

英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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 2017 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	错误! 未定义书签。
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	英大睿鑫混合	
基金主代码	003446	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	193,503,093.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
下属分级基金的交易代码:	003446	003447
报告期末下属分级基金的份额总额	6,000.08 份	193,497,093.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。
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、中小企业私募债券的投资；5、股指期货投资策略；6、权证投资策略；7、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	50%×中证全指指数收益率+50%×中证全债指数收益率
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。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宗宽广
	联系电话	010-59112066
	电子邮箱	zongkg@ydamc.com
客户服务电话	400-890-5288	95511-3
传真	010-59112222	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址	北京市朝阳区东三环中路1	广东省深圳市罗湖区深南东路

	号环球金融中心西塔 22 楼 2201	5047 号
邮政编码	100020	518001
法定代表人	张传良	谢永林

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
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

基金级别	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	3,549.20	15,473,648.91
本期利润	3,729.13	25,507,111.55
加权平均基金份额本期利润	0.1423	0.1712
本期加权平均净值利润率	13.85%	16.47%
本期基金份额净值增长率	18.56%	16.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	680.60	19,643,153.43
期末可供分配基金份额利润	0.1134	0.1015
期末基金资产净值	6,857.35	218,719,161.18
期末基金份额净值	1.1429	1.1303
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.29%	13.03%

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

英大睿鑫 A

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	5.98%	0.51%	2.79%	0.35%	3.19%	0.16%
过去三个月	13.02%	0.58%	-0.84%	0.40%	13.86%	0.18%
过去六个月	18.56%	0.57%	-0.18%	0.36%	18.74%	0.21%
自基金合同	14.29%	0.59%	-3.96%	0.38%	18.25%	0.21%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

英大睿鑫 C

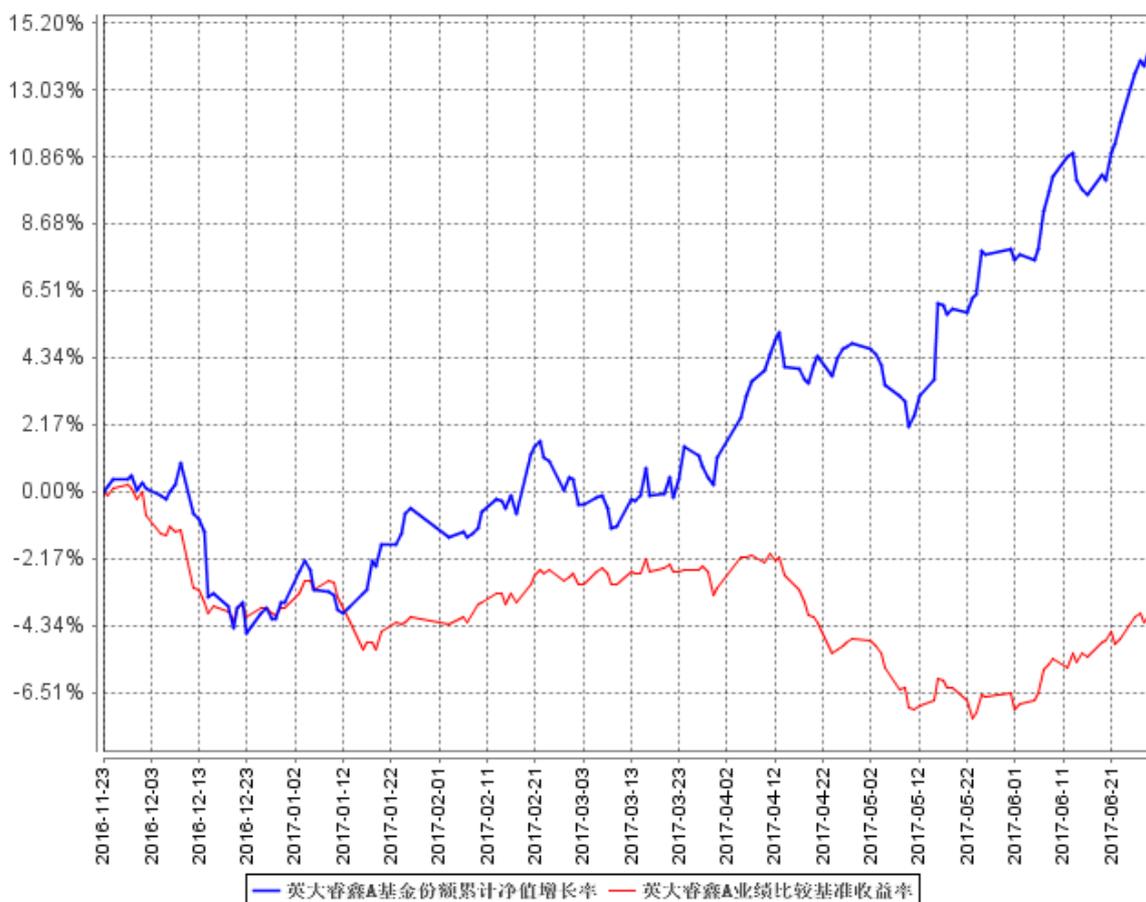
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.95%	0.51%	2.79%	0.35%	3.16%	0.16%
过去三个月	11.11%	0.51%	-0.84%	0.40%	11.95%	0.11%
过去六个月	16.41%	0.54%	-0.18%	0.36%	16.59%	0.18%
自基金合同生效起至今	13.03%	0.56%	-3.96%	0.38%	16.99%	0.18%

