

# 英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 27 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>16</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	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.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
4.9 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.....	22
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>23</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	23
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.....	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	23
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>24</b>
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	24
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>27</b>
7.1 资产负债表.....	27
7.2 利润表.....	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	29
7.4 报表附注.....	30
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6 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.....	62

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 .....	62
8.8 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 .....	62
8.9 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 .....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	63
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
9.3 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 .....	65
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	66
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
11.2 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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>74</b>
12.1 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 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>
13.1 备查文件目录 .....	75
13.2 存放地点 .....	75
13.3 查阅方式 .....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	英大灵活配置混合	
场内简称	-	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	157,397,550.03 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
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
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	001270	001271
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	1,314,622.29 份	156,082,927.74 份

### 2.2 基金产品说明

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。	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘轶	贺倩

	联系电话	010-59112020	010-66060069
	电子邮箱	liuyi@ydamc.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-890-5288	95599
传真		010-59112222	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		100020	100031
法定代表人		孔旺	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ydamc.com">http://www.ydamc.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔9层
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、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年		2017 年		2016 年	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
本期已实现收益	242,622.74	-142,658.92	43,222,108.61	9,990,539.61	34,228,055.22	26,521,535.28
本期利润	-500,859.92	-15,692,540.17	35,401,981.75	8,163,060.19	24,221,103.98	22,293,436.46
加权平均基金份额本期利润	-0.1014	-0.1046	0.0714	0.0688	0.0255	0.0192
本期加权平	-9.39%	-10.14%	6.83%	6.64%	2.46%	1.86%

均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	-8.72%	-9.58%	7.31%	6.89%	2.81%	2.30%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
期末可供分配利润	-19,359.52	-5,448,326.72	794,290.15	7,997,443.01	2,953,639.36	-165,833.69
期末可供分配基金份额利	-0.0147	-0.0349	0.0794	0.0674	0.0059	-0.0014



润						
期						
末						
基						
金	1,295,262.	150,634,601	10,802,178	126,607,446	506,540,763	118,397,805
资	77	.02	.71	.94	.17	.53
产						
净						
值						
期						
末						
基						
金						
份	0.9853	0.9651	1.0794	1.0674	1.0059	0.9986
额						
净						
值						
指						
标						
3.1.						
3						
累						
计						
期						
末						
指						
标						
	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
基						
金						
份						
额						
累						
计						
净						
值						
增						
长						
率	3.43%	1.34%	13.31%	12.08%	5.59%	4.86%

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

英大灵活配置 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
过去三个月	-6.83%	0.88%	0.79%	0.01%	-7.62%	0.87%
过去六个月	-4.16%	0.84%	1.59%	0.01%	-5.75%	0.83%
过去一年	-8.72%	0.70%	3.20%	0.01%	-11.92%	0.69%
过去三年	0.71%	0.42%	10.24%	0.01%	-9.53%	0.41%
自基金合同生效起至今	3.43%	0.38%	13.02%	0.01%	-9.59%	0.37%

英大灵活配置 B

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
过去三个月	-7.18%	0.89%	0.79%	0.01%	-7.97%	0.88%
过去六个月	-4.87%	0.84%	1.59%	0.01%	-6.46%	0.83%
过去一年	-9.58%	0.70%	3.20%	0.01%	-12.78%	0.69%
过去三年	-1.13%	0.42%	10.24%	0.01%	-11.37%	0.41%
自基金合同生效起至今	1.34%	0.38%	13.02%	0.01%	-11.68%	0.37%

