

英大领先回报混合型发起式证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 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

送出日期：2016 年 8 月 25 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。本半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 2016 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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 主要财务指标和基金净值表现	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 其他指标.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 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.....	35
7.7 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.....	35
7.8 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.....	35
7.9 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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35

7.12 投资组合报告附注.....	36
§8 基金份额持有人信息.....	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
8.3 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的情况.....	37
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	37
§9 开放式基金份额变动.....	38
§10 重大事件揭示.....	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
10.2 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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	41
§12 备查文件目录.....	41
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点.....	41
12.3 查阅方式.....	41

§ 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	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
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	134,098,400.11份
基金合同存续期	不定期

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。

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	宗宽广	李春磊
	联系电话	010-59112066	010-65169830
	电子邮箱	zongkg@ydamc.com	lichunlei@cgbchina.com.cn
客户服务电话		400-890-5288	010-65169830
传真		010-85878087	010-65169555
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	广东省广州市越秀区东风东路713号
办公地址		北京市朝阳区东三环中路1	北京市东城区东长安街甲2号

	号环球金融中心西塔 22 楼 2201	
邮政编码	100020	510080
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、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ydamc.com
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,880,799.74
本期利润	-8,113,656.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0587
本期加权平均净值利润率	-8.65%
本期基金份额净值增长率	-7.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-39,786,397.34
期末可供分配基金份额利润	-0.2967
期末基金资产净值	94,312,002.77
期末基金份额净值	0.7033
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	20.01%

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

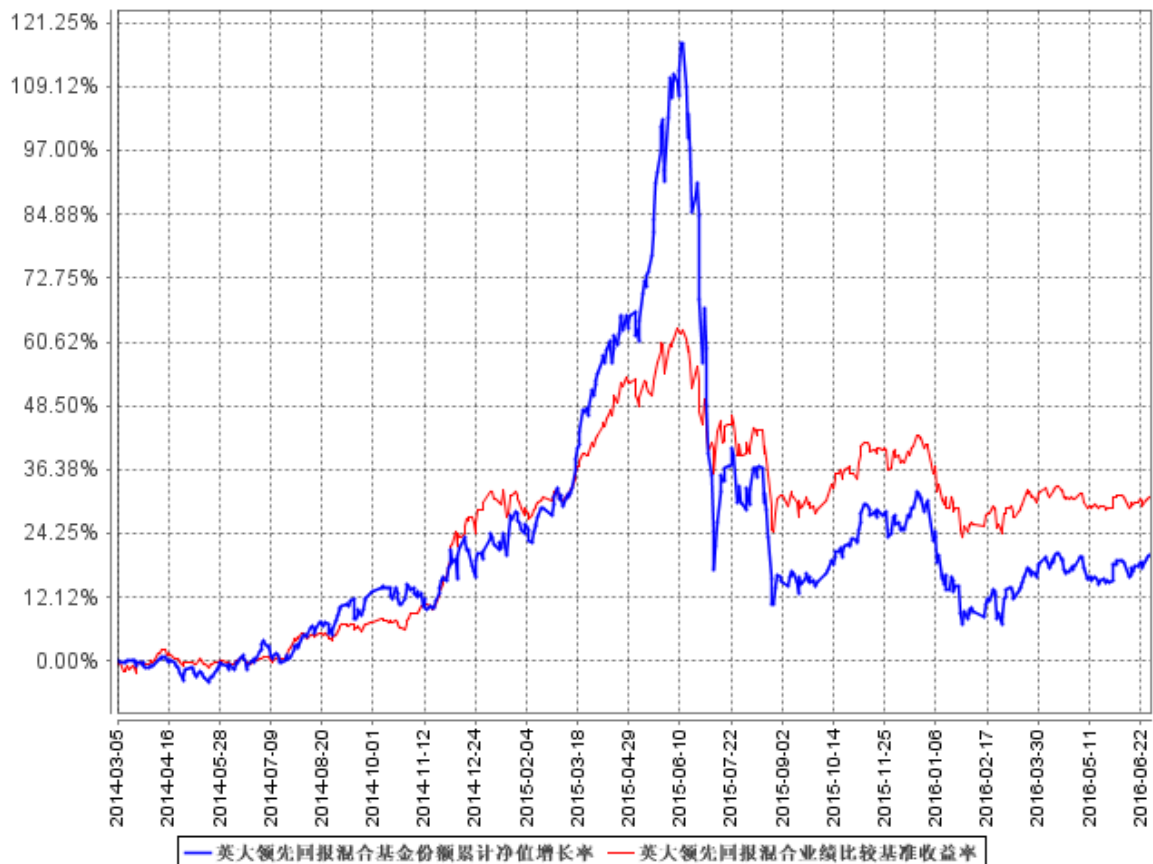
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.22%	0.73%	-0.07%	0.49%	1.29%	0.24%
过去三个月	1.37%	0.81%	-0.60%	0.50%	1.97%	0.31%
过去六个月	-7.46%	1.35%	-6.64%	0.92%	-0.82%	0.43%
过去一年	-28.21%	1.77%	-12.36%	1.15%	-15.85%	0.62%
自基金合同生效起至今	20.01%	1.63%	31.18%	0.99%	-11.17%	0.64%

