# 

#### 送出日期:2016年3月30日

§1 重要提示

\$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、准确性环记器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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25日度核了本报告中的财务指标,净值表现、和阅分配情况、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。
基金管理人东话以诚实信用、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。
基金的过行生业绩并不代表其未来表现。投资者风险、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2015年1月1日起至12月31日止。

本报台	<b>- 期自20</b>	15年1月1日起至	12月31日			
2.1 寿	金基本性	青况		§ 2 基金简介		
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	i总额		733,186,126.71份		
基金合同				不定期		
2.2 基	金产品记	兑明				
投资目标				力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩较基准的投资收益。		
投资策略	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, 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	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料 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 型基金。		
2.3 基	金管理	人和基金托管人		•	T	
	项目			基金管理人	基金托管人	
名称			英大基金	论管理有限公司	中国建设银行股份有限公司	
		姓名	赵照		田青	
信息披露	8负责人	联系电话	010-591	12177	010-67595096	

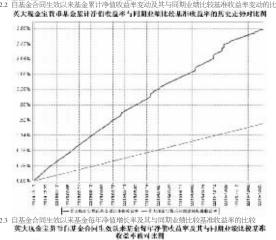
各尸服务电话	400-890-5288		010-67595096		
传真	010-85878087		010-66275853		
2.4 信息披露方式					
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址			http://www.ydamc.com		
基金年度报告备置地点			管理人和基金托管人的办公地址		
§3 主 3.1 主要会计数据和财务指标	要财务指标、基金净值表现	1及利泊	国分配情况 - 全經算位   民币		

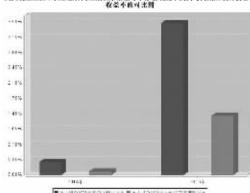
tianqing1.zh@ccb.com

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年12月10日(基金合同生效日)-2014年12 月31日
本期已实现收益	5,526,539.33	842,251.45
本期利润	5,526,539.33	842,251.45
本期净值收益率	3.4743%	0.2970%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-	-
期末基金资产净值	733,186,126.71	256,264,852.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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,由于货引本法核算,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。

(3)华蓝地区面为10分页的。						
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
过去三个月	0.7675%	0.0137%	0.3403%	0.0000%	0.4272%	0.0137%
过去六个月	1.5110%	0.0110%	0.6805%	0.0000%	0.8305%	0.0110%
过去一年	3.4743%	0.0093%	1.3500%	0.0000%	2.1243%	0.0093%
自基金合同生 效起至今	3.7816%	0.0091%	1.4314%	0.0000%	2.3502%	0.0091%
注:本基金	成立于2014年	12月10日,业组	比较基准是同	司期七天通知存	款利率(税后)。	





3.3 MZ=	- 中國並1979円7月日1月9日			单位	:人民币:
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2015	5,533,742.91	-	-7,203.58	5,526,539.33	
2014	807,551.26	-	34,700.19	842,251.45	
合计	6,341,294.17	-	27,496.61	6,368,790.78	
		《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 2012年8月17日, 经中国证监会批准, 英大基金管理有限公司在北京正式成立。公司由英大国际信托有 职责任公司(简称英大信托), 中国交通建设股份有限公司(简称中交股份)和航天科工财务有限责任公司 (简称航天科工财务)—家股东发起成立。英大基金注册资金2亿元人民币, 其中英大信托出资比例为49%, 中交股份出资比例为59%, 就天科工财务出资比例为59%。 截至报告期末, 本公司管理5只开放式证券投资基金, 同时,管理多个特定客户资产投资组合。

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从业	说明
灶石	界バラチ	任职日期	离任日期	年限	DC97
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。关于。 6年益长、9年基金从业经历。关于 后任益民基金管理有限公司集中交易。2012年3月加 经理等联务。2012年3月加 曾任公司交易管理都必副总 经理(住持工作)现任固定 收益部副总经理。

