英大策略优选混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 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 10 月 26 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 10 月 25 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 2017 年 7 月 1 日起 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	英大策略优选混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	88,068,935.02 份
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。
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	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	88,034,720.47 份	34,214.55 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(2017年7月1日－2017年9月30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	1,771,185.44	23.05
2. 本期利润	12,366,727.90	3,505.70
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0825	0.0696
4. 期末基金资产净值	105,344,918.49	35,403.21
5. 期末基金份额净值	1.1966	1.0347

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

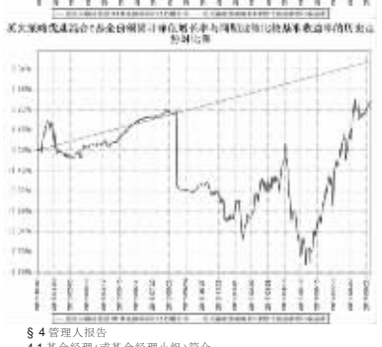
英大策略优选混合 A

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	7.18%	0.53%	0.84%	0.01%	6.34%	0.52%

英大策略优选混合 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	7.08%	0.53%	0.84%	0.01%	6.24%	0.52%

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		
窦志伟	本基金基金经理	2015年 12 月 2 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。

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 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

一、基金投资策略

2017 年中国经济运行呈现"稳中略降"的概率较大,全年经济增速可能 6.8%附近,预计 A 股三季度业绩增速仍将维持较好势头。三季度国际货币环境由宽松缓步回归常态,国内货币政策保持稳健中性,参考现金宝收益率和国债利率,目前无风险利率在 4%左右;金融去杠杆力度边际放缓,市场风险偏好略有改善。基于经济增长、无风险收益率和风险偏好三个因素考虑,我们预计 2017 年余下时段 A 股将维持"震荡市"特征,业绩状况将是决定震荡中枢的主要因素,具有估值优势和业绩成长性的公司股票才能真正贡献正收益。2017 年三季度,本基金股票市值配置策略:以机构投资理念配置稳健增值资产,低估值、高分红、有成长前景的公司股票可作为重点投资对象,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。

二、三季度运作分析

2017 年三季度,A 股市场呈现上行走势,沪深 300 指数上涨 4.63%,中证 500 指数上涨 7.58%;三季度本基金单位净值上涨 7.16%,超越沪深 300 指数,主要得益于本基金对市场风格的把握与选股策略,股票组合具有阿尔法收益。我们坚持价值投资策略,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提升基金业绩。三季度股票仓位波动区间位于 3%~87%之间,季末股票仓位为 33.5%。基金三季度净收益 1237 万元,其中:新股配售贡献 284 万元,二级市场投资扣除基金费用后贡献 953 万元。

4.5 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 1.1966 元,本报告期基金份额净值增长率为 7.18%;截至本报告期末英大策略优选混合 C 基金份额净值为 1.0347 元,本报告期基金份额净值增长率为 7.08%;同期业绩比较基准收益率为 0.84%。

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	35,306,281.08	32.85
	其中:股票	35,306,281.08	32.85
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	66,000,000.00	61.40
	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	6,073,857.41	5.65
8	其他资产	107,481.17	0.10
9	合计	107,487,619.66	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,023,811.10	4.77
B	采矿业	39,793.60	0.04
C	制造业	4,635,546.97	4.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	4,025,862.82	3.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.02
J	金融业	16,091,275.13	15.27
K	房地产业	1,259,200.00	1.19
L	租赁和商务服务业	4,027,768.50	3.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.11
R	文化、体育和娱乐业	12,776.05	0.01
S	综合	-	-
	合计	35,306,281.08	33.50

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	601688	华泰证券	357,525	8,087,215.50	7.67
2	600138	中青旅	187,950	4,027,768.50	3.82
3	601211	国泰君安	185,201	4,005,897.63	3.80
4	600004	白云机场	305,599	4,000,290.91	3.80
5	601118	海南橡胶	622,100	4,000,103.00	3.80
6	600030	中信证券	219,800	3,998,162.00	3.79
7	600038	中直股份	91,100	3,981,981.00	3.78
8	000031	中粮地产	157,400	1,259,200.00	1.19
9	600975	新五丰	156,770	1,023,708.10	0.97
10	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.11

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。

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。

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

无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无国债期货投资。

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制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	138,820.32
2	应收证券清算款	3,446.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-34,785.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,481.17

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	000031	中粮地产	1,259,200.00	1.19	临时停牌
2	600975	新五丰	1,023,708.10	0.97	临时停牌

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	英大策略优选混合 A	英大策略优选混合 C
报告期期初基金份额总额	183,713,020.71	57,339.46
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	95,678,300.24	23,124.91
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	88,034,720.47	34,214.55

§ 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。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	2017.7.1-2017.9.30	138,883,336.27	0.00	50,888,336.27		88,000,000.00	99.92%
	2	2017.7.1-2017.8.15	44,773,887.35	0.00	44,773,887.35		0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-		-	-

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准英大策略优选混合型证券投资基金设立的文件

《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》

《英大策略优选混合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

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 10 月 26 日

英大领先回报混合型发起式证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 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 10 月 26 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 10 月 25 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 2017 年 7 月 1 日起 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	英大领先回报混合
交易代码	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	233,149,328.83 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(2017年7月1日－2017年9月30日)
1.本期已实现收益	12,093,557.14
2.本期利润	7,339,095.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0309
4.期末基金资产净值	209,847,480.93
5.期末基金份额净值	0.9001

