

英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年年度报告

2014年12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

送出日期：2015年3月27日

§ 1 重要提示及目录

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2015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2014年3月5日（基金合同生效日）起至12月31日止。

1.2 目录

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
8.6 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.....	49
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
8.8 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贵金属投资明细.....	49
8.9 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.....	49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
8.12 投资组合报告附注.....	50

§9	基金份额持有人信息.....	50
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	51
§10	开放式基金份额变动.....	52
§11	重大事件揭示.....	52
11.1	基金份额持有人大会决议.....	52
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
11.4	基金投资策略的改变.....	52
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
11.8	其他重大事件.....	54
§12	备查文件目录.....	56
12.1	备查文件目录.....	56
12.2	存放地点.....	56
12.3	查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	英大领先回报混合型发起式证券投资基金
基金简称	领先回报
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	98,748,402.99

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体系下，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	张宁
	联系电话	010-59112066
	电子邮箱	zhangning@ydamc.com
		李春磊
		010-6516 9830
		lichunlei@cgbchina.com.cn

客户服务电话	400-890-5288	400-830-8003
传真	010-59112222	020-65169555
注册地址	北京市朝阳区东三环中路1号 环球金融中心西塔22楼2201	广州市东风东路713号
办公地址	北京市朝阳区东三环中路1号 环球金融中心西塔22楼2201	北京市东城区东长安街甲2号 广发银行大厦四层
邮政编码	100020	100005
法定代表人	张传良	董建岳

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市海淀区西四环中路16号院 2号楼4层
注册登记机构	英大基金管理有限公司	北京市朝阳区东三环中路1号环 球金融中心西塔22楼2201

§ 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	2014年3月5日-2014年12月31日
本期已实现收益	19,844,799.68
本期利润	20,221,045.70
加权平均基金份额本期利润	0.1654

本期加权平均净值利润率	16.14%
本期基金份额净值增长率	20.94%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配利润	10,929,441.82
期末可供分配基金份额利润	0.1107
期末基金资产净值	110,784,617.95
期末基金份额净值	1.1219
3.1.3 累计期末指标	2014年末
基金份额累计净值增长率	20.94%

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。5、本基金成立于2014年3月5日，本报告期不完整且没有过往可比期间。

3.2 基金净值表现

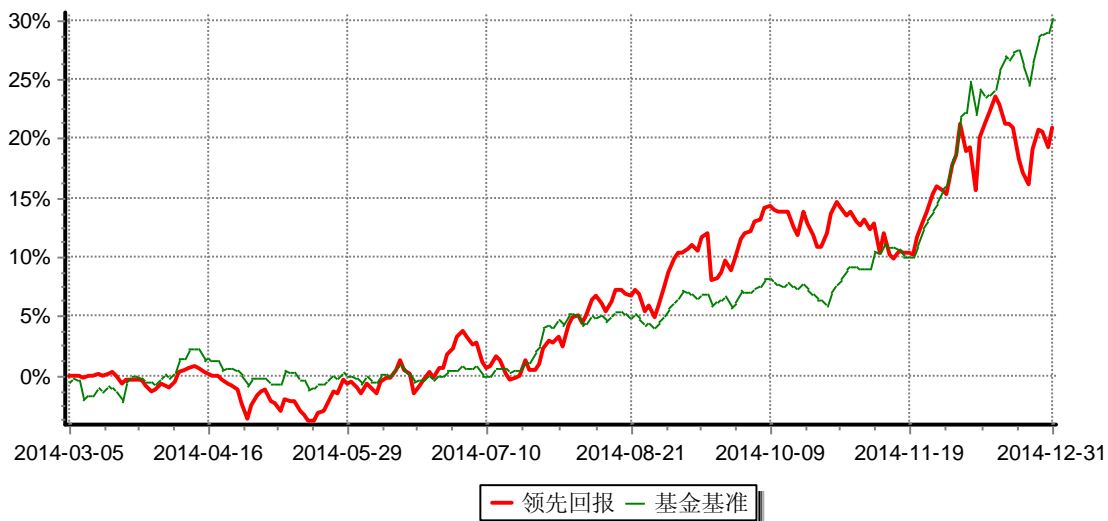
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.91%	1.23%	21.22%	0.82%	-14.31%	0.41%
过去六个月	18.74%	1.05%	29.77%	0.66%	-11.03%	0.39%
自基金合同生效日起至今（2014年03月05日-2014年12月31日）	20.94%	0.90%	30.27%	0.61%	-9.33%	0.29%

