

英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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。本中期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 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44

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.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§ 8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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情况.....	46
§ 9 开放式基金份额变动.....	46
§ 10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
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.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§ 12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	51

§ 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	
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	23,342,965.62份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
下属分级基金的交易代码	003446	003447
报告期末下属分级基金的份额总额	15,344,701.77份	7,998,263.85份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、固定收益品种投资策略；4、中小企业私募债券的投资；5、股指期货投资策略；6、权证投资策略；7、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	50%×中证全指指数收益率+50%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	英大基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘康喜
	联系电话	010-59112026
	电子邮箱	liukx@ydamc.com
客户服务电话	400-890-5288	95511-3
传真	010-59112222	0755-82080387
注册地址	北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址	北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座
邮政编码	100020	518001

法定代表人	范育晖	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ydamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	英大基金管理有限公司	北京市朝阳区东三环中路1号 环球金融中心西塔22楼2201
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

§ 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

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
本期已实现收益	1,091,144.35	785,821.12
本期利润	2,192,100.52	1,744,740.88
加权平均基金份额 本期利润	0.1430	0.1451
本期加权平均净 值利润率	7.25%	7.45%
本期基金份额净 值增长率	8.37%	8.26%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利 润	14,683,618.28	7,273,342.04
期末可供分配基 金份额利润	0.9569	0.9094
期末基金资产净 值	30,028,320.05	15,271,605.89
期末基金份额净 值	1.9569	1.9094
3.1.3 累计期末	报告期末(2023年6月30日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	113.53%	108.51%

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	0.30%	1.07%	0.76%	0.43%	-0.46%	0.64%
过去三个月	-3.94%	0.90%	-1.12%	0.40%	-2.82%	0.50%
过去六个月	8.37%	0.95%	2.67%	0.39%	5.70%	0.56%
过去一年	-3.92%	1.15%	-2.27%	0.47%	-1.65%	0.68%
过去三年	50.65%	1.14%	8.47%	0.58%	42.18%	0.56%
自基金合同生效起至今	113.53%	1.08%	14.75%	0.59%	98.78%	0.49%

英大睿鑫 C

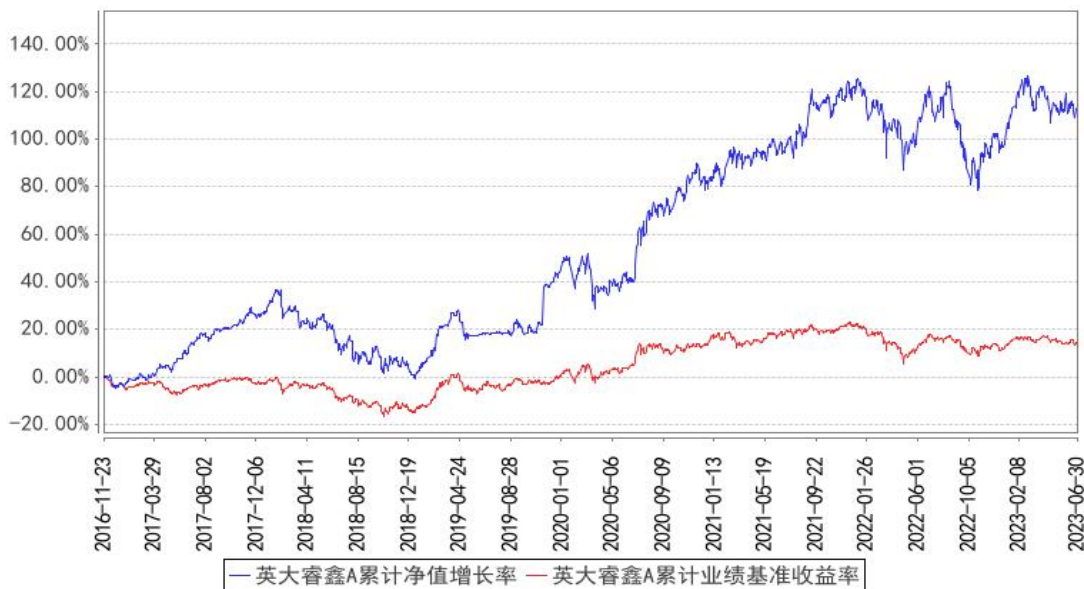
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.28%	1.07%	0.76%	0.43%	-0.48%	0.64%
过去三个月	-3.99%	0.90%	-1.12%	0.40%	-2.87%	0.50%
过去六个月	8.26%	0.95%	2.67%	0.39%	5.59%	0.56%
过去一年	-4.12%	1.15%	-2.27%	0.47%	-1.85%	0.68%
过去三年	49.73%	1.14%	8.47%	0.58%	41.26%	0.56%
自基金合同生效起	108.51%	1.08%	14.75%	0.59%	93.76%	0.49%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

