

# 英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 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：2016 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 2016 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 2016 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	623,006,391.68 份	
投资目标	本基金通过把握宏观经济转折点，灵活配置权益类资产和固定收益类资产，并在严格控制下行风险的基础上，力争实现基金资产较高的长期稳健回报。	
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、固定收益品种投资策略；4、股指期货投资策略；5、权证投资策略。	
业绩比较基准	1 年期银行定期存款利率（税后）+2%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
下属分级基金的交易代码	001270	001271
报告期末下属分级基金的份额总额	503,586,937.96 份	119,419,453.72 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016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	7,156,446.27	6,109,823.66
2. 本期利润	4,429,862.82	5,076,535.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0104
4. 期末基金资产净值	528,848,456.09	124,702,581.59
5. 期末基金份额净值	1.0502	1.0442

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

###### 英大灵活配置 A

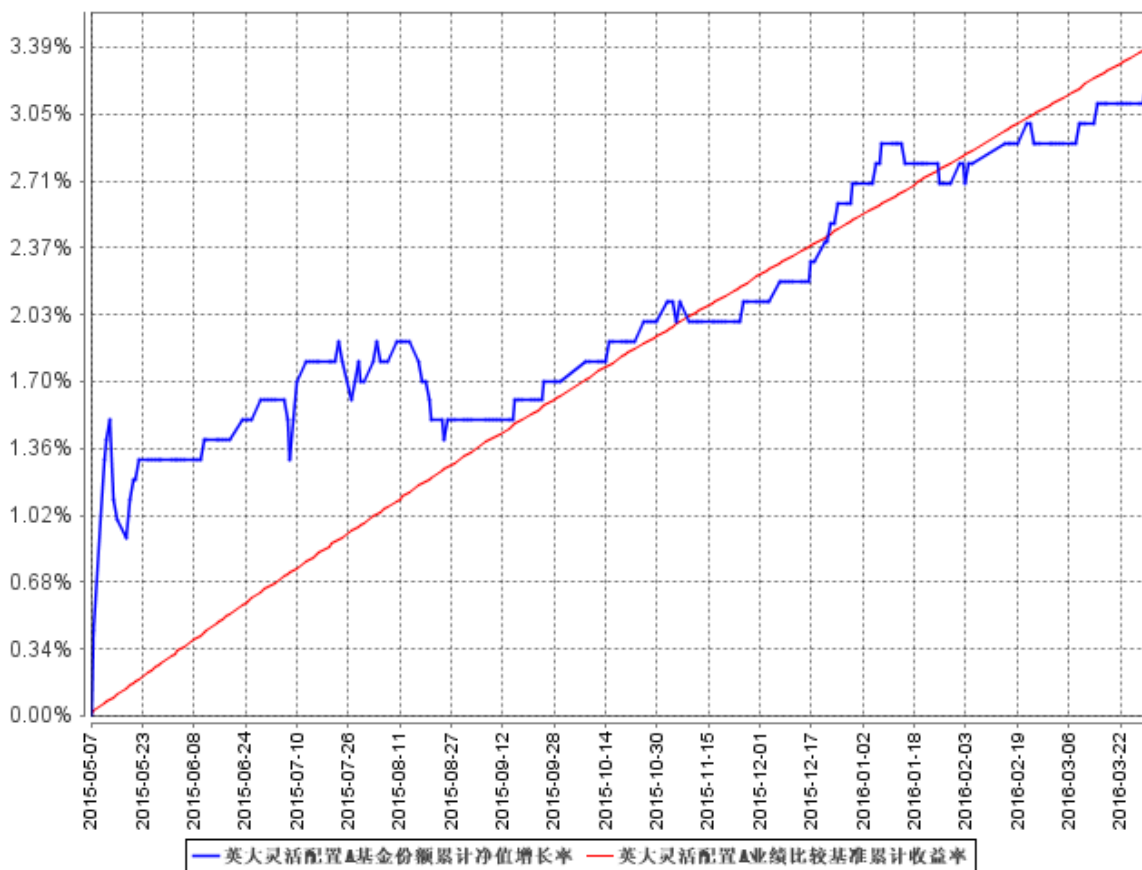
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.88%	0.07%	0.85%	0.01%	0.03%	0.06%

