

# 英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 3 月 31 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 2020 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 2019 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.....	21
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>59</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
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.....	66

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>69</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
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 .....	69
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	69
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>71</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
11.8 其他重大事件 .....	74
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>79</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 .....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>80</b>
13.1 备查文件目录 .....	80
13.2 存放地点 .....	80
13.3 查阅方式 .....	80

## § 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	162,369,733.07 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	47,227,731.56 份	115,142,001.51 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	刘康喜
	联系电话	010-59112026
	电子邮箱	liukx@ydamc.com
		贺倩
		010-66060069
		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	马晓燕	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	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8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	2019 年		2018 年		2017 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	7,605,346.4 5	27,726,465. 90	242,622.74	-142,658.92	43,222,108. 61	9,990,539.6 1
本期 利 润	6,235,201.6 9	47,421,368. 53	-500,859.9 2	-15,692,540 .17	35,401,981. 75	8,163,060.1 9
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.2824	0.3196	-0.1014	-0.1046	0.0714	0.0688
本 期 加 权 平 均	25.46%	30.13%	-9.39%	-10.14%	6.83%	6.64%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	36.75%	35.10%	-8.72%	-9.58%	7.31%	6.89%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期末可供分配利润	5,819,078.56	9,251,621.02	-19,359.52	-5,448,326.72	794,290.15	7,997,443.01
期末可供分配基金份额利润	0.1232	0.0804	-0.0147	-0.0349	0.0794	0.0674

期末基金资产净值	53,046,810.12	124,393,622.53	1,295,262.77	150,634,601.02	10,802,178.71	126,607,446.94
期末基金份额净值	1.1232	1.0803	0.9853	0.9651	1.0794	1.0674
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	41.43%	36.91%	3.43%	1.34%	13.31%	12.08%

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

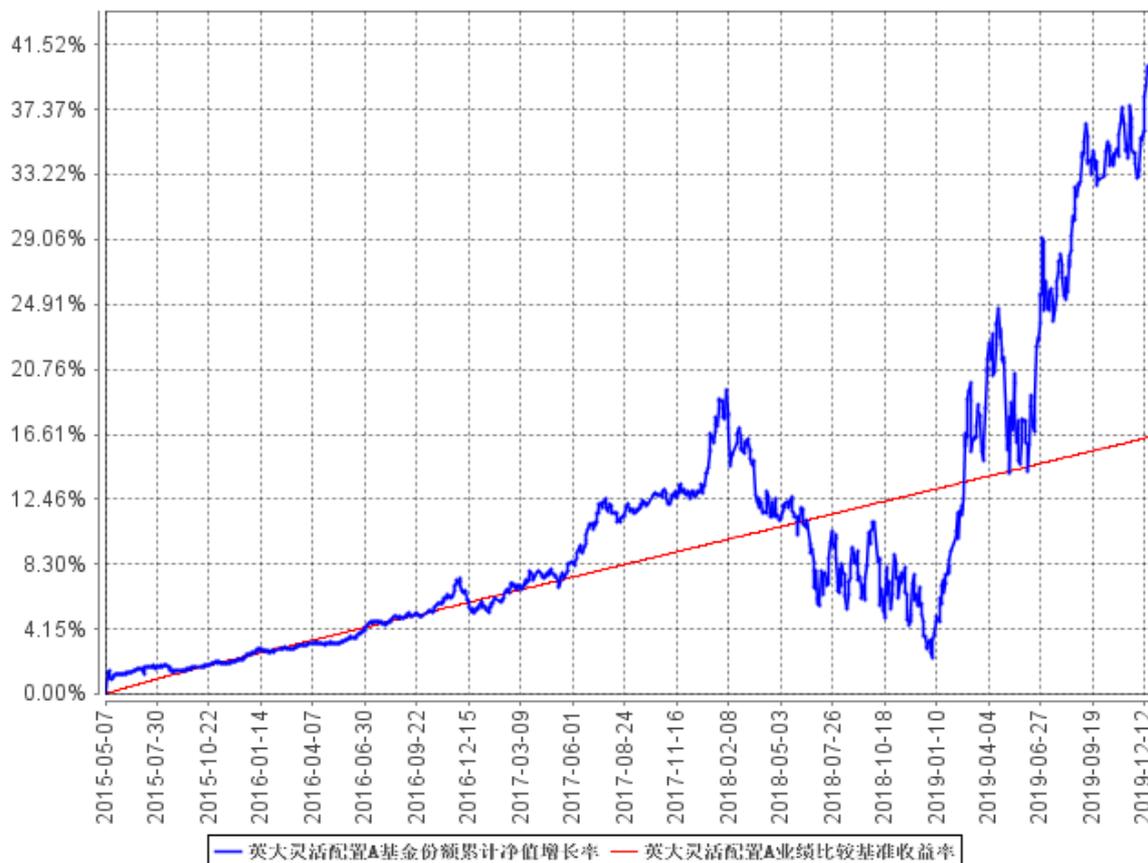
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.48%	0.59%	0.76%	0.01%	5.72%	0.58%
过去六个月	12.66%	0.70%	1.54%	0.01%	11.12%	0.69%
过去一年	36.75%	0.96%	3.10%	0.01%	33.65%	0.95%
过去三年	33.95%	0.69%	9.90%	0.01%	24.05%	0.68%
自基金合同生效起至今	41.43%	0.56%	16.53%	0.01%	24.90%	0.55%

英大灵活配置 B

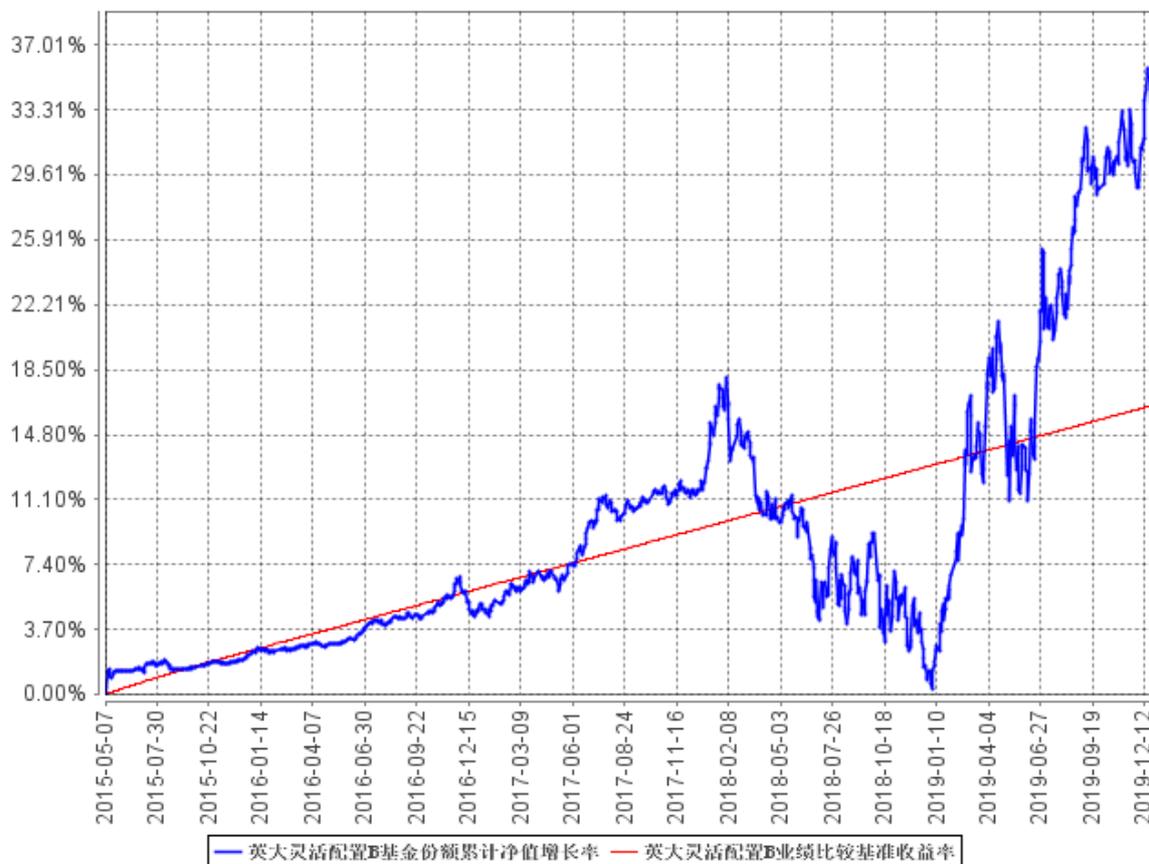
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.34%	0.59%	0.76%	0.01%	5.58%	0.58%
过去六个月	12.34%	0.70%	1.54%	0.01%	10.80%	0.69%
过去一年	35.10%	0.96%	3.10%	0.01%	32.00%	0.95%
过去三年	30.57%	0.69%	9.90%	0.01%	20.67%	0.68%
自基金合同生效起至今	36.91%	0.56%	16.53%	0.01%	20.38%	0.55%