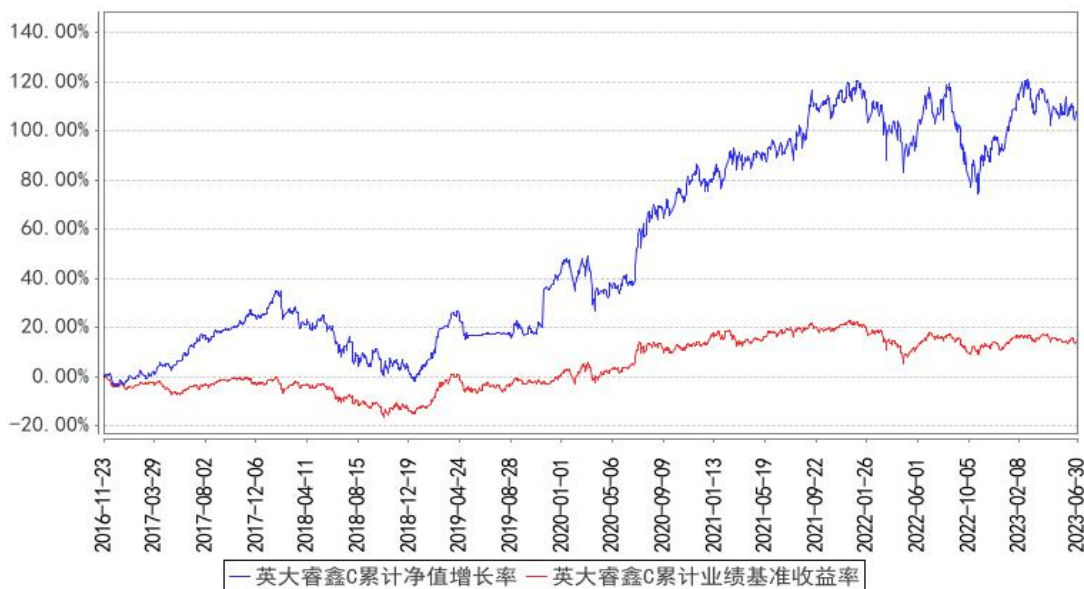
注：同期业绩比较基准为 50%×中证全指指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

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

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“英大基金”）成立于 2012 年 8 月 17 日，注册资本金 11.46 亿元，是国网英大国际控股集团有限公司的全资子公司，实际控制人为国家电网有限公司。英大基金依托股东优势，坚持市场化发展方向，立足新发展阶段、贯彻新发展理念，根植主业、服务实业、坚持能源特色、努力创造价值，积极构建规模、速度、结构、质量、效益、安全“六统一”的新发展格局，致力于为客户提供卓越的资产管理服务。

截至 2022 年末，公司全口径管理资产规模站稳千亿平台，主动管理能力与业务规模同步提升。公司依托高效的决策机制、专业的投研团队、严谨的风控体系，先后荣获东方财富风云榜“最具潜力基金公司奖”、金融界领航中国“金智奖”之“杰出新锐基金公司”、新浪财经“最具成长潜力基金公司”，在 2023 金融业高质量发展大会暨第九届金融企业社会责任论坛上，公司以“深化普惠金融，助力共同富裕”的一系列实践获评《金融企业社会责任蓝皮书（2022）》优秀案例等奖项。

截至 2023 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、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金、英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金、英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、英大安益中短债债券型证券投资基金、英大安悦纯债债券型证券投资基金、英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、英大通佑纯债一年定期开放债券型证券投资基金、英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大安昶纯债债券型证券投资基金、英大碳中和混合型证券投资基金、英大延福养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2055 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2060 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）26 只开放式证券投资基金，同时，管理数十个特定客户资产投资组合。