注：①本基金合同于 2015 年 5 月 7 日生效；

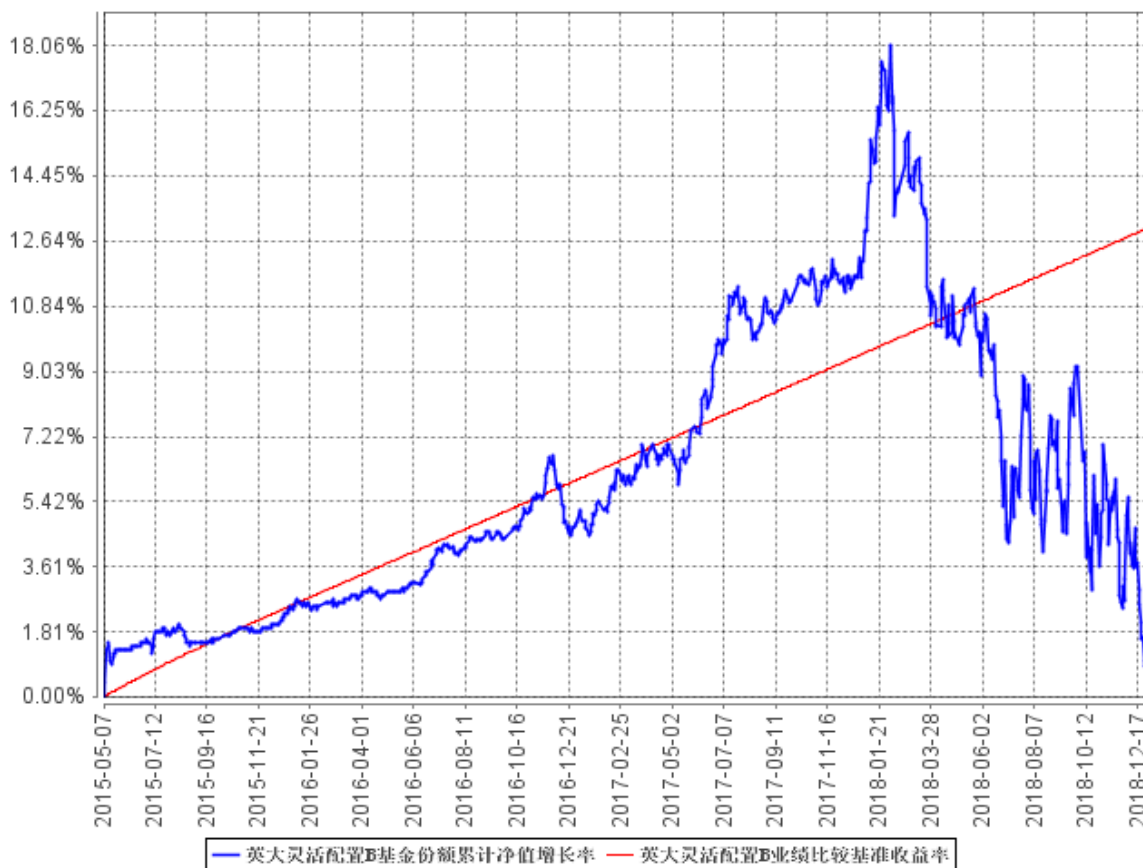
②本基金的业绩比较基准为：1 年期银行定期存款利率（税后）+2%。

### 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

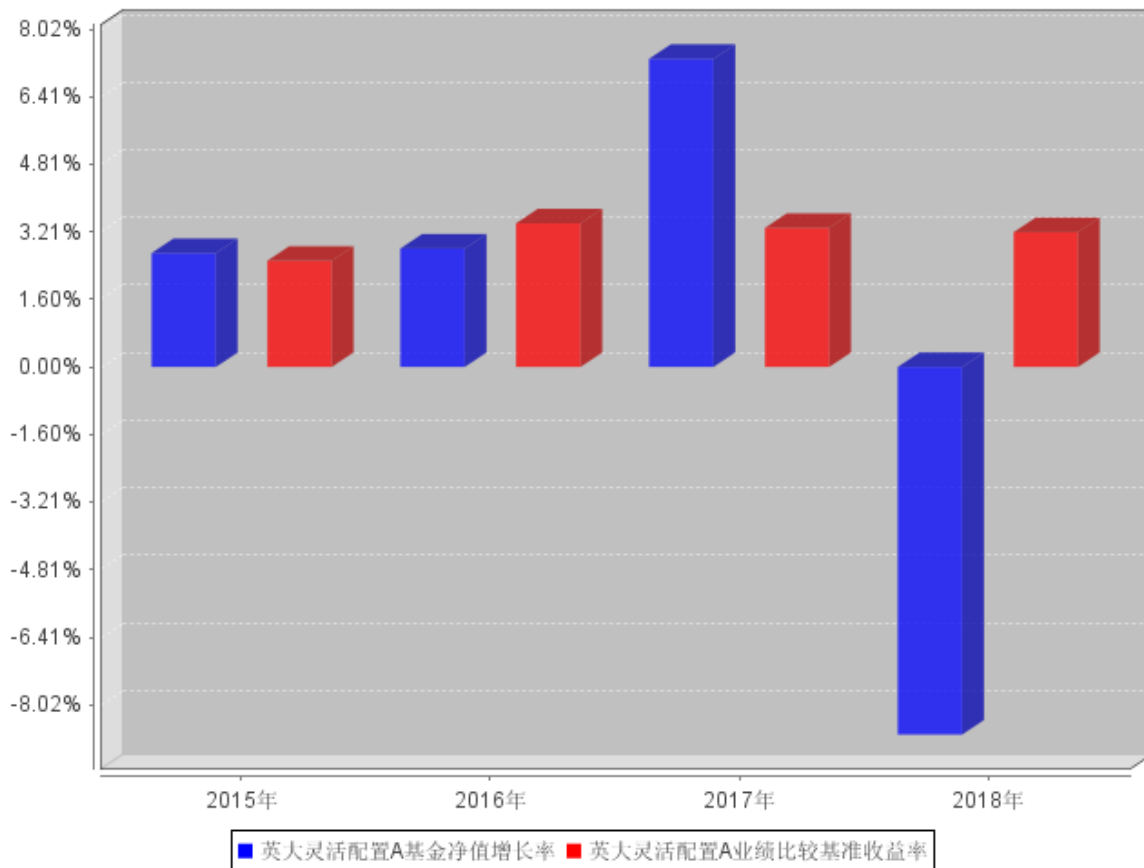


英大灵活配置B基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

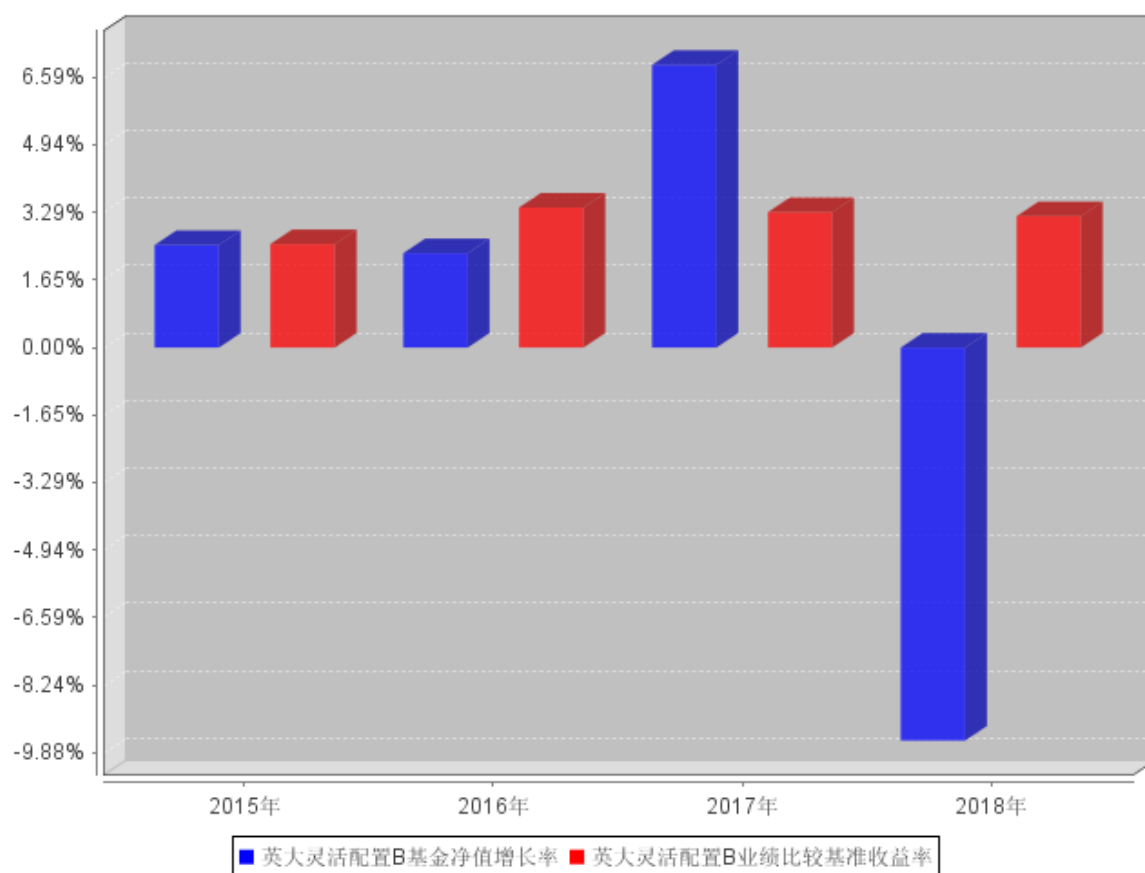


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大灵活配置A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 英大灵活配置B自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