注：①本基金合同于2014年3月5日生效；

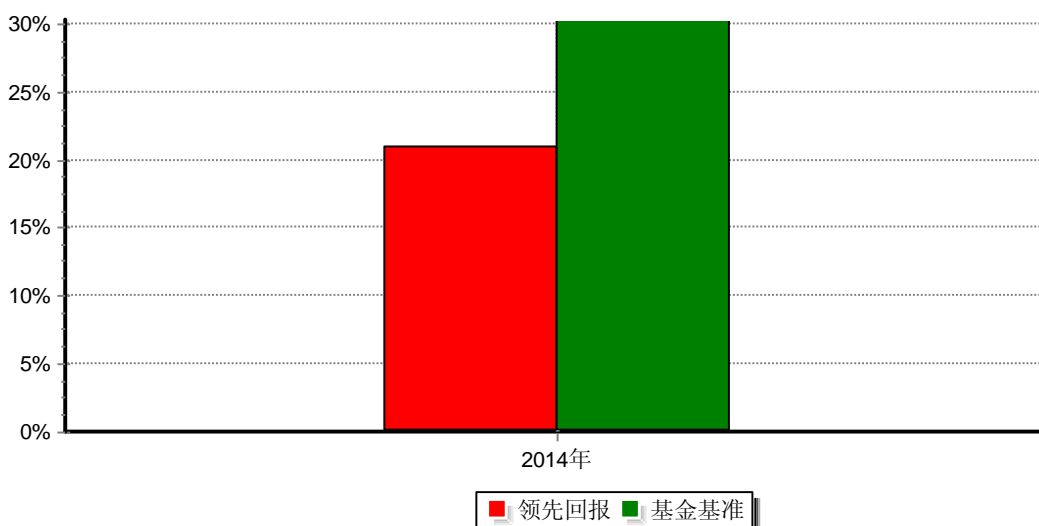
②本基金的业绩比较基准为：50%*沪深300指数+50%*上证国债指数。

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



注：本基金基金合同生效日为2014年3月5日，截止报告期末本基金运行未满一年。图示日期为2014年3月5日至2014年12月31日。

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：本基金基金合同生效日为2014年3月5日，截止报告期末本基金运行未满一年。

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
2014年	0.800	4,525,485.73	1,388,450.40	5,913,936.13	

合计	0.800	4,525,485.73	1,388,450.40	5,913,936.13	
----	-------	--------------	--------------	--------------	--

注：本基金成立于2014年3月5日，于2014年9月12日分红，每份分红金额0.08元。

§ 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。英大基金注册资金已增资至2亿元人民币，其中英大信托出资比例为49%，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3只开放式证券投资基金-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		
秦岭	研究部副总经理，本基金基金	2014年3月5日	—	9	秦岭先生，清华大学管理学硕士。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。历任国务院发展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，	2014年3月5日	—	12	赵强先生，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

	本基金 基金经 理			任英大基金管理有限公司权益投资部基金经理。具备16年金融业从业经历，其中12年基金行业从业经历。曾任职于国金通用基金管理有限公司、华安基金管理有限公司，招商银行天津分行、中国农业银行天津分行等金融机构。
--	-----------------	--	--	---

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

2014年，经济下行压力加大，房地产销售数据整体疲弱。从3月份开始，各项深化改革的措施不断推进，政府也陆续推出了稳增长的政策。2014年前三季度，股市继续延续2013年的风格，新经济的成长股在传统经济低迷和转型的大背景下持续火热；随着新一届政府在经济政治等领域积极作为，市场信心急剧膨胀，并影响居民资产配置向股市转移，2014年4季度以金融股为代表的大盘蓝筹股迅速爆发。

在投资策略上，我们在二季度市场调整中持续加仓符合未来发展趋势的信息技术、文化传媒、医药、军工等行业，以及估值较低的食品饮料、家电等消费品行业，取得了一定的收益。四季度我们做出了调整，增持了大金融类、建材、机械类个股，减持新经济成长股。市场的上涨超出了我们的预期，我们调仓的力度明显不足。

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1.2019，份额净值增长率为20.94%，同期业绩比较基准收益率为30.27%，基金表现落后业绩比较基准9.33%。

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2015年，国内仍处于转型和换挡期，经济仍将继续在底部震荡。2015年国内房地产面临人口结构拐点和高库存重压，制造业受制于产能过剩、高杠杆，海外需求偏弱，国内经济面继续承压。不过在政府继续托底的思维下国内经济会保持稳定，货币政策预

计继续整体保持稳定，年内降息降准都有空间。

目前看，改革预期还在，市场估值水平不高，市场向下的空间不大。我们认为今年证券市场仍有不错的投资机会，后续改革政策的陆续落地还会带来市场的活跃。但是估值提升带来的空间已经有限，后续需要经济基本面的改善来助力股市进一步走高。

2015年我们看好的各类型的服务业和高端装备制造业。具体而言，看好产业升级的高端装备、新材料，运营效率提升或受益于资产整合的国企，具有较好盈利模式的互联网企业，金融、医疗等服务业，以及受益于去产能和环保趋严的环保、钢铁、化工等行业的部分子领域。在产业转型和升级的背景下，新兴产业仍充满了投资机会，不过对投资时点和个股的选择提出了很高要求。

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，本基金管理人管理的基金整体运作合法合规，依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度，在督察长的指导和监察稽核部的努力下，开展了一系列监察稽核工作。采取的主要措施如下：

1)据国家法律法规的变化和公司业务发展的需要，按照规定程序对公司基本管理制度进行全面梳理，对内部控制大纲、风险控制制度等基本制度进行修订，进一步完善公司的内部控制体系；

