英大领先回报混合型发起式证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月22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2015年4月20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2015年1月1日起3月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	189,416,604.64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 (2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	17,903,306.04
2.本期利润	50,473,428.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.2719
4.期末基金资产净值	241,225,645.86
5.期末基金份额净值	1.2735

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投资收益、利息收入、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	24.50%	1.29%	8.17%	0.91%	16.33%	0.38%

注:本基金基金合同生效日为2014年3月5日。报告期内,本基金的投资运作严格按照法律法规和基金合同的约定执行。

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

注:本基金基金合同生效日为2014年3月5日,图示日期为2014年3月5日至2015年3月31日。

§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		
秦岭	权益投资部副总经理,本基金基金经理	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权益投资部副总经理。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,本基金基金经理	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,现任英大基金管理有限公司权益投资部基金经理。具备17年金融业从业经历,其中12年基金行业从业经历。历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

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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年一季度,中国经济继续筑底,但是证券市场却如火如荼,出现了较大的涨幅。在投资上我们主要沿着中国未来转型和改革的发展方向进行布局,一方面加大了新兴产业的投资力度,重点布局了互联网、新能源、环保等战略新兴产业,以分享中国未来成长的收益;另一方面,我们继续持有部分低估值的金融蓝筹和国企改革的标的,分享中国未来制度改革带来的红利。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,领先回报基金累计份额净值为1.4535元。报告期内,基金份额净值增长率为24.50%,同期业绩比较基准增长率为8.17%。

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。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对2015年的市场走势继续保持积极乐观的态度,主要是政府的改革力度加快,结构转型取得一定成效,增强了投资者对中国未来长期发展的信心。我们已经清晰感受到政府与时俱进,为我们顶确勾勒出未来的发展方向,中国未来必将沿着转型与改革的道路前进。国务院总理李克强在政府工作报告中三次提及了互联网发展,并且提出要制定"互联网+"行动计划。我们认为,互联网无时无刻不改变这个世界,我们也无时无刻不随人其中,这是历史发展的必然趋势,也为投资上提供了难得的历史机遇。另外,在两会上财政部提出2015年将有1万亿地方存量债务被置换为地方政府债。这将一方面大大减少地方政府融资平台进约的风险,从而减少银行的坏账风险,提升银行股的估值水平,带动指数的上涨;另一方面,该措施将减少融资平台的资金饥渴,从而降低信托、银行等渠道发行融资产品的收益率水平,促使资金市场无风险利率下降,从而带动大量的存量资金入市,提升二级市场的估值水平。下一步我们继续看好互联网等相关板块的投资机遇,也会围绕着改革进行布局。国企改革、金融体制改革、加大环保、民生领域的投资力度,都为我们提供了非常好的投资机会。

§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	216,777,512.56	86.14
	其中:股票	216,777,512.56	86.14
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	-	-
	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	32,807,553.02	13.04
8	其他资产	2,085,353.56	0.83
9	合计	251,670,419.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	10,315,802.98	4.28
C	制造业	117,775,064.38	48.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	22,404,307.20	9.29
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,268,409.20	2.18
H	住宿和餐饮业	9,134,083.46	3.79
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,256,600.00	10.47
J	金融业	24,057,809.34	9.97
K	房地产业	2,565,436.00	1.06
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	216,777,512.56	89.87

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	600549	厦门钨业	290,000	11,086,700.00	4.60
2	601318	中国平安	140,000	10,953,600.00	4.54
3	600048	保利地产	939,966	10,800,209.34	4.48
4	000758	中色股份	509,926	10,315,802.98	4.28
5	002236	大华股份	280,000	10,234,000.00	4.24
6	000002	万科A	680,000	9,397,600.00	3.90
7	000039	中集集团	400,000	9,068,000.00	3.76
8	000623	吉林敖东	240,000	8,793,600.00	3.65
9	000550	江铃汽车	199,874	8,590,584.52	3.56
10	601028	玉龙股份	350,000	8,337,000.00	3.46

