



信息披露

2016年7月19日 星期二
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B134

英大策略优选混合型证券投资基金

2016 第二季度 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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2016年7月19日

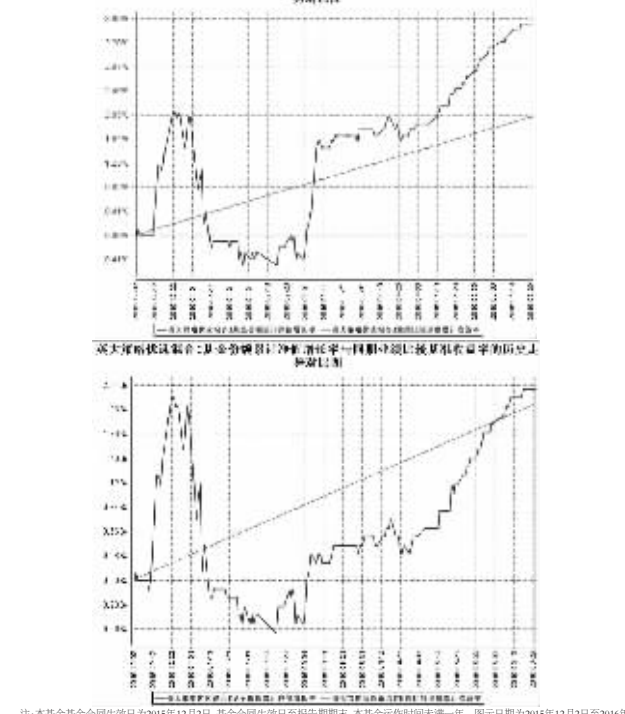
1 重要提示
基金管理人英大基金管理有限公司董事会及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期间为2016年4月1日起至6月30日止。

基金产品概况	
基金简称	英大策略优选混合
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12月12日
报告期末基金份额总额	303,589,487.27
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的资产，通过积极主动的投资策略，在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	1、大类资产配置策略：2、股票投资策略：3、固定收益品种投资策略：4、股指期货投资策略：5、衍生品投资策略
业绩比较基准	中证500指数收益率×60%+人民币定期存款利率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益低于股票型基金和股票型基金，高于债券型基金。
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基本信息	英大策略优选混合A
下属分级基金的交易代码	001270
报告期末下属分级基金的份额总额	303,589,487.27

3.1 主要财务指标和基金净值表现	
单位：人民币元	
报告期：2016年4月1日至2016年6月30日	
1.本期已实现收益	36.61
2.本期利润	41.18
3.本期基金份额净值增长率	0.0000
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	0.0000
5.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	0.0000

3.2 基金净值表现	
单位：人民币元	
报告期：2016年4月1日至2016年6月30日	
1.本期已实现收益	36.61
2.本期利润	41.18
3.本期基金份额净值增长率	0.0000
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	0.0000
5.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	0.0000

注：1.本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，是指本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，下同。
2.本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，是指本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，下同。
3.本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，是指本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，下同。
4.本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，是指本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，下同。
5.本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，是指本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，下同。



注：本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，是指本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，下同。

4.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	
单位：份	
姓名	期末
张洪伟	15
张洪伟	5

注：1.报告期内，基金管理人持有本基金份额的变动情况，是指基金管理人持有本基金份额的变动情况，下同。
2.基金管理人持有本基金份额的变动情况，是指基金管理人持有本基金份额的变动情况，下同。
3.基金管理人持有本基金份额的变动情况，是指基金管理人持有本基金份额的变动情况，下同。
4.基金管理人持有本基金份额的变动情况，是指基金管理人持有本基金份额的变动情况，下同。
5.基金管理人持有本基金份额的变动情况，是指基金管理人持有本基金份额的变动情况，下同。