###### 英大灵活配置 B

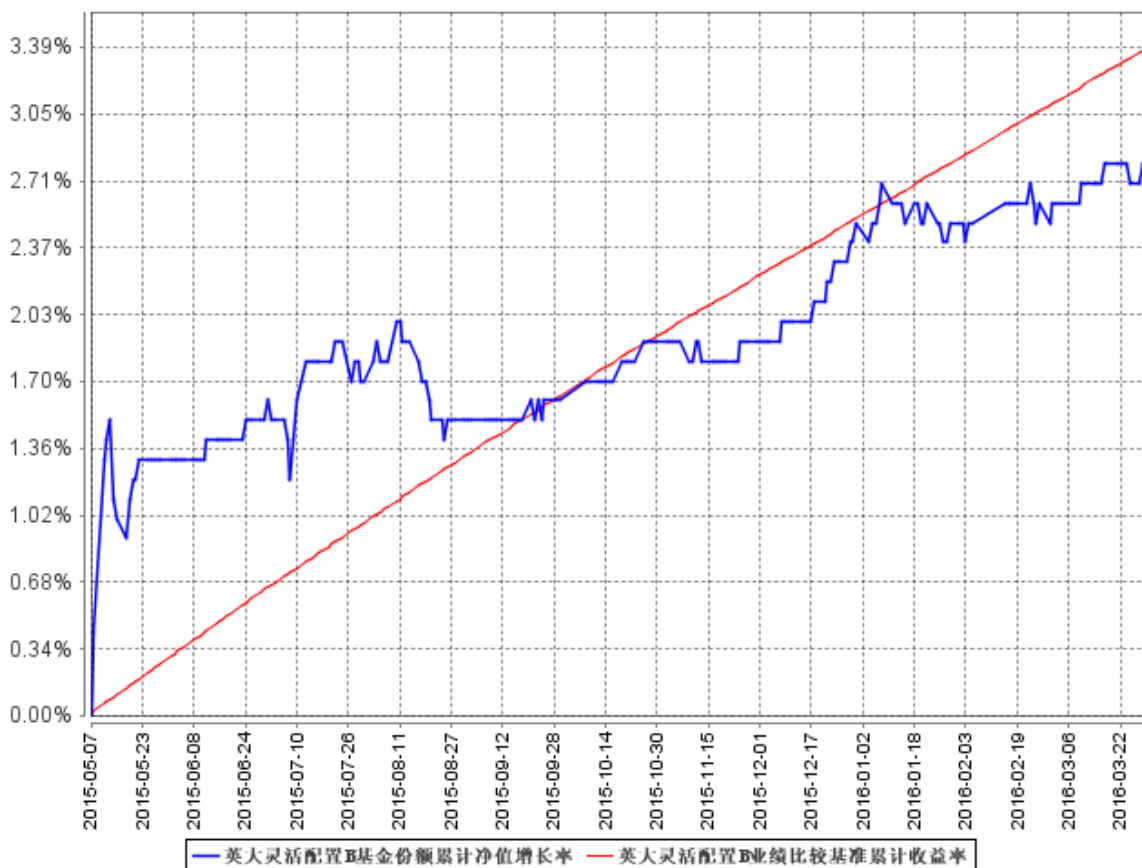
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.69%	0.07%	0.85%	0.01%	-0.16%	0.06%

### 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

英大灵活配置A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



英大灵活配置B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



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁忠伟	本基金基金经理	2015年5月7日	-	15	曾任中国民族证券证券投资部总经理助理、执行总经理；华西证券股份有限公司资产管理总部研究总监。2015年1月加入英大基金管理有限公司，曾任研究发展部副总经理，现任权益投资部总经理。
张琳娜	本基金基金经理	2015年7月15日	-	9	对外经济贸易大学金融学硕士，9年基金从业经历。先后任益民基金管理有限公司集中交易部交易员、副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限

					公司，曾任公司交易管理部副总经理（主持工作），现任固定收益部总经理。
--	--	--	--	--	------------------------------------

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过公司新上线的公平交易系统监测和人工复核等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

### 1、整体资产配置

为持有人持续实现正收益是本基金投资运作的目标，在股票市场整体估值水平偏高、上市公司整体业绩增速放缓的背景下，本基金坚持以债券投资为主，坚持严格控制股票投资比例。三季度，股票投资占净资产的比例在 4.1%~7.3% 波动，以积极有效的仓位调控应对市场的区间震荡；债券和现金占净资产的比例在 95.9%~92.7% 波动，为基金净值稳步提升打下坚实的基础。