英大灵活配置 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
2016	0.5000	25,179,351.22	-	25,179,351.22	
合计	0.5000	25,179,351.22	-	25,179,351.22	

单位：人民币元

英大灵活配置 B					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	-	-	-	-	

2017	-	-	-	-	
2016	0.5000	5,928,181.96	-	5,928,181.96	
合计	0.5000	5,928,181.96	-	5,928,181.96	

## § 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

英大基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2012 年 8 月 17 日，注册资本金为 20,000 万元人民币。现有三家股东，分别是网英大国际控股集团有限公司、中国交通建设股份有限公司、航天科工财务有限责任公司，持股比例分别为 49%、36%和 15%。

公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司 90%以上的员工来自于基金公司等金融机构，平均行业从业时间超过 10 年，硕士以上学历的员工占员工总数 70%以上，核心团队拥有丰富的经验和行业影响力。

公司自成立就秉承了国有企业诚信、责任、奉献的优良传统，确立了以“诚信、责任、专业、创新”为核心的企业文化，坚持以维护基金持有人利益为经营原则，坚持公募、私募协同发展、两翼齐飞的战略，坚持以市场为导向，坚持价值投资、长期投资理念，注重发展和创新，建立了科学、专业的投研体系和严谨的风控体系，力争成为具有核心竞争力、受人尊敬、业内领先的专业财富管理公司。

截至 2018 年 12 月 31 日，本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、英大睿盛混合型证券投资基金 8 只开放式证券投资基金，同时，管理过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、权益投资部总经理	2015年5月7日	-	18	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。
易祺坤	本基金基金经理	2017年12月28日	-	7	北京大学理学学士,5年以上证券从业经历。2011年8月至2013年8月就职于寰富投资咨询(上海)有限公司,任衍生品交易员。2013年10月加入英大基金管理有限公司,历任公司交易管理部交易员和交易管理部副总经理(主持工作)。现任固定收益部基金经理。
张琳娜	本基金基金经理、固定收益部总经理	2015年7月15日	2017年12月29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)、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

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据《证券投资基

金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等国家法律法规和监管部门的规定，公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》，适用于公司所管理的全部公募基金、私募资产管理计划、社保基金、企业年金等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括公司实行投资决策委员会领导下的基金经理/投资经理负责制，明确各自的投资权限，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，交易执行部门与投资决策部门严格分离，业绩与风险评估以数量分析为基础，对投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程，明确投资各环节的业务职责，防范投资风险。公司的所有投资组合共享公司统一的投资研究平台，投资研究团队使用同一研究报告系统，确保公募基金、特定客户资产管理组合等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括公司建立交易分配公平的内部控制流程，将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并确保公平交易可操作、可稽核、可持续。公司在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，以技术措施保障公平交易的实现。

监察稽核部定期对公司的不同投资组合（尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合）在连续四个季度期间内、不同时间窗下（1日内、3日内、5日内等）的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

#### **4.3.2 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。

#### **4.3.3 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，且未发现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**

本基金坚持在风险可控的条件下获取投资收益，合理配置基金资产，2018 年股票和债券配置比例平均为 6: 4。

## 2、股票投资

2018 年，中国 GDP 同比增速逐季度下行，全年 GDP 同比增速下滑至 6.6%。在“去杠杆”政策主导下，上半年金融环境收缩特征明显，下半年货币政策边际放松但传导机制仍有待疏通。与此同时，中美贸易战升级风险不断影响市场预期、压制风险偏好。在内外因素压力下，2018 年 A 股呈现震荡下跌特征。投资策略上，本基金坚持价值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，本基金积极参与网下新股配售。全年业绩来看，相比沪深 300 指数 25.31% 的跌幅，本基金股票组合有一定的收益增强效果，但全年投资未能实现盈利。

## 3、债券投资

2018 年，受去杠杆政策下的融资收缩、贸易战影响，经济基本面持续下行，为对冲经济下行压力，央行货币政策发生转向，采用降准、MLF 和 OMO 等方式维护市场流动性“合理充裕”，资金利率中枢稳步下移。在股市大幅调整保持低迷的背景下，债券市场迎来了不错的牛市行情。全年债市收益率在波动中下行，十年期国债和国开收益率分别下行了 65bp 和 118bp。收益率曲线陡峭化，同时 2018 年信用风险事件继续高发，继续扰动债券市场。

本基金债券仓位全年对持仓组合的久期和杠杆控制较为稳健，主要投资于短期限的中高等级信用债及政策性金融债，保持适度的组合久期，在保证产品流动性的同时，收益较为稳定。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，英大灵活配置 A 基金份额净值为 0.9853 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.72%；英大灵活配置 B 基金份额净值为 0.9651 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.58%；同期业绩比较基准收益率为 3.20%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

#### 1、股票投资策略

展望 2019 年，A 股市场风险与机遇并存。近期，固定资产投资、社会消费品零售总额、净出口增速呈现整体趋弱态势，预计 2019 年一、二季度中国 GDP 同比增速仍存下行压力，从而对上半年 A 股企业盈利、投资者风险偏好形成压制因素。但是，宏观政策已开始逆周期调节，财政政策

有望更加积极，货币降准空间开启后，实体经济流动性有望逐渐改善，同时降低市场无风险利率。从中长期来看，积极因素正在逐渐积累。外部方面，2019 年美联储加息将逐渐进入尾声，新兴市场再次受到国际资金关注；中美贸易战演进可能会是大国博弈寻找平衡点的中长期过程，仍将构成 2019 年市场的不确定性因素，但这种不确定性很大程度上已经被包含在市场定价之中。国内方面，宏观政策结构性放松对经济减速发挥托底作用，供给侧改革逐渐取得成效，部分行业产能出清后出现恢复性增长，技术创新带动新兴产业发展。上述短中长期因素决定 A 股市场从筑底到反转的过程可能不会一蹴而就，在 2019 年较长的时段里将维持震荡市特征。但需要重点强调的是，经过 2018 年下跌的 A 股估值已经降至历史较低水平，从国际比较来看亦具备较高的中长期配置价值，中长期资金应该更多看到的是机会。

