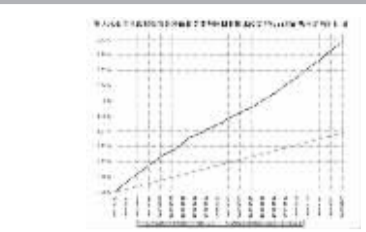


英大现金宝货币市场基金

2017年第三季度报告

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:2017年10月26日
1 重要提示
基金管理人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。投资者有风险,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。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。
2 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资策略, 投资范围, 业绩比较基准, 基金管理人, 基金托管人.

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

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年7月1日至2017年9月30日), 1. 本期已实现收益, 2. 本期利润, 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...

3.2 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

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职本基金的基金经理日期 证券从业年限 说明

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,取信于市场,取信于社会公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
在本报告期内,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,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年第三季度,全国金融工作会议召开,提出金融工作要围绕服务实体经济、防控风险、深化改革,并定调“强监管、去杠杆、防风险”,监管政策逐步推进落地,央行继续执行“削峰填谷”操作,货币政策维持中性,三季度资金面整体呈现中性偏紧走势,在月末、季末等紧张时点资金价格波动进一步加大。现券市场短端收益率先下后上,整体维持震荡。

4.5 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1.0103%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

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20人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 占基金资产净值比例(%)

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

Table with columns: 序号, 平均剩余期限, 报告期内资产净值增加/减少的比例(%)

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告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

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with columns: 项目, 偏离情况

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本基金本报告期内负偏离度的绝对值未超过0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
在本报告期内,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,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年第三季度,全国金融工作会议召开,提出金融工作要围绕服务实体经济、防控风险、深化改革,并定调“强监管、去杠杆、防风险”,监管政策逐步推进落地,央行继续执行“削峰填谷”操作,货币政策维持中性,三季度资金面整体呈现中性偏紧走势,在月末、季末等紧张时点资金价格波动进一步加大。现券市场短端收益率先下后上,整体维持震荡。

永赢货币市场基金

2017年第三季度报告

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内基金业绩表现为1.0665%,业绩比较基准收益率为0.3403%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 占基金资产净值比例(%)

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内基金业绩表现为1.0665%,业绩比较基准收益率为0.3403%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 占基金资产净值比例(%)

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

1.1 重要提示
基金管理人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。投资者有风险,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。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。
2 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资策略, 投资范围, 业绩比较基准, 基金管理人, 基金托管人.

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

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年7月1日至2017年9月30日), 1. 本期已实现收益, 2. 本期利润, 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...

3.2 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

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职本基金的基金经理日期 证券从业年限 说明

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《永赢货币市场基金基金合同》、《永赢货币市场基金招募说明书》的约定,取信于市场,取信于社会公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
在本报告期内,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《永赢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,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年第三季度,全国金融工作会议召开,提出金融工作要围绕服务实体经济、防控风险、深化改革,并定调“强监管、去杠杆、防风险”,监管政策逐步推进落地,央行继续执行“削峰填谷”操作,货币政策维持中性,三季度资金面整体呈现中性偏紧走势,在月末、季末等紧张时点资金价格波动进一步加大。现券市场短端收益率先下后上,整体维持震荡。

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

2017年第三季度报告

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内基金业绩表现为1.0665%,业绩比较基准收益率为0.3403%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 占基金资产净值比例(%)

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内基金业绩表现为1.0665%,业绩比较基准收益率为0.3403%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 占基金资产净值比例(%)

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

基金管理人:永赢基金管理有限公司
基金托管人:华泰证券股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日
1 重要提示
基金管理人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。投资者有风险,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。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。
2 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资策略, 投资范围, 业绩比较基准, 基金管理人, 基金托管人.

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

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年7月1日至2017年9月30日), 1. 本期已实现收益, 2. 本期利润, 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...

3.2 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

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职本基金的基金经理日期 证券从业年限 说明

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《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的约定,取信于市场,取信于社会公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
在本报告期内,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《永赢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,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年第三季度,市场情绪较为乐观,各板块出现明显上涨,热点板块表现活跃。在此背景下,采用量化选股策略的产品表现良好。在本季度,本基金遵循稳健原则,灵活运用资产配置,通过量化选股策略筛选出表现符合预期的个股,体现了本基金投资策略的有效性。

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

2017年第三季度报告

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内基金业绩表现为1.179%,同期业绩比较基准收益率为0.404%。
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20人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 占基金资产净值比例(%)

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内基金业绩表现为1.179%,同期业绩比较基准收益率为0.404%。
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20人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 占基金资产净值比例(%)

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

1.1 重要提示
基金管理人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。投资者有风险,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。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。
2 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资策略, 投资范围, 业绩比较基准, 基金管理人, 基金托管人.

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职本基金的基金经理日期 证券从业年限 说明

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《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的约定,取信于市场,取信于社会公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
在本报告期内,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《永赢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,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年第三季度,市场情绪较为乐观,各板块出现明显上涨,热点板块表现活跃。在此背景下,采用量化选股策略的产品表现良好。在本季度,本基金遵循稳健原则,灵活运用资产配置,通过量化选股策略筛选出表现符合预期的个股,体现了本基金投资策略的有效性。

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

2017年第三季度报告

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内基金业绩表现为1.179%,同期业绩比较基准收益率为0.404%。
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20人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 占基金资产净值比例(%)

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内基金业绩表现为1.179%,同期业绩比较基准收益率为0.404%。
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20人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 占基金资产净值比例(%)

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。
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十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。
5.9.2 本报告期内,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、处罚的情况。

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with columns: 报告期期初基金份额总额, 报告期基金申购份额, 报告期基金赎回份额, 报告期基金转入份额, 报告期基金转出份额, 报告期末基金份额总额

7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

8.1 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

Table with columns: 投资者序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 期初比例, 期末份额, 期末比例, 持有份额, 份额占比

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
8.2.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额(份), 交易金额(元), 适用费率

8.3 影响投资者决策的其他重要信息
8.3.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

8.4 影响投资者决策的其他重要信息
8.4.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.5 影响投资者决策的其他重要信息
8.5.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.5.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.6 影响投资者决策的其他重要信息
8.6.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.7 影响投资者决策的其他重要信息
8.7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.8.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.9 影响投资者决策的其他重要信息
8.9.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.10 影响投资者决策的其他重要信息
8.10.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
8.10.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细