02%

英大纯债债券C

阶段	净值增长率①	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	3.03%	0.08%	1.35%	0.10%	1.68%	-0.02%

注:本基金的业绩比较基准是中债综合指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘寒	总经理助理,本基金基金经理	2013年04月24日	2013年09月09日	13	曾任嘉实基金管理有限公司投资决策委员会委员,固定收益部副总监、总监,社保债券基金经理、公募债券基金经理;招商证券研发中心高级研究员;巨田证券投资部副经理;平安证券固债部、平安集团投资管理中心投资经理。2012年加入英大基金管理有限公司,于2013年9月9日离职。
李岚	本基金基金经理	2013年09月09日	2014年11月03日	7	曾任深圳发展银行深圳龙岗支行信贷员,平安资产管理有限责任公司研究员,中国人保资产管理股份有限公司投资经理,安邦资产管理有限责任公司部门副总等职。2012年9月加入英大基金管理有限公司。
张琳娜	本基金基金经理	2014年10月24日		9	对外经济贸易大学金融学硕士,9年基金从业经历。先后任益民基金管理有限公司集中交易部交易员、副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限公司,曾任公司交易管理部副总经理(主持工作),现任固定收益部副总经理。

注:①任职日期说明:首位基金经理的任职日期为基金合同生效的日期,继任基金经理的任职日期为该基金经理经监管机构审核通过后公司公开披露的日期。
②证券从业年限的计算标准:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,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《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》、《英大纯债债券型证券投资基金基金招募说明书》的约定,以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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,通过公司新上线的公平交易系统监测和人工复核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非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年二季度债市收益率先抑后扬,10年国债季度末和季度初基本持平,季度内一年期存款利率下调50BP至2.0%,二季度存款准备金率全面下调和定向下调相结合,央行于季度末重启暂停数周的公开市场操作,资金价格6月有所上升。宏观数据初现企稳,市场预期和长端利率债走势相吻合,由于长端收益率处于震荡环境中,没有方向性,因此本基金在二季度小幅调整了持仓调整,对单券占比过高的品种进行了减持操作,组合杠杆稍有增加,但久期较短。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,英大纯债A类基金累计份额净值为1.1555元,报告期基金份额净值增长率为3.14%;英大纯债C类基金份额净值为1.1443元,报告期基金份额净值增长率为3.03%;同期业绩比较基准增长率为1.35%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年,美国经济上涨暂缓将再次延迟加息时点,希腊债务危机的演变将决定是否退出欧元区,海外经济的不确定性增加会对国内稍有企稳的经济形势带来冲击,基建投资、一带一路的实质效应以及财政政策的发力成为助推经济增长的引擎,效果有待观察。通胀在下半年不成为影响债市的主导因素,资金面保持宽松格局叠加宏观经济存在下修的可能。
展望三季度,本基金将适度增加久期,持续关注全球和国内经济形势,保持稳健的风格,力争为持有人持续实现正收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	57,512,335.80	93.86
	其中:债券	57,512,335.80	93.86
	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	798,306.53	1.30
8	其他资产	2,963,774.12	4.84
9	合计	61,274,416.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。
5.4 报告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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	723,795.30	1.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,997,000.00	8.08
	其中:政策性金融债	2,997,000.00	8.08
4	企业债券	43,706,040.50	117.84
5	企业短期融资券	10,085,500.00	27.19
6	中期票据		-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	57,512,335.80	155.07

5.5 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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122125	11美兰债	51,000	5,505,960.00	14.85
2	112142	12格林债	52,000	5,468,840.00	14.75
3	122132	12鹏博债	52,000	5,452,200.00	14.70
4	112079	12长安债	51,000	5,283,600.00	14.25
5	112069	12明牌债	51,000	5,249,940.00	14.16

5.6 报告期末按公允价值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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 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
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无股指期货投资。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末无股指期货的投资。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2014年10月24日,12鹏博债(122132)的发行主体鹏博士电信传媒集团股份有限公司(以下简称"鹏博士")由于公司披露的2011、2012、2013年年度财务报告中现金流量表及补充资料的数据存在错误,收到证监会四川监管局《关于对鹏博士电信传媒集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》(行政监管措施决定书[2014]15号)。鹏博士在收到警示函后,组织对相关财务信息进行更正,并于2014年10月31日公布了关于执行落实证监会四川监管局《关于对电信传媒集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》的整改报告。2014年11月7日,鹏博士发布《关于大股东增持公司股份及误操作导致短线交易的公告》,公告中说明由于操作失误,鹏博士的大股东在增持公司股份过程中出现短线操作,违反了《证券法》及上海证券交易所的有关规定,但短线交易涉及金额较小,且未产生收益。除上述情况外,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。