### 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

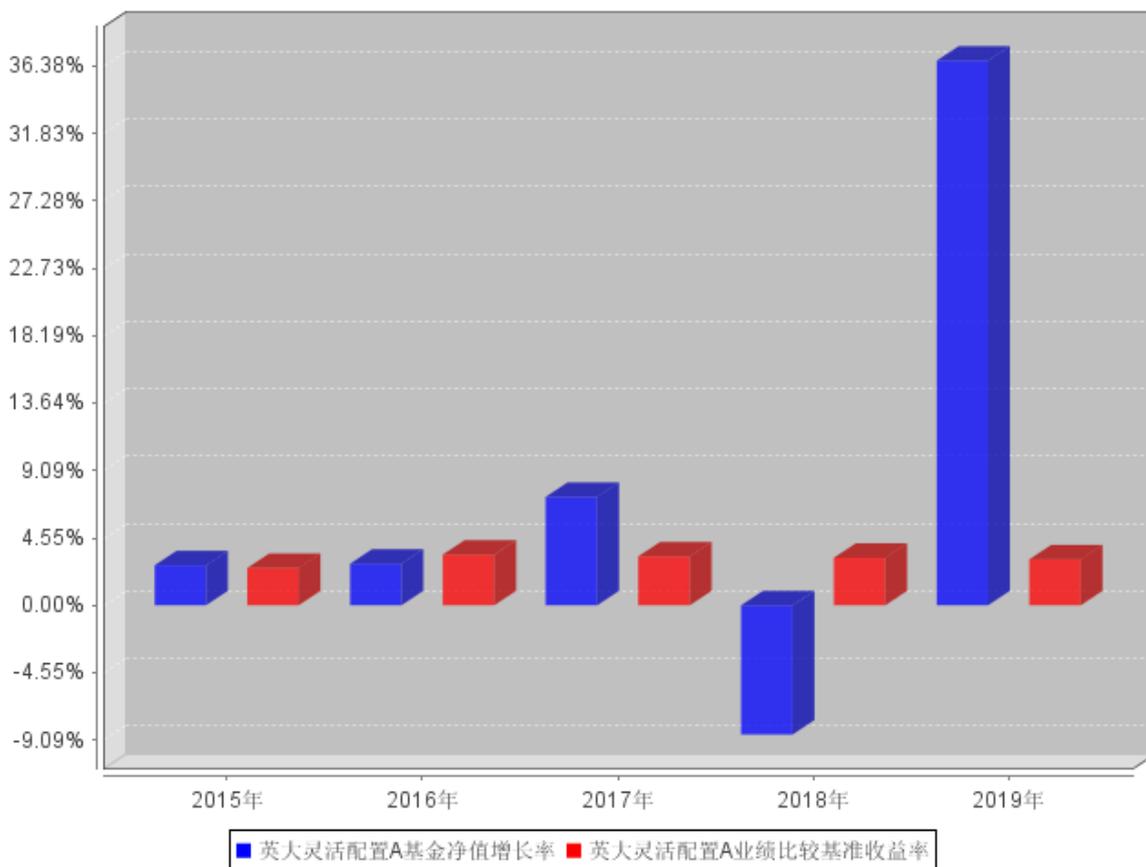


英大灵活配置B基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

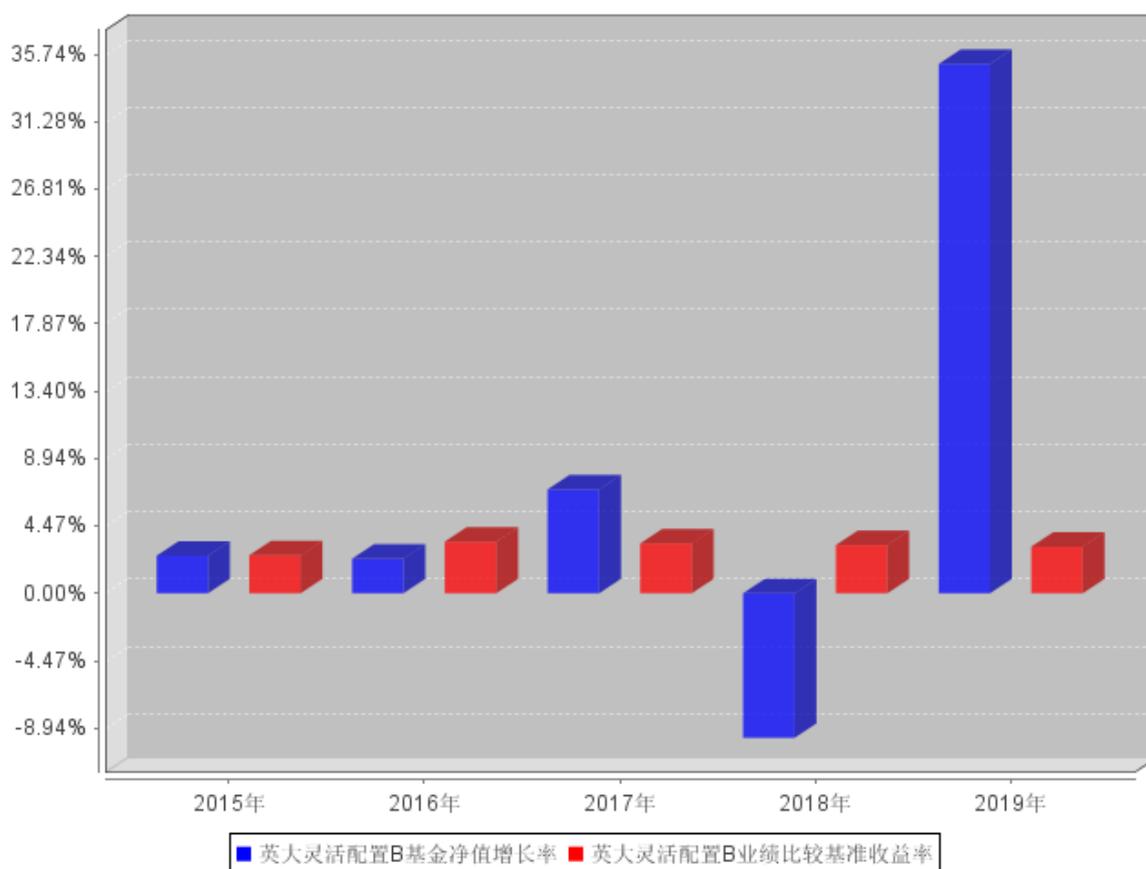


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2019	2.0000	4,702,215.89	37,269.41	4,739,485.30	
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
合计	2.0000	4,702,215.89	37,269.41	4,739,485.30	

