

# 英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 26 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 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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>6</b>
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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
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.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
7.7 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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>

---

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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

## § 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	
场内简称	-	
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	97,998,735.91 份	
基金合同存续期	-	
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:	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	003446	003447
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	97,699,455.80 份	299,280.11 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。	
	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘轶	李帅帅
	联系电话	010-59112020	0755-25878287
	电子邮箱	liuyi@ydamc.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
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
邮政编码		100020	518001
法定代表人		马晓燕	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	-
基金半年度报告备置地点	-

### 2.5 其他相关资料

### § 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	5,619,223.76	-13,904.36
本期利润	14,653,990.92	-60,286.31
加权平均基金份额本期利润	0.2696	-0.1959
本期加权平均净值利润率	25.00%	-17.10%
本期基金份额净值增长率	17.29%	18.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	8,223,952.46	22,942.23
期末可供分配基金份额利润	0.0842	0.0767
期末基金资产净值	105,923,408.26	322,222.34
期末基金份额净值	1.0842	1.0767
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	18.30%	17.58%

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	0.72%	0.12%	1.78%	0.62%	-1.06%	-0.50%
过去三个月	-4.35%	0.86%	-2.24%	0.81%	-2.11%	0.05%
过去六个月	17.29%	0.92%	12.80%	0.80%	4.49%	0.12%



过去一年	3.65%	1.18%	5.42%	0.77%	-1.77%	0.41%
自基金合同生效起至今	18.30%	0.93%	-3.57%	0.60%	21.87%	0.33%

## 英大睿鑫 C

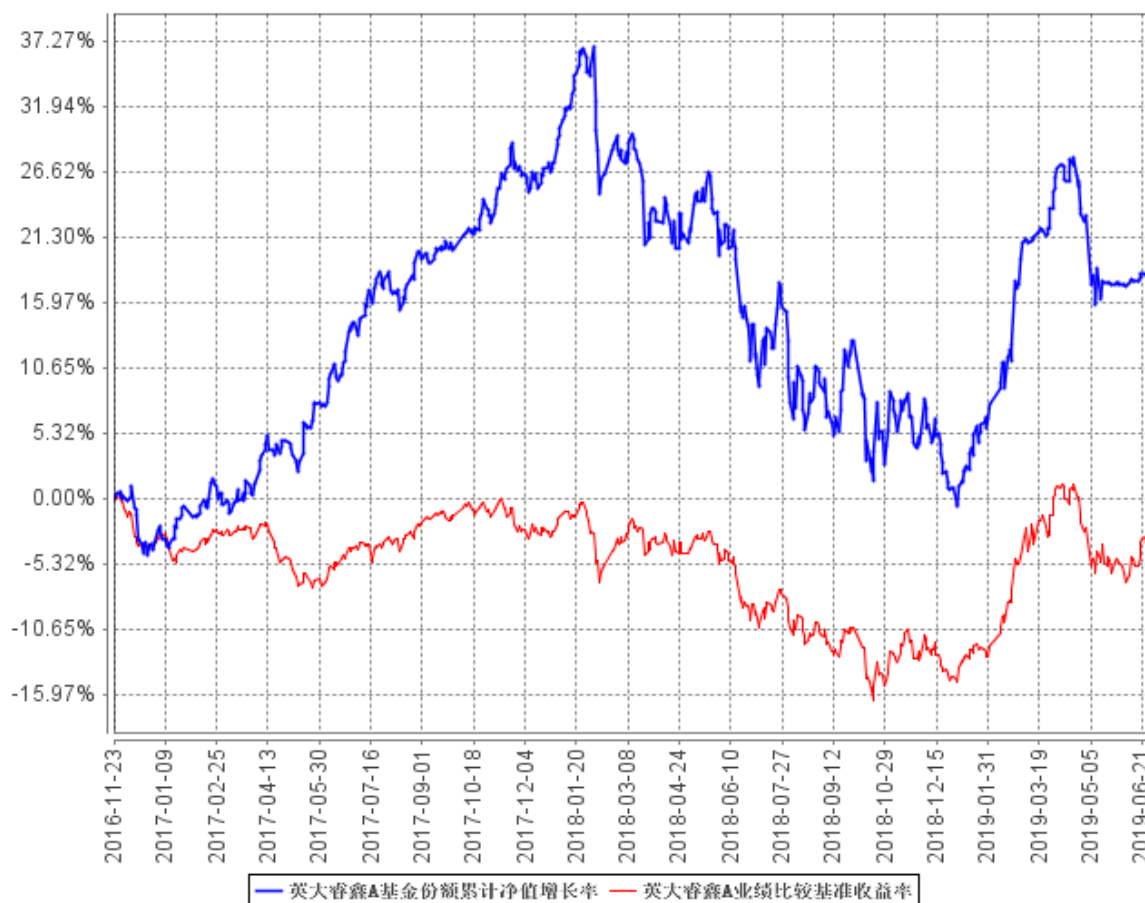
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.71%	0.11%	1.78%	0.62%	-1.07%	-0.51%
过去三个月	-4.10%	0.87%	-2.24%	0.81%	-1.86%	0.06%
过去六个月	18.01%	0.92%	12.80%	0.80%	5.21%	0.12%
过去一年	4.18%	1.18%	5.42%	0.77%	-1.24%	0.41%
自基金合同生效起至今	17.58%	0.92%	-3.57%	0.60%	21.15%	0.32%

