

英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	英大灵活配置混合	
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	1,093,493,023.04 份	
基金合同存续期	不定期	
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
下属分级基金的交易代码:	001270	001271
报告期末下属分级基金的份额总额	503,588,857.27 份	589,904,165.77 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。

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	宗宽广	林葛
	联系电话	010-59112066	010-66060069
	电子邮箱	zongkg@ydamc.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-890-5288	95599
传真		010-85878087	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ydamc.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日- 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	16,577,908.91	18,110,855.59
本期利润	16,919,776.76	16,696,856.08
加权平均基金份额本期利润	0.0120	0.0082
本期基金份额净值增长率	1.36%	1.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0349	0.0304
期末基金资产净值	524,420,605.63	611,663,052.62
期末基金份额净值	1.041	1.037

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期末可供分配利润为期末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。

3.2 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
过去一个月	0.58%	0.07%	0.28%	0.01%	0.30%	0.06%
过去三个月	0.87%	0.06%	0.84%	0.01%	0.03%	0.05%

过去六个月	1.36%	0.05%	1.70%	0.01%	-0.34%	0.04%
过去一年	2.46%	0.06%	3.60%	0.01%	-1.14%	0.05%
自基金合同生效起至今	4.10%	0.08%	4.26%	0.01%	-0.16%	0.07%

英大灵活配置 B

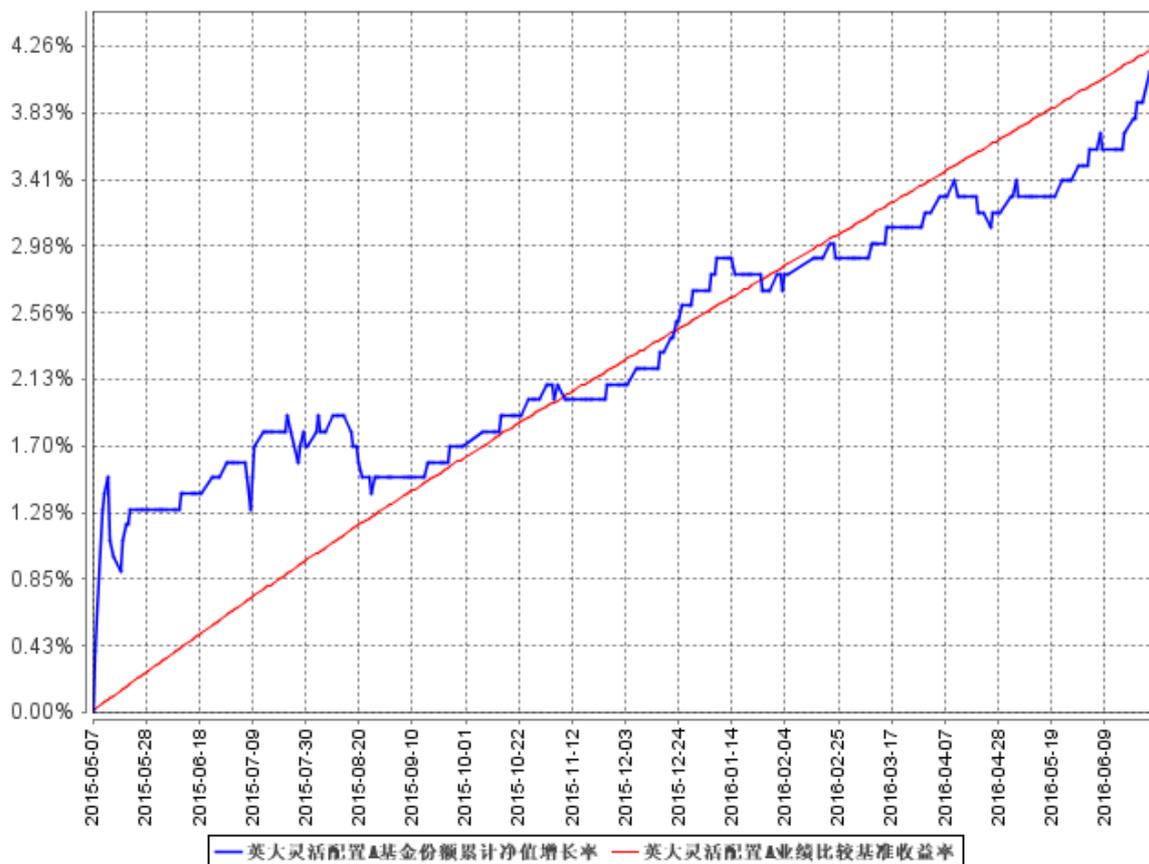
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.58%	0.06%	0.28%	0.01%	0.30%	0.05%
过去三个月	0.88%	0.06%	0.84%	0.01%	0.04%	0.05%
过去六个月	1.17%	0.06%	1.70%	0.01%	-0.53%	0.05%
过去一年	2.17%	0.06%	3.60%	0.01%	-1.43%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.70%	0.09%	4.26%	0.01%	-0.56%	0.08%