5.11.2 本期内本基金没有股票投资。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,504.89
2	应收证券清算款	1,298,464.09
3	应收股利	-
4	应收利息	1,008,195.44
5	应收申购款	642,345.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	11,264.70
8	其他	-
9	合计	2,963,774.12

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	英大纯债债券A	英大纯债债券C
报告期期初基金份额总额	12,473,457.28	37,122,288.85
报告期期间基金总申购份额	980,828.27	6,964,222.11
减:报告期期间基金总赎回份额	6,782,547.72	18,412,158.12
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	6,671,737.83	25,674,352.84

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期末,基金管理人未持有本基金份额。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期末,基金管理人未持有本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准英大纯债债券型证券投资基金设立的文件
《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》
《英大纯债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
报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告
9.2 存放地点
基金管理人和/或基金托管人住所
9.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

英大基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日

英大领先回报混合型发起式证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月14日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年4月1日起6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	领先回报
基金主代码	000458
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月5日
报告期末基金份额总额	182,720,040.44份
投资目标	本基金主要采用宏观周期策略与精选行业领先企业策略,寻找能够持续为股东创造价值的投资标的,在科学严格的投资风险管理前提下,谋求基金资产长期稳健回报。
投资策略	本基金以自上而下和自下而上相结合的方构建投资组合,并对投资组合进行动态调整。由于本基金为混合型基金,核心投资策略包括资产配置策略、行业配置策略、股票选择策略,通过上述策略优化投资组合的风险收益,提升投资组合回报。
业绩比较基准	50%×沪深300指数+50%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金产品。
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	58,760,565.54
2.本期利润	30,883,567.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.1949
4.期末基金资产净值	178,994,088.53
5.期末基金份额净值	0.9796

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②本期已实现收益指基金本期投资收益、利息收入、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。

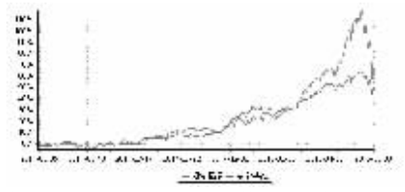
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	11.02%	2.77%	6.22%	1.31%	4.80%	1.46%

注:本基金基金合同生效日为2014年3月5日,报告期内,本基金的投资运作严格按照法律法规和基金合同的约定执行。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金基金合同生效日为2014年3月5日,图示日期为2014年3月5日至2015年6月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
秦岭	权益投资部副总经理,本基金基金经理	2014年3月5日	-	9	秦岭先生,清华大学管理学硕士。9年证券、基金行业从业经历。2012年9月加入我公司,现任英大基金管理有限公司权益投资部副总经理。历任国务院发展研究中心助理研究员,天弘基金研究部研究员,大成基金研究部研究员,中国国际金融有限公司研究部高级经理。
赵强	权益投资部基金经理,本基金基金经理	2014年3月5日	2015年4月28日	12	赵强先生,南开大学管理学硕士。2012年9月加入英大基金管理有限公司,现任英大基金管理有限公司权益投资部基金经理。具备17年金融业从业经历,其中12年基金行业从业经历。历任职于国金通用基金管理有限公司、华安基金管理有限公司,招商银行天津分行、中国农业银行天津分行等金融机构。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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《英大领先回报混合型发起式证券投资基金基金合同》、《英大领先回报混合型发起式证券投资基金招募说明书》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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《英大领先回报混合型发起式证券投资基金基金合同》、《英大领先回报混合型发起式证券投资基金招募说明书》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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度,市场冲高回落,基于宏观经济寻底,传统产业面临较大的压力,我们坚定看好中国经济产业升级和转型的方向,领先回报把握了部分成长股的投资机会,净值有较好增长。为了回报投资者,6月下旬,领先回报进行了大比例分红。6月份在严查场外配资,新股发行节奏加快,以及股票市场内在技术调整的背景下,股票市场大幅回调,并引发了严重的恐慌情绪。本基金净值也出现一定的回撤。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,领先回报基金累计份额净值为1.6396元。报告期内,基金份额净值增长率为11.02%,同期业绩比较基准增长率为6.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本期市场走出冲高回落走势,市场的短期调整压力较大,但是我们认为市场已经进入了寻底阶段,中长期看仍然具有上升空间。主要原因在于:一、宽松的货币政策没有发生变化,政府保增长的决心非常大;二、居民资金向股市转移的趋势未发生变化,公募基金、国内的养老金等大量资金将逐步入市;三、以银行、保险为代表的金融、地产等板块估值较低,虽然这些板块去年曾经大幅上涨;四、政府鼓励大众创业、万众创新的大背景,以及国企改革方案、十三五规划等政策文件会持续发挥作用;五、政府已经意识到了证券市场的风险,一系列政策持续推出。我们相信政府救市的决心和能力。
近期很多前期的强势股已经回调超过50%,市场风险得到了一定释放。未来一段时间市场处于震荡期,市场情绪有望逐步恢复。我们持续关注国企改革、十三五规划等以及超跌的优质成长股,并择机买入。对于讲故事的个股,我们将保持回避,同时在仓位上采取稳健策略。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	160,755,272.91	82.89
	其中:股票	160,755,272.91	82.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	31,010,199.08	15.99
8	其他资产	2,182,767.05	1.13
9	合计	193,948,239.04	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,870,500.00	3.84
C	制造业	72,150,784.88	40.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	31,925,757.28	17.84
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	36,569,633.35	20.43
H	住宿和餐饮业	7,943,287.40	4.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,285,920.00	2.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,390.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	160,755,272.91	89.81