本基金将继续坚持价值投资理念，以低估值、高分红、有成长前景的股票作为重点投资对象；同时针对上述 2019 年市场预判，适时调整价值股与成长股的配置比例，积极把握防御性板块与进攻性板块的投资配置节奏，灵活参与权益市场结构性机会。行业选择上，前期更多关注受经济周期下行影响相对较小的大消费行业、战略性新兴产业，同时重视低估值金融行业，后期会对风险释放充分的中上游周期性行业予以更多关注，首选估值合理的行业龙头。

## 2、债券投资策略

展望 2019 年，虽然基建托底、地产边际放松，减税降费预计也将一定程度上激发实体经济活力，但外需放缓叠加内需走弱，经济基本面仍将面临下行压力。货币政策在宽信用见效以前仍将维持宽松，流动性合理充裕，但进一步宽松空间有限。预计 2019 年债券市场收益率长端震荡下行，短端跟随资金面波动。

结合我们目前的持仓，2019 年本基金债券仓位配置思路以买入并持有到期为主，在流动性风险可控的前提下，力争为持有人持续实现稳定的回报。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面

覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性：公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工相结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决：通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是继续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和 risk 的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效的得到落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，向监管机构报送监察稽核季报。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

#### 4.7 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。估值委员会主任由分管投资的副总经理或实际履行上述职务的其他人员担任；成员包括基金运营部、监察稽核部的负责人及其他根据议题需要指定的相关人员；委员会秘书由基金运营部负责人担任。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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内未进行利润分配，本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.9 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元的情形。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—英大基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，英大基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，英大基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	瑞华审字[2019]01410039 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了英大灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“英大灵活配置基金”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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，公允反映了英大灵活配置基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于英大灵活配置基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>英大灵活配置基金的基金管理人英大基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括 2018 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会发布的有



责任	<p>关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估英大灵活配置基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算英大灵活配置基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督英大灵活配置基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对英大灵活配置基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我</p>

	<p>们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致英大灵活配置基金不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	杨晓辉 束成林
会计师事务所的地址	北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 9 层
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,179,382.45	4,000,026.07
结算备付金		567,789.89	1,551,230.35
存出保证金		41,845.44	69,221.52
交易性金融资产	7.4.7.2	153,288,197.29	121,780,694.02
其中：股票投资		98,995,711.99	70,346,292.12
基金投资		-	-
债券投资		54,292,485.30	51,434,401.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	9,999,135.00
应收证券清算款		-	950,874.97
应收利息	7.4.7.5	577,490.55	646,828.21
应收股利		-	-
应收申购款		4,515.48	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		157,659,221.10	138,998,010.14
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,999,752.50	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,334.86	-
应付管理人报酬		80,688.78	296,409.43
应付托管费		33,620.32	123,503.94
应付销售服务费		66,718.50	53,520.87
应付交易费用	7.4.7.7	150,740.87	704,950.25
应交税费		13.19	-

应付利息		6,487.81	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	390,000.48	410,000.00
负债合计		5,729,357.31	1,588,384.49
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	157,397,550.03	128,617,892.49
未分配利润	7.4.7.10	-5,467,686.24	8,791,733.16
所有者权益合计		151,929,863.79	137,409,625.65
负债和所有者权益总计		157,659,221.10	138,998,010.14

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 157,397,550.03 份。其中 A 类基金份额净值 0.9853 元，基金份额总额 1,314,622.29 份；B 类基金份额净值 0.9651 元，基金份额总额 156,082,927.74 份。

## 7.2 利润表

会计主体：英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-11,911,626.11	55,745,940.78
1.利息收入		2,978,386.98	21,845,367.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	56,341.34	64,672.04
债券利息收入		2,625,442.16	14,034,487.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		296,603.48	7,746,208.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,173,637.92	43,548,086.49
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,890,241.06	44,167,653.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	988,969.71	-4,648,273.29
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,074,909.27	4,028,706.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-16,293,363.91	-9,647,606.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	229,712.90	92.98
<b>减：二、费用</b>		4,281,773.98	12,180,898.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	959,945.13	7,301,934.56
2. 托管费	7.4.10.2.2	399,977.04	1,605,892.67
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	772,896.62	614,345.54
4. 交易费用	7.4.7.19	1,638,207.80	2,090,604.44
5. 利息支出		60,289.82	43,737.25
其中：卖出回购金融资产支出		60,289.82	43,737.25
6. 税金及附加		5,884.07	-
7. 其他费用	7.4.7.20	444,573.50	524,384.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,193,400.09	43,565,041.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-16,193,400.09	43,565,041.94

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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）	128,617,892.49	8,791,733.16	137,409,625.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,193,400.09	-16,193,400.09
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）	28,779,657.54	1,933,980.69	30,713,638.23
其中：1. 基金申购款	78,506,513.23	3,816,115.06	82,322,628.29
2. 基金赎回款	-49,726,855.69	-1,882,134.37	-51,608,990.06
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)	157,397,550.03	-5,467,686.24	151,929,863.79
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	622,150,763.03	2,787,805.67	624,938,568.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43,565,041.94	43,565,041.94
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)	-493,532,870.54	-37,561,114.45	-531,093,984.99
其中: 1. 基金申购款	297,725.90	8,843.65	306,569.55
2. 基金赎回款	-493,830,596.44	-37,569,958.10	-531,400,554.54
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)	128,617,892.49	8,791,733.16	137,409,625.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>孔旺</u>	<u>朱志</u>	<u>陈畅</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

英大灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2015]687号《关于准予英大灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》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《英大灵活配置混合型发起式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 106,018,863.59 元，已经瑞华会计师事务所验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 106,023,543.68 份，本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和《英大灵活配置混合型发起式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 B 类基金份额。本基金 A 类、B 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、B 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 B 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《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、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）。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。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%。

#### 7.4.2 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 42 项具体会计准则、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

金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《英大灵活配置混合型发起式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。

### 7.4.3 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况及 2018 年度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。

### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有债券投资和股票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，在资产负债表中作为交易性金融资产列报。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。

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各类应付款项等。



#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的证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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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。已实现平准金是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。

#### 7.4.4.9 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交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

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。

### 7.4.4.10 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 0.6% 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 0.25% 的年费率逐日计提。

(3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费按照前一日 B 类基金资产净值的 0.5% 的年费率逐日计提。

(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。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 B 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益有所不同。

