英大策略优选混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月28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2019年3月27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2018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	英大策略优选混合	
基金主代码	001607	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月2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	88,930,453.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	英大策略优选混合A	英大策略优选混合C
下属分级基金的交易代码:	001607	001608
报告期末下属分级基金的份额总额	88,022,248.35份	908,205.34份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	1.大类资产配置策略;2.股票投资策略;3.固定收益品种投资策略;4.股指期货投资策略;5.权证投资策略;6.资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	1年期银行定期存款利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
	英大策略优选混合A / 英大策略优选混合C

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	刘轶	戴辉
	联系电话	010-59112020	010-66169958
	电子邮箱	liuyi@ydamc.com	daihui@cgbchina.com.cn
客户服务电话		400-830-5288	95508
传真		010-59112222	010-66169555

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的网址	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

orderNum-berOne 期间数据和指标	2018年		2017年		2016年	
	英大策略优选混合A	英大策略优选混合C	英大策略优选混合A	英大策略优选混合C	英大策略优选混合A	英大策略优选混合C
本期已实现收益	-128,359.06	-42,484.94	13,475,029.05	3,089.61	-67,936.73	-1,756,228.52
本期利润	-15,502,048.83	-194,988.77	14,900,811.69	4,040.78	-982,612.82	-1,548,309.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1761	-0.3820	0.0987	0.0805	-0.0112	-0.0180
本期基金份额净值增长率	-14.80%	-5.23%	8.25%	7.82%	7.79%	-6.42%
orderNum-berTwo 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0141	-0.0256	0.1625	0.0038	0.0995	-0.0464
期末基金资产净值	89,263,075.19	884,917.79	104,772,398.31	32,012.27	202,062,226.61	58,824.13
期末基金份额净值	1.0141	0.9744	1.1902	1.0282	1.0995	0.9536

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

英大策略优选混合A

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	-9.65%	1.48%	0.80%	0.01%	-10.45%	1.47%
过去六个月	-11.33%	1.31%	1.62%	0.01%	-12.95%	1.30%
过去一年	-14.80%	1.20%	3.26%	0.01%	-18.06%	1.19%
过去三年	-0.58%	0.79%	10.47%	0.01%	-11.05%	0.78%
自基金合同生效起至今	1.41%	0.78%	10.79%	0.01%	-9.38%	0.77%

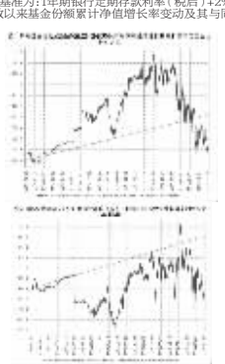
英大策略优选混合C

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	-9.64%	1.48%	0.80%	0.01%	-10.44%	1.47%
过去六个月	-8.13%	1.35%	1.62%	0.01%	-9.75%	1.34%
过去一年	-5.23%	1.26%	3.26%	0.01%	-8.49%	1.25%
过去三年	-4.38%	0.82%	10.47%	0.01%	-14.85%	0.81%
自基金合同生效起至今	-2.56%	0.81%	10.79%	0.01%	-13.35%	0.80%

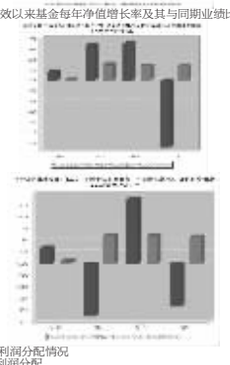
注:①本基金合同于2015年12月2日生效;

②本基金的业绩比较基准为:1年期银行定期存款利率(税后)+2%。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:过去三年未进行利润分配。

§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

英大基金管理有限公司(以下简称"公司")成立于2012年8月17日,注册资本金为20,000万元人民币。现有三家股东,分别是网英大国际控股集团有限公司、中国交通建设股份有限公司、航天科工财务有限责任公司,持股比例分别为49%、36%和15%。

公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司90%以上的员工来自于基金公司等金融机构,平均行业从业时间超过10年,硕士以上学历的员工占员工总数70%以上,核心团队拥有丰富的经验和行业影响力。

公司自成立就秉承了国有企业诚信、责任、奉献的优良传统,确立了以"诚信、责任、专业、创新"为核心的企业文化,坚持以维护基金持有人利益为经营原则,坚持公募、私募协同发展、两翼齐飞的战略,坚持以市场为导向,坚持价值投资、长期投资理念,注重发展和创新,建立了科学、专业的投研体系和严谨的风控体系,力争成为具有核心竞争力、受人尊敬、业内领先的专业财富管理公司。

截至2018年12月31日,本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、英大睿盛混合型证券投资基金8只开放式证券投资基金,同时,管理过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、权益投资部总经理	2015年12月2日	-	18	曾任中国民族证券证券投资部总经理助理、执行总经理;华润证券股份有限公司资产管理总部研究总监。2015年1月加入英大基金管理有限公司,曾任研究发展部副总经理,现任权益投资部总经理。
张玮	本基金基金经理	2016年3月17日	2017年3月28日	5	曾任合众资产管理股份有限公司交易员,2012年10月加入英大基金管理有限公司,曾任公司交易管理部债券交易员、副总经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《英大策略优选混合型证券投资基金基金合同》、《英大策略优选混合型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《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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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、私募资产管理计划、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研资平台,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(尤其是同一位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,且未发现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