规定。
③本基金无基金经理助理。

规定。
③本基金无基金经理助理。
42 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
42 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
42 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
42 管理人对报告期内本基金运作产格按照《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》、《英大观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,加强内阁管理,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。
43 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
43.1 公平交易制度和特别方法。但不受易制度有导意见》、《基金管理人通过不断完善法人治理价基金公司公平交易制度和任政党组合得到公平对待、保护不设定者合法权益、根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度有导意见》、《基金管理和限公司公平交易管理力法》,适用于公司所管理的全部公募基金管理公司公平交易制度有导意见》、《基金管理和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管理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管理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管理力的规定,公司保障投资决策公平的控制方法包括公司的投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程,明确接受各环节的业务职责。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、投资研阅的股资活产,创度的发展的发展,更有关键设力而享有公平的的充限,的范投资组合进行事后监控。公司保险交易为位公平的的范围投资组合,这种优别的投资结合本获得投资信息,投资建议方面享有公平的的东间投资组合。公司保险交易为企公平的相同的投资组合在未得投资信息,投资建议方面,有一个平均的市局投资组合的东间投资组合,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)的同间交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后。据性分析。

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。

本基金全年来看操作相对保守,短應它以過程。 为稳定。 4.2 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3.4743%。同期业绩比较基准收益率为1.5500%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 进入2016年,人民币汇率和信用风险成为影响债券市场最重要的两个因素。2016年财政部公布的国债 发行计划就2014年,2015年有明显增加,这与提高批股赤字思路一致,财政政策的发力效果时效性更为明 显。十三五开局之年不可忽视政策层面对经济的支撑力度。供给侧收革、清理僵尸企业不是一藏而就的,其 过程曲折,并经数策影响较大,从投资层面来将,较难把握。同时央行对待汇率的态度有所转变、公开市场操 作更加灵活且频繁。 因此。2016年,本基金将持续关注—级市场供给和央行的后续操作,保持适度的组合人期,在流动性风

作更加灵活且频繁。
因此、2016年,基金将持续关注一级市场供给和央行的后续操作,保持适度的组合外期,在流动性风险可控的前提下、力争为持有人持续实现理想的回报。
46管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期内、基金管理人严格遵守(企业会计推则)、《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,将估值结果以良于形式报给基金行管人,基金托管人技法金合同规定的估值方法。时间,程序进行复核,基金托管人技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

## 英大现金宝货币市场基金

### **2015** 年度 报告摘要

理,研究、交易,监察髂核部门负责人,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,参与估值涨超各方之间下重大和选冲突。 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10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

"的力水,即根据每日基金收益简优,以每为份基金单收益为基准,为投资人每日订算当日収益开分配,且每日进行结转。 本基金报告期内向份额持有人分配利润5.526,539.33 元。 4.8报告期内,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。

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。
5.1 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,本杆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,基金费用开文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。
本基金投售期内间份额持有人分配利润5.526.539.33 元。
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
本任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。
9.6 审计报告
本基金2015年年度财务会计报告经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了瑞华审字(2016)01390224号"标准无保留意见的审计报告",投资看可通过年度报告正文查看审计报告全文。
7.1资产负债表

7.1资产负债表 会计主体:英大现金宝货币市场基金

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	単位:人民币 上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款		2.447.899.19	243,275,041.8
结算备付金		577,142.86	.,,
存出保证金		-	
交易性金融资产		259,743,850.55	
其中:股票投资		-	
基金投资		_	
债券投资		259,743,850.55	
资产支持证券投资		_	
贵金属投资		_	
衍生金融资产		_	
买人返售金融资产		465,001,657.50	16,000,000.0
应收证券清算款		_	,
应收利息		5,846,440.93	644,441.8
应收股利		_	
应收申购款		3,221.06	
递延所得税资产		_	
其他资产		_	
资产总计		733,620,212.09	259,919,483.6
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		_	
应付证券清算款		_	3,498,866.6
应付赎回款		_	
应付管理人报酬		153,756.46	54,364.4
应付托管费		46,592.85	16,474.0
应付销售服务费		116,482.16	41,185.1
应付交易费用		11,716.20	
应交税费		_	
应付利息		_	
应付利润		27,496.61	34,700.1
递延所得税负债		_	
其他负债		78,041.10	9,041.1
负债合计		434,085.38	3,654,631.0
所有者权益:			·
实收基金		733,186,126.71	256,264,852.0
未分配利润		_	,
听有者权益合计		733,186,126.71	256,264,852.0
负债和所有者权益总计	-	733,620,212.09	259,919,483,6