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
2019	2.0000	28,999,252.74	4,007.33	29,003,260.07	
2018	-	-	-	-	

2017	-	-	-	-	
合计	2.0000	28,999,252.74	4,007.33	29,003,260.07	

## § 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 31,600 万元人民币。现有三家股东，分别是国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 67.7%、22.8%和 9.5%。

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。公司员工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“梦想、真诚、专业、稳健”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、专户协同发展、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 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、英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金 9 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	2019 年 11 月 25 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，权益投资部总经理。
易祺坤	本基金基金经理	2017 年 12 月 28 日	-	8	北京大学理学学士，8 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，历任交易管理部交易员、交易管理部副总经理（主持工作）。现任固定收益部基金经理，英大纯债债券型证券投资基金、英大现金宝货币基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金基金经理。
郑中华	本基金基金经理	2019 年 3 月 14 日	-	4	中央财经大学金融学博士，3 年以上金融从业经验。历任美国友邦保险有限公司北京分公司业务主任、兴业银行总行投资银行部研究处宏观及策略研究员，2017 年 5 月加入英大基金管理有限公司权益投资部，现任英大领先回报混合型发起式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》等国家法律法规和监管部门的规定，公

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、特定客户资产管理计划等。

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、特定客户资产管理计划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 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. 基金投资策略**

2019 年度，A 股市场风险与机遇并存。一方面，短期风险主要体现在全球贸易保护主义和地缘政治风险因素仍存，中国年度 GDP 同比增速仍有下行压力，上市公司整体盈利能力拐点未至、投资者风险偏好仍受压制等因素；另一方面，中长期利多因素逐渐显现，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，民营及中

小企业融资成本和违约风险有所修复，中长期的积极因素正在逐渐积累。

全年基金资产配置方面，主要立足于结构制胜的思路。在股票投资的选择上，继续坚持价值投资理念，在综合研判经济周期、政策周期以及市场周期之后，前三季度以具有相对基本面优势的消费和科技龙头股作为重点投资对象，四季度逐渐将投资重点从“消费+科技”转向行业“均衡+科技”，并根据市场涨跌节奏，适时调整价值股与成长股的配置比例，灵活参与权益市场结构性机会。债券投资方面，全年根据政策预期与预判，择机参与了利率债的投资。

## 2. 全年运作分析

2019 年全年，上证综指上涨 22.3%，上证 50 指数上涨 33.58%，沪深 300 指数上涨 36.07%，英大灵活配置 A 单位净值上涨 36.75%，灵活配置 B 单位净值上涨 35.1%，报告期内产品净值涨幅高于上证综指，上证 50 和沪深 300 指数。其中，上半年基金净值涨幅低于沪深 300，股票投资占 65%左右、主因 Q1 投资组合较早进入防御状态但市场投资情绪快速修复所导致；进入下半年，产品逐渐调整资产配置思路，一方面将股票投资占比逐渐提升至 70%-75%左右、另一方面投资组合通过上下结合的方式，Q3 总体特征为“消费+科技”，Q4 总体特征为“均衡+消费”，下半年产品净值涨幅显著超越沪深 300。

### 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 1.1232 元，本报告期基金份额净值增长率为 36.75%；截至本报告期末英大灵活配置 B 基金份额净值为 1.0803 元，本报告期基金份额净值增长率为 35.10%；同期业绩比较基准收益率为 3.10%。截至 2019 年 12 月 31 日，灵活配置 A 和 B 基金单位净值增长幅度在同类基金中分别排名 660/1812 和 698/1812，全年灵活配置净值表现在同类基金中处于前 37.5%水平。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一、经济判断：疫情扰动节奏，下行压力增加；经济决胜之年，政策护航必达。

1. 2020 年为十三五规划的决胜之年，经济普查后的底线增速要求 5.6%-5.8%，相较于 2019 年回落 0.3 到 0.5PCT。从三驾马车的结构来看，总需求不足的现实情况仍会持续。其中，最重要的年度变量为外需，中美贸易初步协议的进一步落地，导致外需顺差难以系统性扩张。

2. 新冠疫情预期外爆发，显著扰动企业复工节奏，内需承压使得经济增速进一步承压。从行业冲击上来看，疫情爆发的负面冲击从需求端来看主要集中于内需，行业冲击集中于旅游、酒店、餐饮、交运和电影等社会服务类行业。一般而言，一季度 GDP 的年度占比大约为 1/5，假设由疫情耽误的生产合计为 1 个月，新冠疫情对年度 GDP 增速的下拉作用大约为 0.4PCT，进一步加剧经

济增长压力。

3. 政策对冲力度显著加大，节奏进一步提前。预期财政政策会持续加力提效，货币政策边际宽松，产业政策对冲提上日程，产业政策主要集中于基建和消费等细分行业。

4. 总体判断：经济决胜之年，政策护航必达。

二、市场预期：总体判断中性，结构优选制胜，行业拥抱科技。

1. 总体判断：预期全年市场维持震荡为主，疫情缓和后震荡上行。短期而言，疫情的边际变动方向仍会影响权益市场投资节奏，在疫情爆发期仍不宜大幅提升风险偏好。年度范围来看，当疫情发展阶段转为稳定期(重要指标为新增数量和累计病例的变动方向)，预期市场逐渐恢复正常增长格局，权益市场总体年度涨幅 10%左右。

2. 结构建议：建议重点布局以 5G 和新能源汽车为主的科技产业链；除此之外，重点关注宏观政策和产业政策对冲的基建和汽车及家电产业链、同时关注金融(推荐券商，交易性机会包括保险和银行)行业的投资机会。

#### 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，及时识别合规风险，有效进行风险控制，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，研究法规变化对公司业务的影响，督促责任部门落实各项法规要求，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；五是持续开展合规培训，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，采用法规解读加案例演示的方式，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落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和运营等内部制度建设情况、内部制度执

行情况、各项业务开展的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报告。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。

#### 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

本报告期内本基金实施了四次利润分配，英大灵活配置 A 于 2019 年 4 月 23 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 22,016.47 元，再投资形式发放总额为 6,112.75 元，本期利润分配合计为 28,129.22 元，英大灵活配置 B 于 2019 年 4 月 23 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 7,251,855.37 元，再投资形式发放总额为 49.28 元，本期利润分配合计为 7,251,904.65 元；英大灵活配置 A 于 2019 年 6 月 18 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 24,504.44 元，再投资形式发放总额为 7,379.50 元，本期利润分配合计为 31,883.94 元，英大灵活配置 B 于 2019 年 6 月 18 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 7,250,442.00 元，再投资形式发放总额为 1,036.73 元，本期利润分配合计为 7,251,478.73 元；英大灵活配置 A 于 2019 年 8 月 27 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 2,309,365.99 元，再投资形式发放总额为 10,038.98 元，本期利润分配合计为 2,319,404.97 元，