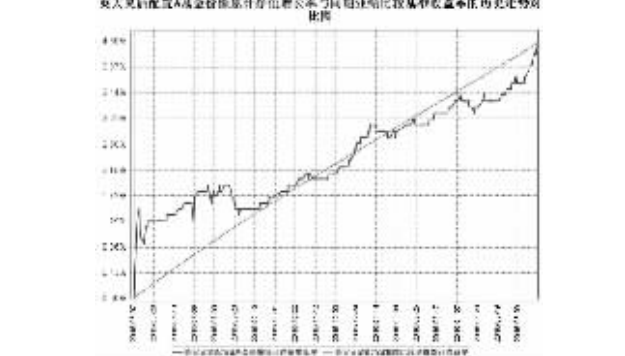
基金管理人：英大基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2016年7月19日

1 重要提示
基金管理人英大基金管理有限公司董事会及董事承诺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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年7月18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。投资者有风险，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。
本报告期间为2016年4月1日起至6月30日止。

基金产品概况	
基金简称	英大策略优选混合
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12月12日
报告期末基金份额总额	303,589,487.27
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的资产，通过积极主动的投资策略，在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	1、大类资产配置策略：2、股票投资策略：3、固定收益品种投资策略：4、股指期货投资策略：5、衍生品投资策略
业绩比较基准	中证500指数收益率×60%+人民币定期存款利率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益低于股票型基金和股票型基金，高于债券型基金。
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基本信息	英大策略优选混合A
下属分级基金的交易代码	001270
报告期末下属分级基金的份额总额	303,589,487.27

3.1 主要财务指标	
单位：人民币元	
报告期：2016年4月1日至2016年6月30日	
1.本期已实现收益	36.61
2.本期利润	41.18
3.本期基金份额净值增长率	0.0000
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	0.0000
5.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	0.0000

3.2 基金净值表现	
单位：人民币元	
报告期：2016年4月1日至2016年6月30日	
1.本期已实现收益	36.61
2.本期利润	41.18
3.本期基金份额净值增长率	0.0000
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	0.0000
5.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	0.0000



注：本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，是指本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比，下同。

4.5 报告期末基金的投资组合
报告期末，本基金投资组合资产配置情况如下：股票资产占基金资产净值的比例为1.00%，固定收益资产占基金资产净值的比例为1.00%，现金资产占基金资产净值的比例为1.00%，其他资产占基金资产净值的比例为1.00%。
4.6 报告期末基金的投资组合
报告期末，本基金投资组合资产配置情况如下：股票资产占基金资产净值的比例为1.00%，固定收益资产占基金资产净值的比例为1.00%，现金资产占基金资产净值的比例为1.00%，其他资产占基金资产净值的比例为1.00%。

5.1 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.2 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.3 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.4 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.5 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.6 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.7 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.8 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.9 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.10 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.11 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.12 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.13 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.14 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.15 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.16 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

5.17 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

天治成长精选混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人：天治基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2016年7月19日

1 重要提示
基金管理人天治基金管理有限公司董事会及董事承诺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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年7月18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。投资者有风险，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。
本报告期间为2016年4月1日起至6月30日止。

基金产品概况	
基金简称	天治成长精选混合
交易代码	350808
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月1日
报告期末基金份额总额	35,784,444.00
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的资产，通过积极主动的投资策略，在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	1、大类资产配置策略：2、股票投资策略：3、固定收益品种投资策略：4、股指期货投资策略：5、衍生品投资策略
业绩比较基准	中证500指数收益率×60%+人民币定期存款利率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益低于股票型基金和股票型基金，高于债券型基金。
基金管理人	天治基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	
单位：人民币元	
报告期：2016年4月1日至2016年6月30日	
1.本期已实现收益	-403,252.20
2.本期利润	-401,662.16
3.本期基金份额净值增长率	-0.0049
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	-0.0049
5.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	-0.0049

3.2 基金净值表现	
单位：人民币元	
报告期：2016年4月1日至2016年6月30日	
1.本期已实现收益	-403,252.20
2.本期利润	-401,662.16
3.本期基金份额净值增长率	-0.0049
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	-0.0049
5.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	-0.0049



3.3 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.4 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.5 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.6 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.7 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.8 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.9 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.10 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.11 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.12 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	现金类资产
4	其他资产
5	其他资产
6	其他资产
7	其他资产
8	其他资产
9	其他资产
10	其他资产

3.13 报告期末基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益类资产
2	固定收益类资产
3	