2)保持与监管机构的联系，以"守住三条底线"、防控内幕交易为基础，多次组织各业务条线学习最新的监管要求和法律法规，加强全体员工的合规和风险意识；

3)监督检查基金资产运作，就资产运作的合法合规性和有效性进行独立、客观的分析，并向督察长汇报；

4)根据监管机构的要求以及基金资产运作情况开展公司的监察稽核工作，出具监察稽核报告，并按照规定程序上报督察长、公司董事和监管机构；

5)对基金投资与专户投资的公平交易、异常交易情况进行分析，并出具交易分析报告；

6)按照公司的内部管理制度开展反洗钱、反不正当竞争和商业贿赂、反内幕交易等工作，并按照公司《信息披露管理制度》的有关规定开展信息披露工作；

7)对基金合同、宣传推介材料、涉及基金份额持有人和公司利益的对外言论等进行审查，并出具合规意见，有效防范风险，规避违法违规行为的发生；

8)配合监管部门和外聘会计师事务所开展本基金的审计事务，并向公司员工提供法律咨询服务；

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验。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

本基金的基金管理人于2014年9月10日宣告本2014年度第1次分红，向截至2014年9月12日止在本基金注册登记人建信基金管理有限责任公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.80元，收益分配基准日为2014年9月9日，共发放红利人民币元5,913,936.13元,其中现金分红人民币4,525,485.73元，红利再投形式发放人民币1,388,450.40元，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。

4.9 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

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	瑞华审字[2015]第01390127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	英大领先回报混合型发起式证券投资基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的英大领先回报混合型发起式证券投资基金(以下简称"英大领先基金")的财务报表，包括 2014年12月31日的资产负债表、2014年3月5日(基金合同生效日)起至2014年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是英大领先基金的基金管理人英大基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大

	<p>错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述英大领先基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了英大领先基金2014年12月31日的财务状况以及2014年3月5日(基金合同生效日)起至2014年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	张琴、张庆瑞
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层
审计报告日期	2015-03-27

§ 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：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年12月31日
资产：		

英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年年度报告

银行存款	7.4.7.1	12,716,869.70
结算备付金		1,135,731.94
存出保证金		161,625.60
交易性金融资产	7.4.7.2	95,471,460.48
其中：股票投资		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	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		5,385,545.32
应收利息	7.4.7.5	3,745.53
应收股利		—
应收申购款		42,608.69
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		114,917,587.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		1,828,510.44
应付赎回款		1,207,993.33
应付管理人报酬		153,540.08
应付托管费		25,590.03
应付销售服务费		—

应付交易费用	7.4.7.7	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	7.4.7.8	364,858.20
负债合计		4,132,969.31
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	98,748,402.99
未分配利润	7.4.7.10	12,036,214.96
所有者权益合计		110,784,617.95
负债和所有者权益总计		114,917,587.26

注：1. 报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.1219元，基金份额总额98,748,402.99份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2014年3月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

3. 本基金成立于2014年3月5日，因此无上年度末数据。

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：2014年3月5日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
一、收入		24,191,013.38
1.利息收入		909,810.12
其中：存款利息收入	7.4.7.11	302,370.48
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		583,900.83
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填		22,465,335.80

列)		
其中：股票投资收益	7.4.7.12	21,251,430.61
基金投资收益	7.4.7.13	
债券投资收益	7.4.7.14	42,569.44
7.4.7.15	7.4.7.14. 4	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.16	—
股利收益	7.4.7.17	1,171,335.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	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）	7.4.7.19	439,621.44
减：二、费用		3,969,967.68
1. 管理人报酬		1,545,536.95
2. 托管费		257,589.49
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.20	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	7.4.7.21	361,304.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,221,045.70
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,221,045.70

注：本基金成立于2014年3月5日，因此无上年度可比期间数据。

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：2014年3月5日至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年3月5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

注：本基金成立于2014年3月5日，因此无上年度可比期间数据。

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 基金基本情况

英大领先回报混合型发起式证券投资基金(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[2013]1461号《关于核准英大领先回报混合型发起式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《英大领先回报混合型发起式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161,880,816.40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，《英大领先回报混合型发起式证券投资基金基金合同》于2014年3月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为161,922,767.08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《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大领先回报混合型发起式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、债券（含可转换债券、分离交易可转债）、资产支持证券、中票、债券回购、短期融资券、银行存款、货币市场工具、现金等固定收益品种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(但须符合中国证监会相关规定)。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：本基金投资的股票资产占基金资产的30%-95%；债券（含可转换债券、分离交易可转债）、资产支持证券、中票、债券回购、短期融资券、银行存款、货币市场工具、现金等金融工具占基金资产的比例为5%-70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和41项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《英大领先回报混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2014年12月31日的财务状况及2014年3月5日（基金合同生效日）起至2014年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。此外，本财务报表在所有重大方面符合中国证监会颁布的《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>》中有关财务报表及其附注的披露要求。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止，本期财务报表的实际编制期间为2014年3月5日（基金合同生效日）至2014年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。卖出股票、基金、债券等金融资产的成本按移动加权平均法逐日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金及适用利率逐日计提。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时采用合同利率）在回购期内逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.11 费用的确认和计量