注：①本基金合同于 2015 年 5 月 7 日生效；

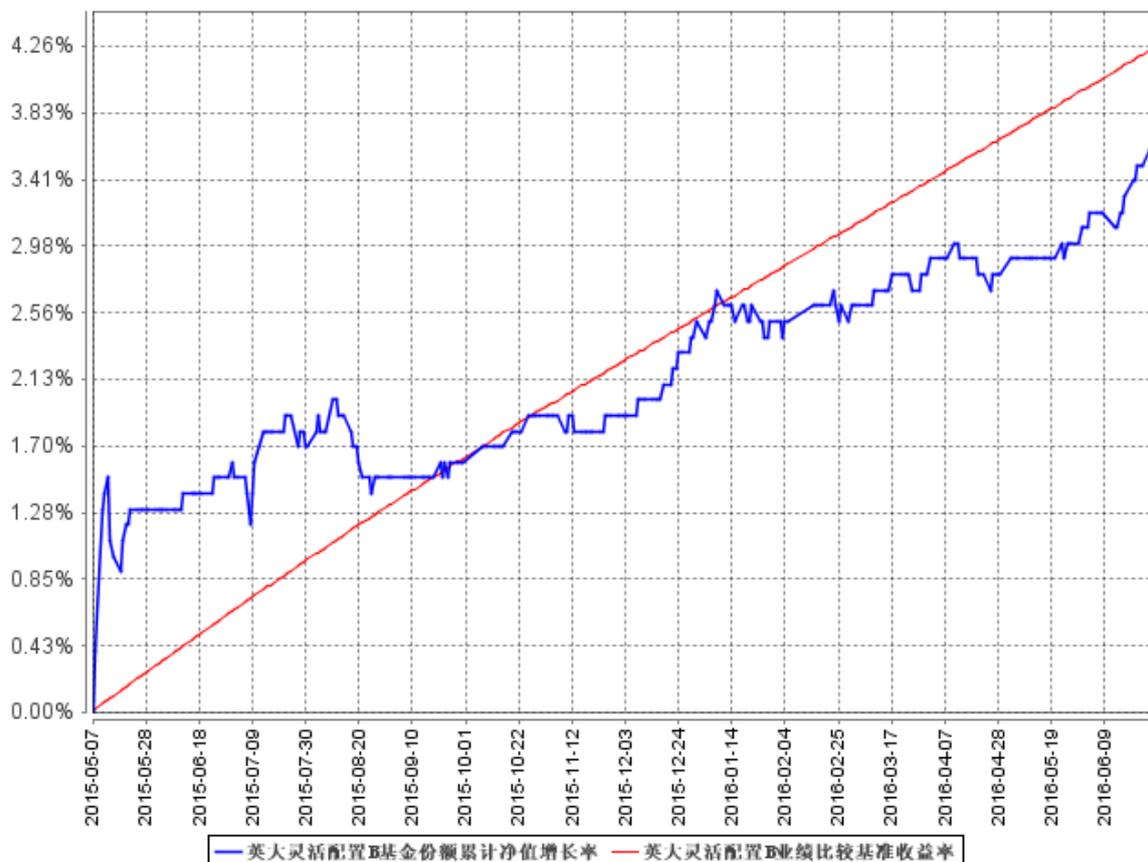
②本基金的业绩比较基准为：1 年期银行定期存款利率（税后）+2%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

2012年8月17日，经中国证监会批准，英大基金管理有限公司在北京正式成立。公司由英大国际信托有限责任公司（简称英大信托）、中国交通建设股份有限公司（简称中交股份）和航天科工财务有限责任公司（简称航天科工财务）三家股东发起成立。英大基金注册资金2亿元人民币，其中英大信托出资比例为49%，中交股份出资比例为36%，航天科工财务出资比例为15%。