基金管理人与股东之间实行业务隔离制度，股东并不直接参与基金财产的投资运作。

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		
汤戈	本基金的基金经理	2021年8月6日	2023年3月31日	22年	清华大学硕士研究生，历任国泰君安证券股份有限公司企业融资部、大企业战略合作部项目经理，国信证券股份有限公司投资研究总部行业研究员，华西证券股份有限公司投资研究总部高级研究员，英大泰和人寿保险股份有限公司投资管理部权益投资处处长、总经理助理、副总经理，英大保险资产管理有限公司首席策略师兼组合管理部总经理，泛海股权投资管理有限公司助理总裁兼证券投资部总经理，泛海投资集团有限公司助理总裁兼民丰资本公司副总经理。2020年5月加入英大基金，历任权益投资总监（履行高级管理人员职务）兼权益投资部总经理，2021年8月至2023年3月期间担任英大策略优选混合型证券投资基金基金经理，2021年8月至2023年3月期间担任英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年8月至2023年3月期间担任英大国企改革主题股票型证券投资基金基金经理。
张媛	本基金的基金经理	2019年11月20日	-	9年	北京工业大学博士。曾任中国国际期货有限公司资产管理部高级量化分析师，2016年9月加入英大基金管理有限公司权益投资部，现任英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大中证ESG120策略指数基金、英大碳中和混合型证券投资基金基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等国家法律法规和监管部门的规定，公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》，适用于公司所管理的全部公募基金、私募资产管理计划等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括：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。所有投资组合共享统一的投资研究平台，投资研究团队使用同一研究报告系统，确保公募基金、特定客户资产管理组合等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括：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。

风险管理部定期对不同投资组合（尤其是同一位投资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。

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

（一）基金投资策略

2023 年上半年，中国资本市场经历了由复苏预期驱动的快速反弹阶段和实际经济数据疲软引发震荡下跌的两个阶段，市场呈现“倒 V”字型宽幅震荡，经济恢复强预期与企业盈利端弱现实形成鲜明对比，这样的市场行情对于投资形成一定的挑战和压力。

自从去年 11 月到今年 3 月，资本市场对于疫情后的经济复苏寄予较高期望。这种信心一方面来自市场阶段性累积的需求快速释放。例如，2023 年初全社会人员流动的恢复驱动偏社交属性的餐饮、旅游等行业快速升温，地产、出口相应的累积需求释放驱动需求数据阶段性同比高增长。另一方面，信心来自货币政策总量扩张。社融方面，一季度较强势，季末央行超预期降低金融机构存款准备金率 0.25 个百分点；宽信用意在精准引导资金流向实体经济，解决其融资难的问题。产业政策角度，延续 2022 年年底地产“三支箭”政策的落实，全国各地政府在“房住不炒”的框架内，陆续推出不同力度的地产投资、需求端支持政策。因而，在一季度业绩真空期，市场对经济恢复的预期上行，此阶段资产价格也快速上涨，其中沪深 300 指数上涨约 16%，大宗商品价格上行，10 年期国债收益率也大幅上行约 30 个基点。

进入 4 月份，各项经济指标表现不及预期，市场信心受到一定冲击，A 股整体震荡下行。一方面，房地产销售数据边际放缓，工业企业利润同比负增速，制造业投资不及预期。疫情带来居民资产负债表受损，居民“超额储蓄”增加，消费在短暂的复苏回弹后步调开始减弱；CPI、PPI 数据处于低位，引发市场对于经济通缩的担忧。外需方面，一季度出口数据短暂结构性好转，但二季度在海外去库背景下，出口数据下滑。另一方面，稳增长政策效用边际递减。二季度各产业层面的促消费政策不断推出，包括家电、新能源车等角度的促消费举措，但扩散性不足，长期拉动力量有待观察。宽松政策在二季度有短暂的边际收紧迹象。相较于 2022 年 Q2 的低基数，当季高增长的达成基本没有悬念，导致大家对于政策的储备和预期下行。随着企业阶段经营数据的披露，市场信心下挫。与一季度全市场普遍上涨形成鲜明对比的是，二季度主要指数和行业都出现回调，仅 AI 新业态相关的重点行业呈现较好收益。

外部环境因素方面，美联储仍在加息周期中，虽仍为负面冲击，但影响的幅度逐渐降低。国内资本市场整体较弱，一方面源于对经济自然恢复的弹性和对保增长政策力度的“高估”，另一方面来自对中国经济长周期下的中低增速高质量发展及经济结构转型的政策定力“新常态”的“低估”。