- (1) 本基金的管理人报酬按照前一日基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提。
 - (2) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提。
 - (3) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时采用合同利率）在回购期内逐日计提。
 - (4) 其他费用根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额列入当期基金费用。
- 如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法，在受益期内分摊计入本期和以后各期。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金将根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》确定估值方法进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
活期存款	12,716,869.70
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	12,716,869.70

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	95,095,214.46	95,471,460.48	376,246.02
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—

基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	95,095,214.46	95,471,460.48	376,246.02

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
应收活期存款利息	—
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	3,103.24
应收结算备付金利息	562.21
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	80.08
合计	3,745.53

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	552,477.23
银行间市场应付交易费用	—
合计	552,477.23

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	4,858.20
审计费	60,000.00
信息披露费	300,000.00
合计	364,858.20

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年3月5日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	161,922,767.08	161,922,767.08
本期申购	84,437,612.50	84,437,612.50
本期赎回（以“-”号填列）	-147,611,976.59	-147,611,976.59
本期末	98,748,402.99	98,748,402.99

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

首次设立募集不包括认购资金利息共募集161,880,816.40元。经向中国证监会备案，《英大领先回报混合型发起式证券投资基金基金合同》于2014年3月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为161,922,767.08份基金份额，认购资金利息折合41,950.68份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	19,844,799.68	376,246.02	20,221,045.70
本期基金份额交易产生的变动数	-3,001,421.73	730,527.12	-2,270,894.61
其中：基金申购款	1,276,138.24	2,558,457.02	3,834,595.26
基金赎回款	-4,277,559.97	-1,827,929.90	-6,105,489.87
本期已分配利润	-5,913,936.13	—	-5,913,936.13
本期末	10,929,441.82	1,106,773.14	12,036,214.96

注：：①本表涉及报告期内未分配利润的变动项目中，如为利润减少或亏损，以“-”号填列。

②本基金基金合同生效日为2014年3月5日，为报告期内合同生效的基金，无上年度可比数据；

本报告期为2014年3月5日至2014年12月31日。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
活期存款利息收入	111,762.50
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	173,169.44
结算备付金利息收入	15,653.75
其他	1,784.79
合计	302,370.48

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	580,784,639.84
减：卖出股票成本总额	559,533,209.23
买卖股票差价收入	21,251,430.61

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本期无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益**7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	42,569.44
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—
合计	42,569.44

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	4,959,270.20
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	4,757,016.80
减：应收利息总额	159,683.96
买卖债券差价收入	42,569.44

7.4.7.14.3 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
申购基金份额对价总额	—
减：现金支付申购款总额	—

减：申购债券成本总额	—
减：申购债券应收利息总额	—
申购差价收入	—

7.4.7.14.4 资产支持证券投资收益

本基金本期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本期无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,171,335.75
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,171,335.75

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
1.交易性金融资产	376,246.02
——股票投资	376,246.02
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—

——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	376,246.02

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
基金赎回费收入	439,609.41
其他	12.03
合计	439,621.44

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	1,805,537.24
银行间市场交易费用	—
合计	1,805,537.24

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	300,000.00
证券帐户开户费	900.00
银行费用	404.00

合计	361,304.00
----	------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,545,536.95
其中：支付销售机构的客户维护费	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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月5日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 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：人民币元

项目	本期 2014年3月5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	—
基金合同生效日起至报告期	772,797.53

期末基金总申购份额	
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	—
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	—
期末持有的基金份额	10,772,797.53
期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.91%

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2014年3月5日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每10份基金 份额分红数	现金形式 发放	再投资形式 发放	利润分配 合计
	2014-09-12	2014-09-	2014-09-	0.800	4,525,485.73	1,388,450.40	5,913,936.13

		12	12				
合计				0.800	4,525,485.73	1,388,450.40	5,913,936.13

注：本基金成立于2014年3月5日，于2014年9月12日分红,每份分红金额0.08元。

7.4.12 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：									
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
002736	国信证券	2014-12-23	2015-01-15	非公开发行	5.83	10.16	6,500	37,895.00	66,040.00

7.4.12.2 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 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
002396	星网锐捷	2014-10-20	拟披露重大事项	27.31	2015-02-09	30.04	80,000	2,258,888.00	2,184,800.00

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员

会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

7.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持交易性金融资产均在证券交易所上市，除前文所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

对流动性风险的监控和管理，本基金管理人根据对市场特征和发展形势等方面的分析和判断，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标。

7.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、VAR等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2014年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,716,869.	—	—	—	12,716,869.