注：①本基金合同于 2016 年 11 月 23 日生效；

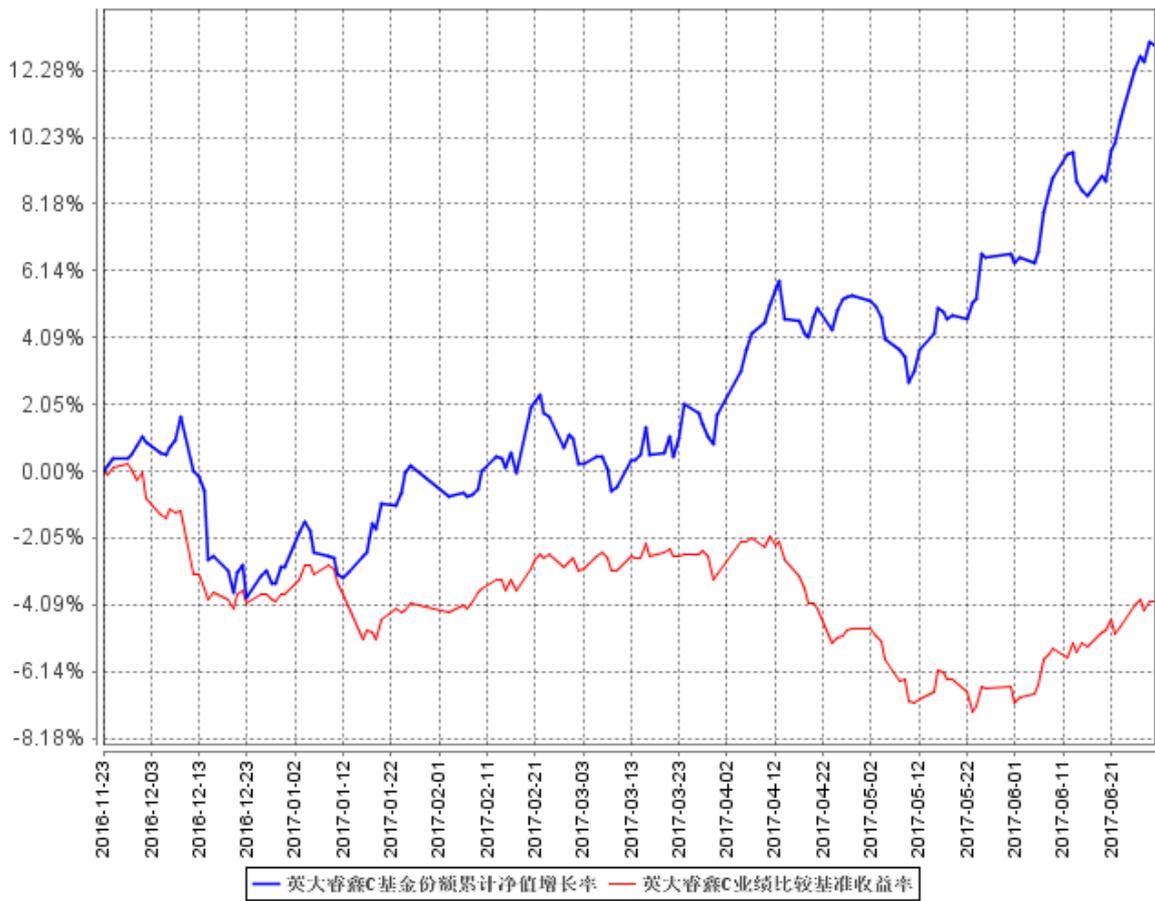
②本基金的业绩比较基准为：50%×中证全指指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

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

英大睿鑫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



英大睿鑫C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 7 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	2016 年 11 月 23 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。
管瑞龙	本基金基金经理	2017 年 2 月 17 日	-	10	曾任深圳利通控股有限公司、深圳鹏元资信有限公司、中国建设银行博士后工作站、中信银行资产管理业务中心，从事证券投资与研究。2016 年 11 月加入英大基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。

注：①任职日期说明：基金经理袁忠伟的任职日期为基金合同生效的日期，基金经理管瑞龙的任职日期为该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。