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

英大领先回报混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

注：无。

§ 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5只开放式证券投资基金，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		
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。
周木林	本基金基金经理	2015年7月8日	-	4	曾任香港诚信资本、上海嘉量投资管理合伙企业量化研究员。2014年8月加入英大基金管理有限公司，曾任公司专户投资部金融工程师、投资经理。

注：①任职日期说明：基金经理的任职日期为基金经理经监管机构审核通过后公司公开披露的日期。

②证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的

相关规定。

③2016年7月27日，基金经理周木林离任；2016年7月29日，增聘基金经理刘杰。上述事项已按规定在中国证券投资基金业协会完成相关手续并进行披露。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

4.3.2 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

为回避市场估值水平高位回落的风险，基金经理在2015年末调整股票投资组合，以价值股为主要投资方向。虽然股票组合显示较好的抗跌性，但年初市场的快速下跌也使基金净值损失较大。在市场止跌回稳后，本基金及时提高股票仓位，积极操作，挽回了部分损失。在新股发行估值水平较低的情况下，本基金积极参与网下新股配售，新股配售正成为本基金获取增值资产的有效途径之一。基于我们一季度末“宏观经济企稳复苏给股票市场带来阶段性投资机会，汇率、利率、通胀率的波动会对短期股票市场形成扰动，以谨慎的心态关注全球和国内经济形势”的市场分析，本基金在二季度采取“价值与成长均衡配置的二级市场股票，从风险可控、收益可期两维度构建投资组合，获取投资收益；注重一级市场网下配售，尽可能获取低风险增值资产，有效提升基金

业绩”的投资策略。

2016年上半年，股票市场呈现“大幅下跌—震荡回升”的走势，沪深300指数下跌15.47%，基金单位净值跌幅为7.46%。从指数波动对应的本基金单位净值变化幅度分析，本基金具有较好的抗跌性，六月末股票投资比例为83.62%。

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1.3633，份额净值增长率为-7.46%，同期业绩比较基准收益率为-6.64%，基金表现落后业绩比较基准0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年的国内生产总值（GDP）增速有望保持在6.7%左右，上市公司整体业绩增速有限，股票市场估值水平偏高的现状难以通过业绩大幅增长得到改善，这决定股票市场在下半年难有连续性上涨的机会和空间。预计估值变化是决定下半年市场波动的核心因素，估值由利率和风险偏好决定，我们判断下半年利率可能震荡弱回升，而“调结构”和“稳增长”使风险偏好在低位震荡，因此对估值的综合影响是震荡回落，使市场进入调整格局。当前市场主要指数（上证50和沪深300）因估值偏低而难以大幅下跌，“国家队”维稳也使恐慌盘基本消失。但包括创业板、次新股在内的一大批小盘股和题材股的估值高企，不排除该类股票在半年报公布后有释放风险的要求。因此，区间震荡可能是市场合理的选择，也符合绝大多数投资者的预期。