	70				70
结算备付金	1,135,731.94	—	—	—	1,135,731.94
存出保证金	161,625.60	—	—	—	161,625.60
交易性金融资产	—	—	—	95,471,460.48	95,471,460.48
应收证券清算款	—	—	—	5,385,545.32	5,385,545.32
应收利息	—	—	—	3,745.53	3,745.53
应收申购款	—	—	—	42,608.69	42,608.69
资产总计	14,014,227.24	—	—	100,903,360.02	114,917,587.26
负债					
应付证券清算款	—	—	—	1,828,510.44	1,828,510.44
应付赎回款	—	—	—	1,207,993.33	1,207,993.33
应付管理人报酬	—	—	—	153,540.08	153,540.08
应付托管费	—	—	—	25,590.03	25,590.03
应付交易费用	—	—	—	552,477.23	552,477.23
其他负债	—	—	—	364,858.20	364,858.20
负债总计	—	—	—	4,132,969.31	4,132,969.31
利率敏感度缺口	14,014,227.24	—	—	96,770,390.71	110,784,617.95

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2014年12月31日，本基金未持有债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用Barra风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	95,471,460.48	86.18
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	95,471,460.48	86.18

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末(2014年12月31日)
	+5%	4,773,573.02
	-5%	-4,773,573.02

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

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	95,471,460.48	83.08
	其中：股票	95,471,460.48	83.08
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	—	—
	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	13,852,601.64	12.05
7	其他各项资产	5,593,525.14	4.87
8	合计	114,917,587.26	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	—	—
C	制造业	54,523,842.48	49.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,005,200.00	1.81
E	建筑业	8,572,800.00	7.74
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	6,258,538.00	5.65
H	住宿和餐饮业	1,981,440.00	1.79
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,148,540.00	9.16

J	金融业	4,712,500.00	4.25
K	房地产业	7,268,600.00	6.56
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	95,471,460.48	86.18

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600502	安徽水利	460,000	5,354,400.00	4.83
2	002690	美亚光电	132,907	4,731,489.20	4.27
3	000826	桑德环境	150,000	4,102,500.00	3.70
4	000786	北新建材	150,000	3,792,000.00	3.42
5	000860	顺鑫农业	200,000	3,736,000.00	3.37
6	601318	中国平安	50,000	3,735,500.00	3.37
7	600549	厦门钨业	110,000	3,627,800.00	3.27
8	002481	双塔食品	200,000	3,498,000.00	3.16
9	000002	万科A	250,000	3,475,000.00	3.14
10	002271	东风雨虹	100,000	3,334,000.00	3.01
11	600970	中材国际	240,000	3,218,400.00	2.91
12	600019	宝钢股份	450,000	3,154,500.00	2.85
13	601328	交通银行	460,000	3,128,000.00	2.82
14	600351	亚宝药业	350,000	3,055,500.00	2.76
15	600686	金龙汽车	250,972	2,991,586.24	2.70

16	000157	中联重科	399,930	2,823,505.80	2.55
17	002303	美盈森	199,972	2,683,624.24	2.42
18	300072	三聚环保	100,000	2,418,000.00	2.18
19	002396	星网锐捷	80,000	2,184,800.00	1.97
20	002065	东华软件	120,000	2,149,200.00	1.94
21	300095	华伍股份	210,000	2,070,600.00	1.87
22	600292	中电远达	90,000	2,005,200.00	1.81
23	600176	中国玻纤	127,100	1,966,237.00	1.77
24	000555	神州信息	49,988	1,924,538.00	1.74
25	300070	碧水源	50,000	1,740,000.00	1.57
26	601166	兴业银行	100,000	1,650,000.00	1.49
27	000625	长安汽车	100,000	1,643,000.00	1.48
28	300337	银邦股份	130,000	1,588,600.00	1.43
29	600000	浦发银行	100,000	1,569,000.00	1.42
30	000831	五矿稀土	50,000	1,499,500.00	1.35
31	000425	徐工机械	100,000	1,497,000.00	1.35
32	300284	苏交科	130,000	1,426,100.00	1.29
33	600729	重庆百货	50,000	1,249,500.00	1.13
34	000069	华侨城A	150,000	1,237,500.00	1.12
35	002438	江苏神通	60,000	1,218,600.00	1.10
36	000532	力合股份	80,000	1,152,000.00	1.04
37	000623	吉林敖东	30,000	1,044,300.00	0.94
38	600031	三一重工	100,000	998,000.00	0.90
39	600859	王府井	33,000	731,940.00	0.66
40	002736	国信证券	6,500	66,040.00	0.06

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年年度报告

1	000848	承德露露	12,714,514.02	11.48
2	002241	歌尔声学	11,858,722.92	10.70
3	002065	东华软件	9,608,245.12	8.67
4	600315	上海家化	9,602,125.00	8.67
5	000625	长安汽车	8,845,397.32	7.98
6	000651	格力电器	8,757,809.98	7.91
7	600030	中信证券	7,721,000.00	6.97
8	600549	厦门钨业	7,665,264.00	6.92
9	002690	美亚光电	7,405,939.08	6.68
10	601318	中国平安	7,064,038.00	6.38
11	601601	中国太保	6,951,400.00	6.27
12	600519	贵州茅台	6,939,346.10	6.26
13	002279	久其软件	6,890,216.00	6.22
14	600535	天士力	6,830,719.92	6.17
15	002410	广联达	6,696,080.00	6.04
16	000596	古井贡酒	6,661,197.50	6.01
17	002271	东风雨虹	6,654,716.00	6.01
18	600837	海通证券	6,452,730.00	5.82
19	002303	美盈森	6,435,027.96	5.81
20	600594	益佰制药	6,250,381.00	5.64
21	601166	兴业银行	6,161,500.00	5.56
22	000623	吉林敖东	6,155,867.13	5.56
23	000069	华侨城A	5,925,396.11	5.35
24	601328	交通银行	5,757,000.00	5.20
25	600502	安徽水利	5,481,020.00	4.95
26	601628	中国人寿	5,341,700.00	4.82
27	002023	海特高新	5,148,336.00	4.65
28	601668	中国建筑	5,138,300.00	4.64
29	600153	建发股份	5,095,796.00	4.60
30	600887	伊利股份	5,067,399.50	4.57