③本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，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，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

1、整体资产配置

2017 年上半年，经济增速同比 6.9%略超市场预期，货币政策边际性收紧的宏观环境下，A 股二级市场主要把握结构性机会；一级市场，本基金积极参与网下新股配售，增进基金收益。货币与债券市场方面，重点配置短久期、高信用品种。

2、股票投资

2016 年底，以上证 50、沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹相对于中小创板块具有显著的估值优势，且宏观经济环境、市场制度建设等支持具有国际竞争力的公司快发展壮大。本公司年初制定投资策略时有效地把握了上述重点，本基金上半年坚持以机构投资理念配置稳健增值资产，以低

估值、高分红、有成长前景的大盘蓝筹股票作为重点投资对象，根据季度业绩数据动态调整投资组合。具体来看，一季度对周期性行业适当加大了配置力度，较好把握了周期行业一季报业绩超预期行情；二季度适当加大了低估值大盘蓝筹的持股集中度，投资组合与 A 股市场“龙马行情”的契合度较高。上半年，二级市场股票投资组合收益率较大幅度跑赢沪深 300 指数。

一级市场方面，本基金积极参与网下新股配售，2 月上旬以前，在基金规模有限的制约下，为有效参与一个交易所新股配售，二级市场股票市值集中在上交所；2 月中旬后，二级市场股票市值均匀分布在两个交易所；上半年新股网下配售为基金贡献 2.5% 的收益率。4 月下旬后，二级市场股票市值占净资产比例稳定在 65% 左右。

3、货币与债券市场投资。由于国内金融降杠杆逐步推进，国际货币环境由宽松向常态回归，2017 年上半年货币政策边际趋紧，货币供应量增速有所减缓，市场利率有所提升。本基金重点配置短久期、高信用等级品种，以货币市场短期回购为主，仓位波动区间位于 15%-35%，有效获取货币市场短期利率抬升带来的收益。

4、基金投资绩效

上半年本基金单位净值上涨 16.41%，超越沪深 300 指数 5.63 个百分点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，英大睿鑫 A 类基金份额净值为 1.1429 元，报告期基金份额净值增长率为 18.56%；英大睿鑫 C 类基金份额净值为 1.1303 元，报告期基金份额净值增长率为 16.41%；同期业绩比较基准增长率为-0.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年经济增速维持在 6.9%，预计下半年经济增速稳中趋降，全年经济增速可能在 6.8% 附近；工业生产者出厂价格指数（PPI）月同比增速由今年 2 月份 7.8% 的高位逐步回落，预计下半年仍将处于下降趋势。考虑到全部 A 股上市公司 2016 年度和 17 年一季度净利润同比分别增长 5.43% 和 19.84%，预计 2017 年下半年上市公司利润增速将较上半年稳中有降，但显著高于 2016 年。下半年货币政策保持中性概率较大，截至 2017 年 7 月 25 日 10 年期国债到期收益率位于历史均值，1 年期国债到期收益率高于历史均值，期限利差小于历史平均水平，利率期限结构平坦化，预计下半年无风险利率水平继续大幅上行空间有限。宏观经济与货币环境决定股票市场在下半年难有大幅上涨的机会和下跌空间，总体可能以“震荡行情”为主要特征，重点把握结构性机会。从历史比较和国际比较两个维度来看，沪深 300 指数估值水平相对合理，相对于中小创

等板块仍然具有一定的估值优势。行业重点关注大消费、大创新，板块关注国企改革、一带一路。

股票投资策略：本基金在下半年继续以机构投资理念配置稳健增值资产，以低估值、高分红、有成长前景的公司股票可作为重点投资对象，根据季度业绩数据动态调整投资组合；与此同时，一级市场方面，积极参与网下新股配售，尽可能获取低风险增值资产。货币与债券投资策略：尽管下半年货币政策保持中性概率较大，但鉴于国际货币环境由宽松转向边际收紧，国内金融降杠杆甚至中盘，风险仍不能忽视，本基金重点配置短久期、高信用等级品种。

重要指数风险等级划分：上半年，沪深 300 指数波动区间为 3264~3677，收益波动区间为 -1.39%~11.09%，市场上涨动能明显大于下跌力量。上市公司整体业绩增长即将兑现，随着 A 股纳入 MSCI 指数，沪深 300 样本股中有 200 只股票将中长期获得资金关注，这将有利于沪深 300 指数估值水平的稳定或提升，预计沪深 300 指数下半年估值波动区间为 18 倍~21 倍，以目前指数 3646 为基准（平均市盈率 19.5 倍），沪深 300 指数收益波动区间为 -7.7%~7.7%，对应指数波动区间 3366~3926。