			单位:人民市
项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年12月10日(基金合 同生效日)至2014年12月 31日
一、收入		7,032,563.51	965,856.18
1.利息收入		6,212,678.69	958,616.51
其中:存款利息收入		2,206,179.14	936,443.37
债券利息收入		2,321,032.19	-
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收人		1,685,467.36	22,173.14
其他利息收入		-	
2.投资收益 假失以""填列)		819,884.82	1
其中:股票投资收益		-	1
基金投资收益		-	
债券投资收益		819,884.82	
资产支持证券投资收益		-	
贵金属投资收益		-	
衍生工具收益		-	
股利收益		-	
3.公允价值变动收益		-	-
4. 汇兑收益(损失以""号填列)		-	_
5.其他收入(损失以""号填列)		-	7,239.67
减:二、费用		1,506,024.18	123,604.73
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	592,579.20	54,364.45
2.托管费	7.4.8.2.2	179,569.51	16,474.05
3.销售服务费	7.4.8.2.3	448,923.52	41,185.18
4.交易费用		-	
5.利息支出		17,904.28	
其中:卖出回购金融资产支出		17,904.28	-
6.其他费用		267,047.67	11,581.05
三、利润总额 (亏损总额以""号填列)		5,526,539.33	842,251.45
减:所得税费用		-	-
四、净利润(争亏损以""号填列)		5,526,539.33	842,251.45

			单位:人民币元		
项目	本期 2015年1月1日至2015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 儘金净值)	256,264,852.00	-	256,264,852.00		
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数 (本期净利润)	-	5,526,539.33	5,526,539.33		
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)	476,921,274.71	-	476,921,274.71		
其中:1.基金申购款	981,026,547.21	-	981,026,547.21		
2.基金赎回款	-504,105,272.50	-	-504,105,272.50		
四、本期向基金份额持有人 分配利润产生的基金净值变 动(争值减少以""号填列)	-	-5,526,539.33	-5,526,539.33		
五、期末所有者权益 <b>基金</b> 净 值)	733,186,126.71	-	733,186,126.71		
项目	上年度可比期间 2014年12月10日(基金合同生效日)至2014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 儘金净 值)	361,983,745.08	-	361,983,745.08		
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数 (本期净利润)	-	842,251.45	842,251.45		
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)	-105,718,893.08	-	-105,718,893.08		
其中:1.基金申购款	70,061,790.88	-	70,061,790.88		
2.基金赎回款	-175,780,683.96	-	-175,780,683.96		
四、本期向基金份额持有人 分配利润产生的基金净值变 动 停值减少以""号填列)	-	-842,251.45	-842,251.45		
五、期末所有者权益 儘金净 值) お書附注为財务お書的知	256,264,852.00	_	256,264,852.00		

报表附注为财务报表的组成部分。 本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

\_\_\_\_\_赵照\_\_\_ 主管会计工作负责人

7.4报表附近 7.4.1重要会计政策和会计估计 7.4.1.5计年度 本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。 7.4.1.2记账本位市

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人方,或者(3) 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。金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。当金融负债的现时少多全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债的发入多已解除的部分。终止确认郑分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。卖出债券的成本按移动加权平均法逐日结转。74.15金融资产和金融负债的估值原则
本基金估值采用摊余成本法,其接近于公允价值。估值对象以买人成本列示,按实际利率并考虑其买人时的溢价与折价,在其剩余期限办摊销,每日计提收益或损失。
本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值;
本基金融工具的估值方法具体如下;
(1)银行在勤

(1)银行存款 基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际利率逐日计提利息;

(2)债券投资 基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成 本和实际利率计算确定利息收入;

条件关环间平计算明度和远域人; (3)回馈协议(封闭式回喷),以成本列示,按实际利率在回购期内逐日计提利度; 基金持有的回顺协议(封闭式回购以成本列示,所产生的利息在回购期内逐日计提。回购期满,若双方都能履约, 则按协议进行交割。 若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产,若融券业务到期无法履约,则继续持 有债券资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值; (4)其他

