英大领先回报混合型发起式证券投资基金

2015 年度报告摘要

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
送出日期:2016年3月30日

§1 重要提示

1.1 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、准确性和完整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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25日复核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。

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及其更新。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	英大领先回报混合
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
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
报告期末基金份额总额	140,468,835.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		英大基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵照	李春磊
	联系电话	010-59112177	010-65169830
	电子邮箱	zhaozhao@ydamc.com	lichunlei@cgbchina.com.cn
客户服务电话		400-890-5288	95508
传真		010-85878087	020-65169555

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	基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年3月5日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	41,834,418.89	19,844,799.68
本期利润	42,722,945.91	20,221,045.70
加权平均基金份额本期利润	0.2603	0.1654
本期基金份额净值增长率	7.23%	20.94%
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	-0.2400	0.1107
期末基金资产净值	106,752,507.22	110,784,617.95
期末基金份额净值	0.7600	1.1219

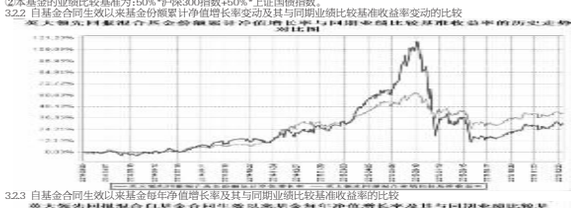
注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.净值相关数据计算中涉及天数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。
4.期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现
3.2.1 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

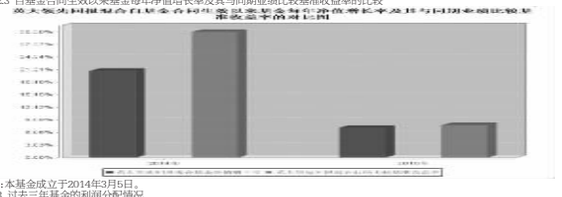
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.89%	1.01%	9.20%	0.84%	3.69%	0.17%
过去六个月	-22.42%	2.11%	-6.12%	1.34%	-16.30%	0.77%
过去一年	7.23%	2.15%	7.87%	1.24%	-0.64%	0.91%
自基金合同生效起至今	29.69%	1.70%	40.52%	1.00%	-10.83%	0.70%

注:①本基金合同于2014年3月5日生效;
②本基金的业绩比较基准为:50%*沪深300指数+50%*上证国债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金成立于2014年3月5日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	5.8000	83,368,611.90	9,155,646.98	92,524,258.88	
2014	0.8000	4,525,485.73	1,388,450.40	5,913,936.13	
合计	6.6000	87,894,097.63	10,544,097.38	98,438,195.01	

§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限责任公司(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)三家股东发起成立。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40%,中交股份出资比例为36%,航天科工财务出资比例为15%。

截至报告期末,本公司管理51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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁忠伟	本基金基金经理	2015年7月8日	-	15	曾任中国民族证券研究发展中心行业分司部经理,证券投资部总经理助理,执行总经理,中再证券股份有限公司资产管理总部投资管理部研究总监,投资主办人。
周木林	本基金基金经理	2015年7月8日	-	4	曾任香港诚信资本上海量化投资管理合伙企业量化研究员。2014年8月加入英大基金管理有限公司,曾任公司专户投资部金融工程师、投资经理。
秦岭	研究部副总经理,本基金基金经理	2014年3月5日	2015年7月16日	9	南华大学管理学硕士。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研究部副总经理,历任国泰君安证券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	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,历任新于国金通用基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司、招商银行天津分行、中国农业银行天津分行等金融机构。