英大灵活配置 B 于 2019 年 8 月 27 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 7,748,063.27 元，再投资形式发放总额为 1,726.82 元，本期利润分配合计为 7,749,790.09 元；英大灵活配置 A 于 2019 年 11 月 27 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 2,346,328.99 元，再投资形式发放总额为 13,738.18 元，本期利润分配合计为 2,360,067.17 元，英大灵活配置 B 于 2019 年 11 月 27 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 6,748,892.10 元，再投资形式发放总额为 1,194.50 元，本期利润分配合计为 6,750,086.60 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。

#### **4.9 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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《公开募集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	毕马威华振审字第 2001422 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>我们审计了后附的第 1 页至第 38 页的英大灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果及基金净值变动情况。</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（以下简称“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，我们独立于该基金，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>该基金管理人英大基金管理有限公司对其他信息负责。其他信息包括该基金 2019 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。该基金 2019 年年度报告预期将在审计报告日后提供给我们。</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，我们的责任是在能够获取上述其他信息时阅读其他信息，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>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人英大基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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，该基金管理人英大基金管理有限公司管理层负责评估该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，除非该基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>该基金管理人英大基金管理有限公司治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>(1) 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>(2) 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>(3) 评价该基金管理人英大基金管理有限公司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>(4) 对该基金管理人英大基金管理有限公司管理层使用持续经营假</p>

	<p>设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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>我们与该基金管理人英大基金管理有限公司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	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	左艳霞   卜建平
会计师事务所的地址	中国北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2020年3月30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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	43,134,188.86	3,179,382.45
结算备付金		3,421,774.94	567,789.89
存出保证金		88,323.06	41,845.44
交易性金融资产	7.4.7.2	69,716,719.03	153,288,197.29
其中：股票投资		69,716,719.03	98,995,711.99
基金投资		-	-
债券投资		-	54,292,485.30
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	60,000,000.00	-
应收证券清算款		9,934,530.21	-
应收利息	7.4.7.5	-614.59	577,490.55
应收股利		-	-
应收申购款		5,687.51	4,515.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		186,300,609.02	157,659,221.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	4,999,752.50
应付证券清算款		7,957,543.13	-
应付赎回款		39,075.14	1,334.86
应付管理人报酬		87,900.17	80,688.78
应付托管费		36,625.06	33,620.32
应付销售服务费		51,347.18	66,718.50
应付交易费用	7.4.7.7	498,633.44	150,740.87
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	189,052.25	390,000.48
负债合计		8,860,176.37	5,729,357.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	162,369,733.07	157,397,550.03
未分配利润	7.4.7.10	15,070,699.58	-5,467,686.24
所有者权益合计		177,440,432.65	151,929,863.79
负债和所有者权益总计		186,300,609.02	157,659,221.10

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，英大灵活配置 A 净值 1.1232 元，基金份额总额 47,227,731.56 份，英大灵活配置 B 净值 1.0803 元，基金份额总额 115,142,001.51 份，总份额合计 162,369,733.07 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		58,308,508.53	-11,911,626.11
1.利息收入		1,558,975.03	2,978,386.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	139,270.14	56,341.34
债券利息收入		1,024,820.37	2,625,442.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		394,884.52	296,603.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		38,415,502.31	1,173,637.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	37,694,557.65	-1,890,241.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-321,661.75	988,969.71
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	1,042,606.41	2,074,909.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	18,324,757.87	-16,293,363.91
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	9,273.32	229,712.90

<b>减：二、费用</b>		4,651,938.31	4,281,773.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,090,350.97	959,945.13
2. 托管费	7.4.10.2.2	454,312.93	399,977.04
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	786,991.05	772,896.62
4. 交易费用	7.4.7.19	2,048,730.87	1,638,207.80
5. 利息支出		28,294.20	60,289.82
其中：卖出回购金融资产支出		28,294.20	60,289.82
6. 税金及附加		66.08	5,884.07
7. 其他费用	7.4.7.20	243,192.21	444,573.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		53,656,570.22	-16,193,400.09
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		53,656,570.22	-16,193,400.09

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	157,397,550.03	-5,467,686.24	151,929,863.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	53,656,570.22	53,656,570.22
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）	4,972,183.04	624,560.97	5,596,744.01
其中：1. 基金申购款	77,068,338.76	5,594,305.12	82,662,643.88
2. 基金赎回款	-72,096,155.72	-4,969,744.15	-77,065,899.87
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）	-	-33,742,745.37	-33,742,745.37
五、期末所有者权益（基金净值）	162,369,733.07	15,070,699.58	177,440,432.65

项目	上年度可比期间 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

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>马晓燕</u>	<u>岳喜伟</u>	<u>李婷</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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 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，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计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 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。

##### 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 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。

#### 7.4.4.8 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)”。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 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

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《中国证券监督管理委员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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在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》,在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 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

本基金在本期未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 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：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 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。

## 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	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
活期存款	43,134,188.86	3,179,382.45
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：	43,134,188.86	3,179,382.45

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	65,565,920.54	69,716,719.03	4,150,798.49
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	65,565,920.54	69,716,719.03	4,150,798.49
项目	上年度末 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
	银行间市场	52,898,220.00	53,715,000.00
	合计	53,454,922.51	54,292,485.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	167,462,156.67	153,288,197.29	-14,173,959.38

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本年末及上年末均未持有任何衍生金融资产 /（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 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	60,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	60,000,000.00	-
项目	上年度末 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	-	-

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金于本年末及上年末均无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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	3,106.18	538.82
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,693.78	281.05
应收债券利息	-	576,650.00
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-5,458.22	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	43.67	20.68
合计	-614.59	577,490.55

注：其他为应收结算保证金利息。

**7.4.7.6 其他资产**

注：本基金于本年末及上年末均未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	497,933.44	146,156.05
银行间市场应付交易费用	700.00	4,584.82
合计	498,633.44	150,740.87

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	52.25	0.48
预提审计费用	60,000.00	60,000.00
预提信息披露费	120,000.00	330,000.00
预提账户维护费	9,000.00	-
应付证券出借违约金	-	-

合计	189,052.25	390,000.48
----	------------	------------

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,314,622.29	1,314,622.29
本期申购	47,846,656.19	47,846,656.19
本期赎回（以“-”号填列）	-1,933,546.92	-1,933,546.92
- 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	47,227,731.56	47,227,731.56

金额单位：人民币元

英大灵活配置 B		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	156,082,927.74	156,082,927.74
本期申购	29,221,682.57	29,221,682.57
本期赎回（以“-”号填列）	-70,162,608.80	-70,162,608.80
- 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	115,142,001.51	115,142,001.51

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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	164,900.59	-184,260.11	-19,359.52
本期利润	7,605,346.45	-1,370,144.76	6,235,201.69
本期基金份额交易产生的变动数	3,289,606.84	1,053,114.85	4,342,721.69

其中：基金申购款	3,535,901.47	971,301.89	4,507,203.36
基金赎回款	-246,294.63	81,812.96	-164,481.67
本期已分配利润	-4,739,485.30	-	-4,739,485.30
本期末	6,320,368.58	-501,290.02	5,819,078.56