股票投资策略：

本基金在下半年继续采取“价值与成长均衡配置的二级市场股票，从风险可控、收益可期两维度构建投资组合，获取投资收益；注重一级市场网下配售，尽可能获取低风险增值资产”的投资策略，有效提升基金净值。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期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。

4.8 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，不存在损害本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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	17,116,160.15	21,145,611.13
结算备付金		219,748.57	2,455,659.18
存出保证金		202,875.11	587,783.22
交易性金融资产	6.4.7.2	78,891,123.52	77,850,659.86
其中：股票投资		78,891,123.52	77,850,659.86
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	7,000,000.00
应收证券清算款		57,048.63	-
应收利息	6.4.7.5	3,579.84	8,750.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	146,692.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		96,490,535.82	109,195,156.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		354,180.99	229,238.10
应付赎回款		115,152.89	125,046.10
应付管理人报酬		115,201.75	136,894.78
应付托管费		19,200.31	22,815.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,335,634.29	1,868,389.46
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	239,162.82	60,265.25
负债合计		2,178,533.05	2,442,649.47
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	134,098,400.11	140,468,835.96
未分配利润	6.4.7.10	-39,786,397.34	-33,716,328.74
所有者权益合计		94,312,002.77	106,752,507.22
负债和所有者权益总计		96,490,535.82	109,195,156.69

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7033 元，基金份额总额 134,098,400.11 份。

6.2 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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-6,374,119.98	84,986,125.12
1.利息收入		93,157.67	241,402.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	86,016.65	125,343.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,141.02	116,058.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,249,751.67	78,719,329.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,977,141.09	77,868,563.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	727,389.42	850,766.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,232,857.21	4,693,123.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	15,331.23	1,332,269.32
减：二、费用		1,739,536.97	3,629,129.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	699,922.62	1,637,299.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	116,653.82	272,883.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	743,947.15	1,540,427.99
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	179,013.38	178,518.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,113,656.95	81,356,995.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,113,656.95	81,356,995.55

6.3 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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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)	140,468,835.96	-33,716,328.74	106,752,507.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,113,656.95	-8,113,656.95
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)	-6,370,435.85	2,043,588.35	-4,326,847.50
其中：1.基金申购款	7,004,063.56	-2,255,181.14	4,748,882.42
2.基金赎回款	-13,374,499.41	4,298,769.49	-9,075,729.92
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	134,098,400.11	-39,786,397.34	94,312,002.77
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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)	98,748,402.99	12,036,214.96	110,784,617.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	81,356,995.55	81,356,995.55
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)	83,971,637.45	-4,594,903.54	79,376,733.91
其中：1.基金申购款	353,058,786.62	87,449,231.18	440,508,017.80
2.基金赎回款	-269,087,149.17	-92,044,134.72	-361,131,283.89
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)	-	-92,524,258.88	-92,524,258.88

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	182,720,040.44	-3,725,951.91	178,994,088.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》(财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订)、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 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。

6.4.3 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况及 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 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。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报告所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

(1) 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开

开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债券利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定, 质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定, 买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

(2) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定, 对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入、储蓄存款利息收入, 由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定, 自 2008 年 10 月 9 日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	17, 116, 160. 15
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	17, 116, 160. 15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	81,859,207.69	78,891,123.52	-2,968,084.17
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	81,859,207.69	78,891,123.52	-2,968,084.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016年6月30日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末（2016年6月30日），本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2016年6月30日），本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	3,389.64
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	98.90
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	91.30
合计	3,579.84

