



英大现金宝货币市场基金

2016 第二季度 报告

2016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:2016年7月19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。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年7月18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,基金的投资业绩并不表示其未来表现,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。
本报告中所载资料截止日:
本报告日期2016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
交易代码	000912
基金运作方式	契约的开放式
基金合同生效日	2014年12月10日
报告期末基金份额总额	1,192,733,444.87份
投资目标	本基金投资于固定收益资产,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	本基金投资策略将结合市场利率需求和货币市场利率预期,在保证基金资产安全性和流动性的基础上,采取积极的投资策略。
业绩比较基准	同期人民币银行活期存款利率(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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2016年4月1日至2016年6月30日)
1.本期已实现收益	2,821,704.33
2.本期利润	2,821,704.33
3.期末基金资产净值	1,192,733,444.87

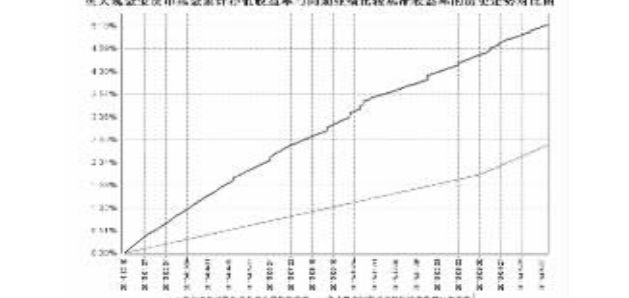
注:①.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
②.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内基金份额净值及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	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	0.6479%	0.0079%	0.3666%	0.0009%	0.3113%	0.0070%

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



4.1 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
张琳琳	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,曾任招商基金管理有限公司基金管理部副经理,2012年7月加入英大基金管理有限公司,曾任公司权益投资部副经理、风控工作人、现任固定收益部总经理。

注:①.任职日期/解聘日期:基金经理的任职日期为基金合同生效之日。
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。
③.管理人对投资组合的资产配置比例符合基金合同的约定。
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,以诚信、勤勉、尽责的态度,为基金份额持有人利益,秉承诚实信用、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基金人治理结构和内控制度,加强内部控制,规范基金运作,本报告期内,基金运作合法合规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 公平交易专项说明
报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金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制度》的规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监督等环节严格把关,通过公司系统上的公平交易监测系统对人工复核并在各个环节严格执行,未发生异常交易行为,未发现存在不公平交易的情况。

4.2.2 异常交易行为专项说明
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,且不存在其他可能损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 报告期内基金投资组合情况

2016年一季度以来市场整体情绪有所回落,CPI和PPI有所回落,债券市场长端品种经历了4月份的大幅调整后,震荡下行,十年期国债和十年期国债收益率水平与季初持平,同时,2016年以来信用风险事件频发,成为扰动债券市场的重要因素之一。

本基金一季度调整了债券结构,增加了高评级短债和存单的投资,保持流动性,同时,收益较为稳定。

4.3.1 报告期内基金的投资策略
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.2 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.3 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.4 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.5 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.6 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.7 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.8 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.9 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.10 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.11 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.12 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.13 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.14 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.15 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.16 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.17 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.18 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.19 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.20 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.21 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.22 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.23 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.24 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.25 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.26 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.27 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.28 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.29 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.30 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.31 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.32 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.33 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.34 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.35 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.36 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.37 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.38 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.39 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.40 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.41 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.42 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.43 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.44 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.45 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.46 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.47 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.48 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.49 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.50 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.51 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.52 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.53 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.54 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.55 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.56 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.57 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.58 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.59 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

4.3.60 报告期内基金的投资组合
截至报告期末,本基金本报告期的资产配置收益率为0.6479%,同期业绩比较基准收益率为0.3666%。

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.1 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.2 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.3 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.4 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.5 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.6 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.7 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.8 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.9 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.10 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.11 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.12 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016年4月6日	31.06	大额赎回	1次
2	2016年4月9日	20.29	大额赎回	3次
3	2016年4月14日	20.29	大额赎回	2次
4	2016年4月16日	20.29	大额赎回	1次
5	2016年4月17日	29.58	大额赎回	1次

5.13 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例:报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

		英大基金管理有限公司	
		2016年7月19日	
1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 11 12			