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拟益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未持有股指期货。
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拟益明细
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末无国债期货投资。
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

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	266,883.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,284.52
5	应收申购款	1,812,185.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,085,353.56

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末无可转换债券投资。
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	98,748,402.99
报告期期间基金总申购份额	217,321,791.48
减:报告期期间基金总赎回份额	126,653,589.83
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	189,416,604.64

§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	10,772,797.53
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,772,797.53
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.69

注:本期基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§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	10,772,797.53	5.69%	10,000,000.00	5.28%	3年
基金管理人高级管理人员	107,727.98	0.06%	100,000.00	0.05%	3年
基金经理等人员	215,460.43	0.11%	200,004.16	0.11%	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	3年
其他	-	-	-	-	3年
合计	11,095,985.94	5.86%	10,300,004.16	5.44%	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领先回报混合型发起式证券投资基金设立的文件
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
二〇一五年四月二十二日

英大现金宝货币市场基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年04月22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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月20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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大现金宝货币
基金主代码	000912
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月10日
报告期末基金份额总额	152,066,082.19
投资目标	力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金投资策略将结合现金需求安排和货币市场利率预测,在保证基金资产安全性和流动性的基础上,获取较高的收益。
业绩比较基准	同期7天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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 (2015年01月01日-2015年03月31日)
1.本期已实现收益	1,542,286.87
2.本期利润	1,542,286.87
3.期末基金资产净值	152,066,082.19

注:(1)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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
(2)本基金无持有人认购\申购或交易基金的各项费用。
(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9810%	0.0008%	0.3329%	0.0000%	0.6481%	0.0008%

注:本基金成立于2014年12月10日,业绩比较基准是同期七天通知存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金成立于2014年12月10日。报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§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		
张琳娜	本基金基金经理	2014年12月10日		9	对外经济贸易大学金融学硕士,9年基金从业经历。先后任诺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),现任固定收益部副总经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《英大现金宝货币市场基金基金合同》、《英大现金宝货币市场基金招募说明书》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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年一季度债市收益率先抑后扬,10年国债季度末比季度初下行4BP,一年期存款利率下调25BP至2.5%,存款准备金率下调50个基点至19.5%,央行通过逐步下调7天逆回购利率引导资金价格下行,全季度看并未使资金面宽松,但资金价格确实有所下降。
本基金在一季度增持短融,并通过存款和逆回购的组合控制流动性风险,组合收益较为稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金本报告期的份额净值收益率为0.981%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

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。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2月工业增加值同比6.8%创新低,制造业投资增长10.6%,回落2.9个百分点,房地产投资增长10.4%,回落0.1个百分点;一季度央行降息一次,降准一次,季度末三部委联合下发房地产税收、二套房放松政策,种种迹象表明宏观经济仍处在下行通道中,本着"经济不起政策不断"的原则,后续相关刺激政策仍旧值得期待。但随着IPO、股市等高风险资产的收益提升,除直接分流债市资金外,市场风险偏好也将被逐步推升,本基金将持续关注一级市场和央行的后续操作,保持适度的组合久期,在流动性风险可控的前提下,力争为持有人持续实现理想的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	50,037,406.03	32.44
	其中:债券	50,037,406.03	32.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	21,900,001.10	14.20
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	78,977,006.22	51.20
4	其他资产	3,326,528.33	2.16
5	合计	154,240,941.68	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目		占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		-
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	61
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	62
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	72.92	1.32
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	6.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	6.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	13.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.25	1.32

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,001,242.86	13.15
	其中:政策性金融债	10,002,043.85	6.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,036,163.17	19.75
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	50,037,406.03	32.91
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	041460066	14两面针CP001	100,000	10,039,861.55	6.60
2	140429	14农发29	100,000	10,002,043.85	6.58
3	071538001	15湘财证券CP001	100,000	9,999,199.01	6.58
4	041558009	15圣农CP001	100,000	9,997,449.30	6.57
5	041554013	15三期CP001	50,000	5,000,575.19	3.29
6	041559014	15开元旅业CP001	50,000	4,998,277.13	3.29