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2016年6月30日）未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,335,634.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,335,634.29

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	149.44
预提费用	239,013.38
合计	239,162.82

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	140,468,835.96	140,468,835.96
本期申购	7,004,063.56	7,004,063.56
本期赎回(以“-”号填列)	-13,374,499.41	-13,374,499.41
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	134,098,400.11	134,098,400.11

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	-27,775,722.57	-5,940,606.17	-33,716,328.74
本期利润	-3,880,799.74	-4,232,857.21	-8,113,656.95
本期基金份额交易产生的变动数	1,565,172.28	478,416.07	2,043,588.35
其中：基金申购款	-1,579,311.88	-675,869.26	-2,255,181.14
基金赎回款	3,144,484.16	1,154,285.33	4,298,769.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-30,091,350.03	-9,695,047.31	-39,786,397.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	77,043.00
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,805.77
其他	3,167.88
合计	86,016.65

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	272,944,432.05
减：卖出股票成本总额	275,921,573.14
买卖股票差价收入	-2,977,141.09

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无贵金属投资收益赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无贵金属投资收益申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无衍生工具收益其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	727,389.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	727,389.42

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,232,857.21
——股票投资	-4,232,857.21
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-4,232,857.21

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	15,331.23
合计	15,331.23

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	743,947.15
银行间市场交易费用	-
合计	743,947.15

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12
合计	179,013.38

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	699,922.62	1,637,299.78
其中：支付销售机构的客户维护费	205,234.19	503,405.32

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	116,653.82	272,883.31

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 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	24,272,190.00	10,772,797.53
期间申购/买入总份额	-	-

期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	24,272,190.00	10,772,797.53
期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.1000%	5.8900%

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	17,116,160.15	77,043.00	30,335,241.70	112,193.47

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本期末及上年度末，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期本基金无利润分配事项。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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	备注
603016	新宏泰	2016年6月23日	-	新股流通受限	8.49	8.49	775	6,579.75	6,579.75	-
300520	科大国创	2016年6月30日	-	新股流通受限	10.05	10.05	624	6,271.20	6,271.20	-
002805	丰元	2016年6	-	新股流通	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

	股份	月 29 日		受限						
601966	玲珑 轮胎	2016 年 6 月 27 日	-	新股流通 受限	12.98	12.98	1,000	12,980.00	12,980.00	-

6.4.12.2 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（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
000651	格力 电器	2016年 2月22 日	临时 停牌	19.22	-	-	357,300	7,749,782.29	6,867,306.00	-
000728	国元 证券	2016年 6月8 日	临时 停牌	16.72	-	-	74,329	1,389,599.24	1,242,780.88	-
000415	渤海 租赁	2016年 2月1 日	临时 停牌	6.82	-	-	147,452	1,198,449.96	1,005,622.64	-
600166	福田 汽车	2016年 6月30 日	临时 停牌	5.52	-	-	89,700	533,698.29	495,144.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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的。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	17,116,160.15	-	-	-	-	-	17,116,160.15
结算备付金	219,748.57	-	-	-	-	-	219,748.57
存出保证金	202,875.11	-	-	-	-	-	202,875.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	78,891,123.52	78,891,123.52
应收证券清算款	-	-	-	-	-	57,048.63	57,048.63
应收利息	-	-	-	-	-	3,579.84	3,579.84
资产总计	17,538,783.83	-	-	-	-	78,951,751.99	96,490,535.82
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	354,180.99	354,180.99
应付赎回款	-	-	-	-	-	115,152.89	115,152.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	115,201.75	115,201.75
应付托管费	-	-	-	-	-	19,200.31	19,200.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,335,634.29	1,335,634.29
其他负债	-	-	-	-	-	239,162.82	239,162.82
负债总计	-	-	-	-	-	2,178,533.05	2,178,533.05
利率敏感度缺口	17,538,783.83	-	-	-	-	76,773,218.94	94,312,002.77
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	1年以内	不计息	合计		
资产							
银行存款	21,145,611.13	-	-	-	-	-	21,145,611.13
结算备付金	2,455,659.18	-	-	-	-	-	2,455,659.18
存出保证金	587,783.22	-	-	-	-	-	587,783.22
交易性金融资产	-	-	-	-	-	77,850,659.86	77,850,659.86
买入返售金融资产	7,000,000.00	-	-	-	-	-	7,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	8,750.67	8,750.67
应收申购款	-	-	-	-	-	146,692.63	146,692.63
资产总计	31,189,053.53	-	-	-	-	78,006,103.16	109,195,156.69
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	229,238.10	229,238.10
应付赎回款	-	-	-	-	-	125,046.10	125,046.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	136,894.78	136,894.78
应付托管费	-	-	-	-	-	22,815.78	22,815.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,868,389.46	1,868,389.46
其他负债	-	-	-	-	-	60,265.25	60,265.25
负债总计	-	-	-	-	-	2,442,649.47	2,442,649.47
利率敏感度缺口	31,189,053.53	-	-	-	-	75,563,453.69	106,752,507.22