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	16,139,180.00	-21,587,506.72	-5,448,326.72
本期利润	27,726,465.90	19,694,902.63	47,421,368.53
本期基金份额交易产生的变动数	-4,266,404.18	548,243.46	-3,718,160.72
其中：基金申购款	1,617,387.80	-530,286.04	1,087,101.76
基金赎回款	-5,883,791.98	1,078,529.50	-4,805,262.48
本期已分配利润	-29,003,260.07	-	-29,003,260.07
本期末	10,595,981.65	-1,344,360.63	9,251,621.02

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

#### 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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	109,475.12	43,674.34
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	28,808.12	11,452.48
其他	986.90	1,214.52
合计	139,270.14	56,341.34

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	804,087,103.26	613,545,250.20
减：卖出股票成本总额	766,392,545.61	615,435,491.26
买卖股票差价收入	37,694,557.65	-1,890,241.06

### 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 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	-321,661.75	988,969.71
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	-321,661.75	988,969.71

#### 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 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	157,726,912.43	274,876,584.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	155,564,580.72	268,311,705.76
减：应收利息总额	2,483,993.46	5,575,908.70
买卖债券差价收入	-321,661.75	988,969.71

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本年度及上年度均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本年度及上年度均无债券申购差价收入。

#### 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：本基金在本年度及上年度均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金在本年度及上年度均无买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本年度及上年度均无贵金属赎回差价收入。

**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：本基金在本年度及上年度均无买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

注：本基金在本年度及上年度均无其他收益投资。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,042,606.41	2,074,909.27
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,042,606.41	2,074,909.27

**7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	18,324,757.87	-16,293,363.91
——股票投资	19,162,320.66	-17,252,080.69
——债券投资	-837,562.79	958,716.78
——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	18,324,757.87	-16,293,363.91

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	9,273.32	229,712.90
合计	9,273.32	229,712.90

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
交易所市场交易费用	2,045,855.87	1,632,170.30
银行间市场交易费用	2,875.00	6,037.50
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,048,730.87	1,638,207.80

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	330,000.00
乙类帐户维护费	45,000.00	36,000.00
银行费用	18,192.21	18,555.40
其他	-	18.10
合计	243,192.21	444,573.50

#### 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

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 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、基金销售机构
国网英大国际控股集团有限公司	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
北京英大资本管理有限公司（注 1）	基金管理人的全资子公司
国网英大国际控股集团有限公司控股子公司（注 2）	受国网英大国际控股集团有限公司控制的企业

注 1：于 2019 年 2 月 25 日，原“深圳英大资本管理有限公司”更名为“北京英大资本管理有限公司”，已于 2019 年 2 月 25 日完成工商变更登记手续。

注 2：国网英大国际控股集团有限公司控股子公司包括国网国际融资租赁有限公司、英大国际信托有限责任公司、英大证券有限责任公司、英大泰和财产保险股份有限公司、英大泰和人寿保险股份有限公司和英大长安保险经纪有限公司等。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本期及上年度均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

##### 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 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,090,350.97	959,945.13
其中：支付销售机构的客户维护费	2,638.06	1,932.97

注：支付基金管理人英大基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/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 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	454,312.93	399,977.04

注：支付基金托管人农业银行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。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 2019年1月1日至2019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	-	786,586.64	786,586.64
合计	-	786,586.64	786,586.64
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

注：支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.50%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：

英大灵活配置 B 日基金销售服务费=前一日基金资产净值×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：本基金在本年度及上年度均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 2019年1月1日至2019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	-

报告期初持有的基金份额	-	22,181,138.52
报告期间申购/买入总份额	-	14,375,833.78
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	20,300,000.00
报告期末持有的基金份额	-	16,256,972.30
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	10.0100%

项目	上年度可比期间	
	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	-
报告期初持有的基金份额	9,999,450.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	29,681,138.52
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	9,999,450.00	7,500,000.00
报告期末持有的基金份额	-	22,181,138.52
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	14.0900%

#### 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 2019年12月31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
英大国际信托 有限责任公司	78,460,019.74	48.3200%	118,460,019.74	75.2600%
北京英大资本 管理有限公司	20,289,297.70	12.5000%	15,213,463.92	9.6700%
合计	98,749,317.44	60.8200%	133,673,483.66	84.9300%

**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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	43,134,188.86	109,475.12	3,179,382.45	43,674.34

注：本基金通过“中国农业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12月31日的相关余额为人民币3,510,098.00元。（2018年12月31日：人民币609,635.33元）

**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：本基金在本年度及上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

**7.4.10.7 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。

**7.4.11 利润分配情况**

英大灵活配置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11月27日	-	2019年11月27日	0.5000	2,346,328.99	13,738.18	2,360,067.17	
2	2019年8月27日	-	2019年8月27日	0.5000	2,309,365.99	10,038.98	2,319,404.97	
3	2019年6月18日	-	2019年6月18日	0.5000	24,504.44	7,379.50	31,883.94	
4	2019年4月23日	-	2019年4月23日	0.5000	22,016.47	6,112.75	28,129.22	
合计	-	-	-	2.0000	4,702,215.89	37,269.41	4,739,485.30	

英大灵活配置B

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 11 月 27 日		2019 年 11 月 27 日	0.5000	6,748,892.10	1,194.50	6,750,086.60	
2	2019 年 8 月 27 日		2019 年 8 月 27 日	0.5000	7,748,063.27	1,726.82	7,749,790.09	
3	2019 年 6 月 18 日		2019 年 6 月 18 日	0.5000	7,250,442.00	1,036.73	7,251,478.73	
4	2019 年 4 月 23 日		2019 年 4 月 23 日	0.5000	7,251,855.37	49.28	7,251,904.65	
合计	-	-		2.0000	28,999,252.74	4,007.33	29,003,260.07	

#### 7.4.12 期末（2019 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
688181	八亿时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	43.98	43.98	2,332	102,561.36	102,561.36	-
688081	兴图新科	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
601077	渝农商行	2019 年 10 月 16 日	2020 年 4 月 29 日	新股 锁定 受限	7.36	6.26	147,778	1,087,646.08	925,090.28	-
601916	浙商银行	2019 年 11 月 18 日	2020 年 5 月 26 日	新股 锁定 受限	4.94	4.66	294,195	1,453,323.30	1,370,948.70	-

688068	热景生物	2019年9月20日	2020年3月30日	新股锁定受限	29.46	44.59	2,641	77,803.86	117,762.19	-
688128	中国电研	2019年10月29日	2020年5月6日	新股锁定受限	18.79	17.52	9,027	169,617.33	158,153.04	-
688357	建龙微纳	2019年11月26日	2020年6月4日	新股锁定受限	43.28	45.83	2,332	100,928.96	106,875.56	-

注：根据中国证监会相关规定，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。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：报告期末，本基金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

本期末，本基金未持有银行间市场债券正回购。

于2019年12月31日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2019年12月31日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场

风险。

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

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，建立债券投资库，同时追踪持仓债券发行人的相关风险事件，以控制可能出现的信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金于本年末及上年末均未持有短期信用债券投资。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金于本年末及上年末均未持有短期资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金于本年末及上年末均未持有短期同业存单。

##### **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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	577,485.30
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	577,485.30

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：本基金于本年末及上年末均未持有长期资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本年末及上年末均未持有长期同业存单。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

##### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：本基金本报告期末持有资产全部为股票和现金，未持有金融负债，不存在到期期限分析问题。

##### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在投资端，报告期末，本基金主要持有沪深交易所股票、交易所买入返售证券和现金资产，股票投资采用分散化组合投资策略，单只股票占净值比最高未超过 5%，在市场成交量不发生重大系统性降低情况下，除少量停牌股票、首次公开发行时申购的暂未上市股票、首次公开发行时申购的附有锁定期的老股转让部分外，所持股票基本可在一个交易日左右变现。