在经济修复的宏观不确定中，我们更注重个股的低估和增长预期的确定性。我们判断当前个

股盈利的修复是今年股票资产价格上涨的主要驱动因素，对于预期盈利增速不能匹配其估值空间的资产更为回避。报告期内，基金的整体运作基于权益投研团队自身所坚持的特色鲜明的理念、模式、流程、方法，开展权益投研工作。组合和个股方面主要布局包括国潮消费品、传媒、家电等泛消费领域的竞争优势企业，信息、电子等先进制造领域的竞争优势企业，化工、汽车零配件及部分金融等顺周期企业。报告期内，部分重点持仓中大消费类、电子等品种收益显著超越其他行业个券，部分先进制造领域个券，为我们的组合在反弹过程中增加了有益的弹性。未来我们将持续观察各行业的基本面改善的预期及确定性，基于自下而上的深入研究和基本面分析，甄别不同经济环境中基本面确定有向好预期的个股。我们将继续秉承既定的投资策略，坚持品种基本面和合理估值兼顾，争取为投资者带来长期稳健的收益回报。

（二）报告期运作分析

报告期内，市场主要指数涨跌不一，上证指数区间上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 500 上涨 2.29%，创业板指下跌 5.61%，万得全 A 上涨 3.06%。同期英大睿鑫 A 单位净值上涨 8.37%，英大睿鑫 C 单位净值上涨 8.26%。报告期内，基金股票投资比例的中枢维持在 90%左右，具体以优选“经济修复受益行业+中国长期竞争优势行业”为主。

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 1.9569 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.37%；截至本报告期末英大睿鑫 C 基金份额净值为 1.9094 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.26%；业绩比较基准收益率为 2.67%。

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）宏观预期：海外稳中略降，国内维持修复

展望 2023 年下半年，预期国外主要经济体经济的共性特征为“稳中略降”，中国经济继续体现出周期的不同，但稳增长仍需较大政策支持。

截至目前，外围经济体通胀数据持续回落，加息进程预期逐步退出，但我们也观察到美国就业数据和服务业 PMI 景气指数的强韧表现，对经济增速形成支撑。且海外库存周期自 2022 年年中开始，也基本行至尾声，下半年的经济增速不应过于悲观。预期中国经济下半年的特征为“周期上行，环比弱改善”。从政策预期来看，关键在于及时挽回信心下滑，推动经济增速回归到潜在可接受的水平。未来半年，决策层在稳增长政策方面仍有较多空间和工具可利用。从货币政策角度来看，首先在于保证相对充足的流动性以支持稳增长，其次要防范风险，以底线思维防范地产、地方政府债务等的风险失控。稳健趋松的货币政策可以通过降准、各种结构性工具从量的角度提供充足流动性，各类期限 LPR 下降等形式的降息也能进一步降低企业融资成本，满足了实体经济

恢复的资金需求；此外，应该因地制宜地降低房贷利息托底地产产业链。财政及产业政策的发力点主要集中于以下几个方面：第一，积极的财政政策集中于发力新型基础设施建设，包括推出专项债和政策性开发性金融工具，为投资端的改善提供资金保障；第二，进一步减税降费，优化营商环境，为民营经济、民间投资和居民大宗消费的逐步恢复创造条件；第三，产业政策将开始结构性发力，提升企业家信心及投融资意愿，为经济的企稳回升提供实质性抓手和保障。

（二）投资策略：经济修复带动市场恢复，结构精选制胜

1. 总体判断

对下半年的经济基本面，我们仍认为内部因素的重要性超过外部因素。从国内整体情况来看，经济的全面复苏为企业盈利改善提供内生动力，而库存周期的触底企稳也是关键的内部因素。从各行业观察，企业去库存的进展显著，经济结构性向好的迹象显现，而中期数据的触底有利于市场重拾对经济修复的理性定价。根据近期市场的一致预期，全 A 市场中 31 个申万一级行业中有超过 25 个行业的 ROE 呈现改善预期，其中大多数改善是由于企业自身盈利能力的提升，特别是经营管理能力提升、毛利提升所带来的基本面的改善。

就估值水平而言，我们注意到市场内部仍然存在一定的结构性低估。在全球权益资产对比中，A 股估值仍处于相对低估的配置状态。前期由于海外加息、增长担忧、人民币贬值等原因流出的外资，将在适当时机回流到人民币资产中。

2. 结构判断

预计下半年结构性的机会将优于整体市场机会。考虑到新常态下的产业格局改善和政策托举支持，在上游价格冲击减缓的环境下，中国具有竞争优势的行业，尤其中游制造业中偏先进制造的部分企业有望在下半年将实现业绩及估值的修复；此外，随着基数效应的缓解、行业周期向上波动以及新消费的恢复，下游大消费行业的部分企业可能在今年表现良好；另外，在经济温和向上、需求恢复的背景下，部分下游结构较好的上游材料行业、部分金融顺周期行业可能会有阶段性良好的表现。