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

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由英大基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,523,541.11	684,883.83
结算备付金		3,894,981.99	3,322,586.98
存出保证金		168,721.76	20,540.13
交易性金融资产	6.4.7.2	141,187,947.47	64,291,515.10
其中：股票投资		141,187,947.47	64,291,515.10
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	54,000,000.00	-
应收证券清算款		10,041,659.65	10,008,355.56
应收利息	6.4.7.5	30,608.62	2,810.31
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		219,847,460.60	78,330,691.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	753,166.79
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		130,114.27	49,961.13
应付托管费		26,022.86	9,992.24
应付销售服务费		34,695.50	13,320.65
应付交易费用	6.4.7.7	851,268.09	134,811.79

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	79,341.35	-
负债合计		1,121,442.07	961,252.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	193,503,093.76	79,681,315.21
未分配利润	6.4.7.10	25,222,924.77	-2,311,875.90
所有者权益合计		218,726,018.53	77,369,439.31
负债和所有者权益总计		219,847,460.60	78,330,691.91

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，A 级基金份额净值 1.1429 元，基金份额总额 6,000.08 份；C 级基金份额净值 1.1303 元，基金份额总额 193,497,093.68 份。

6.2 利润表

会计主体：英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		28,071,187.29	-
1.利息收入		467,928.91	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	62,335.06	-
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		405,593.85	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,569,413.88	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,453,663.29	-
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	2,115,750.59	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,033,642.57	-
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	201.93	-
减：二、费用		2,560,346.61	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	564,426.54	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	112,885.29	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	150,486.69	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,653,206.74	-
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	79,341.35	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,510,840.68	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,510,840.68	-

注：本基金合同生效日为 2016 年 11 月 23 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	79,681,315.21	-2,311,875.90	77,369,439.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,510,840.68	25,510,840.68
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）	113,821,778.55	2,023,959.99	115,845,738.54
其中：1.基金申购款	113,934,763.26	2,025,059.35	115,959,822.61
2.基金赎回款	-112,984.71	-1,099.36	-114,084.07
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)	193,503,093.76	25,222,924.77	218,726,018.53

注：本基金合同生效日为 2016 年 11 月 23 日，无上年度可比期间数据。

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：

_____朱志_____	_____朱志_____	_____耿义辉_____
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

英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金(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【2016】第 1066 号《关于核准英大睿鑫灵活配置混合型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《英大睿鑫灵活配置混合型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 200041845.69 元，业经瑞华会计师事务所有限责任公司(2016)瑞华验字第 01390017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200053856.09 份基金份额(其中英大睿鑫 A 基金份额为 14039.74 份，英大睿鑫 C 基金份额为 200039816.35 份)，认购资金利息折合 12010.4 份基金份额(其中英大睿鑫 A 基金份额为 4.05 份，英大睿鑫 C 基金份额为 12006.35 份)。本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，并报中国证监会备案。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本基金类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类、C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购/申购的基金分类别。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合

同》的有关规定，本基金投资于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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、大额存单、银行存款等）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的相关规定）。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。本基金投资组合资产配置比例：股票资产占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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不低于基金资产的 5%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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》、《英大睿鑫灵活配置混合型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 2017 年 6 月 30 日的财务状况及 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。卖出债券的成本按移动加权平均法逐日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金及适用利率逐日计提。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时采用合同利率）在回购期内逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理人报酬按照前一日基金资产净值的 0.75% 的年费率逐日计提。

(2) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提。

(3) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时采用合同利率）在回购期内逐日计提。

(4) 其他费用根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额列入当期基金费用。

如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法，在受益期内分摊计入本期和以后各期。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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、增值税

根据财政部、国家税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36号）的规定,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入,免征增值税。

2、企业所得税

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税 [2008]1 号）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《关于证券投资基金有关税收问题的通知》（财税[1998]55 号）的规定,对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税,基金向个人投资者分配股息、红利、利息时,不再代扣个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、证监会《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税[2012]85 号）和《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税 [2015] 101 号）的规定,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税;持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1%的税率对双方

当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	10,523,541.11
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	10,523,541.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	134,006,429.44	141,187,947.47	7,181,518.03
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	134,006,429.44	141,187,947.47	7,181,518.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2017 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**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	54,000,000.00	-
合计	54,000,000.00	-

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（2017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 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,683.02
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	1,752.70
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	27,097.00
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	75.90
合计	30,608.62

6.4.7.6 其他资产

本报告期末（2017年6月30日），本基金未持有其他资产（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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	851,268.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	851,268.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	79,341.35
合计	79,341.35

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

英大睿鑫 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,165.81	14,165.81
本期申购	49,749.62	49,749.62
本期赎回(以“-”号填列)	-57,915.35	-57,915.35
- 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	6,000.08	6,000.08

金额单位：人民币元

英大睿鑫 C		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	79,667,149.40	79,667,149.40
本期申购	113,885,013.64	113,885,013.64
本期赎回(以“-”号填列)	-55,069.36	-55,069.36
- 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	193,497,093.68	193,497,093.68