(4)其他
如有确随证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;
为了避免采用继余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏氮从而对基金份额持有,负的对益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日、采用其他可参考公允价值指标、对基金符有的估值对象进行重新评估、即"影子定价"。当"影子定价"确定的基金资产净值的编度度的绝对值达到或超过。25%的,基金管理人短编制并按露临时报 控制的需要调整组合。其中,对于偏离度的绝对值达到或超过。5%的情形,基金管理人应编制并按露临时报 传:

告:
如有新增事项,按国家最新规定估值。
7-4.16金融资产和金融负债的抵销
本基金特有的资产和承租的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法具有抵销已确认金额的法定权利良好性法定权利现在是可执行的;且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债基中列示。
7-4.17次收基金
实地基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金被分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次收基金增加稍世基金的实收基金被成少。
7-4.1.对质益平准金
无。

元。 7.4.1.9收入/(损失)的确认和计量

7.4.1.%以人(横尖)的确认和计量
(1)利息收入
存款利息收入按存款的本金及适用利率逐日计提。
债券利息收入按存款的本金及适用利率逐日计提。
债券利息收入按存款等面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债券发行
企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。
资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本
金部分和投资收益部分,将本金部分冲破资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。
买入返售金融资产收入,接买人运售金融资产的维余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较
/ 时采用台同利率)在回购期内逐日计提。
(2)投资收益
(3)投资收益
(3)投资收益
(3)其他收入
从市级总和投资中经转经分方、经济利益得可能流入日金额确认。
(3)其他收入
从市级人在主票风险和报酬已经转经分方、经济利益得可能流入日金额面以可靠计量比值认。

关的人在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。 7.4.1.10费用的确认和计量

(3)其他败人在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流人且金额可以可靠计量时确认。
7.4.1.10费用的确认和计量
(1)本基金的管理人报酬按照前一日基金资产等值的0.33%的年费率逐日计提。
(2)本基金的托管费按前一日基金资产等值的0.1%的年费率逐日计提。
(3)本基金的销售服务费控前一日基金资产等值的0.1%的年费率逐日计提。
(4)其他费用根据有关法规及相应的认规定,按实际支出金额例入当期基金费用。
7.4.1.11基金的收益分量改策
每一基金份额享有目等分量权。当日申购的基金份额目下一个工作日起享有基金的分配权益:当日赎回的基金份额自了一个工作日起不享有基金的分配权益:本基金以份额面值1.0元后定份额净值交易方式、自基金合同生效日起,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。1.每日分析方式,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。1.41.12分部限营。
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共遗的参与常见有数据。
经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的约者状况。经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有限的经济特定,并且满足一定条件的、则各并为一个经营分部。本基金相告期无其他重要的会计政策和会计估计。
7.4.1.11其他重要的会计政策和会计估计。
7.4.1.11其他重要的会计政策和会计估计。
7.4.1.21,在11,是有是不是不是更加强用本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。
7.4.2 会计政策和会计估计变更。
7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明本基金本报告期无需说明的会计差错更正。
7.4.3 税项。
根据购政部、国家税务总局财税(2002)128号《关于形度的基金、发生的时间面知》、财税(2004)178号《关于证券投资基金的财税(2002)102号《关于股息红利个人所得税有关处策的通知》,财税(2004)178号《关于严户转段等基金的财务,是如原得

根据财政部、国家税务总局财税[2003]128号(关于开放式证券投资基金有关税收同题的通知)、财税 [2004]78号(关于证券投资基金税收款等的通知)、财税[2005]10号(关于股急以利个人所得税有关政策的 通知)、财税[2005]107号(关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知)、财税[2008]1号(关于企业所得 税若干优惠政策的通知)及其他相关财税法规和实务操作。主要税项列示如下: 1、以及行基金方式募集资金不属于营业税征收范围、不证收营业税。 2.基金买卖债券的整价收入暂免征营业税和企业所得税。 3.对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在问基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得 税 暂不征收企业所得税。 7.4.4 关联方关系。