近期，市场对经济复苏情况的认知逐渐变得更加理性和客观。资产价格不仅反映市场预期，还会提前反映市场数据的变化，从 6 月下旬的市场表现能观察到市场对于数据的解读发生了变化。悲观情绪减弱，市场信心增强，这将伴随下半年市场的修复。

下半年，基金投资将坚持以追求长期稳健的业绩表现为投资目标，依托自身所坚持的特色鲜明的理念、模式、流程、方法，始终坚持以价值发现和研究驱动投资的理念进行投资。我们着力寻找具有长期竞争优势的产业链环节，以及基本面良好的品种；坚持以均值回归的思路看待备选品种的估值变化趋势；通过合理的工作流程和可迭代的工作方法开展权益投研工作。产品投资组

合具体以优选“中国长期优势行业+经济修复受益行业”为主线形成投资组合，降低组合波动，穿越市场震荡，力争获取长期稳健的收益。个股主要优选食品饮料、国潮消费、影视传媒、品牌珠宝连锁企业等消费领域的竞争优势企业，电子、计算机、汽车零配件等先进制造领域的竞争优势企业，化工、金融、地产等顺周期企业等。我们将继续秉承既定的投资策略，坚持品种基本面和合理估值兼顾，根据研究成果和市场情况，保持或合理调整投资组合的构成。

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。估值委员会主任由公司总经理担任；成员包括督察长、投资总监、运营分管领导及基金运营部、监察稽核部、风险管理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

本报告期本基金未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金自 2022 年 12 月 5 日至 2023 年 1 月 4 日，出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形；本基金自 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 6 月 30 日，出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

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的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,904,882.62	3,301,152.81
结算备付金		2,769.80	152,472.00
存出保证金		34,338.18	23,044.07
交易性金融资产	6.4.7.2	32,420,679.28	45,229,468.18
其中：股票投资		32,420,679.28	45,229,468.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,402,569.76	2,162.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-

资产总计		45,765,239.64	48,708,299.48
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		352,759.11	6,598.60
应付管理人报酬		17,027.37	25,461.19
应付托管费		2,837.87	4,243.54
应付销售服务费		721.96	3,871.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	91,967.39	127,656.95
负债合计		465,313.70	167,831.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	23,342,965.62	27,167,969.37
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	21,956,960.32	21,372,498.55
净资产合计		45,299,925.94	48,540,467.92
负债和净资产总计		45,765,239.64	48,708,299.48

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，英大睿鑫 A 基金份额净值 1.9569 元，基金份额总额 15,344,701.77 份；英大睿鑫 C 基金份额净值 1.9094 元，基金份额总额 7,998,263.85 份。英大睿鑫份额总额合计为 23,342,965.62 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、营业总收入		4,213,178.79	-478,600.56
1. 利息收入		8,137.42	11,248.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,137.42	11,248.25
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,118,353.23	5,069,220.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,828,494.97	4,593,603.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	44,054.05
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	289,858.26	431,563.43
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,059,875.93	-5,563,673.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	26,812.21	4,603.61
减：二、营业总支出		276,337.39	326,966.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	157,890.68	176,565.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,315.10	29,427.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	22,707.25	51,548.66
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	69,424.36	69,424.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,936,841.40	-805,567.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,936,841.40	-805,567.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,936,841.40	-805,567.15

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	27,167,969.37	-	21,372,498.55	48,540,467.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	27,167,969.37	-	21,372,498.55	48,540,467.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,825,003.75	-	584,461.77	-3,240,541.98
（一）、综合收益总额	-	-	3,936,841.40	3,936,841.40
（二）、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）	-3,825,003.75	-	-3,352,379.63	-7,177,383.38
其中：1. 基金申购款	30,308,111.92	-	29,170,080.45	59,478,192.37
2. 基金赎回款	-34,133,115.67	-	-32,522,460.08	-66,655,575.75
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	23,342,965.62	-	21,956,960.32	45,299,925.94
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	31,368,868.26	-	32,054,961.83	63,423,830.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	31,368,868.26	-	32,054,961.83	63,423,830.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,548,149.69	-	-4,296,176.16	-7,844,325.85
(一)、综合收益总额	-	-	-805,567.15	-805,567.15
(二)、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)	-3,548,149.69	-	-3,490,609.01	-7,038,758.70
其中：1. 基金申购款	13,288,991.10	-	12,276,116.27	25,565,107.37
2. 基金赎回款	-16,837,140.79	-	-15,766,725.28	-32,603,866.07
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	27,820,718.57	-	27,758,785.67	55,579,504.24