注：①本基金合同于 2016 年 11 月 23 日生效；

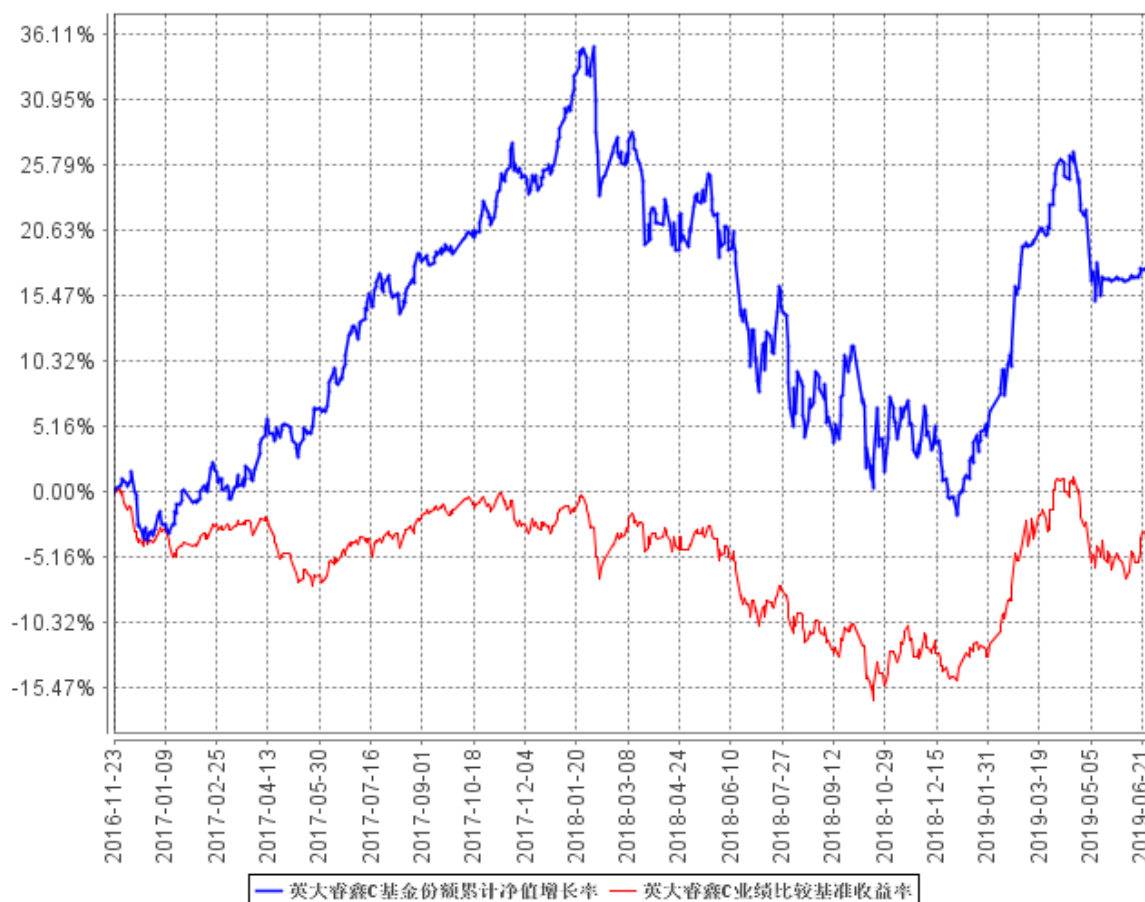
②本基金的业绩比较基准为：50%×中证全指指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

### 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



注：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。

### 3.3 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

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 2019 年 6 月 30 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	2016 年 11 月 23 日	-	19	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，英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金基金经理。
管瑞龙	本基金基金经理	2017年2月17日	-	11	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，英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

## 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》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不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