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

英大睿鑫 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	39.40	-549.20	-509.80
本期利润	3,549.20	179.93	3,729.13
本期基金份额交易产生的变动数	-2,908.00	545.94	-2,362.06
其中：基金申购款	638.81	-715.82	-77.01
基金赎回款	-3,546.81	1,261.76	-2,285.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	680.60	176.67	857.27

单位：人民币元

英大睿鑫 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	798,382.79	-3,109,748.89	-2,311,366.10
本期利润	15,473,648.91	10,033,462.64	25,507,111.55
本期基金份额交易产生的变动数	3,371,121.73	-1,344,799.68	2,026,322.05
其中：基金申购款	3,371,674.93	-1,346,538.57	2,025,136.36
基金赎回款	-553.20	1,738.89	1,185.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,643,153.43	5,578,914.07	25,222,067.50

注：本表涉及报告期内未分配利润的变动项目中，如为利润减少或亏损，以“-”号填列。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	47,483.52
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	13,886.57
其他	964.97
合计	62,335.06

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	611,162,271.22
减：卖出股票成本总额	595,708,607.93
买卖股票差价收入	15,453,663.29

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（2017年1月1日至2017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（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本报告期（2017年1月1日至2017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（2017年1月1日至2017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（2017年1月1日至2017年6月30日），本基金无贵金属投资收益——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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无贵金属投资收益——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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无贵金属投资收益——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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益——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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,115,750.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,115,750.59

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	10,033,642.57
——股票投资	10,033,642.57
——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	10,033,642.57

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	201.93
合计	201.93

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,653,206.74
银行间市场交易费用	-
合计	1,653,206.74

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
合计	79,341.35

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
中国平安银行股份有限公司	基金托管人
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

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

无。

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	564,426.54	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：①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 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

本基金合同生效日为 2016 年 11 月 23 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	112,885.29	-

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15% / 当年天数。

本基金合同生效日为 2016 年 11 月 23 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C	合计
英大基金管理有限公司	-	150,486.69	150,486.69
合计	-	150,486.69	150,486.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C	合计

注：①C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%。在通常情况下，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：日C类基金份额销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×0.2%/当年天数，销售服务费每日计提，按月支付。C类基金份额的销售服务费主要用于本基金的持续销售以及基金份额持有人的服务。

②A类基金份额不收取销售服务费。

本基金合同生效日为2016年11月23日，无上年度可比期间数据。

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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
中国平安银行股份有限公司	10,523,541.11	47,483.52	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。本基金合同生效日为2016年11月23日，无上年度可比期间数据。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配事项。

6.4.12 期末（2017 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
002859	洁美科技	2017 年 3 月 24 日	2018 年 4 月 9 日	新股流通受限	29.82	73.00	6,666	198,780.12	486,618.00	-
002860	星帅尔	2017 年 3 月 31 日	2018 年 4 月 12 日	新股流通受限	19.81	48.90	7,980	158,083.80	390,222.00	-
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	1,483	9,194.60	9,194.60	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

		日	3 日							
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

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
002128	露天煤业	2017 年 3 月 17 日	临时停牌	8.70	-	-	310,000	2,793,422.60	2,697,000.00	-

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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并

制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围內。

6.4.13.2 信用风险

无债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

无债券投资。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无债券投资。

6.4.13.4 市场风险

无债券投资。

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。报告期本基金未持有债券投资。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	10,523,541.11	-	-	-	-	-	10,523,541.11
结算备付金	3,894,981.99	-	-	-	-	-	3,894,981.99
存出保证金	168,721.76	-	-	-	-	-	168,721.76
交易性金融资产	-	-	-	-	-	141,187,947.47	141,187,947.47
买入返售金融资产	54,000,000.00	-	-	-	-	-	54,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,041,659.65	10,041,659.65
应收利息	-	-	-	-	-	30,608.62	30,608.62
资产总计	68,587,244.86	-	-	-	-	151,260,215.74	219,847,460.60

负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	130,114.27	130,114.27
应付托管费	-	-	-	-	-	26,022.86	26,022.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-	34,695.50	34,695.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	851,268.09	851,268.09
其他负债	-	-	-	-	-	79,341.35	79,341.35
负债总计	-	-	-	-	-	1,121,442.07	1,121,442.07
利率敏感度缺口	68,587,244.86	-	-	-	-	-150,138,773.67	218,726,018.53
上年度末 2016 年 12 月 31 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	684,883.83	-	-	-	-	-	684,883.83
结算备付金	3,322,586.98	-	-	-	-	-	3,322,586.98
存出保证金	20,540.13	-	-	-	-	-	20,540.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	64,291,515.10	64,291,515.10
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,008,355.56	10,008,355.56
应收利息	-	-	-	-	-	2,810.31	2,810.31
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,028,010.94	-	-	-	-	74,302,680.97	78,330,691.91
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	753,166.79	753,166.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,961.13	49,961.13
应付托管费	-	-	-	-	-	9,992.24	9,992.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,320.65	13,320.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	134,811.79	134,811.79
其他负债	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	961,252.60	961,252.60
利率敏感度缺口	4,028,010.94	-	-	-	-	-73,341,428.37	77,369,439.31