2018年,中国GDP同比增速逐季度下行,全年GDP同比增速下滑至6.6%。在"去杠杆"政策主导下,上半年金融环境收缩特征明显,下半年货币政策边际放松但传导机制仍有待疏通。与此同时,中美贸易战升级风险不断影响市场预期、压制风险偏好。在内外部因素压力下,2018年A股呈现震荡下跌特征。投资策略上,本基金坚持价值投资理念配置稳健增值资产,以低估值、高分红、有成长前景的公司股票作为重点投资对象,根据季度业绩数据动态调整投资组合;与此同时,一级市场方面,本基金积极参与网下新股配售。报告期本基金未进行债券投资,主要采取国债逆回购操作进行现金管理。具体运作上,上半年在市场整体下行过程中,上证50、沪深300指数与中小创指数呈现风格轮动特征,本基金以低估值大盘蓝筹股为主要投资标的,同时对中盘成长股给予小比例配置;下半年随着市场风险偏好进一步下降,本基金投资范围向沪深300指数成分股集中,同时持股进一步分散化、降低个股风险。全年业绩来看,相比沪深300指数25.31%的跌幅,本基金股票组合有一定的收益增强效果,但全年投资未能实现盈利,策略A基金单位净值下跌14.8%,策略C基金单位净值下跌5.23%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,英大策略优选混合A基金份额净值为1.0141元,本报告期基金份额净值增长率为-14.80%;英大策略优选混合C基金份额净值为0.9744元,本报告期基金份额净值增长率为-5.23%;同期业绩比较基准收益率为3.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年,A股市场风险与机遇并存。近期固定资产投资、社会消费品零售总额、净出口增速呈现整体趋弱态势,预计2019年一、二季度中国GDP同比增速仍存下行压力,从而对上半年A股企业盈利、投资者风险偏好形成压制因素。但是,宏观政策已开始逆周期调节,财政政策有望更加积极,货币降准空间开启后,实体经济流动性有望逐渐改善,同时降低市场无风险利率。从中长期来看,积极因素正在逐渐积聚。外部方面,2019年美联储加息将逐渐进入尾声,新兴市场再次受到国际资金关注;中美贸易战演进可能会是大国博弈寻找平衡点的中长期过程,仍将构成2019年市场的不确定性因素,但这和不确定性很大程度上已经被包含在市场定价之中。国内方面,宏观政策结构性放松对经济减速发挥托底作用,供给侧改革逐渐取得成效,部分行业产能出清后出现恢复性增长,技术创新带动新兴产业发展。上述短中长期因素决定A股市场从筑底到反转的过程可能不会一蹴而就,在2019年较长的时段里将维持震荡市特征。但需要重点强调的是,经过2018年下跌的A股估值已经降至历史较低水平,从国际比较来看亦具备较高的中长期配置价值,中长期资金应该更多看到的是机会。

本基金将继续坚持价值投资理念,以低估值、高分红、有成长前景的股票作为重点投资对象;同时针对上述2019年市场预判,适时调整价值股与成长股的配置比例,积极把握防御性板块与进攻性板块的投资配置节奏,灵活参与权益市场结构性机会。行业选择上,前期更多关注受经济周期下行影响相对较小的大消费行业、战略性新兴行业,同时重视低估值金融行业,后期会对风险释放充分的中上游周期性行业予以更多关注,首选估值合理的行业龙头。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作,使得法律合规风险被及时识别并得到控制,保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面,一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态,及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响,落实各项要求的责任部门,使得公司从业人员知法、守法;二是严格事前的监督审查和控制机制,保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务,并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制,保证投资过程的合规性:公司设置专人专岗监控投资指标,利用系统和人工结合的方式,实现重点监控环节的刚性控制,系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制,保证潜在合规风险得到及时解决:通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况,跟踪其限期回归到合规范围之内;五是继续开展合规培训,不断增强公司员工合规意识,促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式,结合新出台的法律法规和行业风险事件,加深员工对法律法规和风险的理解,从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效的得到落实。

监察稽核方面,一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价,跟进后续改进情况,向监管机构报送监察稽核季报。同时,按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型,采用有效手段,日常监控投资管理人员的个人行为,利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为,防范出现违反"三条底线"的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性,全面梳理各项业务的工作流程,对其中的各项风险进行识别、评估,并对现有的控制手段提出改进性建议。同时,结合出台的法律法规和行业的新要求,督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

4.7 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。估值委员会主任由分管投资的副总经理或实际履行上述职务的其他人员担任;成员包括基金运营部、监察稽核部的负责人及其他根据议题需要指定的相关人员;委员会秘书由基金运营部负责人担任。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