截至报告期末，本公司管理5只开放式证券投资基金，同时，管理多个特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
袁忠伟	本基金基金经理	2015 年 5 月 7 日	-	15	曾任中国民族证券证券投资部总经理助理、执行总经理；华西证券股份有限公司资产管理总部研究总监。2015 年 1 月加入英大基金管理有限公司，曾任研究发展部副总经理，现任权益投资部总经理。
张琳娜	本基金基金经理	2015 年 7 月 15 日	-	9	对外经济贸易大学金融学硕士，9 年基金从业经历。先后任益民基金管理有限公司集中交易部交易员、副总经理等职务。2012 年 3 月加入英大基金管理有限公司，曾任公司交易管理部副总经理（主持工作），现任固定收益部总经理。

注：①任职日期说明：基金经理袁忠伟的任职日期为基金合同生效的日期，基金经理张琳娜的任职日期为该基金经理经监管机构审核通过后公司公开披露的日期。

②证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

③本基金基金经理助理赵玲莹女士，澳洲昆士兰科技大学应用金融学硕士，曾任职于交通银行山西省分行，2013 年加入英大基金管理有限公司，从事固定收益研究工作，具备 4 年金融业从业经历。

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、整体资产配置

为持有人持续实现正收益是本基金投资运作的目标，在股票市场整体估值水平偏高、上市公司整体业绩增速放缓、波动风险加大的背景下，本基金坚持严格控制股票投资比例，加大债券投资规模的资产配置策略。上半年股票投资占净资产的比例在 1%~4.9% 波动，以积极有效的仓位调控应对市场的区间震荡；债券和现金占净资产的比例在 95.1%~99% 波动。低风险资产配置策略为基金净值稳步提升打下坚实的基础。

2、股票投资

本基金继续采取“以价值股为主要投资方向，仓位控制坚持高减低增、灵活调控”的投资策略。虽然投资组合较为抗跌，但年初市场大幅下跌也使股票投资再前两月出现一定程度的亏损。当市场企稳后，我们适度增仓二级市场股票，积极参与网下新股配售，从三月份起，股票投资实现月月盈利。上半年，股票投资实现较大盈利，为基金净值增长贡献了力量。

3、债券投资

2016 年，从数据来看宏观经济增速略有下降、CPI 稳中有降，债券市场长端品种经历了 4 月份的大幅调整后，震荡下行；同时，2016 年以来信用风险事件频发，成为扰动债券市场的因素之一。本基金半年末整体保持较高的杠杆水平和中等账户久期，增加了中长端利率债配置比例，时点把握较好，同时对账户贡献较多。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，英大灵活配置 A 类基金累计份额净值为 1.041 元，报告期基金份额净值增长

率为 1.36%；英大灵活配置 B 类基金累计份额净值为 1.037 元，报告期基金份额净值增长率为 1.17%；同期业绩比较基准增长率为 1.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年的国内生产总值（GDP）增速有望保持在 6.7%左右，上市公司整体业绩增速有限，股票市场估值水平偏高的现状难以通过业绩大幅增长得到改善，这决定股票市场在下半年难有连续性上涨的机会和空间。预计估值变化是决定下半年市场波动的核心因素，估值由利率和风险偏好决定，我们判断下半年利率可能震荡弱回升，而“调结构”和“稳增长”使风险偏好在低位震荡，因此对估值的综合影响是震荡回落，使市场进入调整格局。当前市场主要指数（上证 50 和沪深 300）因估值偏低而难以大幅下跌，“国家队”维稳也使恐慌盘基本消失。但包括创业板、次新股在内的一大批小盘股和题材股的估值高企，不排除该类股票在半年报公布后有释放风险的要求。因此，区间震荡可能是市场合理的选择，也符合绝大多数投资者的预期。

股票投资策略：本基金在下半年继续采取“价值与成长均衡配置的二级市场股票，从风险控制、收益可期两维度构建投资组合，获取投资收益；注重一级市场网下配售，尽可能获取低风险增值资产”的投资策略，有效提升基金净值。