英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年年度报告

31	600037	歌华有线	5,024,146.38	4.54
32	600970	中材国际	4,946,640.00	4.47
33	600000	浦发银行	4,773,800.00	4.31
34	600118	中国卫星	4,738,595.16	4.28
35	002051	中工国际	4,531,115.68	4.09
36	600276	恒瑞医药	4,404,967.80	3.98
37	601633	长城汽车	4,360,625.76	3.94
38	002665	首航节能	4,360,000.00	3.94
39	000826	桑德环境	4,320,964.20	3.90
40	300049	福瑞股份	4,160,285.34	3.76
41	600010	包钢股份	4,144,162.50	3.74
42	600176	中国玻纤	4,122,456.68	3.72
43	000786	北新建材	4,115,400.00	3.71
44	600690	青岛海尔	4,109,221.00	3.71
45	300157	恒泰艾普	4,095,170.50	3.70
46	300199	翰宇药业	4,012,648.10	3.62
47	000860	顺鑫农业	4,005,877.00	3.62
48	000858	五粮液	3,895,400.00	3.52
49	601098	中南传媒	3,893,176.08	3.51
50	601311	骆驼股份	3,822,782.88	3.45
51	300079	数码视讯	3,807,680.00	3.44
52	600066	宇通客车	3,782,300.00	3.41
53	600372	中航电子	3,630,384.95	3.28
54	002179	中航光电	3,627,807.00	3.27
55	002481	双塔食品	3,619,219.20	3.27
56	002229	鸿博股份	3,604,472.38	3.25
57	300335	迪森股份	3,586,895.00	3.24
58	600351	亚宝药业	3,558,000.00	3.21
59	300075	数字政通	3,543,435.03	3.20
60	600366	宁波韵升	3,518,537.60	3.18

英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年年度报告

61	002035	华帝股份	3,506,002.00	3.16
62	600048	保利地产	3,413,100.00	3.08
63	600804	鹏博士	3,397,160.00	3.07
64	600643	爱建股份	3,381,050.00	3.05
65	002396	星网锐捷	3,377,338.00	3.05
66	000851	高鸿股份	3,375,720.00	3.05
67	002139	拓邦股份	3,347,859.34	3.02
68	002111	威海广泰	3,325,168.40	3.00
69	600271	航天信息	3,287,642.00	2.97
70	000402	金融街	3,245,584.00	2.93
71	600686	金龙汽车	3,219,169.36	2.91
72	600016	民生银行	3,204,000.00	2.89
73	300026	红日药业	3,189,730.00	2.88
74	000961	中南建设	3,145,600.00	2.84
75	002390	信邦制药	3,138,010.88	2.83
76	600469	风神股份	3,080,042.67	2.78
77	002231	奥维通信	3,076,923.24	2.78
78	600019	宝钢股份	3,072,200.00	2.77
79	601989	中国重工	3,070,500.00	2.77
80	300070	碧水源	3,039,050.00	2.74
81	600138	中青旅	3,005,000.00	2.71
82	000002	万科A	2,987,300.00	2.70
83	300017	网宿科技	2,956,102.00	2.67
84	600557	康缘药业	2,934,291.65	2.65
85	000400	许继电气	2,896,864.58	2.61
86	600522	中天科技	2,870,928.35	2.59
87	002501	利源精制	2,857,889.00	2.58
88	002253	川大智胜	2,793,475.66	2.52
89	002376	新北洋	2,735,530.00	2.47
90	002465	海格通信	2,721,461.90	2.46

91	601555	东吴证券	2,682,154.01	2.42
92	300095	华伍股份	2,673,788.00	2.41
93	300208	恒顺电气	2,634,538.00	2.38
94	300287	飞利信	2,601,523.45	2.35
95	300072	三聚环保	2,600,000.00	2.35
96	601336	新华保险	2,584,000.00	2.33
97	002662	京威股份	2,562,894.00	2.31
98	000157	中联重科	2,510,974.10	2.27
99	600376	首开股份	2,468,187.06	2.23
100	002354	科冕木业	2,356,025.00	2.13
101	600021	上海电力	2,355,000.00	2.13
102	300045	华力创通	2,342,178.00	2.11
103	600201	金宇集团	2,340,713.34	2.11
104	002475	立讯精密	2,327,159.00	2.10
105	300271	华宇软件	2,323,150.00	2.10
106	000712	锦龙股份	2,314,171.05	2.09
107	000555	神州信息	2,298,937.51	2.08
108	601100	恒立油缸	2,296,550.00	2.07
109	300010	立思辰	2,284,548.00	2.06
110	300150	世纪瑞尔	2,268,880.00	2.05
111	300337	银邦股份	2,263,367.00	2.04