整体资产配置，2019 年上半年国内生产总值按可比价格计算同比增速 6.3%，分季度看，一季度同比增长 6.4%，二季度增长 6.2%，呈现稳中略降态势；在上半年不利的外部贸易形势和全球经济下行压力逐渐显现情况下，中国经济 2019 年上半年总体表现出韧性，下行趋势可控。因此，本基金采取稳健的整体资产配置策略，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。

股票投资，2019 年上半年 A 股超跌反弹后有所回落呈现震荡上行特征。超跌反弹主要表现在一季度，一方面受益于经济开局良好，另一方面受益于估值修复，上证 50、沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股与中小创板块轮动上行。二季度伴随经济下行和中美贸易摩擦不确定性上升，A 股震荡回落，回吐部分涨幅。上半年本基金坚持：以机构投资理念配置稳健增值资产，低估值、高分红、有成长前景的大盘蓝筹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。

货币与债券市场投资，由于国内信用风险事件增多，加之中美贸易摩擦不确定性，信用债市场存在较多不确定性，报告期本基金债券投资全部为中短久期国债，同时采取国债逆回购操作进行现金管理。

基金投资绩效，上半年，A 股市场主要指数上涨，沪深 300 指数涨幅 27.07%，本基金单位净值涨幅 17.29%，投资者的资产得到保值增值。

本基金于 2019 年 6 月 11 日进行 2019 年第一次分红。英大睿鑫混合 A 类每 10 份基金份额配送 0.5 元，英大睿鑫混合 C 类每 10 份基金份额配送 0.5 元。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，英大睿鑫 A 基金份额净值为 1.0842 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.29%；英大睿鑫 C 基金份额净值为 1.0767 元，本报告期基金份额净值增长率为 18.01%；同期业绩比较基准收益率为 12.80%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年实际 GDP 同比增速逐季下行，预计下半年经济增速稳中趋降，全年实际 GDP 同比增速可能在 6.0%-6.3% 区间；考虑到 2018 年 A 股业绩增速为-1.9% 的低基数效应，预计 2019 年全年 A 股上市公司业绩同比增速接近或高于 2019 年实际 GDP 增速。下半年政策面将根据经济下行压力的程度采取逆周期操作，积极的财政政策与稳健的货币政策都有一定放松政策空间，财政政策空间相对更大。

鉴于这样宏观经济与政策环境，同时考虑到目前权益市场的估值水平基本修复至中位数附近，由估值所引发的修复动力正在衰减；基本面和上市公司实际的业绩增长情况正逐渐受到机构投资者的不断重视，也会成为接下来基金净值增长和相对收益的重要影响因素。预计下半年，股票市场收益来源于上市公司业绩增长和部分行业结构性估值提升。

投资策略上，在指数未出现大幅上涨、市场估值水平合理的环境，本基金股票仓位基本保持稳定，股票组合仍将以低估值、高分红、有成长前景的股票作为重点投资对象，根据市场涨跌节奏，适时调整价值股与成长股的配置比例。股票选择方面，立足于中长期中国产业结构和人口结构的变动，加大消费与科技行业研究力度，精选具有大空间、高壁垒，强优势的龙头企业，力争获取超额收益。积极参与一级市场新股配售，获取低风险收益。

#### 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金实施了利润分配，2019 年第一次收益分配基准日为 6 月 11 日，并于 2019 年 6 月 19 日进行现金红利发放，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 4,434,597.3 元，再投资形式发放总额为：430,465.86 元，本期利润分配合计为 4,865,063.16 元；本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 15,505.87 元，再投资形式发放总额为：102.94 元，本期利润分配合计为 15,608.81 元，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

#### 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，本基金出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。自 2019 年 4 月 1 日-2019 年 5 月 15 日，本基金基金资产净值出现连续低于五千万元的情形，已触发《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十九条，公司已报告中国证监会。



## § 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，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，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。

本报告期内本基金实施了利润分配，2019 年第一次收益分配基准日为 6 月 11 日，并于 2019 年 6 月 19 日进行现金红利发放，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 4,434,597.3 元，再投资形式发放总额为：430,465.86 元，本期利润分配合计为 4,865,063.16 元；本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 15,505.87 元，再投资形式发放总额为：102.94 元，本期利润分配合计为 15,608.81 元，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

### 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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	21,979,958.98	4,199,988.00
结算备付金		1,008,986.29	496,180.15
存出保证金		117,864.51	146,278.15
交易性金融资产	6.4.7.2	40,975,189.80	72,002,696.73
其中：股票投资		10,686,967.00	72,002,696.73
基金投资		-	-
债券投资		30,288,222.80	-
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	42,000,000.00	-
应收证券清算款		19,895.34	-
应收利息	6.4.7.5	354,816.05	1,262.40
应收股利		-	-
应收申购款		250.00	600.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		106,456,960.97	76,847,005.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		902.23	18.52
应付管理人报酬		66,867.72	65,275.05
应付托管费		13,373.52	13,055.04
应付销售服务费		57.24	7.75
应付交易费用	6.4.7.7	60,059.60	90,520.33