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。

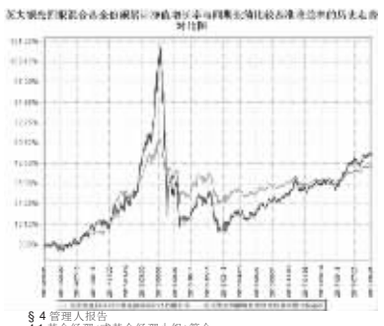
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	3.58%	0.58%	2.41%	0.30%	1.17%	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		
窦志伟	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。

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

一、基金投资策略

2017 年中国经济运行呈现"稳中略降"的概率较大,全年经济增速可能 6.8%附近,预计 A 股三季度业绩增速仍将维持较好势头。三季度国际货币环境由宽松缓步回归常态,国内货币政策保持稳健中性,参考现金宝收益率和国债利率,目前无风险利率在 4%左右;金融去杠杆力度边际放缓,市场风险偏好略有改善。基于经济增长、无风险收益率和风险偏好三个因素考虑,我们预计 2017 年余下时段 A 股将维持"震荡市"特征,业绩状况将是决定震荡中枢的主要因素,具有估值优势和业绩成长性的公司股票才能真正贡献正收益。2017 年三季度,本基金股票市值配置策略:以机构投资理念配置稳健增值资产,低估值、高分红、有成长前景的公司股票可作为重点投资对象,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。

二、三季度运作分析

2017 年三季度,A 股市场呈现上行走势,沪深 300 指数上涨 4.63%,中证 500 指数上涨 7.58%;三季度本基金单位净值上涨 3.58%。我们坚持价值投资策略,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提升基金业绩。三季度股票仓位波动区间位于 83%~92%之间,季末股票仓位为 86%。基金三季度净收益 686 万元,其中:新股配售贡献 314 万元,二级市场投资扣除基金费用后贡献 372 万元。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9001 元;本报告期基金份额净值增长率为 3.58%,业绩比较基准收益率为 2.41%。

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	181,062,622.58	85.04
	其中:股票	181,062,622.58	85.04
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	20,000,000.00	9.39
	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	11,479,094.61	5.39
8	其他资产	371,225.50	0.17
9	合计	212,912,942.69	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,462,793.60	4.51
C	制造业	91,361,209.66	43.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	15,210,000.00	7.25
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	24,206,571.91	11.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.01
J	金融业	34,046,800.00	16.22
K	房地产业	1,960,000.00	0.93
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.05
R	文化、体育和娱乐业	4,625,000.50	2.20
S	综合	-	-
	合计	181,062,622.58	86.28

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	000651	格力电器	350,000	13,265,000.00	6.32
2	002202	金风科技	850,000	11,101,000.00	5.29
3	600104	上汽集团	350,000	10,566,500.00	5.04
4	601166	兴业银行	600,000	10,374,000.00	4.94
5	600015	华夏银行	1,100,000	10,197,000.00	4.86
6	000623	吉林敖东	450,000	10,102,500.00	4.81
7	000625	长安汽车	700,000	9,919,000.00	4.73
8	600270	外运发展	550,000	9,856,000.00	4.70
9	601088	中国神华	450,000	9,423,000.00	4.49
10	601668	中国建筑	1,000,000	9,280,000.00	4.42

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

无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无国债期货投资。

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制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	347,347.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,205.95
5	应收申购款	6,671.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	371,225.50

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	244,566,999.56
报告期期间基金总申购份额	10,200,086.90
减:报告期期间基金总赎回份额	21,617,757.63
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	233,149,328.83

§ 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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	45,622,353.28
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
报告期期末管理人持有的本基金份额	45,622,353.28
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	19.57

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	英大直销	2014年 3 月 4 日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
2	英大直销	2015年 7 月 13 日	13,499,392.47	10,000,000.00	0.00%
3	英大直销	2017年 3 月 3 日	21,350,163.28	17,000,000.00	0.00%
合计			44,849,555.75	37,000,000.00	

§ 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	45,622,353.28	19.57	10,000,000.00	4.29	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	3年
基金经理等人员	-	-	-	-	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	3年
其他	-	-	300,004.16	0.13	3年
合计	45,622,353.28	19.57	10,300,004.16	4.42	3年

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	2017.7.1-2017.9.30	74,877,074.75	0.00	0.00		74,877,074.75	32.12%
个人	-	-	-	-	-		-	-

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会批准英大领先回报混合型发起式证券投资基金设立的文件

《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》

《英大领先回报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

10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所

10.3 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 10 月 26 日

英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 日
基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2017 年 10 月 26 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 10 月 25 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 2017 年 7 月 1 日起 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	英大灵活配置混合
交易代码	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	622,253,058.48 份
投资目标	本基金通过把握宏观经济特征点,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	503,593,562.56 份	118,659,495.92 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(2017年7月1日－2017年9月30日)	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
1. 本期已实现收益	7,264,957.42	1,536,484.06
2. 本期利润	5,992,068.17	1,239,781.58
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0104
4. 期末基金资产净值	538,190,849.58	125,425,906.80
5. 期末基金份额净值	1.0687	1.0570

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	1.13%	0.18%	0.82%	0.01%	0.31%	0.17%

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	0.99%	0.18%