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0444%
报告期内偏离度的最低值	-0.0023%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0184%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。
5.8.2 本报告期内,本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。
5.8.3 本期内未发现本基金投资的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、处罚的情况。
5.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,011,733.54
3	应收利息	1,237,657.05
4	应收申购款	77,137.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,326,528.33

5.8.6 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	256,264,852.00
报告期期间基金总申购份额	144,313,750.79
减:报告期基金总赎回份额	248,512,520.60
报告期期末基金份额总额	152,066,082.19

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
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
无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准英大现金宝货币市场基金设立的文件
《英大现金宝货币市场基金基金合同》
《英大现金宝货币市场基金托管协议》
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
二〇一五年四月二十二日

融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月16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2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通健康产业灵活配置混合
交易代码	000727
前端交易代码	000727
后端交易代码	000731
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月25日
报告期末基金份额总额	628,995,800.99份
投资目标	通过主要投资于健康产业的优质上市公司,同时通过合理的动态资产配置,在合理控制投资风险的基础上,获取基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的长期收益。
投资策略	通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,规避系统性风险。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数收益率×70%+中债综合(全价)指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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 (2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	93,226,748.62
2.本期利润	162,910,136.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.1822
4.期末基金资产净值	763,076,528.82
5.期末基金份额净值	1.213

注:1、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损益。
2、本报告所列示的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。

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	20.46%	0.87%	23.78%	0.89%	-3.32%	-0.02%

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

注:1、本基金合同生效日为2014年12月25日。
2.本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月。截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

§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		
蒋秀蕾	本基金、融通医疗保健股票的基金经理	2014-12-25	-	8	药物化学硕士学位,具有基金从业资格。2006年8月起,先后担任御生医药(深圳)有限公司产品经理、招商证券研发中心研究员、嘉联融丰投资有限公司投资经理。2009年2月加入融通基金管理有限公司,先后担任研究策划部行业研究员、行业组长。

注:任职日期指根据基金管理人对外披露的任职日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第一季度,以互联网为代表的新经济模式持续走热,转型成为1季度社会经济的最热词,市场流动性尚好,反映市场对于中国经济新一轮转型的充分认可。医药行业走势和创业板走势基本一致,行业本身行业数据(1-2月份统计局公布行业收入利润增长10-12%附近)平淡,但代表未来发展的行业新方向新资产很多,医疗器械和医疗服务两个子行业领涨医药指数。第一季度申万医药指数上涨35.5%,跑赢沪深300指数20.9个百分点,整体涨幅居28个申万一级子行业第12位。

健康产业基金从2014年12月份成立以来,按照基金契约规定要求,根据市场形势,在第一季度重点布局国企改革、医药转型、养老服务、医疗器械等代表健康产业未来发展新方向的资产,并阶段性的参与3D打印、金融等板块的绝对性收益的机会,逐步向基金契约靠拢。目标争取拿住几支中长期具备大空间的健康产业成长性个股。

展望14年二季度,预计药品价格改革政策将出台,处方药品降价趋势明确,此外医药电商、医疗服务等新政策也将陆续出台,将带动相关板块上涨。医药行业目前已经陷入了一个低速增长的态势,但行业自身越来越多的新方向预示着行业正在进入一个发展的新阶段,大健康产业的理念正在越来越深入人心,传统医药资产或其他行业公司通过不断转型正站在进入到大健康产业的领域里来。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金份额净值增长率为20.46%,同期业绩比较基准收益率为23.78%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§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	717,701,345.77	89.23
	其中:股票	717,701,345.77	89.23
2	固定收益投资	10,244,000.00	1.27
	其中:债券	10,244,000.00	1.27
	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	47,930,369.75	5.96
7	其他资产	28,489,003.99	3.54
8	合计	804,364,719.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	22,822,937.04	2.99
C	制造业	457,259,444.13	59.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	108,971,371.71