在份额端，存在单一机构巨额赎回的可能性。在发生巨额赎回时，本基金将在维护存量持有人和申请赎回持有人利益公平的原则下，审慎确认赎回申请，适当使用《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》中规定的流动性风险管理工具，防范流动性风险发生。

#### 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。本基金管理人通过久期、凸性、VAR 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。报告期本基金未持有债券投资。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	43,134,188.86	-	-	-	-	-	43,134,188.86
结算备付金	3,421,774.94	-	-	-	-	-	3,421,774.94
存出保证金	88,323.06	-	-	-	-	-	88,323.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-69,716,719.03	69,716,719.03
买入返售金融资产	60,000,000.00	-	-	-	-	-	60,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,934,530.21	9,934,530.21
应收利息	-	-	-	-	-	-614.59	-614.59
应收申购款	-	-	-	-	-	5,687.51	5,687.51
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	106,644,286.86	-	-	-	-	-79,656,322.16	186,300,609.02
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,957,543.13	7,957,543.13

应付赎回款	-	-	-	-	-	39,075.14	39,075.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	87,900.17	87,900.17
应付托管费	-	-	-	-	-	36,625.06	36,625.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-	51,347.18	51,347.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	498,633.44	498,633.44
其他负债	-	-	-	-	-	189,052.25	189,052.25
负债总计	-	-	-	-	-	8,860,176.37	8,860,176.37
利率敏感度缺口	106,644,286.86	-	-	-	-	-70,796,145.79	177,440,432.65
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	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

注：无

## 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（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率平行下降 25 个基点	-	1,996,374.57
市场利率平行上升 25 个基点	-	-1,774,152.06	

注：于 2019 年 12 月 31 日，本基金不持有债券，现金资产以活期利率计息。因此，市场利率变动对本基金资产净值无影响。

## 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 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 2019年12月31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	69,716,719.03	39.29	98,995,711.99	65.16
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
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	69,716,719.03	39.29	153,288,197.29	100.89

注：无

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	沪深 300 指数出现涨跌变化，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（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	4,027,826.75	4,405,545.58
	沪深 300 指数下跌 5%	-4,027,826.75	-4,405,545.58

注：无

#### 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（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	合计	-	-

#### 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	69,716,719.03	37.42
	其中：股票	69,716,719.03	37.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	60,000,000.00	32.21
	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	46,555,963.80	24.99
8	其他各项资产	10,027,926.19	5.38
9	合计	186,300,609.02	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	26,637.00	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,892,438.67	16.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,380,632.00	1.34
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	4,449,699.00	2.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,756,772.00	0.99
J	金融业	28,173,859.28	15.88
K	房地产业	2,871,950.00	1.62
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	158,153.04	0.09

N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
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	69,716,719.03	39.29

### 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（2019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	600030	中信证券	262,801	6,648,865.30	3.75
2	600258	首旅酒店	215,900	4,449,699.00	2.51
3	601012	隆基股份	178,190	4,424,457.70	2.49
4	601601	中国太保	108,300	4,098,072.00	2.31
5	600031	三一重工	216,700	3,694,735.00	2.08
6	601318	中国平安	42,000	3,589,320.00	2.02
7	600585	海螺水泥	65,200	3,572,960.00	2.01
8	603583	捷昌驱动	72,400	3,223,972.00	1.82
9	600837	海通证券	205,900	3,183,214.00	1.79
10	600048	保利地产	177,500	2,871,950.00	1.62
11	601688	华泰证券	138,700	2,816,997.00	1.59
12	000651	格力电器	40,000	2,623,200.00	1.48
13	601668	中国建筑	423,600	2,380,632.00	1.34
14	002353	杰瑞股份	54,300	2,006,928.00	1.13
15	600309	万华化学	35,600	1,999,652.00	1.13
16	601166	兴业银行	100,000	1,980,000.00	1.12
17	002475	立讯精密	50,940	1,859,310.00	1.05
18	000063	中兴通讯	50,100	1,773,039.00	1.00
19	002624	完美世界	39,800	1,756,772.00	0.99
20	601628	中国人寿	46,900	1,635,403.00	0.92
21	600567	山鹰纸业	398,900	1,503,853.00	0.85
22	000425	徐工机械	272,700	1,491,669.00	0.84
23	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.77
24	002271	东方雨虹	48,000	1,262,880.00	0.71

25	601319	中国人保	131,500	998,085.00	0.56
26	601398	工商银行	157,800	927,864.00	0.52
27	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.52
28	688128	中国电研	9,027	158,153.04	0.09
29	688068	热景生物	2,641	117,762.19	0.07
30	688357	建龙微纳	2,332	106,875.56	0.06
31	688181	八亿时空	2,332	102,561.36	0.06
32	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.05
33	002714	牧原股份	300	26,637.00	0.02
34	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
35	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
36	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

## 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	18,305,937.00	12.05
2	601818	光大银行	17,860,318.00	11.76
3	601328	交通银行	17,301,000.00	11.39
4	600104	上汽集团	16,436,399.48	10.82
5	300498	温氏股份	16,150,540.26	10.63
6	600585	海螺水泥	15,185,073.04	9.99
7	600048	保利地产	14,290,789.59	9.41
8	601688	华泰证券	13,946,584.00	9.18
9	601398	工商银行	13,858,647.00	9.12
10	601628	中国人寿	13,780,796.00	9.07
11	601012	隆基股份	11,528,414.36	7.59
12	601988	中国银行	11,393,990.00	7.50
13	000063	中兴通讯	11,135,526.02	7.33
14	600258	首旅酒店	10,647,905.75	7.01
15	600009	上海机场	10,182,140.44	6.70
16	002475	立讯精密	9,584,573.00	6.31
17	002202	金风科技	9,549,915.00	6.29
18	000333	美的集团	9,527,214.57	6.27

19	601186	中国铁建	9,292,729.00	6.12
20	300014	亿纬锂能	9,164,078.06	6.03
21	601601	中国太保	9,070,286.00	5.97
22	300003	乐普医疗	8,954,299.61	5.89
23	000651	格力电器	8,774,738.00	5.78
24	601668	中国建筑	8,683,614.80	5.72
25	002236	大华股份	8,644,241.62	5.69
26	601128	常熟银行	8,595,995.00	5.66
27	600741	华域汽车	8,544,340.46	5.62
28	300572	安车检测	8,447,941.10	5.56
29	600859	王府井	8,413,628.90	5.54
30	000932	华菱钢铁	8,324,954.20	5.48
31	600031	三一重工	7,990,539.00	5.26
32	002624	完美世界	7,734,814.00	5.09
33	601607	上海医药	7,582,305.16	4.99
34	300144	宋城演艺	7,495,976.00	4.93
35	601166	兴业银行	7,244,037.00	4.77
36	600519	贵州茅台	7,119,461.54	4.69
37	600030	中信证券	6,994,234.00	4.60
38	000858	五粮液	6,938,059.00	4.57
39	600056	中国医药	6,869,925.00	4.52
40	600801	华新水泥	6,794,500.00	4.47
41	601933	永辉超市	6,595,853.00	4.34
42	002039	黔源电力	6,440,191.00	4.24
43	601169	北京银行	6,225,000.00	4.10
44	603043	广州酒家	6,182,101.00	4.07
45	600383	金地集团	6,143,623.71	4.04
46	002035	华帝股份	6,057,008.77	3.99
47	600872	中炬高新	6,002,009.30	3.95
48	000425	徐工机械	5,894,053.00	3.88
49	600436	片仔癀	5,819,704.00	3.83
50	002439	启明星辰	5,780,562.96	3.80
51	601939	建设银行	5,497,325.00	3.62
52	600763	通策医疗	5,474,089.00	3.60
53	601336	新华保险	5,399,485.00	3.55
54	601888	中国国旅	4,966,348.10	3.27

