英大纯债债券型证券投资基金

【2016】第四季度报告

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:2017年1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2017年1月19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应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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大纯债债券	
基金主代码	650001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年4月24日	
报告期末基金份额总额	325,350,447.67份	
投资目标	本基金投资于固定收益类资产,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	本基金依据宏观经济运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场收益特征,分析判断市场利率水平变动趋势,并预测下一阶段的利率水平,结合各类别资产的收益性、风险性和流动性特征,进行大类资产配置。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,该类基金长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,但高于货币市场基金,属于中低风险和收益水平的投资品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	英大纯债债券A	英大纯债债券C
下属分级基金的交易代码	650001	650002
报告期末下属分级基金的份额总额	316,431,956.72份	8,918,490.95份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)	
	英大纯债债券A	英大纯债债券C
1. 本期已实现收益	2,798,895.06	450,571.75
2. 本期利润	95,951.53	162,654.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0003	0.0025
4. 期末基金资产净值	355,706,526.71	9,677,738.11
5. 期末基金份额净值	1.1241	1.0851

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。

3.2 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

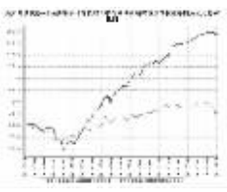
英大纯债债券A

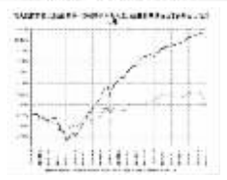
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	0.04%	-2.32%	0.15%	2.32%	-0.11%

英大纯债债券C

阶段	净值增长率①	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	-0.11%	0.04%	-2.32%	0.15%	2.21%	-0.11%

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 管理人报告

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
		任职日期	离任日期		
张琳娜	本基金基金经理	2014年10月24日	-	9	对外经济贸易大学金融学硕士,9年基金从业经历。先后任益民基金管理有限公司集中交易部交易员、副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限公司,曾任公司交易管理部副总经理(主持工作),现任固定收益部总经理。
张玮	本基金基金经理	2016年1月8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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》、《英大纯债债券型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定,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,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无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,通过公司新上线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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度人数据来看宏观经济整体运行平稳回暖,受内外部因素影响债券市场收益率大幅上行,收益率曲线平坦化;同时,信用违约事件继续扰动债券市场,中低评级品种整体收益率曲线上移,信用利差走扩。

本基金四季度整体保持较低的杠杆水平和账户久期,在资金扰动的时点增加了短端品种的配置,积极把握资金面扰动带来的机会,既规避了市场下跌对基金收益的侵蚀,又较好的把握了短端品种波段操作带来的收益,全年来看收益稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,英大纯债A类基金累计份额净值为1.2691元,报告期基金份额净值增长率为0%;英大纯债C类基金累计份额净值为1.2301元,报告期基金份额净值增长率为-0.11%;同期业绩比较基准增长率为-2.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情形。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	313,346,217.25	84.19
	其中:债券	313,346,217.25	84.19
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	52,000,518.00	13.97
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,453,154.36	0.39
8	其他资产	5,408,162.34	1.45
9	合计	372,208,051.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,877,000.00	5.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	69,105,217.25	18.91
5	企业短期融资券	214,312,000.00	58.65
6	中期票据	10,052,000.00	2.75
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	313,346,217.25	85.76

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041654027	16金红叶CP001	200,000	20,138,000.00	5.51
2	071621007	16渤海证券CP007	200,000	20,016,000.00	5.48
3	041670004	16怡亚通CP001	200,000	20,000,000.00	5.47
4	011698993	16龙源电力SCP016	200,000	19,994,000.00	5.47
5	011698874	16沪华信SCP004	200,000	19,912,000.00	5.45

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本期内未发现本基金投资的前十名证券的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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,627.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,966,470.37
5	应收申购款	439,064.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,408,162.34

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	英大纯债债券A	英大纯债债券C
报告期期初基金份额总额	372,360,983.91	91,443,783.31
报告期期间基金总申购份额	13,394,873.84	9,160,534.81
减:报告期期间基金总赎回份额	69,323,901.03	91,685,827.17
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期末基金份额总额	316,431,956.72	8,918,490.95