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。

### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 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股票投资和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，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[2017]13号《中国证监会关于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》提供的指数收益法估值技术进行估值。

(2) 对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，自2018年3月26日起，本基金持有的流通受限股票按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的会计差错更正。

### 7.4.6 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、债券的转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

根据财政部、国家税务总局《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）的规定，自2018年1月1日起，本基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税及相应的附加税费。

#### 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	3,179,382.45	4,000,026.07
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,179,382.45	4,000,026.07

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	114,007,234.16	98,995,711.99	-15,011,522.17	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	556,702.51	577,485.30	20,782.79
	银行间市场	52,898,220.00	53,715,000.00	816,780.00
	合计	53,454,922.51	54,292,485.30	837,562.79
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	167,462,156.67	153,288,197.29	-14,173,959.38	
项目	上年度末 2017年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	68,105,733.60	70,346,292.12	2,240,558.52	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,597,000.00	1,553,401.90	-43,598.10
	银行间市场	49,958,555.89	49,881,000.00	-77,555.89
	合计	51,555,555.89	51,434,401.90	-121,153.99
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	119,661,289.49	121,780,694.02	2,119,404.53
----	----------------	----------------	--------------

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
项目	上年度末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	9,999,135.00	-
合计	9,999,135.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	538.82	12,461.25
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	281.05	767.91
应收债券利息	576,650.00	628,162.97
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	5,401.76
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	20.68	34.32
合计	577,490.55	646,828.21

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本期末及上年度末，本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	146,156.05	686,350.35
银行间市场应付交易费用	4,584.82	18,599.90
合计	150,740.87	704,950.25

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.48	-
信息披露费	330,000.00	330,000.00
会计师费	60,000.00	80,000.00
合计	390,000.48	410,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

英大灵活配置 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,007,888.56	10,007,888.56
本期申购	1,654,638.88	1,654,638.88
本期赎回（以“-”号填列）	-10,347,905.15	-10,347,905.15
- 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	1,314,622.29	1,314,622.29

金额单位：人民币元

英大灵活配置 B



项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	118,610,003.93	118,610,003.93
本期申购	76,851,874.35	76,851,874.35
本期赎回(以“-”号填列)	-39,378,950.54	-39,378,950.54
- 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	156,082,927.74	156,082,927.74

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

英大灵活配置 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,090,209.29	-295,919.14	794,290.15
本期利润	242,622.74	-743,482.66	-500,859.92
本期基金份额交易产生的变动数	-1,167,931.44	855,141.69	-312,789.75
其中: 基金申购款	245,593.05	-210,900.22	34,692.83
基金赎回款	-1,413,524.49	1,066,041.91	-347,482.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	164,900.59	-184,260.11	-19,359.52

单位: 人民币元

英大灵活配置 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,476,908.52	-3,479,465.51	7,997,443.01
本期利润	-142,658.92	-15,549,881.25	-15,692,540.17
本期基金份额交易产生的变动数	4,804,930.40	-2,558,159.96	2,246,770.44
其中: 基金申购款	9,599,042.74	-5,817,620.51	3,781,422.23
基金赎回款	-4,794,112.34	3,259,460.55	-1,534,651.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,139,180.00	-21,587,506.72	-5,448,326.72

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年1月1日至2018年 12月31日	2017年1月1日至2017年12月31 日
活期存款利息收入	43,674.34	52,896.24
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	11,452.48	10,999.03
其他	1,214.52	776.77
合计	56,341.34	64,672.04

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
卖出股票成交总额	613,545,250.20	899,060,652.68
减：卖出股票成本总额	615,435,491.26	854,892,999.30
买卖股票差价收入	-1,890,241.06	44,167,653.38

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	988,969.71	-4,648,273.29
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	988,969.71	-4,648,273.29

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	274,876,584.17	1,490,606,205.13

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	268,311,705.76	1,466,319,194.82
减：应收利息总额	5,575,908.70	28,935,283.60
买卖债券差价收入	988,969.71	-4,648,273.29

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,074,909.27	4,028,706.40
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,074,909.27	4,028,706.40

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-16,293,363.91	-9,647,606.28
——股票投资	-17,252,080.69	-9,382,214.39
——债券投资	958,716.78	-265,391.89
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-16,293,363.91	-9,647,606.28

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	229,712.90	92.98
合计	229,712.90	92.98

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12
----	-----------------------	------------------------------

	12 月 31 日	月 31 日
交易所市场交易费用	1,632,170.30	2,074,704.44
银行间市场交易费用	6,037.50	15,900.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,638,207.80	2,090,604.44

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	80,000.00
信息披露费	330,000.00	330,000.00
乙类帐户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	18.10	-
银行费用	18,555.40	38,384.38
律师费及公证费	-	40,000.00
合计	444,573.50	524,384.38

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人

国网英大国际控股集团有限公司	基金管理人的股东
英大国际信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国交通建设股份有限公司	基金管理人的股东
航天科工财务有限公司	基金管理人的股东
深圳英大资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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、2018年5月25日，中国证券监督管理委员会核准英大国际信托有限责任公司将所持本基金管理人英大基金管理有限公司49%的股权转让给其母公司国网英大国际控股集团有限公司（证监许可[2018]872号），2018年6月14日，英大基金管理有限公司完成工商变更登记手续。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：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。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：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。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：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。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：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。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	959,945.13	7,301,934.56
其中：支付销售机构的客户维护费	1,932.97	176.30

注：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 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。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 × 0.6% / 当年天数。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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	399,977.04	1,605,892.67

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。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 × 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B	合计
英大基金管理有限公司	-	770,845.57	770,845.57
合计	-	770,845.57	770,845.57
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B	合计
英大基金管理有限公司	-	614,074.78	614,074.78
合计	-	614,074.78	614,074.78

注：A 类基金份额不收取销售服务费；B 类基金份额收取销售服务费，主要用于本基金的持续销售以及基金份额持有人的服务。支付基金管理人的 B 类基金销售服务费按前一日 B 类基金资产净值

0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算方法如下：日 B 类基金份额销售服务费 = 前一日 B 类基金份额资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期内及上年度可比期间，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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
基金合同生效日（2015 年 5 月 7 日）持有的基金份额	9,999,450.00	-
期初持有的基金份额	9,999,450.00	-
期间申购/买入总份额	-	29,681,138.52
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	9,999,450.00	7,500,000.00
期末持有的基金份额	0.00	22,181,138.52
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	14.0900%