55	002353	杰瑞股份	4,875,175.00	3.21
56	000538	云南白药	4,793,808.00	3.16
57	600230	沧州大化	4,784,449.00	3.15
58	600004	白云机场	4,748,826.00	3.13
59	600000	浦发银行	4,669,964.00	3.07
60	600837	海通证券	4,497,786.00	2.96
61	300188	美亚柏科	4,497,740.00	2.96
62	600999	招商证券	4,497,118.00	2.96
63	002271	东方雨虹	4,494,194.00	2.96
64	000860	顺鑫农业	4,484,978.00	2.95
65	603517	绝味食品	4,469,835.00	2.94
66	002120	韵达股份	4,437,285.01	2.92
67	601233	桐昆股份	4,420,304.60	2.91
68	002714	牧原股份	4,313,584.00	2.84
69	601009	南京银行	4,298,258.00	2.83
70	300122	智飞生物	4,275,971.28	2.81
71	000961	中南建设	4,195,841.00	2.76
72	600547	山东黄金	3,999,366.20	2.63
73	300413	芒果超媒	3,996,028.00	2.63
74	002508	老板电器	3,748,219.00	2.47
75	600596	新安股份	3,709,900.00	2.44
76	000725	京东方 A	3,649,714.00	2.40
77	002832	比音勒芬	3,641,081.20	2.40
78	000031	大悦城	3,497,909.00	2.30
79	600598	北大荒	3,497,062.00	2.30
80	000776	广发证券	3,278,000.00	2.16
81	603583	捷昌驱动	3,225,508.00	2.12
82	300450	先导智能	3,142,543.00	2.07
83	600016	民生银行	3,111,939.91	2.05

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	601328	交通银行	26,249,192.00	17.28
2	600585	海螺水泥	21,529,343.84	14.17

3	000651	格力电器	20,934,312.02	13.78
4	601318	中国平安	20,913,690.40	13.77
5	601166	兴业银行	19,719,507.03	12.98
6	600801	华新水泥	17,962,799.77	11.82
7	601818	光大银行	17,961,476.00	11.82
8	600104	上汽集团	16,330,366.40	10.75
9	600000	浦发银行	16,220,295.38	10.68
10	600741	华域汽车	15,781,332.34	10.39
11	300498	温氏股份	15,374,529.78	10.12
12	601628	中国人寿	13,241,705.00	8.72
13	601398	工商银行	12,790,294.00	8.42
14	300014	亿纬锂能	12,522,500.30	8.24
15	600015	华夏银行	12,472,919.40	8.21
16	600048	保利地产	11,355,939.00	7.47
17	601688	华泰证券	11,131,600.63	7.33
18	601988	中国银行	10,963,151.00	7.22
19	002475	立讯精密	10,890,378.00	7.17
20	000063	中兴通讯	10,559,506.01	6.95
21	600009	上海机场	10,545,322.26	6.94
22	600056	中国医药	10,067,839.08	6.63
23	601186	中国铁建	9,519,752.00	6.27
24	000858	五粮液	9,397,999.00	6.19
25	300003	乐普医疗	9,387,564.80	6.18
26	600519	贵州茅台	9,366,034.50	6.16
27	000333	美的集团	9,280,904.79	6.11
28	002202	金风科技	9,223,321.80	6.07
29	002236	大华股份	8,945,602.20	5.89
30	601128	常熟银行	8,648,847.00	5.69
31	000932	华菱钢铁	8,294,015.20	5.46
32	300144	宋城演艺	8,166,156.85	5.37
33	600859	王府井	7,990,505.59	5.26
34	601607	上海医药	7,966,245.00	5.24
35	300572	安车检测	7,926,429.60	5.22
36	600763	通策医疗	7,803,167.00	5.14
37	002624	完美世界	7,679,825.50	5.05
38	601012	隆基股份	6,949,763.20	4.57
39	603043	广州酒家	6,827,170.00	4.49
40	601888	中国国旅	6,717,138.00	4.42

41	601668	中国建筑	6,715,545.20	4.42
42	600004	白云机场	6,698,933.00	4.41
43	002039	黔源电力	6,502,513.00	4.28
44	600016	民生银行	6,461,583.97	4.25
45	600872	中炬高新	6,346,192.66	4.18
46	601933	永辉超市	6,342,334.00	4.17
47	601169	北京银行	6,173,400.00	4.06
48	002439	启明星辰	6,141,441.35	4.04
49	002035	华帝股份	5,853,862.27	3.85
50	600383	金地集团	5,777,164.00	3.80
51	603517	绝味食品	5,749,505.00	3.78
52	601939	建设银行	5,356,098.00	3.53
53	600031	三一重工	5,288,568.00	3.48
54	600436	片仔癀	5,175,076.00	3.41
55	000860	顺鑫农业	5,029,479.80	3.31
56	601601	中国太保	5,005,954.00	3.29
57	600258	首旅酒店	4,909,036.05	3.23
58	601336	新华保险	4,907,168.00	3.23
59	600426	华鲁恒升	4,823,346.00	3.17
60	002120	韵达股份	4,688,231.24	3.09
61	600123	兰花科创	4,678,000.00	3.08
62	600230	沧州大化	4,624,105.70	3.04
63	601233	桐昆股份	4,588,957.00	3.02
64	000538	云南白药	4,483,313.00	2.95
65	300188	美亚柏科	4,353,997.00	2.87
66	600999	招商证券	4,214,755.74	2.77
67	300122	智飞生物	4,123,534.76	2.71
68	000425	徐工机械	4,110,627.20	2.71
69	601009	南京银行	4,090,339.00	2.69
70	300413	芒果超媒	4,061,155.00	2.67
71	600547	山东黄金	4,056,547.10	2.67
72	002714	牧原股份	3,996,516.00	2.63
73	000961	中南建设	3,971,272.00	2.61
74	600596	新安股份	3,879,065.37	2.55
75	002508	老板电器	3,812,883.00	2.51
76	600508	上海能源	3,799,500.00	2.50
77	000661	长春高新	3,763,793.00	2.48
78	002271	东方雨虹	3,734,077.30	2.46

79	002353	杰瑞股份	3,703,309.00	2.44
80	600598	北大荒	3,496,278.00	2.30
81	000725	京东方 A	3,463,388.00	2.28
82	000031	大悦城	3,389,944.00	2.23
83	002832	比音勒芬	3,367,405.50	2.22
84	300450	先导智能	3,365,743.76	2.22
85	000776	广发证券	3,232,608.64	2.13
86	600919	江苏银行	3,190,000.00	2.10
87	600690	海尔智家	3,075,077.00	2.02
88	002025	航天电器	3,065,397.61	2.02

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	717,951,231.99
卖出股票收入（成交）总额	804,087,103.26

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本报告期末（2019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：报告期内（2019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（2019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

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

## 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

-

### 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

-

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	88,323.06
2	应收证券清算款	9,934,530.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-614.59
5	应收申购款	5,687.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,027,926.19