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

报告期本基金未持有债券投资。

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 2017年6月30日		上年度末 2016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	141,187,947.47	64.55	64,291,515.10	83.10
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	141,187,947.47	64.55	64,291,515.10	83.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数变化 5%，其他变量不变。		
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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	7,059,400.00	3,214,600.00
	沪深 300 指数下降 5%	-7,059,400.00	-3,214,600.00

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	141,187,947.47	64.22
	其中：股票	141,187,947.47	64.22
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	54,000,000.00	24.56
	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	14,418,523.10	6.56
7	其他各项资产	10,240,990.03	4.66
8	合计	219,847,460.60	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	2,697,000.00	1.23
C	制造业	57,536,096.38	26.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,812,000.00	2.20
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,134,425.92	6.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	49,677,529.55	22.71
K	房地产业	6,192,656.00	2.83

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	5,130,600.00	2.35
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	141,187,947.47	64.55

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

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	300,000	12,351,000.00	5.65
2	601166	兴业银行	700,000	11,802,000.00	5.40
3	600585	海螺水泥	500,000	11,365,000.00	5.20
4	601318	中国平安	200,000	9,922,000.00	4.54
5	600015	华夏银行	1,000,000	9,220,000.00	4.22
6	600000	浦发银行	700,000	8,855,000.00	4.05
7	000858	五粮液	148,635	8,273,024.10	3.78
8	601111	中国国航	600,000	5,850,000.00	2.67
9	000625	长安汽车	400,000	5,768,000.00	2.64
10	000488	晨鸣纸业	429,909	5,545,826.10	2.54
11	000429	粤高速 A	626,928	5,353,965.12	2.45
12	000069	华侨城 A	510,000	5,130,600.00	2.35
13	601186	中国铁建	400,000	4,812,000.00	2.20
14	000900	现代投资	427,224	3,930,460.80	1.80
15	002142	宁波银行	199,906	3,858,185.80	1.76
16	000338	潍柴动力	290,000	3,828,000.00	1.75
17	000725	京东方 A	900,000	3,744,000.00	1.71
18	000776	广发证券	199,963	3,449,361.75	1.58
19	002202	金风科技	200,000	3,094,000.00	1.41
20	002128	露天煤业	310,000	2,697,000.00	1.23

21	000001	平安银行	273,800	2,570,982.00	1.18
22	000732	泰禾集团	140,000	2,335,200.00	1.07
23	000581	威孚高科	89,916	2,328,824.40	1.06
24	600048	保利地产	200,000	1,994,000.00	0.91
25	002146	荣盛发展	188,800	1,863,456.00	0.85
26	002859	洁美科技	6,666	486,618.00	0.22
27	002860	星帅尔	7,980	390,222.00	0.18
28	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
29	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
30	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
31	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
32	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
33	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
34	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
35	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
36	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
37	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
38	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
39	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
40	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
41	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
42	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
43	002882	金龙羽	1,483	9,194.60	0.00
44	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
45	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	600104	上汽集团	34,884,098.33	45.09
2	601668	中国建筑	33,012,028.21	42.67
3	000651	格力电器	29,051,409.41	37.55
4	600309	万华化学	27,791,253.18	35.92
5	600585	海螺水泥	26,808,934.28	34.65
6	601318	中国平安	24,399,132.25	31.54