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
基金合同生效日（2015 年 5 月 7 日）持有的基金份额	9,999,450.00	-
期初持有的基金份额	9,999,450.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,450.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	7.7700%	-



**7.4.10.4.2 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**

份额单位：份

英大灵活配置 B				
关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
英大国际信托 有限责任公司	118,460,019.74	75.2600%	118,460,019.74	92.1000%
深圳英大资本 管理有限公司	15,213,463.92	9.6700%	0.00	0.0000%
合计	133,673,483.66	84.9300%	118,460,019.74	92.1000%

**7.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,179,382.45	43,674.34	4,000,026.07	52,896.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期无利润分配事项。

**7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股认购	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
603156	养元饮品	2018年2月2日	2019年2月12日	老股转让	56.24	40.68	52,804	2,969,459.41	2,148,066.72	-

注：根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末，未持有需披露的暂时停牌股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 4,999,752.50 元，是以以上债券作为抵押。

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180312	18 进出 12	2019年1月2日	100.23	23,000	2,305,290.00
180006	18 付息国债 06	2019年1月2日	109.23	27,000	2,949,210.00
合计				50,000	5,254,500.00

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末及上年度末，本基金未持有交易所市场债券正回购。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

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内。

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	30,005,000.00
合计	-	30,005,000.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告，以上按短期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。表中列示的未评级债券为超短期融资券。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末未持有同业存单。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	577,485.30	1,553,401.90
AAA 以下	-	9,929,000.00
未评级	-	-
合计	577,485.30	11,482,401.90

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末未持有同业存单。

**7.4.13.3 流动性风险**

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持交易性金融资产均在证券交易场所进行交易，除前文所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

对流动性风险的监控和管理，本基金管理人根据对市场特征和发展形势等方面的分析和判断，并由独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标持续性持续的检测和分析。

**7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析****7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式

《证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的。

##### 7.4.13.4.1 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。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	3,179,382.45	-	-	-	-	-	3,179,382.45
结算备付金	567,789.89	-	-	-	-	-	567,789.89
存出保证金	41,845.44	-	-	-	-	-	41,845.44
交易性金融资产	-	-10,023,000.00	419,109.60	43,850,375.70	98,995,711.99	153,288,197.29	
应收利息	-	-	-	-	-	577,490.55	577,490.55
应收申购款	-	-	-	-	-	4,515.48	4,515.48
资产总计	3,789,017.78	-10,023,000.00	419,109.60	43,850,375.70	99,577,718.02	157,659,221.10	
负债							

卖出回购金融资产款	4,999,752.50	-	-	-	-	-	4,999,752.50
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,334.86	1,334.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	80,688.78	80,688.78
应付托管费	-	-	-	-	-	33,620.32	33,620.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	66,718.50	66,718.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	150,740.87	150,740.87
应付利息	-	-	-	-	-	6,487.81	6,487.81
应交税费	-	-	-	-	-	13.19	13.19
其他负债	-	-	-	-	-	390,000.48	390,000.48
负债总计	4,999,752.50	-	-	-	-	729,604.81	5,729,357.31
利率敏感度缺口	-1,210,734.72	-10,023,000.00	419,109.60	43,850,375.70	98,848,113.21	151,929,863.79	
上年度末 2017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	4,000,026.07	-	-	-	-	-	4,000,026.07
结算备付金	1,551,230.35	-	-	-	-	-	1,551,230.35
存出保证金	69,221.52	-	-	-	-	-	69,221.52
交易性金融资产	-	-49,881,000.00	1,553,401.90	-	-	-70,346,292.12	121,780,694.02
买入返售金融资产	9,999,135.00	-	-	-	-	-	9,999,135.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	950,874.97	950,874.97
应收利息	-	-	-	-	-	646,828.21	646,828.21
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,619,612.94	-49,881,000.00	1,553,401.90	-	-	-71,943,995.30	138,998,010.14
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	296,409.43	296,409.43
应付托管费	-	-	-	-	-	123,503.94	123,503.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	53,520.87	53,520.87
应付交易费用	-	-	-	-	-	704,950.25	704,950.25
其他负债	-	-	-	-	-	410,000.00	410,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,588,384.49	1,588,384.49
利率敏感度缺口	15,619,612.94	-49,881,000.00	1,553,401.90	-	-	-70,355,610.81	137,409,625.65

**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2018年12月31日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	1,996,374.57	72,485.45
市场利率上升 25 个基点	-1,774,152.06	-72,156.74	

**7.4.13.4.2 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。

**7.4.13.4.3 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。

**7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017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	98,995,711.99	65.16	70,346,292.12	51.19
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	54,292,485.30	35.74	51,434,401.90	37.43
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	153,288,197.29	100.90	121,780,694.02	88.62

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	本基金的业绩比较基准变化 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（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,374,128.84	704,723.70
	业绩比较基准下降 5%	-1,265,239.80	-704,723.70

**7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

无			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）

**7.4.14 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。



## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	98,995,711.99	62.79
	其中：股票	98,995,711.99	62.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,292,485.30	34.44
	其中：债券	54,292,485.30	34.44
	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	3,747,172.34	2.38
8	其他各项资产	623,851.47	0.40
9	合计	157,659,221.10	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,637,500.00	4.37
C	制造业	42,443,066.19	27.94
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	-	-
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	-	-
J	金融业	49,915,145.80	32.85

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	98,995,711.99	65.16

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：报告期末（2018年12月31日），本基金未持有港股通股票。

### 8.3 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	601166	兴业银行	750,000	11,205,000.00	7.38
2	600015	华夏银行	1,500,000	11,085,000.00	7.30
3	600000	浦发银行	1,000,000	9,800,000.00	6.45
4	000651	格力电器	270,000	9,636,300.00	6.34
5	600801	华新水泥	550,000	9,196,000.00	6.05
6	601328	交通银行	1,400,000	8,106,000.00	5.34
7	600585	海螺水泥	250,000	7,320,000.00	4.82
8	600741	华域汽车	350,000	6,440,000.00	4.24
9	601318	中国平安	100,000	5,610,000.00	3.69
10	600426	华鲁恒升	300,000	3,621,000.00	2.38
11	600508	上海能源	350,000	3,377,500.00	2.22
12	600123	兰花科创	500,000	3,260,000.00	2.15
13	600016	民生银行	500,000	2,865,000.00	1.89
14	600056	中国医药	207,718	2,611,015.26	1.72
15	603156	养元饮品	52,804	2,148,066.72	1.41
16	600409	三友化工	250,000	1,430,000.00	0.94
17	600919	江苏银行	200,000	1,194,000.00	0.79
18	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.03
19	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.03

