

英大现金宝货币市场基金

2015 第二季度 报告

2015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
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

基金名称	英大现金宝货币
基金代码	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	为基金份额持有人提供流动性,追求超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金投资策略符合基金管理人流动性管理下,追求超越业绩比较基准的投资收益。
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低于证券投资基金中其他类别基金。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年04月01日至2015年06月30日)
1.本期已实现收益	1,410,684.53
2.本期利润	1,410,684.53
3.本期基金份额净值	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。

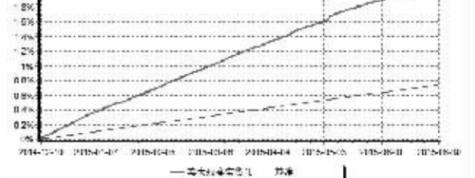
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长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	业绩比较基准收益率②	差额①-②
过去三个月	0.9438%	0.0998%	0.3366%

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 魏金经理小组 简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏金	本基金基金经理	2014年12月10日	-	9	对非货币类基金有多年从业经验,9年基金从业经历,先后担任基金基金经理等职务,具有丰富市场交易经验,基金管理经验,2014年9月加入英大基金管理有限公司,担任公募基金经理职务,现任基金经理。

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合同》、《英大现金宝货币市场基金招募说明书》的约定,以诚信于市场,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公司治理结构和内部控制制度,加强内部治理,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或成交较多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续作的公开市场操作,资金价格6月有所上升。本基金在二季度继续维持增持,并通过存单和逆回购的组合控制流动性风险,组合收益较为稳定。

4.5 报告期内基金的投资表现

截至报告期末,本基金本报告期的份额净收益率为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元的情形。

4.7 管理人应对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年,我国经济将继续保持稳中趋缓态势,希腊债务危机的演变将决定是否重返欧元区,海外经济的不确定性增加将对国内稍有利企稳形势带来冲击,基建投资、“一带一路”的实际效应以及财政政策的有效性成为助推经济增长的引擎,效果有待观察。通胀在中长期内不会成为影响债市的主导因素,经济没有确定性的增长前,资金面将继续保持宽松格局,取消存贷比叠加关键关联交易限制都会减小资金的季节性波动。

本基金将持续关注一级市场和央行的后续操作,保持适度的组合久期,在流动性可控的前提下,力争为持有人持续实现理想的回报。

§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	占基金总资产比例(%)
1	固定收益投资	67,078,943.92	69.81
1.1	其中:债券	67,078,943.92	69.81
2	货币市场基金	-	-
3	权益类投资	-	-
4	其他资产	27,987,916.26	29.13
5	其他负债	1,015,766.63	1.06
6	合计	96,062,566.83	100.00

5.2 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	0.38
1.1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
3	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,为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。

5.3 本报告期末投资组合平均剩余期限分布

在本报告期内,本基金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%。

5.3.1 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	122
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

注:本报告期末货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 本报告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(%)	长期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	29.20	-
2	30天-60天	20.89	-
3	60天-90天	7.32	-
4	90天-180天	6.31	-
5	180天-397天(含)	38.46	-
6	合计	99.12	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,036,399.57	17.77
4	企业债券	17,036,399.57	17.77
5	企业短期融资券	50,042,544.35	52.20
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	合计	67,078,943.92	69.97

5.4.1 报告期末按信用评级分类的债券投资组合

序号	信用评级	持仓成本	占基金资产净值比例(%)
1	AAA	-	-
2	AA+	-	-
3	AA	17,036,399.57	17.77
4	AA-	17,036,399.57	17.77
5	AA+	50,042,544.35	52.20
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	合计	67,078,943.92	69.97

5.4.2 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	持仓成本	占基金资产净值比例(%)
1	100220	10附开3	10,000.00	10.46
2	07150105	15国债05	9,999,025.50	10.43
3	110212	11附开1	7,012,623.19	7.32
4	04145262	14晋开债 CP01	6,052,725.80	6.31
5	04150809	15皖开债 CP01	5,995,033.71	6.26
6	04150821	15豫开债 CP01	5,997,067.89	6.28
7	04150707	15皖开债 CP01	5,997,572.44	6.26
8	04150803	15晋开债 CP01	5,997,441.99	6.26
9	04150513	15上开债 CP01	5,000,429.80	5.22
10	04150914	15开开债 CP01	5,000,429.80	5.22