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末基金管理人未持有本基金份额

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准英大纯债债券型证券投资基金设立的文件

《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》

《英大纯债债券型证券投资基金招募说明书》

《英大纯债债券型证券投资基金托管协议》

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在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站:http://www.ydamc.com/

英大基金管理有限公司
2017年1月20日

英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2016】第四季度报告

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年1月19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应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2016年10月1日起12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大灵活配置混合	
基金主代码	001270	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月7日	
报告期末基金份额总额	622,150,763.03份	
投资目标	本基金通过把握宏观经济转折点,灵活配置权益类资产和固定收益类资产,并在严格控制下行风险的基础上,力争实现基金资产较高的长期稳健回报。	
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。	
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。	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	英大灵活配置A	英大灵活配置B
下属分级基金的交易代码	001270	001271
报告期末下属分级基金的份额总额	503,587,123.81份	118,563,639.22份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)	
	英大灵活配置A	英大灵活配置B
1. 本期已实现收益	10,493,700.04	2,300,856.03
2. 本期利润	2,871,464.40	520,045.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0057	0.0044
4. 期末基金资产净值	506,540,763.17	118,397,805.53
5. 期末基金份额净值	1.0059	0.9986

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。

3.2 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

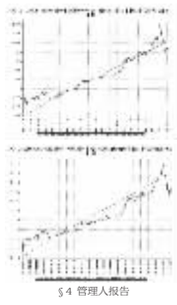
英大灵活配置A

阶段	净值增长率①	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	0.54%	0.16%	0.84%	0.01%	-0.30%	0.15%

英大灵活配置B

阶段	净值增长率①	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	0.42%	0.16%	0.84%	0.01%	-0.42%	0.15%

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 管理人报告

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
		任职日期	离任日期		
袁忠伟	本基金基金经理	2015年5月7日	-	15	曾任中国民族证券证券投资部总经理助理、执行总经理;华西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。
张琳娜	本基金基金经理	2015年7月15日	-	9	对外经济贸易大学金融学硕士,9年基金从业经历。先后任益民基金管理有限公司集中交易部交易员,副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限公司,曾任公司交易管理部副总经理(主持工作),现任固定收益部总经理。

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《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、《英大灵活配置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 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,通过公司新上线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 报告期内基金投资策略和运作分析

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,通过公司新上线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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度,A股市场呈现整体震荡上行而季末回落调整的走势。沪深300指数本季上涨1.75%,本基金单位净值本季上涨幅度为5.32%,显著超越指数。本季沪深300指数最大区间涨幅为9.58%,本基金单位净值最大区间涨幅为9.78%;沪深300指数本季最大区间跌幅为-7.50%,本基金单位净值最大区间跌幅为-4.56%。表现出较强抗跌性的同时能够较好把握市场上涨机会。

本季度我们继续秉持价值与成长均衡配置的投资策略。从风险可控、收益可期两个维度构建投资组合来获取投资收益。在注重高股息率、低估值品种的配置价值的同时,对于成长性较好、基本面改善且估值回落至合理区间的新兴产业成长股也采取了择机介入的投资策略。同时,积极参与一级市场网下配售获取低风险投资收益以有效提升基金业绩。

本基金四季度平均股票仓位在85%以上,波动区间为 77%-94%,根据市场走势及我们的判断进行灵活调整。季末股票投资比例为93.24%。同时,本季基金投资组合配置品种较为稳定,组合能稳定跑赢沪深300指数。积极参与新股配售,获配新股市值40万元,为基金提供了稳定增值资产。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,领先回报基金累计份额净值为1.4394元。报告期内,基金份额净值增长率为5.32%,同期业绩比较基准增长率为1.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情形。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	87,427,719.77	91.08
	其中:股票	87,427,719.77	91.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,000,000.00	3.13
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,205,227.16	5.42
8	其他资产	362,895.48	0.37
9	合计	95,985,842.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	838,760.00	0.89
B	采矿业	876,240.00	0.93
C	制造业	52,638,032.13	56.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,645,499.00	3.89
F	批发和零售业	466,650.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	785,852.00	0.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,255,782.29	5.61
J	金融业	20,685,792.00	22.06
K	房地产业	535,425.00	0.57
L	租赁和商务服务业	749,527.35	0.80
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	950,160.00	1.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	87,427,719.77	93.25