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	70,070.06	160,000.01
负债合计		211,330.37	328,876.70
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	97,998,735.91	79,115,441.77
未分配利润	6.4.7.10	8,246,894.69	-2,597,313.04
所有者权益合计		106,245,630.60	76,518,128.73
负债和所有者权益总计		106,456,960.97	76,847,005.43

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，英大睿鑫 A 净值人民币 1.0842 元，基金份额总额 97,699,455.80 份，英大睿盛 C 净值人民币 1.0767 元，基金份额总额 299,280.11 份，总份额合计 97,998,735.91 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		15,537,658.99	-5,489,503.65
1.利息收入		288,757.78	781,179.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	53,111.24	88,461.02
债券利息收入		111,156.83	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		124,489.71	692,718.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,256,364.58	10,232,205.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,032,797.78	8,852,257.29
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	223,566.80	1,379,947.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,988,385.21	-16,502,893.56
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	4,151.42	5.21
<b>减：二、费用</b>		943,954.38	2,666,430.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	221,355.89	880,718.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	44,271.16	176,143.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	351.14	74,713.56
4. 交易费用	6.4.7.19	607,906.13	1,455,513.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	70,070.06	79,341.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,593,704.61	-8,155,933.78
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,593,704.61	-8,155,933.78

### 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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	79,115,441.77	-2,597,313.04	76,518,128.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,593,704.61	14,593,704.61
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）	18,883,294.14	1,131,175.09	20,014,469.23
其中：1.基金申购款	99,136,763.59	13,041,842.64	112,178,606.23
2.基金赎回款	-80,253,469.45	-11,910,667.55	-92,164,137.00

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)	-	-4,880,671.97	-4,880,671.97
五、期末所有者权益(基金净值)	97,998,735.91	8,246,894.69	106,245,630.60
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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)	286,345,905.05	74,944,281.16	361,290,186.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,155,933.78	-8,155,933.78
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)	-135,929,950.88	-45,899,609.99	-181,829,560.87
其中：1.基金申购款	71,344,830.52	18,675,573.06	90,020,403.58
2.基金赎回款	-207,274,781.40	-64,575,183.05	-271,849,964.45
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)	-	-6,674,324.11	-6,674,324.11
五、期末所有者权益(基金净值)	150,415,954.17	14,214,413.28	164,630,367.45

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：

_____ 马晓燕	_____ 朱志	_____ 李婷
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 200,041,845.69 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 200,053,856.09 份基金份额(其中英大睿鑫 A 基金份额为 14,039.74 份,英大睿鑫 C 基金份额为 200,039,816.35 份),认购资金利息折合 12,010.4 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 12,006.35 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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的,基金管理人在履

行适当程序后，可以做出相应调整。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证券监督管理委员会(以下简称“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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况及 2019 年 1 月 1 日起至 2019 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

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。

##### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金目前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变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

(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；

(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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 所转移金融资产的账面价值

(2) 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。



与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(未弥补亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的

差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

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**

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。

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 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。

#### **6.4.4.13 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：

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。

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。

### **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**

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《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 [2015] 101 号《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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《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[2016]36 号文《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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(2)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品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取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。免征增值税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)对基金从上市公司取得的股息、红利所得对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；

解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(5) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	21,979,958.98
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：	21,979,958.98

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	10,171,819.00	10,686,967.00	515,148.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	30,194,172.00	30,288,222.80	94,050.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	30,194,172.00	30,288,222.80	94,050.80
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	40,365,991.00	40,975,189.80	609,198.80

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末（2019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 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	42,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	42,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 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。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	4,873.91
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	454.00
应收债券利息	349,435.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	53.10
合计	354,816.05

### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
应收申购款	250.00
合计	250.00

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	60,059.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	60,059.60

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	70,070.06
合计	70,070.06

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	79,049,967.01	79,049,967.01
本期申购	97,885,447.23	97,885,447.23
本期赎回(以“-”号填列)	-79,235,958.44	-79,235,958.44
- 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	97,699,455.80	97,699,455.80
-----	---------------	---------------

金额单位：人民币元

英大睿鑫 C		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	65,474.76	65,474.76
本期申购	1,251,316.36	1,251,316.36
本期赎回(以“-”号填列)	-1,017,511.01	-1,017,511.01
- 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	299,280.11	299,280.11