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金不持有债券，现金资产以活期利率计息。因此，本年度和上年度利率变动对本基金资产净值无影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	78,891,123.52	83.65	77,850,659.86	72.93
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	78,891,123.52	83.65	77,850,659.86	72.93

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	6,548,040.74	8,011,960.72
业绩比较基准下降 5%	-6,548,040.74	-8,011,960.72	

6.4.14 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	78,891,123.52	81.76
	其中：股票	78,891,123.52	81.76
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	17,335,908.72	17.97
7	其他各项资产	263,503.58	0.27
8	合计	96,490,535.82	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,307,941.58	1.39
C	制造业	33,409,559.51	35.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,879,505.00	5.17
E	建筑业	1,428,744.72	1.51
F	批发和零售业	751,941.49	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	1,477,980.00	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,117,926.35	3.31
J	金融业	25,800,432.48	27.36

K	房地产业	2,270,499.00	2.41
L	租赁和商务服务业	1,005,622.64	1.07
M	科学研究和技术服务业	11,947.00	0.01
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	3,429,023.75	3.64
S	综合	-	-
	合计	78,891,123.52	83.65

7.3 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	000651	格力电器	357,300	6,867,306.00	7.28
2	600015	华夏银行	600,000	5,934,000.00	6.29
3	000063	中兴通讯	400,000	5,736,000.00	6.08
4	601166	兴业银行	350,000	5,334,000.00	5.66
5	002202	金风科技	300,000	4,539,000.00	4.81
6	600104	上汽集团	220,000	4,463,800.00	4.73
7	000966	长源电力	500,000	3,250,000.00	3.45
8	601328	交通银行	349,300	1,966,559.00	2.09
9	601818	光大银行	518,800	1,950,688.00	2.07
10	601288	农业银行	608,000	1,945,600.00	2.06
11	601988	中国银行	572,200	1,836,762.00	1.95
12	000686	东北证券	116,760	1,507,371.60	1.60
13	601333	广深铁路	378,000	1,477,980.00	1.57
14	300508	维宏股份	5,721	1,455,994.50	1.54
15	002736	国信证券	83,800	1,445,550.00	1.53
16	601901	方正证券	173,800	1,331,308.00	1.41
17	000750	国海证券	176,700	1,305,813.00	1.38
18	000728	国元证券	74,329	1,242,780.88	1.32
19	002792	通宇通讯	20,698	1,237,740.40	1.31
20	000719	大地传媒	100,000	1,056,000.00	1.12
21	600383	金地集团	99,800	1,033,928.00	1.10