7.4.4 关联万夫糸	
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
注 ①工法关股六月初九工尚山友范围由统_	, 帆 东川, 久 势 (T 六

国建业银行股份有限公司 注:①丁诺关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 ②本报告期本基金关联方未发生变化。 7.4.5 本报告期处于程则市场的关联方交易 ①下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 ②本报告期本基金关联方未发生变化。 7.4.5.1 通过关联方交易中元进行的交易 7.4.5.1 股票交易 7.4.5.1 股票交易 不提引期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。 7.4.5.1 债券空易 本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。 7.4.5.1 债券回购交易 本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行间购交易。 7.4.5.1 债券回购交易 本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。 7.4.5.1.4 优亚交易 本报告期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。 7.4.5.1.4 应支付关联方的佣金

7.4.5.1.5 应支付关联方的佣金 本报告期及上午度可比期间,本基金无应支付关联方的佣金。 7.4.5.2 关联方招酬

7.4.5.2.1 基金管理费		单位:人民币元
项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年12月10日(基金合同生效日)至2014 年12月31日
当期发生的基金应支付的管 理费	592,579.20	54,364.45
其中:支付销售机构的客户 维护费	33,521.38	171.12
注:本基金的管理费按前	一日基金资产净值的0.33%年费率计	提。管理费的计算方法如下:

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.33% - 当年天致 H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值 基金管理费每日计算, 溶日累计至每月月末, 按月支付, 由托管人根据与管理人核对一致的财务数据, 地在月初5个工作日内, 按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法 等四日, 0.4年度 生4时, 2004年

上年度可比期间 2014年12月10日(基金合同生效日)至2014 年12月31日 本期 2015年1月1日至2015年12月31日

当期发生的基金应支付的持 等费 179,569,51 日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如

注:本基金的托管费按前一目基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E \ 0.1% - 当年天教 H为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产单值 基金托管费每日计算。遂日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据, 自动在月初 5 个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法 定节假日。公休日等支付日期顺延。 7.45.2.3 销售服务费

	金额早位:人民用刀
获得销售服务费 各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
合大联刀	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	393,965.62
中国建设银行股份有限公司	51,826.54
合计	445,792.16
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2014年12月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日
台大联刀石桥	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	38,369.45
中国建设银行股份有限公司	277.35
合计	38,646.80

注:本基金的年销售服务费率为0.25%,基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

注:本基金的年销售服务费率为0.25%,基金份额的销售服务费计提的计算公式如下: H=Ex0.25%-当年天教 H为每日基金份额应计提的基金销售服务费 E为前一日基金份额的进程的基金销售服务费 E为前一日基金份额的基金资产净值 基金销售服务费每日计提,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个作日内,按照特定的账户赔偿进行资金支付。管理人无需再出具资金划按指令。若遇法定节假日、休息日不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。 不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。 不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。 不4.5.3 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,本金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。 7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况 不4.5.4 报告期内基金管理人人运用固有资金投资本基金的情况 本报告期及上年度可比期间,基金管理人未运用固有资金投资本基金的情况 本报告期末其他关联方未持有本基金。 7.4.5.1 任务期末联基金管理人全外均其他关联方投资本基金的情况 本基金本报告期末其他关联方未持有本基金。 7.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方 名称	本其 2015年1月1日至2		2014年12月10日(基金台12月3	合同生效日)至2014年
	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	2,447,899.19		17,275,041.80	2,008.42
	明银行存款由基金托管 G承销期内参与关联方		安约定利率计息。	

7.4.5.6 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明日。基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。 7.4.5.7 其他关联交易事项的说明 本期未及上年度末、本基金无其他关联交易事项。 7.4.6 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券 7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 本基金本程与期末(2015年12月31日)未持有需被露的暂时停牌股票。 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2015年12月31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 版工学》 50.00元。 7.46.3.2 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正回购。 § 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

	777 (		金额单位:人民币元
때	项目	金额	占基金总资产的比例 %)
	固定收益投资	259,743,850.55	35.41
	其中:债券	259,743,850.55	35.41
	资产支持证券	-	-
	买人返售金融资产	465,001,657.50	63.38
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
	银行存款和结算备付金合计	3,025,042.05	0.41
	其他各项资产	5,849,661.99	0.80
	合计	733,620,212.09	100.00