注:①任职日期说明:秦岭和赵强的任职日期为基金合同生效的日期,袁忠伟和周木林的任职日期为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。
③本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,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指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等国家法律法规和监管部门的规定,公司已经制定了《英大基金管理有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、特定客户资产管理组合、社保基金、企业年金等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括公司的投资决策实行投资决策委员会领导下的基金经理投资经理负责制,明确各自的投资权限,保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性。交易执行部门与投资决策部门严格分离,业绩与风险评估以数量分析为基础,对投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程,明确投资各环节的业务职责,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,投资研究团队使用同一研究报告系统,确保公募基金、特定客户资产管理组合等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括公司建立交易分配公平的内部控制流程,将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行包括所有投资品种的集中交易制度,并确保公平交易可操作、可稽核、可持续。公司在交易系统中设置公平交易功能并严格执行,以技术措施保障公平交易的实现。

监察稽核部定期对公司的不同投资组合(尤其是同一投资组合经理管理的不同投资组合)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)的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,股票市场整体处于牛市氛围,本基金以成长股为投资标的,获得较好的投资回报。三季度,在宏观经济增速放缓、上市公司整体业绩不及投资者预期的基本面背景下,股票市场遭遇杠杆资金平仓出局、违规配资清理等资金面压力,股票市场估值水平快速从高估状态向正常水平回归,这导致沪深300指数当季度下跌28.39%,中小板和创业板指数跌幅均在27%左右。在市场恐慌下跌的过程中,管理层、证券公司、上市公司及上市公司股东所采取的救市和维稳措施曾使投资者阶段情绪高涨,而救市资金撤离、经济数据不佳、美联储加息等信息又使投资者情绪迅速降至冰点,股票市场急涨急跌使投资操作难度大增。针对本基金三季度初股票持仓比例较高的现状,新任基金经理采取"以价值配为主要投资方向,在仓控制坚持高减低增,减店调控"的投资策略,努力从股市中获取绝对收益,在8月20日之前有效地稳定了基金单位净值,8月下旬开始的大幅杀跌使基金资产出现一定幅度的损失,9月下旬,在配资清理接近尾声、美联储公布不加息决议、A股投资者情绪逐步稳定后,本基金适度提高股票仓位,获取阶段反弹收益。四季度基金股票仓位在36%-74%变动,基金经理根据市场环境、趋势强弱、新股发行节奏调整股票仓位,分别于10月16日左右、12月14日左右两次上调股票投资比例,取得了较好的投资收益。

截止2015年12月31日(英大领先回报成立于2014年3月5日),英大领先回报基金累计净值1.42,2015年基金单位净值上涨7.23%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金的累计单位净值是1.4200,份额净值增长率为7.23%,同期业绩比较基准收益率为7.87%,基金表现落后业绩比较基准0.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票市场:

2015 年12月全国制造业创08年以来同期新低,下行压力较大。汇率继续贬值,资本市场需注意防范风险。未来经济增长最大潜力在于改革,尤其是去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板等五大供给侧改革。

展望2016 年,在稳增长政策持续发力和推动下,中国经济有望低位企稳;美联储推迟和缓慢的加息步伐可能会缓解外部的潜在冲击;在资产回报普遍下降以及人民币可能走弱的环境下,低估值与高股息收益率股票更具吸引力;随着新股供给增加,市场流通市值的膨胀,高估值股面临回落的风险日益增加。预计2016年的股票市场以震荡调整为主。

二级市场投资方面,本基金采取"以价值投为主要投资方向,从价值股中精选成长和稳健回报两类股票,成长类股票以新兴产业为主,根据市场阶段风险释放程度灵活配置成长和稳健回报两类股票资产比例"的投资策略。一级市场方面,积极参与新股网下配售,获取低风险、较高收益的资产。保持稳健的投资风格,力争为持有人持续实现正收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《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,将估值结果以电子形式报给基金托管人,基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,基金托管人复核无误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、基金经理、研究、交易、监察稽核部门负责人,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,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1.2015年1月7日宣告本年度第1次分红,向截至2015年1月9日止在本基金注册登记的全体持有人,按每10份基金份额派发红利0.1元,收益分配基准日为2015年1月6日,其发放红利人民币98,661,380.88元,其中现金分红人民币7,610,933.83元,红利再投形式发放人民币1,050,447.05元;