22	000415	渤海租赁	147,452	1,005,622.64	1.07
23	000540	中天城投	161,300	1,004,899.00	1.07
24	000157	中联重科	231,400	955,682.00	1.01
25	002791	坚朗五金	16,002	860,427.54	0.91
26	600757	长江传媒	100,000	839,000.00	0.89
27	600157	永泰能源	203,739	802,731.66	0.85
28	601600	中国铝业	209,900	791,323.00	0.84
29	600887	伊利股份	43,500	725,145.00	0.77
30	600068	XD 葛洲坝	123,300	717,606.00	0.76
31	601669	中国电建	114,940	656,307.40	0.70
32	600600	青岛啤酒	22,100	642,447.00	0.68
33	600050	XD 中国联	158,000	601,980.00	0.64
34	600718	东软集团	32,700	599,064.00	0.64
35	600642	申能股份	98,200	563,668.00	0.60
36	002236	大华股份	42,505	556,815.50	0.59
37	600023	浙能电力	106,800	543,612.00	0.58
38	000793	华闻传媒	54,000	533,520.00	0.57
39	600373	中文传媒	25,525	529,643.75	0.56
40	600027	华电国际	105,500	522,225.00	0.55
41	600028	中国石化	107,036	505,209.92	0.54
42	600066	宇通客车	25,200	498,960.00	0.53
43	600166	福田汽车	89,700	495,144.00	0.53
44	601231	环旭电子	45,775	489,792.50	0.52
45	600315	上海家化	16,600	478,744.00	0.51
46	601098	中南传媒	26,000	470,860.00	0.50
47	600660	福耀玻璃	32,800	459,200.00	0.49
48	000917	电广传媒	26,400	436,392.00	0.46
49	600038	中直股份	10,500	435,540.00	0.46
50	000738	中航动控	15,576	411,206.40	0.44
51	600332	白云山	15,600	384,384.00	0.41
52	601607	上海医药	20,900	377,245.00	0.40
53	600998	九州通	21,399	374,696.49	0.40
54	000999	华润三九	15,400	372,988.00	0.40
55	002294	信立泰	12,605	342,856.00	0.36
56	000623	吉林敖东	13,600	339,320.00	0.36
57	600089	特变电工	39,300	334,836.00	0.36
58	601179	中国西电	63,678	322,847.46	0.34
59	300146	汤臣倍健	19,054	257,991.16	0.27
60	600177	雅戈尔	16,800	231,672.00	0.25

61	000876	新希望	25,600	212,992.00	0.23
62	601611	中国核建	2,621	54,831.32	0.06
63	603131	上海沪工	758	46,010.60	0.05
64	300515	三德科技	966	45,276.42	0.05
65	002799	环球印务	864	37,704.96	0.04
66	601127	小康股份	1,346	32,129.02	0.03
67	300518	盛讯达	389	18,224.65	0.02
68	601966	玲珑轮胎	1,000	12,980.00	0.01
69	603909	合诚股份	650	11,947.00	0.01
70	603958	哈森股份	742	10,759.00	0.01
71	603016	新宏泰	775	6,579.75	0.01
72	300520	科大国创	624	6,271.20	0.01
73	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	26,926,638.82	25.22
2	000333	美的集团	23,212,139.04	21.74
3	000966	长源电力	22,625,862.17	21.19
4	601166	兴业银行	21,085,900.00	19.75
5	002202	金风科技	20,071,143.68	18.80
6	000623	吉林敖东	19,071,306.32	17.86
7	600104	上汽集团	17,790,534.21	16.67
8	000581	威孚高科	10,103,559.50	9.46
9	600004	白云机场	8,384,069.00	7.85
10	000651	格力电器	7,775,874.00	7.28
11	000039	中集集团	7,415,600.00	6.95
12	601211	国泰君安	7,291,300.00	6.83
13	000625	长安汽车	4,691,500.00	4.39
14	601328	交通银行	3,741,828.00	3.51
15	000858	五粮液	3,617,854.00	3.39
16	000776	广发证券	3,203,052.00	3.00
17	601009	南京银行	3,163,500.00	2.96