注:上表中,债券的成本包括摊余成本和溢价。

5.4.3 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	持仓成本	占基金资产净值比例(%)
1	100220	10附开3	10,000.00	10.46
2	07150105	15国债05	9,999,025.50	10.43
3	110212	11附开1	7,012,623.19	7.32
4	04145262	14晋开债 CP01	6,052,725.80	6.31
5	04150809	15皖开债 CP01	5,995,033.71	6.26
6	04150821	15豫开债 CP01	5,997,067.89	6.28
7	04150707	15皖开债 CP01	5,997,572.44	6.26
8	04150803	15晋开债 CP01	5,997,441.99	6.26
9	04150513	15上开债 CP01	5,000,429.80	5.22
10	04150914	15开开债 CP01	5,000,429.80	5.22

注:上表中,债券的成本包括摊余成本和溢价。

5.6 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏差

项目	偏离情况
报告期内偏离度绝对值最大值(0.25%-0.5%)的频数	-
报告期内偏离度绝对值最大值	0.3421%
报告期内偏离度绝对值最小值	0.0422%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2126%

5.7 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金采用摊余成本法计价,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。本基金采用固定的摊余成本,基金账面价值始终保持100元。

5.8.2 本报告期内,本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 本报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行人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。

5.8.4 其他资产构成

项目	金额(元)
应收证券清算款	-
应收利息	915,601.15
应收申购款	100,420.20
其他应收款	40,130.50
其他	-
合计	1,015,766.63

5.8.6 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

报告期末基金份额总额	152,066,082.19
报告期基金份额总额	31,091,160.59
减:报告期基金份额赎回	87,250,360.01
报告期末基金份额总额	95,863,873.77

§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 影响投资者决策的其他重要信息

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准英大现金宝货币市场基金设立的文件
《英大现金宝货币市场基金合同》
《英大现金宝货币市场基金托管协议》
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指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人住所

9.3 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅,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

2015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: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仔细阅读本基金的招募说明书。

§2 基金产品概况

基金名称	英大领先回报
基金代码	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
投资目标	本基金主要采用周期策略与精选行业龙头企业,寻找具有持续成长能力的优质个股,在保持资产流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要采用周期策略与精选行业龙头企业,寻找具有持续成长能力的优质个股,在保持资产流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	50%×沪深300指数+50%×上证综指
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品种。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	56,700,563.54
2.本期利润	30,863,567.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.1949
4.期末基金资产净值	179,948,088.53
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据。
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。

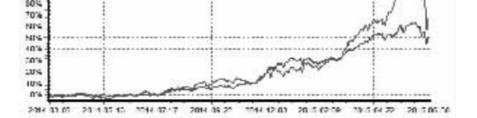
3.2 基金业绩表现

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	业绩比较基准收益率②	差额①-②
过去三个月	11.02%	2.77%	8.25%

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执行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,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 魏金经理小组 简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏金	权益投资部副经理,本基金基金经理	2014年3月5日	-	9	硕士学历,清华大学管理专业硕士,9年证券基金从业从业经历,2012年9月加入魏公司,现任英大基金管理有限公司权益投资部副经理,担任基金基金经理等职务,具有丰富市场交易经验,基金管理经验,2014年9月加入英大基金管理有限公司,担任公募基金经理职务,现任基金经理。
魏金	权益投资部副经理,本基金基金经理	2014年3月5日	2015年4月28日	12	硕士学历,南开大学管理专业硕士,2012年9月加入魏公司,现任英大基金管理有限公司权益投资部副经理,担任基金基金经理等职务,具有丰富市场交易经验,基金管理经验,2014年9月加入英大基金管理有限公司,担任公募基金经理职务,现任基金经理。

4.2 管理人对于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,以诚信于市场,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公司治理结构和内部控制制度,加强内部治理,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或成交较多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