8.2	债券回购融资情况	金额单位:人民币元
序号	项目	占基金资产净值的比例 %)
1	报告期内债券回购融资余额	0.60
	The state of the s	

2 报告期末债券回购融资余额 其中:买断式回购融资

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

回亦止巴姆印列亚东南西过至亚贝(平區印20%印500円 在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%. 8.3 基金投资组合平均剩余期限

6.3.1 汉贝纽百十岁州市州水塞平旧儿	
项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	39
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	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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180天。 832 期末投资组合平均剩余期限分布比例

8.3.2	期不仅页组合干均剩未期限万印	ECINI	
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	81.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	1.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	6.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	3.01	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天 含)	6.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮	_	_

8.4	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	37,123,310.29	5.06
	其中:政策性金融债	37,123,310.29	5.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	222,620,540.26	30.36
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	259,743,850.55	35.43
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	_	_

85 期末按摊金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
序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值出 例 %)
1	011599215	15新兴际华 SCP001	500,000	50,176,931.96	6.8
2	011598007	15浙物产 SCP007	300,000	30,147,230.12	4.1
3	130241	13国开41	200,000	20,103,226.12	2.7
4	041554005	15金红叶 CP001	200,000	20,039,789.39	2.7
5	041559014	15开元旅业 CP001	150,000	15,115,769.12	2.0
6	041558029	15好当家 CP001	100,000	10,083,386.27	1.3
7	041563002	15富兴CP001	100,000	10,075,164.88	1.3
8	011599191	15渝水务 SCP003	100,000	10,027,455.53	1.3
9	150403	15农发03	100,000	10,016,790.16	1.3
10	071508005	15东方证券 CP005	100,000	9,999,221.17	1.3

8.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离 告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数

於告期内偏离度的最高值

8.8.4 期末其他各项资产构成

告期内偏离度的最低值 告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 8.7 期末按公允价值占基金资产争值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明组本期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注 8.8.1 本基金采用固定份额争值,基金账面份额争值始终保持为人民币1.0000元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买人成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买人时的 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。

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

-0.0023

504,105,272.50 733,186,126,71

金额单位:人民币元

备注

0.1920%

8.8.3 本期內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。

单位:人民币元 金额 5,846,440.93 3,221.06 6 待摊费用

《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	
the death of the death.	户均持有的基 金份额	持有人结构				
持有人户数 (户)		机构投资者		个人投资者		
(/)	312 03 134	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	
2,370	309,361.23	716,650,323.42	97.74%	16,535,803.29	2.26%	
9.2 期末	基金管理人的是	人业人员持有本基金	的情况			

持有基金份额总量的数量区间 历份 § 10 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 361,983,745.08 256,264,852.00 981,026,547,2

§ 11 重大事件揭示 11.1 基金份额持有人大会决议

减:本报告期基金总赎回份额

单位:人民币元

券商名称

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2015年11月30日发布公告,管察长张宁先生自2015年11月28日起不再担任督察长职务。制总经理赵熙先生自2015年11月28日起代任英大基金管理有限公司督察长职务。相关变更事项已按规定向中国证据点条和北京证据局报告。 本报告期内,本基金托管人2015年1月4日发布任免通知,聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部局总经理。本基金托管人2015年9月18日发布任免通知,解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的访 本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变 报告期内本基金未变更为本基金审计的会计师事务所,报告期内本基金应支付给瑞华会计师事务所, 特殊普通合伙,审计费用人民币60,000元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为2年。 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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽核或处罚

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 交易单元数 量

成交金额 占当期股票 成交总额的比

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。 证 有良好的内控制度,在电力分析的压量。 证 有段好的内控制度,在业内有良好的声誉。 证 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: 級が同々用文列平/U29年的7年 | 对交易单元族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。

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。 1172 基全和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
	债券交易		债券回购交易		权证交易	
券商名称	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	-	-	705,289,000.00	100.00%	-	-

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在0.5%(含)以上的情况。

2016年3月30日