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601318	中国平安	52,201,078.16	37.99
2	601088	中国神华	45,954,986.29	33.44
3	600741	华域汽车	40,216,299.24	29.27
4	600585	海螺水泥	35,244,033.94	25.65
5	600123	兰花科创	34,940,259.22	25.43
6	601939	建设银行	34,912,719.00	25.41
7	000651	格力电器	29,228,554.00	21.27
8	600498	烽火通信	23,117,810.00	16.82
9	601818	光大银行	21,884,000.00	15.93
10	601668	中国建筑	21,064,248.20	15.33
11	601006	大秦铁路	19,681,904.00	14.32
12	601607	上海医药	19,610,551.26	14.27
13	600801	华新水泥	19,440,458.38	14.15
14	601186	中国铁建	18,428,402.48	13.41
15	600104	上汽集团	17,183,195.00	12.51
16	600056	中国医药	15,934,490.22	11.60
17	600522	中天科技	14,329,145.00	10.43
18	600919	江苏银行	11,321,000.00	8.24
19	600016	民生银行	10,964,040.00	7.98
20	601328	交通银行	10,887,000.00	7.92
21	600309	万华化学	10,860,026.00	7.90
22	601628	中国人寿	10,589,460.00	7.71
23	600782	新钢股份	8,058,151.00	5.86
24	601166	兴业银行	7,871,000.00	5.73
25	600383	金地集团	7,134,400.00	5.19
26	600089	特变电工	7,021,128.10	5.11
27	600487	亨通光电	6,515,058.20	4.74
28	601336	新华保险	6,432,680.55	4.68

29	603369	今世缘	6,069,300.00	4.42
30	000900	现代投资	6,055,870.00	4.41
31	600409	三友化工	6,054,636.50	4.41
32	600015	华夏银行	6,025,551.00	4.39
33	600373	中文传媒	5,650,487.11	4.11
34	600000	浦发银行	5,598,800.00	4.07
35	600271	航天信息	5,550,427.00	4.04
36	600352	浙江龙盛	5,406,000.00	3.93
37	601398	工商银行	5,120,700.00	3.73
38	002396	星网锐捷	5,033,100.00	3.66
39	000623	吉林敖东	4,780,500.00	3.48
40	601601	中国太保	4,476,412.00	3.26
41	600426	华鲁恒升	4,101,405.00	2.98
42	601225	陕西煤业	4,091,000.00	2.98
43	600508	上海能源	3,870,819.00	2.82
44	600216	浙江医药	3,521,732.00	2.56
45	600177	雅戈尔	3,231,867.60	2.35
46	603156	养元饮品	2,969,459.41	2.16

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601318	中国平安	48,701,201.85	35.44
2	601088	中国神华	47,069,073.79	34.25
3	601939	建设银行	34,729,732.20	25.27
4	600741	华域汽车	32,291,271.04	23.50
5	600123	兰花科创	30,152,219.64	21.94
6	601668	中国建筑	29,088,859.60	21.17
7	600585	海螺水泥	27,471,609.58	19.99
8	600104	上汽集团	23,410,118.68	17.04
9	600498	烽火通信	22,486,193.94	16.36
10	601818	光大银行	21,495,000.00	15.64
11	601607	上海医药	19,757,782.88	14.38
12	601006	大秦铁路	19,336,769.64	14.07
13	600016	民生银行	18,194,800.00	13.24

14	601186	中国铁建	17,690,605.00	12.87
15	000651	格力电器	16,998,381.00	12.37
16	600522	中天科技	14,225,321.25	10.35
17	600056	中国医药	13,582,376.00	9.88
18	601628	中国人寿	10,722,849.23	7.80
19	600919	江苏银行	9,910,993.00	7.21
20	600373	中文传媒	9,198,711.46	6.69
21	600801	华新水泥	9,110,328.00	6.63
22	600309	万华化学	8,243,362.64	6.00
23	601166	兴业银行	7,861,500.00	5.72
24	600782	新钢股份	7,818,605.00	5.69
25	600383	金地集团	7,126,034.00	5.19
26	600089	特变电工	6,907,915.74	5.03
27	601336	新华保险	6,489,352.00	4.72
28	600487	亨通光电	6,440,115.89	4.69
29	603369	今世缘	6,181,264.72	4.50
30	600271	航天信息	5,677,061.00	4.13
31	000900	现代投资	5,518,000.00	4.02
32	600015	华夏银行	5,272,018.00	3.84
33	002396	星网锐捷	5,054,082.00	3.68
34	601398	工商银行	4,931,600.00	3.59
35	000623	吉林敖东	4,638,100.00	3.38
36	601601	中国太保	4,385,750.00	3.19
37	600409	三友化工	4,291,018.00	3.12
38	600352	浙江龙盛	4,232,000.00	3.08
39	601225	陕西煤业	4,153,212.00	3.02
40	600270	外运发展	3,819,241.82	2.78
41	600216	浙江医药	3,367,378.00	2.45
42	600000	浦发银行	3,317,609.80	2.41
43	600177	雅戈尔	3,259,758.60	2.37

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。

#### 8.4.3 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	661,336,991.82
卖出股票收入（成交）总额	613,545,250.20

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。

### 8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	43,692,000.00	28.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,023,000.00	6.60
	其中：政策性金融债	10,023,000.00	6.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	577,485.30	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,292,485.30	35.74

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	180006	18 付息国债 06	400,000	43,692,000.00	28.76
2	180312	18 进出 12	100,000	10,023,000.00	6.60
3	113008	电气转债	3,990	419,109.60	0.28
4	127005	长证转债	1,610	158,375.70	0.10

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：本报告期末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有资产支持证券。

### 8.8 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

注：报告期末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持贵金属。

### 8.9 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

注：报告期末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金不参与股指期货投资。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不参与股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金不参与国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形

经查询上海证券交易所、深圳证券交易所、中国货币网等公开信息披露平台，除以下情形，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

浦发银行列本产品持仓前十名股票中，浦发银行成都分行于 2018 年 1 月 18 日，被银监会四川监管局采取行政处罚决定，对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46,175 万元人民币。此外，对成都分行原行长、2 名副行长、1 名部门负责人和 1 名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高

级管理人员任职资格、警告及罚款。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期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。

### 8.12.3 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	41,845.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	577,490.55
5	应收申购款	4,515.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	623,851.47