## 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	6,442,987.17	-9,037,354.29	-2,594,367.12
本期利润	5,619,223.76	9,034,767.16	14,653,990.92
本期基金份额交易产生的变动数	7,320,928.79	-6,291,536.97	1,029,391.82
其中：基金申购款	19,614,412.29	-6,813,965.05	12,800,447.24
基金赎回款	-12,293,483.50	522,428.08	-11,771,055.42
本期已分配利润	-4,865,063.16	-	-4,865,063.16
本期末	14,518,076.56	-6,294,124.10	8,223,952.46

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	4,485.68	-7,431.60	-2,945.92
本期利润	-13,904.36	-46,381.95	-60,286.31
本期基金份额交易产生的变动数	67,165.27	34,618.00	101,783.27
其中：基金申购款	311,720.24	-70,324.84	241,395.40
基金赎回款	-244,554.97	104,942.84	-139,612.13
本期已分配利润	-15,608.81	-	-15,608.81



本期末	42,137.78	-19,195.55	22,942.23
-----	-----------	------------	-----------

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	47,260.84
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	4,722.47
其他	1,127.93
合计	53,111.24

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	254,122,671.07
减：卖出股票成本总额	248,089,873.29
买卖股票差价收入	6,032,797.78

#### 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

注：本报告期（2019年1月1日至2019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

注：本报告期及上年度可比期间，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

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。

##### 6.4.7.13.4 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。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本报告期及上年度可比区间，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**

注：本报告期及上年度可比期间，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**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 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。

**6.4.7.14.4 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。

**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**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本报告期，本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	223,566.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	223,566.80

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	8,988,385.21
——股票投资	8,894,334.41

——债券投资	94,050.80
——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	8,988,385.21

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	4,151.42
合计	4,151.42

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	607,906.13
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	607,906.13

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	40,317.28
合计	70,070.06

#### 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

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的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

-

##### 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
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
平安银行股份有限公司	基金托管人
北京英大资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

##### 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

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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

**6.4.10.1.4 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。

**6.4.10.1.5 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。

**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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	221,355.89	880,718.15
其中：支付销售机构的客户维护费	473.54	-

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。

**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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	44,271.16	176,143.61

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。

**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 2019年1月1日至2019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	-	105.87	105.87
合计	-	105.87	105.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	-	74,713.56	74,713.56
合计	-	74,713.56	74,713.56

注：A类基金份额不收取销售服务费；C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C类基金销售服务费按前一日C类基金资产净值0.20%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。

#### 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

注：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

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
基金合同生效日（2016年11月23日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	4,504,059.10	-
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	4,504,059.10	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.6000%	-

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 23 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

#### 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

份额单位：份

英大睿鑫 A				
关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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
北京英大资本 管理有限公司	4,504,059.10	4.6100%	0.00	0.0000%

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
平安银行股份有 限公司	21,979,958.98	47,260.84	8,657,036.68	49,857.65

注：本基金通过“平安银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2019 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 1,126,850.8 元。（2018 年 6 月 30 日：人民币 1,529,981.24 元）

**6.4.10.6 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**

本期末及上年度末，本基金无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

## 英大睿鑫 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019年6 月18日	-	2019年6 月18日	0.5000	4,434,597.30	430,465.86	4,865,063.16	
合计	-	-	-	0.5000	4,434,597.30	430,465.86	4,865,063.16	

## 英大睿鑫 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019年6 月18日	-	2019年6 月18日	0.5000	15,505.87	102.94	15,608.81	
合计	-	-	-	0.5000	15,505.87	102.94	15,608.81	

**6.4.12 期末（2019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**

注：本基金本期末（2019年6月30日）未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。



#### 6.4.12.2 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（2019 年 6 月 30 日）未持有需披露的暂时停牌股票。

#### 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

本基金本期期末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

本期末及上年度末，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

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。

##### 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。

##### 6.4.13.2 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。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：债券投资全部为国债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：债券投资全部为国债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

### 6.4.13.3 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。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。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所上市，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，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：本报告期末，金融资产为股票、国债及现金，无金融负债。

#### 6.4.13.3.2 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

本基金投资组合所持有大部分证券在证券交易所上市，且本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中的 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内的流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 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最大的风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的。

##### 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。报告期本基金债券投资全部为中短久期国债。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	21,979,958.98	-	-	-	-	-	21,979,958.98
结算备付金	1,008,986.29	-	-	-	-	-	1,008,986.29
存出保证金	117,864.51	-	-	-	-	-	117,864.51
交易性金融资产	-	-	9,992,000.00	20,296,222.80	-	10,686,967.00	40,975,189.80
买入返售金融资产	42,000,000.00	-	-	-	-	-	42,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,895.34	19,895.34
应收利息	-	-	-	-	-	354,816.05	354,816.05