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000848	承德露露	13,123,143.30	11.85
2	002241	歌尔声学	11,606,539.51	10.48
3	600030	中信证券	9,105,169.00	8.22
4	600315	上海家化	8,985,325.50	8.11

英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年年度报告

5	000651	格力电器	8,664,490.87	7.82
6	000596	古井贡酒	8,011,410.62	7.23
7	002279	久其软件	7,766,710.00	7.01
8	000625	长安汽车	7,660,295.05	6.91
9	601601	中国太保	7,540,576.90	6.81
10	002065	东华软件	7,223,869.60	6.52
11	600519	贵州茅台	7,167,143.06	6.47
12	600837	海通证券	7,076,100.00	6.39
13	002410	广联达	6,962,308.54	6.28
14	600535	天士力	6,673,003.62	6.02
15	601628	中国人寿	6,341,995.00	5.72
16	601668	中国建筑	5,882,500.00	5.31
17	000623	吉林敖东	5,792,393.20	5.23
18	002023	海特高新	5,761,800.00	5.20
19	600594	益佰制药	5,608,000.00	5.06
20	600037	歌华有线	5,561,942.00	5.02
21	600153	建发股份	5,000,275.10	4.51
22	000069	华侨城A	4,961,951.16	4.48
23	600887	伊利股份	4,914,562.45	4.44
24	601318	中国平安	4,913,200.00	4.43
25	600118	中国卫星	4,749,310.00	4.29
26	300049	福瑞股份	4,576,636.50	4.13
27	002051	中工国际	4,515,002.44	4.08
28	601166	兴业银行	4,488,500.00	4.05
29	601633	长城汽车	4,450,236.40	4.02
30	600010	包钢股份	4,415,612.50	3.99
31	002665	首航节能	4,394,000.00	3.97
32	002303	美盈森	4,391,726.00	3.96
33	600276	恒瑞医药	4,338,468.54	3.92
34	600549	厦门钨业	4,326,773.35	3.91

英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年年度报告

35	300199	翰宇药业	4,310,530.00	3.89
36	600690	青岛海尔	4,198,780.00	3.79
37	000858	五粮液	4,099,910.00	3.70
38	600066	宇通客车	4,066,811.00	3.67
39	300075	数字政通	4,064,035.26	3.67
40	601311	骆驼股份	3,985,929.75	3.60
41	601098	中南传媒	3,982,156.21	3.59
42	002179	中航光电	3,977,485.90	3.59
43	600000	浦发银行	3,940,000.00	3.56
44	600643	爱建股份	3,757,800.00	3.39
45	600372	中航电子	3,711,185.81	3.35
46	002662	京威股份	3,662,758.00	3.31
47	601336	新华保险	3,640,200.00	3.29
48	002111	威海广泰	3,618,656.63	3.27
49	002035	华帝股份	3,601,449.00	3.25
50	002271	东风雨虹	3,571,450.00	3.22
51	600271	航天信息	3,554,761.92	3.21
52	300079	数码视讯	3,514,144.57	3.17
53	002139	拓邦股份	3,446,166.70	3.11
54	300157	恒泰艾普	3,397,490.02	3.07
55	002501	利源精制	3,392,896.82	3.06
56	600366	宁波韵升	3,377,585.08	3.05
57	600804	鹏博士	3,369,650.00	3.04
58	002231	奥维通信	3,313,974.20	2.99
59	000961	中南建设	3,298,650.69	2.98
60	601328	交通银行	3,287,636.00	2.97
61	600048	保利地产	3,270,100.00	2.95
62	600176	中国玻纤	3,268,133.85	2.95
63	002229	鸿博股份	3,266,077.06	2.95
64	002465	海格通信	3,244,858.15	2.93

英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年年度报告

65	000402	金融街	3,233,400.00	2.92
66	600016	民生银行	3,229,000.00	2.91
67	002390	信邦制药	3,216,222.80	2.90
68	600557	康缘药业	3,145,552.65	2.84
69	000851	高鸿股份	3,123,318.63	2.82
70	600469	风神股份	3,089,810.76	2.79
71	300026	红日药业	2,974,240.00	2.68
72	300335	迪森股份	2,929,000.00	2.64
73	601989	中国重工	2,925,000.00	2.64
74	600522	中天科技	2,896,383.70	2.61
75	000400	许继电气	2,890,805.50	2.61
76	600138	中青旅	2,856,000.00	2.58
77	300150	世纪瑞尔	2,767,420.00	2.50
78	002376	新北洋	2,744,424.00	2.48
79	002354	科冕木业	2,720,571.00	2.46
80	601555	东吴证券	2,707,200.00	2.44
81	300010	立思辰	2,647,997.50	2.39
82	300017	网宿科技	2,570,930.00	2.32
83	002253	川大智胜	2,548,578.68	2.30
84	600373	中文传媒	2,457,480.00	2.22
85	300208	恒顺电气	2,438,597.52	2.20
86	300045	华力创通	2,416,692.00	2.18
87	600201	金宇集团	2,406,767.81	2.17
88	300271	华宇软件	2,402,535.85	2.17
89	300287	飞利信	2,397,684.86	2.16
90	002690	美亚光电	2,390,050.28	2.16
91	000401	冀东水泥	2,381,700.00	2.15
92	000712	锦龙股份	2,366,450.00	2.14
93	600990	四创电子	2,332,701.00	2.11
94	600329	中新药业	2,306,863.02	2.08