7	600270	外运发展	23,911,548.16	30.91
8	601111	中国国航	22,486,059.00	29.06
9	601088	中国神华	20,960,148.60	27.09
10	002202	金风科技	20,165,982.16	26.06
11	600373	中文传媒	20,092,919.07	25.97
12	000776	广发证券	20,053,293.48	25.92
13	601211	国泰君安	16,766,000.00	21.67
14	000625	长安汽车	15,008,532.00	19.40
15	000900	现代投资	12,999,537.96	16.80
16	601601	中国太保	12,920,266.90	16.70
17	600519	贵州茅台	12,120,477.00	15.67
18	600741	华域汽车	11,750,202.60	15.19
19	000623	吉林敖东	10,611,758.08	13.72
20	000858	五粮液	9,374,827.55	12.12
21	600000	浦发银行	9,362,500.00	12.10
22	600089	特变电工	9,134,769.30	11.81
23	000429	粤高速 A	9,040,501.63	11.68
24	600079	人福医药	8,570,622.00	11.08
25	601098	中南传媒	8,437,213.26	10.91
26	002394	联发股份	8,357,236.91	10.80
27	000063	中兴通讯	8,317,900.00	10.75
28	600177	雅戈尔	8,109,595.85	10.48
29	000600	建投能源	7,634,195.04	9.87
30	002142	宁波银行	7,214,338.56	9.32
31	600004	白云机场	7,034,873.00	9.09
32	600522	中天科技	6,756,000.00	8.73
33	002146	荣盛发展	6,635,597.00	8.58
34	000488	晨鸣纸业	6,562,664.83	8.48
35	000001	平安银行	6,386,399.95	8.25
36	000069	华侨城 A	5,992,163.00	7.74
37	600690	青岛海尔	5,878,800.00	7.60
38	000338	潍柴动力	5,778,200.00	7.47
39	000876	新希望	5,525,776.46	7.14
40	000539	粤电力 A	5,166,694.40	6.68
41	601186	中国铁建	4,810,000.00	6.22
42	002250	联化科技	4,721,109.64	6.10

43	600060	海信电器	4,303,200.00	5.56
44	600066	宇通客车	4,220,044.00	5.45
45	000581	威孚高科	4,173,817.36	5.39
46	601166	兴业银行	4,172,800.00	5.39
47	000726	鲁泰 A	4,148,561.01	5.36
48	000860	顺鑫农业	4,108,839.00	5.31
49	601006	大秦铁路	4,070,400.00	5.26
50	600019	宝钢股份	3,920,000.00	5.07
51	601398	工商银行	3,728,000.00	4.82
52	000725	京东方 A	3,663,000.00	4.73
53	601012	隆基股份	3,592,950.57	4.64
54	000685	中山公用	2,966,840.05	3.83
55	600048	保利地产	2,937,000.00	3.80
56	002128	露天煤业	2,793,422.60	3.61
57	600551	时代出版	2,667,900.00	3.45
58	000521	美菱电器	2,526,302.00	3.27
59	000732	泰禾集团	2,319,800.00	3.00
60	000002	万科 A	2,237,947.80	2.89
61	000789	万年青	2,203,262.00	2.85
62	000983	西山煤电	2,183,681.00	2.82
63	600015	华夏银行	2,148,300.00	2.78
64	000587	金洲慈航	2,034,080.00	2.63
65	002433	太安堂	2,027,286.00	2.62
66	002398	建研集团	2,013,997.00	2.60
67	002026	山东威达	2,006,865.31	2.59
68	000898	鞍钢股份	2,005,615.00	2.59
69	000701	厦门信达	1,988,469.80	2.57
70	000719	大地传媒	1,945,904.98	2.52
71	000830	鲁西化工	1,862,495.00	2.41
72	000698	沈阳化工	1,715,719.00	2.22

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	600104	上汽集团	40,933,972.74	52.91
2	601668	中国建筑	33,637,150.48	43.48
3	600309	万华化学	29,650,881.40	38.32
4	000651	格力电器	26,949,361.61	34.83
5	600270	外运发展	24,594,504.00	31.79
6	601318	中国平安	22,687,221.48	29.32
7	002202	金风科技	22,300,996.06	28.82
8	000776	广发证券	22,023,244.43	28.47
9	601088	中国神华	21,754,281.26	28.12
10	600373	中文传媒	20,361,299.58	26.32
11	601111	中国国航	17,355,909.39	22.43
12	601211	国泰君安	16,915,500.00	21.86
13	000063	中兴通讯	16,609,059.96	21.47
14	600585	海螺水泥	16,580,284.76	21.43
15	000625	长安汽车	15,741,685.53	20.35
16	601601	中国太保	12,887,022.60	16.66
17	600519	贵州茅台	12,270,748.00	15.86
18	600741	华域汽车	12,060,739.33	15.59
19	601398	工商银行	11,240,000.00	14.53
20	000623	吉林敖东	10,255,152.99	13.25
21	000900	现代投资	9,556,734.33	12.35
22	600089	特变电工	9,389,262.97	12.14
23	600079	人福医药	8,691,568.95	11.23
24	002394	联发股份	8,577,173.59	11.09
25	601098	中南传媒	8,526,868.73	11.02
26	600177	雅戈尔	8,191,345.80	10.59
27	000600	建投能源	8,119,834.36	10.49
28	600004	白云机场	7,506,989.49	9.70
29	600522	中天科技	6,887,000.00	8.90
30	002146	荣盛发展	6,632,360.00	8.57
31	600690	青岛海尔	6,016,300.00	7.78
32	000876	新希望	5,477,154.30	7.08
33	000539	粤电力 A	5,312,564.80	6.87
34	002250	联化科技	4,778,527.72	6.18
35	600060	海信电器	4,340,789.81	5.61
36	600066	宇通客车	4,280,094.56	5.53
37	601006	大秦铁路	4,216,000.00	5.45

