

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:广发银行股份有限公司
报告编制日期:2016年7月19日

\$1 重要提示
基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在违法违纪、误导性陈述或重大遗漏，并对其实内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人和广发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。保证复核的内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。投资者投资在本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告出自2016年4月1日起至6月30日止。

\$2 基金概况

基金名称 英大策略优选混合

基金代码 000667

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2015/12/22

报告期末基金总资产 501,159,264.91份

投资目标 在严格控制风险的前提下实现资产的增值。本基金通过资产的配置，在股票、债券、货币市场工具等大类金融产品中选择最佳品种进行投资，追求实现资金的长期稳定增值。

投资策略 1. 大类资产配置策略：即根据宏观经济、国家政策、行业发展趋势、以及投资资金的流动性情况，对股票、债券、货币市场工具等大类金融产品进行配置。

2. 行业配置策略：即根据宏观经济、国家政策、行业发展趋势、以及投资资金的流动性情况，对股票、债券、货币市场工具等大类金融产品进行配置。

3. 基金资产配置策略：即根据宏观经济、国家政策、行业发展趋势、以及投资资金的流动性情况，对股票、债券、货币市场工具等大类金融产品进行配置。

4. 债券投资策略：即根据宏观经济、国家政策、行业发展趋势、以及投资资金的流动性情况，对股票、债券、货币市场工具等大类金融产品进行配置。

5. 货币市场工具投资策略：即根据宏观经济、国家政策、行业发展趋势、以及投资资金的流动性情况，对股票、债券、货币市场工具等大类金融产品进行配置。

6. 不同期限的存款：即根据宏观经济、国家政策、行业发展趋势、以及投资资金的流动性情况，对股票、债券、货币市场工具等大类金融产品进行配置。

7. 银行理财产品策略：即根据宏观经济、国家政策、行业发展趋势、以及投资资金的流动性情况，对股票、债券、货币市场工具等大类金融产品进行配置。

8. 其他资产：即根据宏观经济、国家政策、行业发展趋势、以及投资资金的流动性情况，对股票、债券、货币市场工具等大类金融产品进行配置。

9. 合计：即根据宏观经济、国家政策、行业发展趋势、以及投资资金的流动性情况，对股票、债券、货币市场工具等大类金融产品进行配置。

\$3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2016年4月1日至 2016年6月30日)

英大策略优选混合 A -1,359,667.25

2.本期利润 41.18 1,135,250.08

3.加权平均基金份额本期利润 0.0188 0.0002

4.期末基金资产净值 2,285.96 51,276,075.32

5.期末基金份额净值 1.006 1.002

(注:上述基金净值增长率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收入扣除各项必要支出后的余额, 其收入(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 盈利净值

3.2.1 本基金报告期内的净值增长率与同期同类基金的比较

英大策略优选混合A

阶段 净值增长率 (%)

净值增长率标准差 (%)

业绩比较基准收益率 (%)

业绩比较基准收益率的标准差 (%)

3.2.2 本基金同期同类基金的净值增长率与同期同类基金的比较

英大策略优选混合 A & 天治成长精选混合 & 华泰柏瑞精选混合 & 海富通精选混合 & 华泰柏瑞精选混合

阶段 净值增长率 (%)

净值增长率标准差 (%)

业绩比较基准收益率 (%)

业绩比较基准收益率的标准差 (%)

3.3 报告期内基金的净值增长率与同期同类基金的比较

英大策略优选混合 A

阶段 净值增长率 (%)

净值增长率标准差 (%)

业绩比较基准收益率 (%)

业绩比较基准收益率的标准差 (%)

3.4 报告期末基金资产净值占基金资产净值比例最大的前十名债券型基金明细

序号 基金名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国银行 600,611 1,000 20,920.00 0.04

2. 报告期末债券品种分类的证券投资组合

序号 基金名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家开发银行 19,895,000 38.80

2 中行票据 19,970,000 38.94

3 国开行票据 19,970,000 38.94

4 中行票据 18,051,700 35.20

5 中行票据 4,050,000 7.90

6 中行票据 9,840 1.80

7 可转债(含分离债) 0 0.00

8 资金类 0 0.00

9 其他 0 0.00

10 合计 61,966,700.00 120.04

3.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名货币市场基金明细

序号 基金名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国银行 160,750 50,000 5.98%

2 中国银行 160,702 50,000 5.97%

3 中国银行 160,715 50,000 5.98%

4 中国银行 160,724 50,000 5.97%

5 中国银行 160,785,202 50,000 5.02%

6 中国银行 50,000 5,000 9.76%

7. 基金管理人持有的基金资产净值情况

序号 基金名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国银行 174,967.84 1.000 0.00%

2 国投瑞银货币 1,000,000 1,000 0.00%

3 国投瑞银货币 849,678.20 849,678.20 1.00%

4 国投瑞银货币 0 0.00

5 国投瑞银货币 0 0.00

6 国投瑞银货币 0 0.00

7 国投瑞银货币 2,205.73 50,157,826.28 1.00%

8 其他 0 0.00

9 合计 2,024,634.04 50,157,826.28 1.00%

9. 投资影响报告的其他信息

9.1 备查文件目录

9.2 报告期内基金未出现单只基金连续二十个交易日偏离度绝对值达到百分之三以上的现象。

9.3 期间费用

9.4 公平交易制度执行情况

9.5 异常交易行为专项报告

9.6 公平交易制度执行情况说明

9.7 公平交易制度执行情况说明

9.8 公平交易制度执行情况说明

9.9 公平交易制度执行情况说明

9.10 公平交易制度执行情况说明

9.11 公平交易制度执行情况说明

9.12 公平交易制度执行情况说明

9.13 公平交易制度执行情况说明

9.14 公平交易制度执行情况说明

9.15 公平交易制度执行情况说明

9.16 公平交易制度执行情况说明

9.17 公平交易制度执行情况说明

9.18 公平交易制度执行情况说明

9.19 公平交易制度执行情况说明

9.20 公平交易制度执行情况说明

9.21 公平交易制度执行情况说明

9.22 公平交易制度执行情况说明

9.23 公平交易制度执行情况说明

9.24 公平交易制度执行情况说明

9.25 公平交易制度执行情况说明

9.26 公平交易制度执行情况说明

9.27 公平交易制度执行情况说明

9.28 公平交易制度执行情况说明

9.29 公平交易制度执行情况说明

9.30 公平交易制度执行情况说明

9.31 公平交易制度执行情况说明

9.32 公平交易制度执行情况说明

9.33 公平交易制度执行情况说明

9.34 公平交易制度执行情况说明

9.35 公平交易制度执行情况说明

9.36 公平交易制度执行情况说明

9.37 公平交易制度执行情况说明

9.38 公平交易制度执行情况说明

9.39 公平交易制度执行情况说明

9.40 公平交易制度执行情况说明

9.41 公平交易制度执行情况说明

9.42 公平交易制度执行情况说明

9.43 公平交易制度执行情况说明

9.44 公平交易制度执行情况说明

9.45 公平交易制度执行情况说明

9.46 公平交易制度执行情况说明

9.47 公平交易制度执行情况说明

9.48 公平交易制度执行情况说明

9.49 公平交易制度执行情况说明

9.50 公平交易制度执行情况说明

9.51 公平交易制度执行情况说明

9.52 公平交易制度执行情况说明

9.53 公平交易制度执行情况说明

9.54 公平交易制度执行情况说明

9.55 公平交易制度执行情况说明

9.56 公平交易制度执行情况说明

9.57 公平交易制度执行情况说明