过去三年本基金未进行利润分配,本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

会计师事务所未出具非标准审计报告。

4.10 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元的情形。

§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

本报告期,广发银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对英大策略优选混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在任何损害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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、开放式基金份额变动、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第1901397号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	英大策略优选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的英大策略优选混合型证券投资基金(以下简称"英大策略优选混合基金")财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表、2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了英大策略优选混合基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果及基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称"审计准则")的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于英大策略优选混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	英大策略优选混合基金管理人英大基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括英大策略优选混合基金2018年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	英大策略优选混合基金管理人英大基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,英大策略优选混合基金管理人英大基金管理有限公司管理层负责评估英大策略优选混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非英大策略优选混合基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 英大策略优选混合基金管理人英大基金管理有限公司治理层负责监督英大策略优选混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价英大策略优选混合基金管理人英大基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对英大策略优选混合基金管理人英大基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对英大策略优选混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致英大策略优选混合基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与英大策略优选混合基金管理人英大基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	左艳隙 / 刘璐珊
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:英大策略优选混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	4,965,982.81	3,980,336.10
结算备付金		-	677,399.40
存出保证金		26,300.81	263,021.79
交易性金融资产	7.4.7.2	73,113,489.85	77,560,961.80
其中:股票投资		73,113,489.85	77,560,961.80
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	12,500,000.00	22,000,000.00
应收证券清算款		-	1,028,804.53
应收利息	7.4.7.5	14,940.51	-2,260.17
应收股利		-	-
应收申购款		40.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		90,620,753.98	105,508,263.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		175.36	-
应付管理人报酬		47,226.30	53,204.56
应付托管费		19,677.62	22,168.57
应付销售服务费		296.40	11.06
应付交易费用	7.4.7.7	6,385.32	229,468.68
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	399,000.00	399,000.00
负债合计		472,761.00	703,852.87
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	88,930,453.69	88,058,471.57
未分配利润	7.4.7.10	1,217,539.29	16,745,939.01
所有者权益合计		90,147,992.98	104,804,410.58
负债和所有者权益总计		90,620,753.98	105,508,263.45

注:截至截止日2018年12月31日,英大策略优选混合A净值人民币1.0141元,基金份额总额88,022,248.35份,英大策略优选混合C净值人民币0.9744元,基金份额总额908,205.34份,总份额合计88,930,453.69份。

7.2 利润表

会计主体:英大策略优选混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		-14,313,430.11	19,835,195.05
1.利息收入		319,981.34	2,173,593.50
其中:存款利息收入	7.4.7.11	141,319.34	115,806.72
债券利息收入		-	703,051.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		178,662.00	1,354,735.49
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		873,615.99	16,234,778.14
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-452,489.97	14,265,216.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	46,061.23
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,326,105.96	1,923,500.39
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-15,526,193.60	1,426,733.81
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	19,166.16	89.60
减:二、费用		1,383,607.49	4,930,342.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	605,986.98	1,660,112.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	252,494.56	428,505.55
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,119.20	197.73
4. 交易费用	7.4.7.19	96,606.75	2,281,129.98
5. 利息支出		-	85,396.79
其中:卖出回购金融资产支出		-	85,396.79
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	426,400.00	475,000.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-15,697,037.60	14,904,852.47
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-15,697,037.60	14,904,852.47

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:英大策略优选混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	88,058,471.57	16,745,939.01	104,804,410.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,697,037.60	-15,697,037.60
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)	871,982.12	168,637.88	1,040,620.00
其中:1.基金申购款	4,094,828.93	344,634.32	4,439,463.25
2.基金赎回款	-3,222,846.81	-175,996.44	-3,398,843.25
五、期末所有者权益(基金净值)	88,930,453.69	1,217,539.29	90,147,992.98
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	183,822,646.16	18,288,404.58	202,111,050.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,904,852.47	14,904,852.47
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)	-95,764,174.59	-16,447,318.04	-112,211,492.63
其中:1.基金申购款	1,844.90	382.47	2,227.37
2.基金赎回款	-95,766,019.49	-16,447,700.51	-112,213,720.00
五、期末所有者权益(基金净值)	88,058,471.57	16,745,939.01	104,804,410.58

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:

孔旺 朱志 陈畅

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 基金基本情况

英大策略优选混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]1334号《关于核准英大策略优选混合型证券投资基金募集的批复》核准,由英大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大策略优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集200,081,805.26元,已经瑞华会计师事务所验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《英大策略优选混合型证券投资基金基金合同》于2015年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,081,805.26份,本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司,基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据《英大策略优选混合型证券投资基金基金合同》和《英大策略优选混合型证券投资基金招募说明书》,并按中国证监会备案。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的,而不计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本基金类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设基金代码。由于基金费用的不同,本基金A类、C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购/申购的基金分类别。本基金A类基金份额和C类基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大策略优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%;权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的5%;每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,本基金保留的现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表将会计年人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及财法7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况、2018年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制