### 8.12.4 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。

### 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	276	171,114.97	45,698,747.83	96.76%	1,528,983.73	3.24%
英大灵活配置B	107	1,076,093.47	115,027,783.17	99.90%	114,218.34	0.10%
合计	376	431,834.40	160,726,531.00	98.99%	1,643,202.07	1.01%

### 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	67,794.14	0.1435%
	英大灵活配置B	8,039.06	0.0070%
	合计	75,833.20	0.0467%

### 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
	英大灵活配置B	0
	合计	0
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	0
	合计	0~10

### 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	16,256,972.30	10.01	9,999,450.00	6.16	3年

资金					
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	3 年
基金经理等人员	-	-	-	-	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	3 年
其他	4,960.32	0.00	6,060.36	0.00	3 年
合计	16,261,932.62	10.02	10,005,510.36	6.16	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	1,314,622.29	156,082,927.74
本报告期基金总申购份额	47,846,656.19	29,221,682.57
减:本报告期基金总赎回份额	1,933,546.92	70,162,608.80
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,227,731.56	115,142,001.51

## § 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，基金托管人中国农业银行总行于 2019 年 1 月决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 3 月 14 日发布公告，自 2019 年 3 月 14 日起，郑中华新任英大灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

本报告期内，基金托管人中国农业银行总行于 2019 年 4 月决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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，孔旺先生离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，马晓燕女士新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，自 2019 年 5 月 16 日起，张大铮先生任英大基金管理有限公司总经理助理（投资总监），自 2019 年 6 月 28 日开始履行高级管理人员职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 8 月 28 日发布公告，自 2019 年 8 月 27 日起，倪枫先生离任英大基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 9 月 20 日发布公告，自 2019 年 9 月 18 日起，刘轶先生离任英大基金管理有限公司督察长职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 10 月 15 日发布公告，自 2019 年 10 月 14 日起，刘康喜先生新任英大基金管理有限公司督察长职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 11 月 14 日发布公告，自 2019 年 11 月 12 日起，柴元春先生离任英大基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2019 年 11 月 27 日发布公告，自 2019 年 11 月 25 日起，袁忠伟先生不再担任英大灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

### 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

无

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构由瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本年度审计费用为 60,000 元。本次会计师事务所的变更已经基金管理人董事会批准，并履行了必要的程序。

### 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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚等情况。

### 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	518,338,575.81	34.37%	379,059.67	35.43%	-
国元证券	1	440,200,106.28	29.19%	321,915.52	30.09%	-
东兴证券	1	438,813,656.17	29.10%	320,904.54	29.99%	-
国联证券	1	109,917,383.83	7.29%	47,408.34	4.43%	-
华林证券	2	800,856.48	0.05%	585.66	0.05%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 公司财务状况良好，经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iii 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究质量评价进行评估：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的行业研究的前瞻性、深度及广度进行评估，初步划定范围；

ii 对交易单元候选券商的研究服务进行评估：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和服务效果进行估，确定选用交易单元的券商。

iii 协议签署及通知托管人本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本表“佣金”指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易合计支付该等券商的佣金合计。

### 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	262,907.00	0.43%	-	-	-	-
国元证券	60,819,399.09	98.37%	3,313,500,000.00	99.55%	-	-
东兴证券	436,705.50	0.71%	15,000,000.00	0.45%	-	-
国联证券	305,539.52	0.49%	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-

### 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 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、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 1 月 2 日
2	关于民生银行系统维护影响部分交易的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 1 月 17 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、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
4	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券日报及公司网站	2019 年 1 月 22 日
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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公	2019 年 2 月 26 日

	询有限公司为代销机构的公告	司网站	
7	英大基金管理有限公司关于变更基金经理的公告	证券日报及公司网站	2019年3月14日
8	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年度报告及摘要	证券日报及公司网站	2019年3月28日
9	英大基金管理有限公司关于调整旗下部分基金估值方法的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年4月3日
10	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年4月16日
11	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券日报及公司网站	2019年4月18日
12	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年第一次收益分配公告	证券日报及公司网站	2019年4月23日
13	英大灵活配置混合型发起式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	证券日报及公司网站	2019年4月23日
14	英大基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年5月14日
15	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年5月14日
16	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	2019年5月24日
17	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019年5月28日
18	英大灵活配置混合型发起式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	证券日报及公司网站	2019年6月17日
19	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年第二次收益分配公告	证券日报及公司网站	2019年6月18日
20	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更	证券日报及公司网站	2019年6月20日

	新) (2019 年第 1 号) 及摘要		
21	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 6 月 21 日
22	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 6 月 21 日
23	英大基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 6 月 21 日
24	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 6 月 27 日
25	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	2019 年 6 月 29 日
26	英大基金关于旗下基金 2019 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	2019 年 7 月 1 日
27	英大基金管理有限公司关于增加上海陆金所基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 7 月 1 日
28	英大基金管理有限公司产品风险等级评价说明 (2019 年 6 月)	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 7 月 1 日
29	英大基金管理有限公司关于增加中信证券股份有限公司、中信证券 (山东) 有限责任公司、中信期货有限公司为旗下部分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	2019 年 7 月 12 日
30	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	证券日报及公司网站	2019 年 7 月 19 日
31	英大基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 7 月 25 日
32	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年第三次收益分配公告	证券日报及公司网站	2019 年 8 月 24 日
33	英大灵活配置混合型发起式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	证券日报及公司网站	2019 年 8 月 26 日

34	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告及摘要	证券日报及公司网站	2019 年 8 月 26 日
35	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	2019 年 8 月 28 日
36	英大基金管理有限公司关于增加交通银行为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报及公司网站	2019 年 9 月 6 日
37	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	2019 年 9 月 20 日
38	英大基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 9 月 21 日
39	英大基金管理有限公司关于增加上海联泰基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 9 月 26 日
40	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	2019 年 10 月 15 日
41	英大基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 10 月 22 日
42	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	证券日报及公司网站	2019 年 10 月 24 日
43	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	2019 年 11 月 14 日
44	英大基金管理有限公司关于修订公司旗下公开募集证券投资基金基金合同信息披露有关条款的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 11 月 23 日
45	英大基金管理有限公司关于更新旗下公募产品招募说明书的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 11 月 23 日
46	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(2019 年第 2 号)	证券日报及公司网站	2019 年 11 月 23 日
47	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年第四次收益分配公告	证券日报及公司网站	2019 年 11 月 27 日
48	英大灵活配置混合型发起式	证券日报及公司网	2019 年 11 月 27 日

	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	站	
49	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第一次收益分配公告	证券日报及公司网站	2019 年 11 月 27 日
50	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	证券日报及公司网站	2019 年 11 月 27 日
51	英大基金招募说明书提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 11 月 28 日
52	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)(2019 年第 3 号)	证券日报及公司网站	2019 年 11 月 28 日
53	英大基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 12 月 6 日
54	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	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 12 月 9 日
55	英大基金管理有限公司产品风险等级评价说明(2019 年 12 月)	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2019 年 12 月 31 日
56	英大基金管理有限公司关于旗下部分产品参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	证券日报及公司网站	2019 年 12 月 31 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	2019.1.1-2019.12.31	118,460,019.74	0.00	40,000,000.00	78,460,019.74	48.32%
	2	2019.7.16-2019.12.31	0.00	45,698,747.83	0.00	45,698,747.83	28.14%
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

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.ydamc.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人英大基金管理有限公司，客户服务电话：010-57835666、400-890-5288。

英大基金管理有限公司

2020 年 3 月 31 日