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：

范育晖

岳喜伟

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。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编制财务报表。本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况及 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税

政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、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》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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。自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。2018 年 1 月 1 日（含）以后，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 日以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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按 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。

(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。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,904,882.62
等于：本金	2,904,631.93
加：应计利息	250.69
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	2,904,882.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	34,617,064.60	-	32,420,679.28	-2,196,385.32
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	34,617,064.60	-	32,420,679.28	-2,196,385.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末，本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末，本基金未持有黄金衍生品。

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

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本期未发生按预期信用损失一般模型计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未发生债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末，本基金未进行其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期末，本基金未发生其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末，本基金无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末，本基金未进行其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	22,543.03
其中：交易所市场	22,543.03
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,424.36
合计	91,967.39

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

英大睿鑫 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,869,842.94	14,869,842.94
本期申购	1,350,007.29	1,350,007.29
本期赎回（以“-”号填列）	-875,148.46	-875,148.46
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	15,344,701.77	15,344,701.77

英大睿鑫 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,298,126.43	12,298,126.43
本期申购	28,958,104.63	28,958,104.63
本期赎回（以“-”号填列）	-33,257,967.21	-33,257,967.21
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,998,263.85	7,998,263.85

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	14,195,125.38	-2,215,044.03	11,980,081.35
本期利润	1,091,144.35	1,100,956.17	2,192,100.52
本期基金份额交易产生的变动数	434,361.46	77,074.95	511,436.41
其中：基金申购款	1,301,949.73	69,434.26	1,371,383.99
基金赎回款	-867,588.27	7,640.69	-859,947.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,720,631.19	-1,037,012.91	14,683,618.28

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	11,196,248.95	-1,803,831.75	9,392,417.20
本期利润	785,821.12	958,919.76	1,744,740.88
本期基金份额交易产生的变动数	-4,171,826.25	308,010.21	-3,863,816.04
其中：基金申购款	26,751,403.90	1,047,292.56	27,798,696.46
基金赎回款	-30,923,230.15	-739,282.35	-31,662,512.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,810,243.82	-536,901.78	7,273,342.04

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

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	7,384.91
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	517.88
其他	234.63
合计	8,137.42

6.4.7.14 股票投资收益**6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,828,494.97
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,828,494.97

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	55,851,803.45
减：卖出股票成本总额	53,890,771.81
减：交易费用	132,536.67
买卖股票差价收入	1,828,494.97

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期，本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益**6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

本报告期，本基金无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期，本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本期末未持有资产支持证券。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期，本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期，本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期，本基金无贵金属投资收益——申购价差收入。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本报告期，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期，本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	289,858.26
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	289,858.26

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	2,059,875.93
股票投资	2,059,875.93
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	2,059,875.93

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	26,756.04
基金转换费收入	56.17
合计	26,812.21

6.4.7.22 信用减值损失

本报告期末，本基金未发生信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	69,424.36

6.4.7.24 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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、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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	157,890.68	176,565.92
其中：支付销售机构的客户维护费	21,419.77	4,035.78

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 0.6%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×0.6%/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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	26,315.10	29,427.65

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 0.1%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×0.1%/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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	8,722.88	8,722.88
合计	-	8,722.88	8,722.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	49,511.73	49,511.73
合计	-	49,511.73	49,511.73

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.20%÷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

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日	2023年1月1日至2023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	-	-
报告期初持有的基金份额	14,033,121.58	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	14,033,121.58	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	60.1200%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2022年1月1日至2022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	-	-

报告期初持有的基金份额	3,221,952.31	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	3,221,952.31	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.5800%	-

注：报告期内申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；报告期内赎回/卖出总份额：含转换出份额。

基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	2,904,882.62	7,384.91	4,961,194.05	10,914.35

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券股份有限公司	001270	铖昌科技	网下询价配售	568	12,314.24

注：本基金在本报告期内，未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2023 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

本基金本期末，本基金未持有因认购新发或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

本基金本报告期末未持有需披露的暂时停牌等流通受限股票。

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

于本报告期末，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金未持有交易所市场正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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、风险管理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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期及上年度末均未持有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

本基金于本报告期末及上年末均未持有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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期及上年度末均未持有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

本基金于本报告期及上年度末均未持有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

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合

理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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。

本基金所持有的证券主要在证券交易所市场交易，因此，除在附注 6.4.12 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金流动性受限资产比例、持仓集中度等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发行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基金资产净值的 15%。