2.2015年6月25日宣告本年度第2次分红,,向截至2015年6月25日止在本基金注册登记的全体持有人,按每10份基金份额派发红利0.48元,收益分配基准日为2015年6月24日,其发放红利人民币53,862,878.00元,其中现金分红人民币75,757,678.07元,红利再投形式发放人民币8,105,199.93元。

本年度分红符合法律法规及本基金基金合同中关于收益分配相关条款的规定。

4.8报告期内管理人对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。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,广发银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对英大领先回报混合型发起式证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守相关法律法规、合同协议及其他有关规定,不存在损害本基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报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

本报告期内,本托管人依照相关法律法规、合同协议及其他有关规定,对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督,对本基金资产净值计算以及费用开支等方面进行了认真地复核,未发现管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本年度报告中的基本情况、主要财务指标、投资组合报告等内容,未发现虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,财务信息真实、准确和完整。

§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]01390222号"标准无保留意见的审计报告",投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表
会计主体:英大领先回报混合型发起式证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		21,145,611.13	12,716,869.70
结算备付金		2,455,659.18	1,135,731.94
存出保证金		587,783.22	161,625.60
交易性金融资产		77,850,659.86	95,471,460.48
其中:股票投资		77,850,659.86	95,471,460.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		7,000,000.00	-
应收证券清算款		-	5,385,545.32
应收利息		8,750.67	3,745.53
应收股利		-	-
应收申购款		146,692.63	42,608.69
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		109,195,156.69	114,917,587.26
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		229,238.10	1,828,510.44
应付赎回款		125,046.10	1,207,993.33
应付管理人报酬		136,894.78	153,540.08
应付托管费		22,815.78	25,590.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,868,389.46	552,477.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		60,265.25	364,858.20
负债合计		2,442,649.47	4,132,969.31
所有者权益:			
实收基金		140,468,835.96	98,748,402.99
未分配利润		-33,716,328.74	12,036,214.96
所有者权益合计		106,752,507.22	110,784,617.95
负债和所有者权益总计		109,195,156.69	114,917,587.26

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.7600元,基金份额总额140,468,835.96份。

7.2 利润表
会计主体:英大领先回报混合型发起式证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

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3月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入		49,897,145.17	24,191,013.38
1.利息收入		504,388.02	909,810.12
其中:存款利息收入		250,976.49	302,370.44
债券利息收入		-	23,538.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		253,411.53	583,900.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		46,721,034.89	22,463,335.80
其中:股票投资收益		45,758,965.70	21,251,430.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	42,569.44
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		962,069.19	1,171,335.75
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		888,527.02	376,246.02
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,783,195.24	439,621.44
减:二、费用		7,174,199.26	3,969,967.68
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	2,511,215.86	1,545,536.95
2.托管费	7.4.8.2.2	418,536.02	257,589.49
3.销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		3,937,052.38	1,805,537.24
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		307,395.00	361,304.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		42,722,945.91	20,221,045.70
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		42,722,945.91	20,221,045.70

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:英大领先回报混合型发起式证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

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(基金净值)	98,748,402.99	12,036,214.96	110,784,617.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	42,722,945.91	42,722,945.91
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)	41,720,432.97	4,048,769.27	45,769,202.24
其中:1.基金申购款	420,120,297.05	72,229,170.48	492,349,467.53
2.基金赎回款	-378,399,864.08	-68,180,401.21	-446,580,265.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-92,524,258.88	-92,524,258.88
五、期末所有者权益(基金净值)	140,468,835.96	-33,716,328.74	106,752,507.22

项目	上年度可比期间 2014年3月5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(基金净值)	161,922,767.08	-	161,922,767.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	20,221,045.70	20,221,045.70
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)	-63,174,364.09	-2,270,894.61	-65,445,258.70
其中:1.基金申购款	84,437,612.50	3,834,595.26	88,272,207.76
2.基金赎回款	-147,611,976.59	-6,105,489.87	-153,717,466.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-5,913,936.13	-5,913,936.13
五、期末所有者权益(基金净值)	98,748,402.99	12,036,214.96	110,784,617.95