应收申购款	-	-	-	-	-	250.00	250.00
资产总计	65,106,809.78	-	9,992,000.00	20,296,222.80	-	11,061,928.39	106,456,960.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	902.23	902.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	66,867.72	66,867.72
应付托管费	-	-	-	-	-	13,373.52	13,373.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-	57.24	57.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	60,059.60	60,059.60
其他负债	-	-	-	-	-	70,070.06	70,070.06
负债总计	-	-	-	-	-	211,330.37	211,330.37
利率敏感度缺口	65,106,809.78	-	9,992,000.00	20,296,222.80	-	10,850,598.02	106,245,630.60
上年度末 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	4,199,988.00	-	-	-	-	-	4,199,988.00
结算备付金	496,180.15	-	-	-	-	-	496,180.15
存出保证金	146,278.15	-	-	-	-	-	146,278.15
交易性金融资产	-	-	-	-	-	72,002,696.73	72,002,696.73
应收利息	-	-	-	-	-	1,262.40	1,262.40
应收申购款	-	-	-	-	-	600.00	600.00
资产总计	4,842,446.30	-	-	-	-	72,004,559.13	76,847,005.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	18.52	18.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	65,275.05	65,275.05
应付托管费	-	-	-	-	-	13,055.04	13,055.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7.75	7.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	90,520.33	90,520.33
其他负债	-	-	-	-	-	160,000.01	160,000.01
负债总计	-	-	-	-	-	328,876.70	328,876.70
利率敏感度缺口	4,842,446.30	-	-	-	-	71,675,682.43	76,518,128.73

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：报告期本基金债券投资全部为中短久期国债。

#### 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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	10,686,967.00	10.06	72,002,696.73	94.10
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	30,288,222.80	28.51	-	-
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	40,975,189.80	38.57	72,002,696.73	94.10

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	沪深 300 指数上升或下降 5%		
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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	534,348.00	6,381,876.12
沪深 300 指数下降 5%	-534,348.00	-6,381,876.12	

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

风险价值 VaR(Value at Risk)的含义是指市场正常波动下，某一金融资产或证券组合的最大可能损失。更确切的说，是指在一定的置信水平下，某一金融资产或证券组合在未来一定的一段时间内的最大可能损失。

假设	1. 置信区间 95%		
	2. 观察期 6 个月		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	1,977,991	106,239,526.46	-
	合计	-	-

#### **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	10,686,967.00	10.04
	其中：股票	10,686,967.00	10.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,288,222.80	28.45
	其中：债券	30,288,222.80	28.45
	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	42,000,000.00	39.45
	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	22,988,945.27	21.59
8	其他各项资产	492,825.90	0.46
9	合计	106,456,960.97	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	-	-
C	制造业	5,051,165.00	4.75
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	5,635,802.00	5.30
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	10,686,967.00	10.06

### 7.2.2 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（2019年6月30日），本基金未持有港股通股票。

### 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	601398	工商银行	290,000	1,708,100.00	1.61
2	600031	三一重工	94,800	1,239,984.00	1.17
3	600690	青岛海尔	69,500	1,201,655.00	1.13
4	600036	招商银行	33,000	1,187,340.00	1.12
5	600519	贵州茅台	1,200	1,180,800.00	1.11
6	601166	兴业银行	60,400	1,104,716.00	1.04
7	600438	通威股份	72,100	1,013,726.00	0.95
8	601939	建设银行	89,000	662,160.00	0.62
9	601336	新华保险	11,200	616,336.00	0.58
10	600585	海螺水泥	10,000	415,000.00	0.39
11	600030	中信证券	15,000	357,150.00	0.34

### 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	600741	华域汽车	10,417,916.00	13.61
2	601607	上海医药	8,083,701.52	10.56
3	601336	新华保险	7,499,488.00	9.80
4	600585	海螺水泥	6,784,570.60	8.87
5	600487	亨通光电	6,419,828.00	8.39
6	600104	上汽集团	6,251,132.95	8.17
7	601233	桐昆股份	6,151,896.50	8.04
8	601998	中信银行	5,407,000.00	7.07
9	600596	新安股份	4,814,700.00	6.29
10	600056	中国医药	4,509,558.36	5.89
11	601328	交通银行	4,425,000.00	5.78
12	600048	保利地产	4,221,485.00	5.52
13	601186	中国铁建	4,088,279.00	5.34
14	000926	福星股份	4,065,300.00	5.31
15	601818	光大银行	4,013,000.00	5.24
16	002396	星网锐捷	3,683,795.51	4.81
17	601169	北京银行	3,657,000.00	4.78
18	601668	中国建筑	3,621,000.00	4.73
19	000623	吉林敖东	3,302,700.00	4.32
20	002146	荣盛发展	3,270,960.00	4.27
21	600859	王府井	3,209,193.00	4.19
22	000776	广发证券	3,199,100.00	4.18
23	600260	凯乐科技	3,003,584.00	3.93
24	600373	中文传媒	2,949,087.00	3.85
25	000830	鲁西化工	2,527,000.00	3.30
26	000028	国药一致	2,446,489.00	3.20
27	601288	农业银行	2,285,000.00	2.99
28	000651	格力电器	2,115,828.00	2.77
29	000938	紫光股份	2,088,335.00	2.73
30	601166	兴业银行	2,058,504.00	2.69
31	600551	时代出版	1,961,959.00	2.56
32	000402	金融街	1,905,500.00	2.49
33	000059	华锦股份	1,873,000.00	2.45
34	600015	华夏银行	1,835,700.00	2.40