本基金在报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	2,904,882.62	-	-	-	-	-	2,904,882.62
结算备付金	2,769.80	-	-	-	-	-	2,769.80
存出保证金	34,338.18	-	-	-	-	-	34,338.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-32,420,679.28	32,420,679.28
应收申购款	-	-	-	-	-	-10,402,569.76	10,402,569.76
资产总计	2,941,990.60	-	-	-	-	-42,823,249.04	45,765,239.64
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	352,759.11	352,759.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,027.37	17,027.37
应付托管费	-	-	-	-	-	2,837.87	2,837.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-	721.96	721.96
其他负债	-	-	-	-	-	91,967.39	91,967.39
负债总计	-	-	-	-	-	465,313.70	465,313.70
利率敏感度缺口	2,941,990.60	-	-	-	-	-42,357,935.34	45,299,925.94
上年度末 2022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	3,301,152.81	-	-	-	-	-	3,301,152.81
结算备付金	152,472.00	-	-	-	-	-	152,472.00
存出保证金	23,044.07	-	-	-	-	-	23,044.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-45,229,468.18	45,229,468.18
应收申购款	-	-	-	-	-	2,162.42	2,162.42
资产总计	3,476,668.88	-	-	-	-	-45,231,630.60	48,708,299.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,598.60	6,598.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,461.19	25,461.19
应付托管费	-	-	-	-	-	4,243.54	4,243.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,871.28	3,871.28
其他负债	-	-	-	-	-	127,656.95	127,656.95
负债总计	-	-	-	-	-	167,831.56	167,831.56
利率敏感度缺口	3,476,668.88	-	-	-	-	-45,063,799.04	48,540,467.92

注：本表所示为本基金资产及负债的帐面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，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重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所市场交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	32,420,679.28	71.57	45,229,468.18	93.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	32,420,679.28	71.57	45,229,468.18	93.18

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5 个百分点	1,186,703.30	2,381,821.37
	沪深 300 指数下跌 5 个百分点	-1,186,703.30	-2,381,821.37

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	-	45,229,468.18
第三层次	-	-
合计	-	45,229,468.18

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 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	32,420,679.28	70.84
	其中：股票	32,420,679.28	70.84
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	-	-
	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	2,907,652.42	6.35
8	其他各项资产	10,436,907.94	22.81
9	合计	45,765,239.64	100.00

7.2 报告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	28,802,300.08	63.58
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	854,112.00	1.89
J	金融业	-	-
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	2,764,267.20	6.10
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	32,420,679.28	71.57

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002867	周大生	183,350	3,259,963.00	7.20
2	601966	玲珑轮胎	131,969	2,932,351.18	6.47
3	600197	伊力特	107,600	2,923,492.00	6.45
4	300887	谱尼测试	69,840	2,764,267.20	6.10
5	688169	石头科技	8,605	2,759,451.40	6.09
6	603228	景旺电子	102,400	2,626,560.00	5.80
7	600419	天润乳业	160,880	2,609,473.60	5.76
8	600519	贵州茅台	1,500	2,536,500.00	5.60
9	600315	上海家化	86,100	2,497,761.00	5.51
10	002876	三利谱	68,200	2,262,194.00	4.99
11	000725	京东方 A	541,700	2,215,553.00	4.89
12	002439	启明星辰	28,700	854,112.00	1.89
13	688141	杰华特	17,524	685,188.40	1.51
14	603989	艾华集团	28,725	604,948.50	1.34
15	002036	联创电子	56,700	550,557.00	1.22
16	603606	东方电缆	6,900	338,307.00	0.75

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	601966	玲珑轮胎	3,932,934.60	8.10
2	002876	三利谱	3,792,955.00	7.81
3	000725	京东方 A	3,524,704.00	7.26
4	600197	伊力特	3,458,741.00	7.13
5	300887	谱尼测试	3,198,386.00	6.59
6	000423	东阿阿胶	3,189,887.25	6.57
7	002867	周大生	2,945,657.00	6.07
8	603228	景旺电子	2,893,330.00	5.96
9	600419	天润乳业	2,685,046.00	5.53
10	688169	石头科技	2,627,334.76	5.41
11	600519	贵州茅台	2,164,426.00	4.46
12	603989	艾华集团	1,942,301.00	4.00
13	002439	启明星辰	1,419,169.00	2.92
14	688141	杰华特	699,986.28	1.44
15	603606	东方电缆	342,240.00	0.71
16	600925	苏能股份	55,372.80	0.11
17	001311	多利科技	30,873.13	0.06
18	603281	江瀚新材	21,496.36	0.04
19	603162	海通发展	19,481.75	0.04
20	601121	宝地矿业	11,090.16	0.02