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600068	葛洲坝	800,000	9,352,000.00	5.22
2	600446	金证股份	70,000	8,642,200.00	4.83
3	600970	中材国际	579,920	8,478,430.40	4.74
4	002385	大北农	624,876	8,448,323.52	4.72
5	600502	安徽水利	400,000	7,996,000.00	4.47
6	300005	探路者	289,901	7,943,287.40	4.44
7	002236	大华股份	230,000	7,341,600.00	4.10
8	002373	千方科技	160,000	6,926,400.00	3.87
9	000758	中色股份	350,000	6,870,500.00	3.84
10	002358	森源电气	299,944	6,442,797.12	3.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告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。
5.7 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
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无股指期货投资。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末无股指期货投资。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本期内未发现本基金投资前十名证券的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、批评的情况。

5.11.2 本期内本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定,也均在基金的备选股票池之内。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	317,209.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,828.88
5	应收申购款	1,854,728.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,182,767.05

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末无可转换债券投资。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	189,416,604.64
报告期期间基金总申购份额	135,736,995.14
减:报告期期间基金总赎回份额	142,433,559.34
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	182,720,040.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,772,797.53
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	10,772,797.53
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.90

注:本期基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	英大直销	2014年2月28日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
合计			10,000,000.00	10,000,000.00	

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,772,797.53	5.90%	10,000,000.00	5.47%	3年
基金管理人高级管理人员	107,727.98	0.06%	100,000.00	0.05%	3年
基金经理等人员	215,460.43	0.12%	200,004.16	0.11%	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	3年
其他	-	-	-	-	3年
合计	11,095,985.94	6.07%	10,300,004.16	5.64%	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录
中国证监会批准英大领先回报混合型发起式证券投资基金设立的文件
10.2 存放地点
基金管理人和/或基金托管人住所
10.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

英大基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日

英大现金宝货币市场基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期:2015年07月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
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2015年7月14日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	95,863,873.77
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年04月01日-2015年06月30日)
1.本期已实现收益	1,416,684.33
2.本期利润	1,416,684.33
3.期末基金资产净值	95,863,873.77

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。

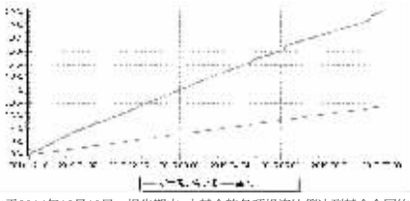
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值收益率①	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	0.9438%	0.0098%	0.3366%	0.0000%	0.6072%	0.0098%

注:本基金成立于2014年12月10日,业绩比较基准是同期七天通知存款利率(税后)。

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



注:本基金成立于2014年12月10日。报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张琳娜	本基金基金经理	2014年12月10日		9	对外经济贸易大学金融学硕士,9年基金从业经历。先后任益民基金管理有限公司集中交易部交易员、副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限公司,曾任公司交易管理部副总经理(主持工作),现任固定收益部副总经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,通过公司新上线的公平交易系统监测和人工复核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非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年二季度短债收益率先抑后扬,季度内一年期存款利率下调50BP至2.0%,二季度存款准备金率全面下调和定向下调相结合,央行于季度末重启暂停数周的公开市场操作,资金价格6月有所上升。
本基金在二季度继续增持短融,并通过存款和逆回购的组合控制流动性风险,组合收益较为稳定。

4.5 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0.9438%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持