35	600123	兰花科创	1,699,400.00	2.22
36	000501	鄂武商 A	1,641,000.00	2.14
37	601398	工商银行	1,640,100.00	2.14
38	000568	泸州老窖	1,592,234.00	2.08

#### 7.4.2 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	600585	海螺水泥	13,241,614.42	17.31
2	600741	华域汽车	10,660,712.19	13.93
3	000651	格力电器	9,332,891.00	12.20
4	601607	上海医药	8,455,173.52	11.05
5	600015	华夏银行	8,213,600.00	10.73
6	601166	兴业银行	7,796,400.00	10.19
7	600016	民生银行	7,328,900.00	9.58
8	600000	浦发银行	7,315,100.20	9.56
9	600801	华新水泥	7,285,269.48	9.52
10	601336	新华保险	7,186,596.00	9.39
11	600426	华鲁恒升	6,900,700.00	9.02
12	600056	中国医药	6,719,176.00	8.78
13	600104	上汽集团	6,582,328.00	8.60
14	600487	亨通光电	6,419,874.00	8.39
15	601318	中国平安	6,267,968.40	8.19
16	601233	桐昆股份	6,252,298.31	8.17
17	601998	中信银行	5,686,000.00	7.43
18	601398	工商银行	5,265,000.00	6.88
19	600919	江苏银行	5,186,000.00	6.78
20	600596	新安股份	4,881,481.00	6.38
21	601328	交通银行	4,454,600.00	5.82
22	600048	保利地产	4,326,739.00	5.65
23	601186	中国铁建	4,254,600.00	5.56
24	000926	福星股份	4,232,738.57	5.53
25	601818	光大银行	4,170,000.00	5.45
26	601169	北京银行	3,793,200.00	4.96
27	000900	现代投资	3,788,606.00	4.95

28	002396	星网锐捷	3,724,722.00	4.87
29	601668	中国建筑	3,716,000.00	4.86
30	000623	吉林敖东	3,390,815.00	4.43
31	002146	荣盛发展	3,300,210.00	4.31
32	000776	广发证券	3,246,800.00	4.24
33	600859	王府井	3,214,089.00	4.20
34	600260	凯乐科技	2,970,195.00	3.88
35	600373	中文传媒	2,950,100.00	3.86
36	600508	上海能源	2,727,500.00	3.56
37	000402	金融街	2,718,100.00	3.55
38	000830	鲁西化工	2,642,717.00	3.45
39	600123	兰花科创	2,596,600.00	3.39
40	000028	国药一致	2,474,099.00	3.23
41	601288	农业银行	2,326,500.00	3.04
42	603156	养元饮品	2,222,473.04	2.90
43	000938	紫光股份	2,067,394.00	2.70
44	600551	时代出版	2,001,305.82	2.62
45	000059	华锦股份	1,969,338.00	2.57
46	000898	鞍钢股份	1,734,363.00	2.27
47	000501	鄂武商 A	1,677,000.00	2.19
48	000568	泸州老窖	1,613,319.00	2.11

### 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	177,879,809.15
卖出股票收入（成交）总额	257,092,130.48

### 7.5 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	30,288,222.80	28.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,288,222.80	28.51

## 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

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	010107	21 国债（7）	99,660	10,253,020.80	9.65
2	010303	03 国债(3)	99,300	10,043,202.00	9.45
3	019611	19 国债 01	100,000	9,992,000.00	9.40

## 7.7 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（2019年6月30日），本基金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

注：报告期内（2019年6月30日），本基金未持贵金属。

## 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

注：报告期末（2019年6月30日），本基金未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金没有参与股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金没有参与国债期货投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期本基金未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

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

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，本基金投资的前十名证券的发行主体本期存在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。