38	000726	鲁泰 A	4,080,231.00	5.27
39	600019	宝钢股份	3,996,000.00	5.16
40	000001	平安银行	3,959,779.00	5.12
41	000429	粤高速 A	3,928,463.11	5.08
42	000860	顺鑫农业	3,864,274.24	4.99
43	601012	隆基股份	3,648,078.80	4.72
44	002142	宁波银行	3,327,192.00	4.30
45	000685	中山公用	2,959,353.65	3.82
46	000858	五粮液	2,717,119.00	3.51
47	600551	时代出版	2,708,100.00	3.50
48	000521	美菱电器	2,507,346.17	3.24
49	000002	万科 A	2,288,190.23	2.96
50	000338	潍柴动力	2,229,636.10	2.88
51	000789	万年青	2,214,054.00	2.86
52	000983	西山煤电	2,072,306.00	2.68
53	000587	金洲慈航	2,052,134.00	2.65
54	000898	鞍钢股份	2,020,892.00	2.61
55	000581	威孚高科	2,016,000.00	2.61
56	000069	华侨城 A	1,954,076.00	2.53
57	000701	厦门信达	1,918,994.43	2.48
58	002398	建研集团	1,905,231.80	2.46
59	000719	大地传媒	1,878,770.49	2.43
60	002433	太安堂	1,813,900.00	2.34
61	000830	鲁西化工	1,808,645.06	2.34
62	002026	山东威达	1,696,123.84	2.19

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	662,571,397.73
卖出股票收入（成交）总额	611,162,271.22

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

本基金没有参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金没有参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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、批评处罚的情况。

7.12.2

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。

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	168,721.76
2	应收证券清算款	10,041,659.65
3	应收股利	-
4	应收利息	30,608.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,240,990.03

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

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

份额级别	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
英大睿鑫A	101	59.41	-	-	6,000.08	100.00%
英大睿鑫C	161	1,201,845.30	193,353,988.37	99.93%	143,105.31	0.07%
合计	262	738,561.43	193,353,988.37	99.92%	149,105.39	0.08%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	英大睿鑫A	675.58	11.2595%
	英大睿鑫C	91,936.40	0.0475%
	合计	92,611.98	0.0479%

注：上表中基金管理人从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	英大睿鑫A	0~10
	英大睿鑫C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	英大睿鑫A	0
	英大睿鑫C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 23 日）基金份额总额	14,039.74	200,039,816.35
本报告期期初基金份额总额	14,165.81	79,667,149.40
本报告期基金总申购份额	49,749.62	113,885,013.64
减：本报告期基金总赎回份额	57,915.35	55,069.36
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	6,000.08	193,497,093.68

§ 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 2017 年 6 月 15 日发布公告，孔旺先生自 2017 年 6 月 14 日起担任英大基金管理有限公司董事长，张传良先生自 2017 年 6 月 14 日起不再担任董事长职务。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，基金管理人于 2017 年 6 月 15 日发布公告，孔旺先生自 2017 年 6 月 14 日起担任英大基金管理有限公司总经理，张传良先生自 2017 年 6 月 14 日起不再担任总经理职务。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，基金管理人于 2017 年 2 月 21 日发布公告，管瑞龙先生自 2017 年 2 月 17 日起担任英大基金管理有限公司英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

基金投资策略没有发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为本基金审计的会计师事务所。

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	
国金证券	1	777,817,332.00	61.21%	568,817.66	61.21%	-
东吴证券	1	492,961,506.16	38.79%	360,503.31	38.79%	-

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

国金证券	-	-	1,187,500,000.00	99.41%	-	-
东吴证券	-	-	7,000,000.00	0.59%	-	-

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	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	《中国证券报》及公司网站	2017年2月21日
2	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金关于开放转换转入业务的公告	《中国证券报》及公司网站	2017年2月28日
3	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告	《中国证券报》及公司网站	2017年4月21日
4	英大基金管理有限公司董事长及总经理变更公告	《中国证券报》及公司网站	2017年6月16日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017. 1. 1-2017. 6. 30	79, 512, 000. 0 0	17, 164, 796. 3 1	0. 0 0	96, 676, 796. 3 1	49. 9 6
	2	2017. 2. 8-2017. 6. 30	0. 00	38, 302, 590. 4 6	0. 0 0	38, 302, 590. 4 6	19. 7 9
	3	2017. 4. 17-2017. 6. 30	0. 00	38, 215, 343. 4 6	0. 0 0	38, 215, 343. 4 6	19. 7 5
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

§ 12 备查文件目录

12.1 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

《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

《英大睿鑫灵活配置混合型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

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：<http://www.ydamc.com/>

英大基金管理有限公司

2017 年 8 月 29 日