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	400,000	6,380,000.00	6.80
2	600015	华夏银行	550,000	5,967,500.00	6.36
3	601166	兴业银行	350,000	5,649,000.00	6.03
4	600104	上汽集团	200,000	4,690,000.00	5.00
5	601318	中国平安	130,000	4,605,900.00	4.91
6	000625	长安汽车	300,000	4,482,000.00	4.78
7	000651	格力电器	180,000	4,431,600.00	4.73
8	601398	工商银行	1,000,000	4,410,000.00	4.70
9	002202	金风科技	200,000	3,422,000.00	3.65
10	600741	华域汽车	200,000	3,190,000.00	3.40

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本期内未发现本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编日前一年内受到公开谴责、批评处罚的情况。

5.11.2

本期内本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定,也均在基金的备选股票池之内。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,994.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,585,832.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,632,827.82

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002791	坚朗五金	6,622,161.00	1.06	新股锁定
2	300508	维宏股份	1,261,430.67	0.20	新股锁定
3	002792	通宇通讯	6,317,546.06	1.01	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

单位:份

项目	英大灵活配置A	英大灵活配置B
报告期期初基金份额总额	503,586,937.96	119,419,453.72
报告期期间基金总申购份额	285.06	3,306.13
减:报告期期间基金总赎回份额	99.21	859,120.63
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期末基金份额总额	503,587,123.81	118,563,639.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

英大灵活配置A

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,450.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	9,999,450.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.00

英大灵活配置B

本报告期末基金管理人未持有本基金份额

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	直销柜台	2015年5月4日	9,999,450.00	10,000,000.00	1000元/笔
合计			9,999,450.00	10,000,000.00	1000元/笔

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,450.00	1.61	9,999,450.00	1.61	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	3年
基金经理等人员	1,100.04	0.00	1,100.04	0.00	3年
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	3年
其他	4,960.32	0.00	4,960.32	0.00	3年
合计	10,005,510.36	1.61	10,005,510.36	1.61	3年

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准英大灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

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在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站:http://www.ydamc.com/

英大基金管理有限公司
2017年1月20日

英大领先回报混合型发起式证券投资基金

【2016】第四季度报告

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:2017年1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2017年1月19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应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2016年10月1日起12月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	120,297,335.78份
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。
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	5,015,542.41
2.本期利润	5,001,477.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0403
4.期末基金资产净值	93,758,162.06
5.期末基金份额净值	0.7794

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。

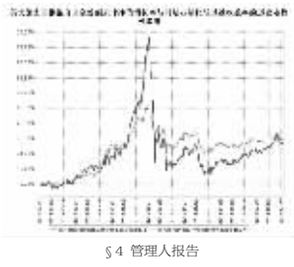
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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	净值增长率①	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	5.32%	0.65%	1.39%	0.37%	3.93%	0.28%

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 管理人报告

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
		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	曾任中国民族证券证券投资部总经理助理、执行总经理;华西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。
刘杰	本基金基金经理	2016年7月29日	-	9	经济学硕士,9年证券、基金等金融机构从业经验。曾任金元证券投资银行部项目经理,天弘基金行业研究员、天弘精选混合基金经理助理等职。2013年加入英大基金管理有限公司,历任高级行业研究员、专户投资部投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《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》等有关基金法律文件的规定,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,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无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,通过公司新上线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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度,A股市场呈现整体震荡上行而季末回落调整的走势。沪深300指数本季上涨1.75%,本基金单位净值本季上涨幅度为5.32%,显著超越指数。本季沪深300指数最大区间涨幅为9.58%,本基金单位净值最大区间涨幅为9.78%;沪深300指数本季最大区间跌幅为-7.50%,本基金单位净值最大区间跌幅为-4.56%。表现出较强抗跌性的同时能够较好把握市场上涨机会。

本季度我们继续秉持价值与成长均衡配置的投资策略。从风险可控、收益可期两个维度构建投资组合来获取投资收益。在注重高股息率、低估值品种的配置价值的同时,对于成长性较好、基本面改善且估值回落至合理区间的新兴产业成长股也采取了择机介入的投资策略。同时,积极参与一级市场网下配售获取低风险投资收益以有效提升基金业绩。

本基金四季度平均股票仓位在85%以上,波动区间为 77%-94%,根据市场走势及我们的判断进行灵活调整。季末股票投资比例