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:
杨峰 赵照 吕向鹏
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明
本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明
对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.2.3 差错更正的说明
本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财[2005]10号《关于股息红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)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
(2)基金买卖债券的差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向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。
(4)对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额,上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

7.4.4 关联方关系

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
广发银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
英大国际信托有限责任公司	基金管理人股东

注: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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.5.1.1 股票交易
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股票交易。

7.4.5.1.2 债券交易
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债券交易。

7.4.5.1.3 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 权证交易
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权证交易。

7.4.5.1.5 应支付关联方的佣金
本报告期及上年度可比期间,本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.5.2 关联方报酬

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3月5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	2,511,215.86	1,545,536.95
其中:支付销售机构的客户维护费	744,444.33	465,752.16

注:支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.5.2.2 基金托管费

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3月5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托管费	418,536.02	257,589.49

注:支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.5.3 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,本基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

7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年31日	上年度可比期间 2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金合同生效日(2014年3月5日)持有的基金份额	-	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,772,797.53	-
期间申购/买入总份额	13,499,392.47	772,797.53
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	24,272,190.00	10,772,797.53
期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.2794%	10.9100%

7.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的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

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	21,145,611.13	212,356.71	12,716,869.70	284,931.94

注:本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管,按银行同业利率计息。

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期间,本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
本报告期及上年度末,本基金无其他关联交易事项。

7.4.6 期末(上年度末)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

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601377	兴业证券	2015年4月21日	2016年1月18日	增发流通受限	8.19	11.00	27,990	229,238.10	307,890.00	-

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601377	兴业证券	2015年12月29日	临时停牌	11.00	2016年1月7日	9.40	93,300	918,942.74	1,026,300.00	-

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
本期末及上年度末,本基金未持有银行间市场债券正回购。
7.4.6.3.2 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

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	77,850,659.86	71.29
	其中:股票	77,850,659.86	71.29
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	7,000,000.00	6.41
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	23,601,270.31	21.61
7	其他各项资产	743,226.52	0.68
8	合计	109,195,156.69	100.00

8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	768,690.56	0.72
C	制造业	17,436,260.94	16.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,817,957.50	5.45
E	建筑业	1,630,153.00	1.53
F	批发和零售业	620,163.40	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	2,992,153.58	2.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,661,859.77	1.56
J	金融业	39,171,326.51	36.69
K	房地产业	5,929,885.00	5.55
L	租赁和商务服务业	582.92	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	976,800.00	0.92
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	844,826.68	0.79
S	综合	-	-
	合计	77,850,659.86	72.93

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	1,761,100	8,065,838.00	7.56
2	600015	华夏银行	600,060	7,284,728.40	6.82
3	000063	中兴通讯	367,700	6,850,251.00	6.42
4	000001	平安银行	500,000	5,995,000.00	5.62
5	601166	兴业银行	300,000	5,121,000.00	4.80
6	600823	世茂股份	400,000	4,892,000.00	4.58
7	000543	皖能电力	500,000	4,235,000.00	3.97
8	600004	白云机场	100,000	1,423,000.00	1.33
9	600016	民生银行	139,800	1,347,672.00	1.26
10	601377	兴业证券	121,290	1,334,190.00	1.25

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	82,827,947.16	74.76
2	000651	格力电器	70,566,565.46	63.70
3	000333	美的集团	65,099,567.62	58.76
4	600015	华夏银行	51,882,084.74	46.83
5	000543	皖能电力	47,209,017.06	42.61
6	601318	中国平安	34,951,022.47	31.55
7	000966	长源电力	26,579,353.67	23.99
8	000063	中兴通讯	25,169,390.44	22.72
9	600177	雅戈尔