根据中国银行间市场交易商协会 2019 年 4 月 15 日公告，经 2019 年第四次自律处分会议审议决定，中信银行作为宏图高科相关债务处理工作的主承销商，在后续管理中存在违反银行间市场自律管理规则的行为，给予通报和批评处分，要求其进行全面深入的整改。

### 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	117,864.51
2	应收证券清算款	19,895.34
3	应收股利	-
4	应收利息	354,816.05
5	应收申购款	250.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	492,825.90

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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	128	763,277.00	97,666,687.22	99.97%	32,768.58	0.03%
英大睿鑫 C	200	1,496.40	0.00	0.00%	299,280.11	100.00%
合计	328	298,776.63	97,666,687.22	99.66%	332,048.69	0.34%

### 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	3,351.72	0.0034%
	英大睿鑫 C	156,448.58	52.2750%
	合计	159,800.30	0.1631%

### 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	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	英大睿鑫 A	0~10
	英大睿鑫 C	10~50
	合计	10~50





## § 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	79,049,967.01	65,474.76
本报告期期间基金总申购份额	97,885,447.23	1,251,316.36
减：本报告期期间基金总赎回份额	79,235,958.44	1,017,511.01
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	97,699,455.80	299,280.11

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

-

### 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 2019 年 5 月 24 日发布公告，自 2019 年 5 月 22 日起，孔旺先生不再担任英大基金管理有限公司董事长职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 5 月 24 日发布公告，自 2019 年 5 月 22 日起，马晓燕女士担任英大基金管理有限公司董事长职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 6 月 29 日发布公告，英大基金管理有限公司总经理助理（投资总监）张大铮自 2019 年 6 月 28 日开始履行高级管理人员职务。

### 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，本基金管理人有三起劳动争议案件尚未了结，该案件不涉及本基金。此外，无涉及基金财产、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

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 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到稽查或处罚。

### 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	281,592,605.64	65.27%	205,928.64	65.27%	-
东吴证券	1	84,302,987.38	19.54%	61,651.32	19.54%	-
国盛证券	2	44,424,594.06	10.30%	32,487.53	10.30%	-
长城证券	1	21,082,542.37	4.89%	15,417.66	4.89%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

### 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	-	-	7,800,000.00	3.01%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	125,100,000.00	48.32%	-	-
长城证券	30,194,172.00	100.00%	126,000,000.00	48.67%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 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	英大基金关于旗下基金 2018 年年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值的公告	中国证券报、公司网站	2019 年 1 月 2 日
2	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）及摘要（2018 年第 2 号）	中国证券报、公司网站	2019 年 1 月 5 日
3	英大基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金调整信息披露媒体的公告	中国证券报、公司网站	2019 年 1 月 19 日
4	英大睿鑫灵活配置混合型证	上海证券报、公司网	2019 年 1 月 22 日

	券投资基金 2018 年第 4 季度报告	站	
5	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	上海证券报、公司网站	2019 年 2 月 25 日
6	英大基金管理有限公司关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 2 月 26 日
7	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金公告	上海证券报、公司网站	2019 年 3 月 5 日
8	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金公告	上海证券报、公司网站	2019 年 3 月 6 日
9	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金公告	上海证券报、公司网站	2019 年 3 月 7 日
10	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告及摘要	上海证券报、公司网站	2019 年 3 月 28 日
11	英大基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 4 月 16 日
12	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上海证券报、公司网站	2019 年 4 月 18 日
13	关于增加北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 5 月 14 日
14	关于网上交易、手机 APP、微信因系统升级维护暂停旗下全部基金交易服务的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 5 月 14 日
15	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、公司网站	-
16	英大基金管理有限公司关于增加联储证券有限责任公司为旗下基金销售机构的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 5 月 28 日
17	关于手机 APP 因系统维护暂停服务的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 6 月 6 日
18	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 6 月 17 日
19	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第一次收益分配公告	上海证券报、公司网站	2019 年 6 月 18 日
20	英大基金管理有限公司关于	上海证券报、公司网	2019 年 6 月 21 日

	增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告	站	
21	英大基金管理有限公司关于降低定期定额投资计划最低申购金额的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 6 月 21 日
22	英大基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 6 月 21 日
23	英大基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	上海证券报、公司网站	2019 年 6 月 27 日
24	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、公司网站	2019 年 6 月 29 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	2019.01.01-2019.03.07	79,038,096.74	0.00	79,038,096.74	0.00	0.00%
	4	2019.05.16-2019.06.30	0.00	44,329,284.51	0.00	44,329,284.51	45.23%
	5	2019.05.16-2019.06.30	0.00	44,329,284.51	0.00	44,329,284.51	45.23%
	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-
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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准英大睿鑫灵活配置混合型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

2019 年 8 月 26 日