

英大策略优选混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

2017年3月31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
报告送出日期：2017年4月21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、完整性和及时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4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和组合报告等。保证本报告不存在虚假记载、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。
基金投资于股票，存在市场风险、管理风险和操作风险。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。
本基金的客户服务未经审计。
本基金报告自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	英大策略优选混合
场内简称	-
交易代码	000300
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月21日
报告期末基金份额总额	103,790,003.93份
投资目标	在严控风险的前提下追求资产收益性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，投资于固定收益类资产等各类资产以力求超额回报并力争在有效控制风险的前提下实现基金资产的增值。
投资范围	1. 大类资产配置策略：2. 投资标的：3. 固定收益品种投资策略：4. 投资组合管理：5. 风险控制策略：6. 其他投资品种的投资策略：7. 估值方法：8. 制度与风险控制：9. 其他。
投资比例	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。
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	广发银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	英大策略优选混合A
下属分级基金的类别	混合型基金-股票型基金
下属分级基金的交易代码	000300
下属分级基金的成立日期	2015-12-21
报告期末基金份额总额	103,790,003.93份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

英大策略优选混合A 英大策略优选混合C

1.本期已实现收益 4,160,675.37 1,206.03

2.本期利润 4,394,000.29 1,177.03

3.加权平均基金份额本期利润 0.0329 0.0106

4.期末基金份额净值 206,410,643.96 16,341.74

5.期末可供分配基金份额净值 11,236.00 0.0734

注：(1)所列数据截至本基金本报告期期末可供分配利润以扣除非经常性损益后的净利润为基

础，采用期末可供分配利润除以最新基金份额净值计算得出；(2)本期利润指报告期利息收入、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，即本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 本基金报告期基金净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

英大策略优选混合C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.18% 0.42% 0.83% 0.01% 1.36% 0.04%

英大策略优选混合C

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.08% 0.42% 0.83% 0.01% 1.26% 0.04%

3.2.1 本基金报告期基金净值增长率及其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 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.18% 0.42% 0.83% 0.01% 1.36% 0.04%

3.2.2 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

英大策略优选混合A

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.18% 0.42% 0.83% 0.01% 1.36% 0.04%

3.3 其他指标

注：无

§ 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间 离任日期 证券从业年限 说明

袁忠伟 基金基金经理 2016年12月21日 - 15 中国国民银行证券投资基金助理理财经理，2016年1月加入英大基金管理有限公司，历任理财产品部产品经理，2016年1月加入英大基金管理有限公司，历任理财产品部产品经理，2016年1月加入英大基金管理有限公司，历任理财产品部产品经理。

张伟 基金基金经理 2016年3月17日 2017年6月30日 6 中国科学院声学研究所硕士研究生，2010年6月加入英大基金管理有限公司，历任理财产品部产品经理。

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

得良好的投资收益为目标，勤勉尽责的履行管理职责和运用基金资产。本基金管理人通过审慎合理的

内部风险控制和外部控制制度，加强内部控制，规范基金运作。本报告期内，本基金运作符合有关法

律法规的规定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司管理人严格按照《证券投资基金公平交易制度指导意见》以及《英大基金

管理有限公司公平交易制度办法》的规定，从分析研究、投资决策、交易执行、事后监控等环节制

度上严格控制交易行为，确保公平交易制度的严格执行。

5.1.14 报告期内本基金报告期前十名股票中不存在流通受限情况的说明

5.1.15 报告期内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总计项之间可能存在尾差。

§ 5 投资组合报告

单位：份

5.1 报告期末基金份额组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 136,962,000.00 81.03

2 固定收益投资 129,062,000.00 81.03

3 货币市场基金 39,901,000.00 14.43

4 其他投资 29,991,000.00 14.43

5 货币市场型证券投资基金 - -

6 买入返售金融资产 46,000,000.00 21.63

7 衍生工具及权证投资 - -

8 其他资产 5,666,381.71 2.43

9 合计 208,036,440.00 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.50% 0.03% -12.4% 0.07% 1.83% -0.04%

英大策略优选A 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.40% 0.03% -1.24% 0.07% 1.73% -0.04%

5.2.2 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

5.3 报告期未按行业分类的境内股票投资组合

序号 行业类别 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

A 农林牧渔业 1,226,350.00 0.62

B 采掘业 5,473,342.26 2.65

C 制造业 61,474,220.36 29.77

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 12,900,377.02 6.26

E 建筑业 4,139,035.08 2.00

F 批发和零售业 6,436,002.17 3.12

G 交通运输、仓储和邮政业 9,546,298.71 4.62

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息、通信、计算机和信息技术服务业 2,626,640.00 1.27

J 金融业 - -

K 国防军工 19,197,479.38 9.30

L 采矿业 1,279,857.00 0.62

M 科学、技术服务业 16,930.16 0.01

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 仪器仪表制造业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 1,296,367.00 0.63

S 综合 1,289,632.00 0.62

合计 126,962,000.00 10.49

5.2.3 报告期未按行业分类的沪港通股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

A 买入返售股票 - -

B 买入返售债券 - -

C 买入返售存单 - -

D 买入返售其他 - -

E 买入返售金融资产 - -

F 买入返售股票 - -

G 买入返售债券 - -

H 买入返售存单 - -

I 买入返售其他 - -

J 买入返售金融资产 - -

K 买入返售股票 - -

L 买入返售债券 - -

M 买入返售存单 - -

N 买入返售其他 - -

O 买入返售金融资产 - -

P 买入返售股票 - -

Q 买入返售债券 - -

R 买入返售存单 - -

S 买入返售其他 - -

T 买入返售金融资产 - -

合计 1,289,632.00 0.62

5.3 报告期未按行业分类的沪港通股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

A 买入返售股票 - -

B 买入返售债券 - -

C 买入返售存单 - -

D 买入返售其他 - -

E 买入返售金融资产 - -

F 买入返售股票 - -