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113008	电气转债	419,109.60	0.28
2	127005	长证转债	158,375.70	0.10

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 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。



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
英大灵活配置 A	401	3,278.36	0.00	0.00%	1,314,622.29	100.00%
英大灵活配置 B	107	1,458,718.95	155,854,622.18	99.85%	228,305.56	0.15%
合计	508	309,837.70	155,854,622.18	99.02%	1,542,927.85	0.98%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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）。

### 9.2 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	英大灵活配置 A	3,437.09	0.0022%
	英大灵活配置 B	165,227.53	0.1050%
	合计	168,664.62	0.1072%

### 9.3 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	英大灵活配置 A	0~10
	英大灵活配置 B	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	英大灵活配置 A	0~10
	英大灵活配置 B	10~50

	合计	10~50
--	----	-------

#### 9.4 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	22,181,138.52	14.09	9,999,450.00	6.35	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	3年
基金经理等人员	161,705.13	0.10	1,100.04	0.00	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	3年
其他	4,960.32	0.00	4,960.32	0.00	3年
合计	22,347,803.97	14.20	10,005,510.36	6.36	3年

## § 10 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
基金合同生效日（2015 年 5 月 7 日）基金份额总额	10,005,501.63	96,018,042.05
本报告期期初基金份额总额	10,007,888.56	118,610,003.93
本报告期期间基金总申购份额	1,654,638.88	76,851,874.35
减:本报告期期间基金总赎回份额	10,347,905.15	39,378,950.54
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,314,622.29	156,082,927.74

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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 2018 年 1 月 30 日发布公告，自 2018 年 1 月 27 日起，宗宽广因个人原因不再担任公司督察长职务。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 2 月 23 日发布公告，自 2018 年 2 月 14 日起，公司总经理朱志代任督察长。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 6 日起，柴元春正式担任英大基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 7 月 26 日发布公告，自 2018 年 7 月 25 日起，刘轶任督察长，总经理朱志不再代任督察长。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 11 月 30 日发布公告，自 2018 年 11 月 28 日起，倪枫担任英大基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 12 月 14 日发布公告，自 2018 年 12 月 12 日起，范育晖担任英大基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，基金托管人聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 11.3 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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

基金投资策略没有发生改变。

### 11.5 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，报告期内本基金应支付给瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用人民币 60,000 元。该审计机构为本基金提供审计服务的连续

年限为 4 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2016 年 10 月，公司未按期报送总经理离任审计报告。北京证监局于 2018 年 12 月 27 日对公司给予警告，并处以 1 万元罚款。前述事项不属于重大违法违规行为，与公募基金、专户业务无关，不影响公司产品投资运作，且发生以来，公司立行整改，严格按照要求，加强内部管理，及时报送有关材料，进一步提升了内控合规水平。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
光大证券	2	560,272,805.63	44.11%	409,727.92	45.23%	-
东兴证券	1	322,473,800.13	25.39%	235,825.22	26.03%	-
华林证券	2	311,198,334.25	24.50%	227,578.28	25.12%	-
国联证券	1	76,115,655.42	5.99%	32,828.64	3.62%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-

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。

### 11.7.2 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
光大证券	1,837,197.56	82.14%	306,000,000.00	100.00%	-	-
东兴证券	398,640.90	17.82%	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	930.09	0.04%	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	英大基金关于旗下基金 2017 年年度最后一个市场交易日资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 1 月 2 日
2	英大灵活配置关于变更基金经理的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 1 月 3 日
3	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 1 月 19 日
4	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 1 月 30 日
5	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 2 月 23 日
6	关于英大基金管理有限公司参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 2 月 28 日
7	英大基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订旗下开放式基金基金合	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 3 月 28 日

	同的公告		
8	英大基金管理有限公司关于旗下基金持有的流通受限股票估值方法调整的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年3月28日
9	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年度报告及摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年3月30日
10	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年4月23日
11	英大基金管理有限公司关于旗下开放式基金开通基金转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年4月24日
12	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年6月8日
13	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)及摘要(2018年第1号)	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年6月15日
14	英大基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年6月20日
15	英大基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年6月25日
16	英大基金关于旗下基金 2018 年半年度最后一个市场交易日资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年7月2日
17	英大基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年7月2日
18	英大基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年7月2日
19	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年7月19日
20	英大基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018年7月23日
21	英大基金管理有限公司高级	中国证券报、证券时	2018年7月26日

	管理人员变更公告	报、上海证券报及公司网站	
22	英大基金管理有限公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 8 月 1 日
23	英大基金管理有限公司关于增加招商证券股份有限公司为公司旗下部分证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 8 月 17 日
24	关于英大基金管理有限公司因系统升级维护暂停网上交易、手机 APP 服务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 8 月 27 日
25	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告及摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 8 月 28 日
26	英大基金管理有限公司关于增加泰诚财富（大连）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 8 月 31 日
27	英大基金管理有限公司关于 App 暂停银联通道光大银行开户及申购等业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 9 月 3 日
28	英大基金管理有限公司关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 9 月 6 日
29	英大基金管理有限公司关于增加开源证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 9 月 11 日
30	英大基金管理有限公司关于参加开源证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 9 月 11 日
31	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告及摘要更正公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 10 月 9 日
32	关于网上交易、手机 APP 因系统升级维护暂停旗下全部基金交易服务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 10 月 19 日
33	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 10 月 24 日
34	英大基金管理有限公司关于增加苏宁基金销售有限公司	中国证券报、证券时报、上海证券报及公	2018 年 10 月 29 日



	为代销机构的公告	司网站	
35	英大基金管理有限公司关于增加万联证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 11 月 9 日
36	英大基金管理有限公司关于旗下基金参加万联证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 11 月 9 日
37	关于网上交易、手机 APP 因系统升级维护暂停旗下全部基金交易服务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 11 月 29 日
38	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 11 月 30 日
39	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 12 月 14 日
40	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书及摘要(更新)(2018 年第 2 号)	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2018 年 12 月 18 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2018. 1. 1-2018. 12. 31	118, 460, 019. 70	0. 00	0. 00	118, 460, 019. 70	75. 26%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

- (1) 赎回申请延期办理的风险  
持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。
- (2) 基金净值大幅波动的风险  
当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。
- (3) 基金规模较小导致的风险  
高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。
- (4) 提前终止基金合同的风险  
高比例投资者赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。
- (5) 对重大事项进行投票表决时面临的风险  
当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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》

《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

报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 13.2 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

### 13.3 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

2019 年 3 月 28 日