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000423	东阿阿胶	7,798,876.00	16.07
2	000725	京东方 A	5,029,453.00	10.36
3	002867	周大生	4,722,347.75	9.73
4	600197	伊力特	4,667,525.00	9.62
5	600419	天润乳业	4,206,352.00	8.67
6	603228	景旺电子	4,134,800.00	8.52
7	002876	三利谱	3,942,552.00	8.12
8	603989	艾华集团	3,936,049.92	8.11
9	688169	石头科技	3,756,633.36	7.74
10	600519	贵州茅台	3,734,783.00	7.69
11	300887	谱尼测试	3,703,450.00	7.63
12	601966	玲珑轮胎	3,668,753.00	7.56
13	002035	华帝股份	1,122,133.00	2.31
14	002439	启明星辰	684,606.00	1.41
15	002036	联创电子	416,860.00	0.86
16	600925	苏能股份	74,368.00	0.15
17	001311	多利科技	51,147.50	0.11
18	603281	江瀚新材	40,794.16	0.08

19	601121	宝地矿业	26,130.24	0.05
20	603162	海通发展	17,834.30	0.04

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	39,022,106.98
卖出股票收入（成交）总额	55,851,803.45

注：注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

经查询上海证券交易所、深圳证券交易所、中国货币网等公开信息披露平台，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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本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	34,338.18
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,402,569.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,436,907.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
英大睿鑫 A	616	24,910.23	14,033,121.58	91.45	1,311,580.19	8.55
英大睿鑫 C	873	9,161.81	1,263,397.33	15.80	6,734,866.52	84.20
合计	1,427	16,358.07	15,296,518.91	65.53	8,046,446.71	34.47

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总

额)。

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	54,286.88	0.3538
	英大睿鑫 C	15,146.96	0.1894
	合计	69,433.84	0.2975

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
基金合同生效日 (2016年11月23日) 基金份额总额	14,039.74	200,039,816.35
本报告期期初基金份额总额	14,869,842.94	12,298,126.43
本报告期基金总申购份额	1,350,007.29	28,958,104.63
减：本报告期基金总赎回份额	875,148.46	33,257,967.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,344,701.77	7,998,263.85

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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，英大基金管理有限公司于 2023 年 1 月 14 日发布公告，自 2023 年 1 月 13 日起，范育晖代为履行英大基金管理有限公司董事长职务；于 2023 年 4 月 1 日发布公告，自 2023 年 3 月 31 日起，汤戈先生不再担任英大基金管理有限公司权益投资总监（履行高级管理人员职务）。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

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	

			(%)		(%)	
中信建投 证券	2	94,668,901.3 4	100.00	69,231.60	100.00	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，公司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

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(%)
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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	英大基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-1-14
2	英大基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-1-19
3	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-1-19
4	英大基金管理有限公司关于公司法定代表人变更公告	中国证监会规定媒介	2023-2-21
5	英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中国人寿保险股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-2-27
6	英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加诺亚正行基金销售有	中国证监会规定媒介	2023-3-13

	限公司为代销机构的公告		
7	关于英大基金管理有限公司北京分公司经营场所变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-3-15
8	英大基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-3-22
9	英大基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-3-22
10	英大基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-3-30
11	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-3-30
12	英大基金管理有限公司关于基金经理变更的公告-英大睿鑫	中国证监会规定媒介	2023-4-1
13	英大基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-4-1
14	英大基金管理有限公司关于旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-4-6
15	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金（英大睿鑫 C 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2023-4-6
16	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023-4-6
17	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金（英大睿鑫 A 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2023-4-6
18	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-4-21
19	英大基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-4-21
20	英大基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-6-5
21	英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明（2023 年 6 月）	中国证监会规定媒介	2023-6-30

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		间区间					
机构	1	20230101 - 20230630	14,033,12 1.58	0.00	0.00	14,033,121.58	60.12
	2	20230101 - 20230313	11,274,96 4.65	0.00	11,274,96 4.65	0.00	0.00
个人	1	20230630 - 20230630	0.00	4,741,58 3.69	0.00	4,741,583.69	20.31

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托管协议》

《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产品资料概要》

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

基金管理人和基金托管人住所。

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

2023 年 8 月 30 日