95	600021	上海电力	2,252,413.83	2.03
96	300168	万达信息	2,225,684.00	2.01
97	600376	首开股份	2,220,180.06	2.00

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	654,628,423.69
卖出股票的收入（成交）总额	580,784,639.84

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告标志日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	161,625.60
2	应收证券清算款	5,385,545.32
3	应收股利	—
4	应收利息	3,745.53
5	应收申购款	42,608.69
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,593,525.14

8.12.4 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。

8.12.5 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不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
1,936	51,006.41	16,620,800.88	16.83%	82,127,602.11	83.17%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	323,188.41	0.33%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

9.4 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	10,772,797. 53	10.91%	10,000,0 00.00	10.13%	3年
基金管理人高级管 理人员	107,727.98	0.11%	100,000. 00	0.10%	3年
基金经理等人员	215,460.43	0.22%	200,000. 00	0.20%	3年
基金管理人股东	—	—	—	—	3年
其他	—	—	—	—	3年
合计	110,959,985 .94	112.37%	10,300,0 00.00	10.43%	3年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年3月5日)基金份额总额	161,922,767.08
本报告期期初基金份额总额	161,922,767.08
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	84,437,612.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	147,611,976.59
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	98,748,402.99

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2014年6月5日发布公告，张传良董事长自2014年6月3日起不再代理总经理职务，杨峰先生自2014年6月3日起担任英大基金管理有限公司总经理职务。相关变更事项已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

本报告期内，基金托管人于2014年5月5日发布公告，禄金山先生不再担任广发银行股份有限公司资产托管部总经理，任命寻卫国先生为广发银行股份有限公司资产托管部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为本基金审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用人民币60,000元。该审计机构从本基金成立即为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽核或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	317,722,928.06	25.73%	289,254.25	26.68%	0.2668
兴业证券	1	282,307,877.12	22.86%	236,457.20	21.81%	0.2181
中信证券	1	238,867,029.56	19.34%	217,464.64	20.06%	0.2006
宏源证券	1	198,816,309.15	16.10%	181,002.33	16.70%	0.167
方正证券	1	197,306,028.64	15.98%	159,897.14	14.75%	0.1475

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i:公司财务状况良好，经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii:有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iii:有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

②券商专用交易单元选择程序：

i:对交易单元候选券商的研究质量评价进行评估：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的行业研究的前瞻性、深度及广度进行评估，初步划定范围；

ii:对交易单元候选券商的研究服务进行评估：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和效果进行估，确定选用交易单元的券商。

iii:协议签署及通知托管人,本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本表"佣金"指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易合计支付该等券商的佣金合计。

④本基金交易单元均为新增交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
安信证券	—	—	103,500,000.00	7.76%	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	4,560,516.80	94.89%	1,230,400,000.00	92.24%	—	—
宏源证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	245,625.00	5.11%	—	—	—	—

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《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发售公告》、《英大领先回报混合型发起式证券投资基金合同摘要》、《英大领先回报混合型发起式证券投资基金合同》、《英大领先回报混合型发起式证券投资基金托管协议》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-01-17
2	英大基金管理有限公司关于增加中期时代基金销售(北京)有限公司为英大领先回报基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-01-23
3	英大基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为英大领先回报基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-01-23
4	英大基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为英	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、	2014-02-18

	大领先回报基金代销机构的公告	本公司网站	
5	英大基金0218管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为英大领先回报基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-02-18
6	英大基金管理有限公司关于增加深圳众禄基金销售有限公司为英大领先回报基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-02-19
7	英大领先回报混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-03-06
8	英大领先回报开放日常申购、赎回业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-04-16
9	英大领先回报混合型发起式证券投资基金开放定投及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-05-07
10	关于英大领先回报混合型发起式证券投资基金参与部分代销机构开展的定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-05-27
11	英大基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-06-07
12	英大领先回报混合型发起式证券投资基金半年度最后一个市场交易日净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-07-01
13	英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年第2季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-07-21
14	英大领先回报混合型发起式证券投资基金2014年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-08-27

15	英大领先回报混合型发起式证券投资基金招募说明书更新	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-10-20
16	英大领先回报混合型发起式证券投资基金第三季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、本公司网站	2014-10-25

§ 12 备查文件目录

12.1 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；
 报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

12.3 查阅方式

1.书面查阅：查阅时间为每工作日8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：<http://www.ydamc.com>

英大基金管理有限公司
 二〇一五年三月二十七日