### 2、股票投资

本基金继续采取“以价值股为主要投资方向，仓位控制坚持高减低增、灵活调控”的投资策略，所持有的二级市场股票组合涨幅较大；积极参与网下新股配售，获配新股市值 143 万元。三季度，股票投资整体盈利数百万元。

### 3、债券投资

2016 年三季度从数据来看宏观经济整体运行平稳、债券市场超长端品种收益率大幅下行，利率品种收益率曲线平坦化；同时，前期信用违约事件风波暂时平缓后，中低评级品种整体收益率曲线修复，信用利差收窄。本基金三季度整体保持适度的账户久期，积极参与利率品种波段操作，既获得了前期信用利差修复带来的收益，又较好的把握波段操作带来的收益，全年来看收益可观。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，英大灵活配置 A 类基金累计份额净值为 1.0502 元，报告期基金份额净值增长率为 0.88%；英大灵活配置 B 类基金累计份额净值为 1.0442 元，报告期基金份额净值增长率为 0.69%；同期业绩比较基准增长率为 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

本基金为发起式基金，自本基金合同生效之日起至报告期末本基金合同生效未满三年，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，基金管理人不对本基金持有人数及基金资产净值进行监控。

## §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	53,434,761.99	8.16
	其中：股票	53,434,761.99	8.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	533,786,000.00	81.49
	其中：债券	533,786,000.00	81.49
	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	54,400,601.60	8.30
	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	3,474,553.16	0.53
8	其他资产	9,963,355.10	1.52
9	合计	655,059,271.85	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	-	-
C	制造业	34,293,987.22	5.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,529,266.53	1.15
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,469,194.50	0.22
J	金融业	10,142,313.74	1.55
K	房地产业	-	-
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	53,434,761.99	8.18

### 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	600015	华夏银行	1,000,000	10,050,000.00	1.54
2	000651	格力电器	400,000	8,888,000.00	1.36
3	002781	奇信股份	204,545	7,504,756.05	1.15
4	002792	通宇通讯	116,431	6,017,154.08	0.92
5	002791	坚朗五金	121,285	5,935,687.90	0.91
6	000063	中兴通讯	400,000	5,912,000.00	0.90
7	300488	恒锋工具	71,341	5,143,686.10	0.79
8	002202	金风科技	150,000	2,352,000.00	0.36
9	300508	维宏股份	10,383	1,469,194.50	0.22
10	600908	无锡银行	8,902	92,313.74	0.01



**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	191,341,000.00	29.28
	其中：政策性金融债	191,341,000.00	29.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	311,735,000.00	47.70
6	中期票据	30,710,000.00	4.70
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	533,786,000.00	81.67

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150223	15 国开 23	600,000	60,228,000.00	9.22
2	150417	15 农发 17	500,000	50,450,000.00	7.72
3	041662004	16 鲁宏桥 CP002	500,000	50,295,000.00	7.70
4	011699190	16 天士力 SCP002	500,000	50,220,000.00	7.68
5	011699247	16 国电 SCP002	500,000	50,150,000.00	7.67

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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

### 5.11.2

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

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	37,164.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,926,190.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,963,355.10

### 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	002781	奇信股份	7,504,756.05	1.15	新股锁定
2	002791	坚朗五金	5,935,687.90	0.91	新股锁定
3	300488	恒锋工具	5,143,686.10	0.79	临时停牌
4	002792	通宇通讯	4,011,453.28	0.61	新股锁定
5	300508	维宏股份	1,469,194.50	0.22	新股锁定
6	600908	无锡银行	92,313.74	0.01	新股锁定

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
报告期期初基金份额总额	503,588,857.27	589,904,165.77
报告期期间基金总申购份额	1,910.13	-
减：报告期期间基金总赎回份额	3,829.44	470,484,712.05
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	503,586,937.96	119,419,453.72

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

英大灵活配置 A

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,450.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,450.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	1.61

英大灵活配置 B

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00

报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.00

注：本报告期末基金管理人未持有本基金份额

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	英大直销	-	9,999,450.00	10,000,000.00	-
合计			9,999,450.00	10,000,000.00	

## §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	9,999,450.00	1.61	9,999,450.00	1.61	3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	3 年
基金经理等人员	1,100.04	0.00	1,100.04	0.00	3 年
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	3 年
其他	4,960.32	0.00	4,960.32	0.00	3 年
合计	10,005,510.36	1.61	10,005,510.36	1.61	3 年

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

中国证监会批准英大灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

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

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

英大基金管理有限公司  
2016 年 10 月 26 日