18	600177	雅戈尔	3,082,657.00	2.89
19	002304	洋河股份	2,981,730.00	2.79
20	000063	中兴通讯	2,739,213.00	2.57
21	002736	国信证券	2,586,270.00	2.42
22	601288	农业银行	2,238,770.00	2.10

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	27,324,057.21	25.60
2	000333	美的集团	24,632,026.85	23.07
3	601166	兴业银行	20,225,300.00	18.95
4	000966	长源电力	19,625,099.00	18.38
5	000623	吉林敖东	18,686,671.70	17.50
6	002202	金风科技	16,438,134.21	15.40
7	600104	上汽集团	13,650,699.53	12.79
8	000581	威孚高科	9,999,805.35	9.37
9	600004	白云机场	9,656,715.00	9.05
10	601398	工商银行	8,172,523.00	7.66
11	601211	国泰君安	7,232,370.00	6.77
12	000039	中集集团	6,892,345.00	6.46
13	600823	世茂股份	5,183,000.00	4.86
14	000001	平安银行	5,049,000.00	4.73
15	000776	广发证券	4,513,463.00	4.23
16	000625	长安汽车	4,256,000.00	3.99
17	000858	五粮液	4,195,341.18	3.93
18	000543	皖能电力	3,440,156.00	3.22
19	601009	南京银行	3,220,000.00	3.02
20	002304	洋河股份	3,031,000.00	2.84
21	600177	雅戈尔	2,922,814.00	2.74
22	601328	交通银行	2,842,784.00	2.66
23	000063	中兴通讯	2,247,891.00	2.11

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	281,194,894.01
卖出股票收入（成交）总额	272,944,432.05

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	202,875.11
2	应收证券清算款	57,048.63
3	应收股利	-
4	应收利息	3,579.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	263,503.58

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000651	格力电器	6,867,306.00	7.28	临时停牌

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
2,700	49,666.07	24,272,190.00	18.10%	109,826,210.11	81.90%

8.2 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	430,400.78	0.3210%

8.3 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的情况

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	0

8.4 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	24,272,190.00	18.10	10,000,000.00	7.45	3年
基金管理人高级管 理人员	107,727.98	0.08	100,000.00	0.07	3年
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	3年
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	3年
其他	215,460.43	0.16	200,004.16	0.14	3年
合计	24,595,378.41	18.34	10,300,004.16	7.68	3年

§ 9 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	140,468,835.96
本报告期基金总申购份额	7,004,063.56
减：本报告期基金总赎回份额	13,374,499.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	134,098,400.11

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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2016年3月17日发布公告，宗宽广先生自2016年3月16日起担任英大基金管理有限公司督察长，副总经理赵照先生自2016年3月16日起不再代任督察长职务。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，寻卫国先生不再担任基金托管人资产托管部总经理职务，蒋柯先生临时主持部门工作。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会报告。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 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查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	1	259,534,934.19	46.95%	189,798.93	44.98%	-
方正证券	1	177,374,752.52	32.09%	147,451.84	34.94%	-
天风证券	2	115,850,324.72	20.96%	84,721.55	20.08%	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

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服务效果进行估，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。

10.7.2 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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	-	-	34,000,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	英大基金关于旗下基金 2015 年年度最后一个市场交易日资产净值的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 1 月 1 日
2	英大基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所指数发生不可恢复熔断的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
3	英大基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 1 月 7 日
4	英大领先回报混合型发起式证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	三大报、公司网站	2016 年 1 月 22 日
5	英大基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 3 月 17 日
6	英大领先回报混合型发起式证券投资基金 2015 年年度报告及摘	三大报、公司网站	2016 年 3 月 30 日

	要		
7	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及摘要	三大报、公司网站	2016年4月20日
8	英大领先回报混合型发起式证券投资基金2016年第1季度报告	三大报、公司网站	2016年4月21日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 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, 13:00-17:00。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
2016年8月25日