债券投资策略：2016 年，在二季度人民币对美元小幅贬值和经济基本面下行的基础上，随着六月末英国脱欧，人民币汇率进一步贬值，国内经济基本面尚未出现实质性改善，以及国际政治格局的变化，都对国内经济形势产生较大影响。与此同时，产能过剩产业的改革不是一蹴而就的，债转股则是金融行业继续加杠杆，若经济基本面没有实质性改善，将面临更大的金融风险。整个 2016 年三季度，经济和债券市场都存在较大不确定性。结合我们目前的持仓，本基金将保持适度的杠杆水平，深入研究精选信用个券、防范信用风险，在保障流动性的前提下，继续保持稳健的风格，力争为持有人持续实现正收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以电子形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后以电子签名形式返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会。估值委员会主任由主管运营公司领导担任，成员包括投资总监、基金经理，研究、交易、监察稽核部门负责人，基金运营部相关负责人。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期末未进行收益分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，英大基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		3,972,643.47	101,477,021.25
结算备付金		83,416.28	524,615.50
存出保证金		69,109.68	673,377.80
交易性金融资产		1,519,313,208.56	2,138,955,831.71
其中：股票投资		53,395,918.56	49,898,981.71
基金投资		-	-
债券投资		1,465,917,290.00	2,089,056,850.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	1,717,002,215.50
应收证券清算款		403,136.70	-
应收利息		26,140,519.26	32,386,416.68
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,549,982,033.95	3,991,019,478.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		409,999,065.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,922,558.74	4,043,694.11
应付托管费		400,533.08	842,436.27

应付销售服务费		342,749.83	1,036,813.95
应付交易费用		862,060.09	1,537,843.61
应交税费		-	-
应付利息		87,530.74	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		283,878.22	80,000.00
负债合计		413,898,375.70	7,540,787.94
所有者权益：			
实收基金		1,093,493,023.04	3,883,796,188.15
未分配利润		42,590,635.21	99,682,502.35
所有者权益合计		1,136,083,658.25	3,983,478,690.50
负债和所有者权益总计		1,549,982,033.95	3,991,019,478.44

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，英大灵活配置 A 类基金份额净值 1.0410 元，基金份额总额 503,588,857.27 份；英大灵活配置 B 类基金份额净值 1.0370 元，基金份额总额 589,904,165.77 份。英大灵活配置基金份额总额合计为 1,093,493,023.04 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 7 日(基金合 同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		66,482,536.58	37,111,233.28
1.利息收入		57,968,027.05	12,330,445.46
其中：存款利息收入		3,369,619.08	8,300,090.99
债券利息收入		47,891,011.71	1,703.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,707,396.26	4,028,651.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,458,526.55	4,449,383.37
其中：股票投资收益		11,012,775.84	4,422,056.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,760,751.88	-6,974.24
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		206,502.59	34,301.00
3.公允价值变动收益（损失以		-1,072,131.66	20,189,380.21

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		128,114.64	142,024.24
减:二、费用		32,865,903.74	13,547,749.34
1. 管理人报酬		21,298,843.23	8,345,826.47
2. 托管费		4,437,258.97	1,738,713.84
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	5,223,563.64	2,606,644.57
4. 交易费用		440,706.76	791,781.23
5. 利息支出		1,199,626.68	-
其中: 卖出回购金融资产支出		1,199,626.68	-
6. 其他费用		265,904.46	64,783.23
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		33,616,632.84	23,563,483.94
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		33,616,632.84	23,563,483.94

6.3 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: 2016年1月1日至2016年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,883,796,188.15	99,682,502.35	3,983,478,690.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	33,616,632.84	33,616,632.84
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)	-2,790,303,165.11	-90,708,499.98	-2,881,011,665.09
其中: 1.基金申购款	2,399.94	93.11	2,493.05
2. 基金赎回款	-2,790,305,565.05	-90,708,593.09	-2,881,014,158.14
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）	1,093,493,023.04	42,590,635.21	1,136,083,658.25
项目	上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效日)至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	106,023,543.68	-	106,023,543.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	23,563,483.94	23,563,483.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	7,396,042,593.87	93,655,270.92	7,489,697,864.79
其中：1.基金申购款	7,492,066,523.87	94,999,625.64	7,587,066,149.51
2.基金赎回款	-96,023,930.00	-1,344,354.72	-97,368,284.72
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）	7,502,066,137.55	117,218,754.86	7,619,284,892.41

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：

杨峰

基金管理人负责人

赵照

主管会计工作负责人

吕向鹏

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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《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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 41 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四中所列示的中国证监会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除 6.4.5.2 会计估计变更的说明中所列的会计估计变更事项外，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。

会计估计变更详见 6.4.5.2 会计估计变更的说明。

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

本基金本报告期间不涉及会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间不涉及会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

(2) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
英大基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：①下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

②本报告期本基金关联方未发生变化。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,298,843.23	8,345,826.47
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 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 × 1.2% / 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,437,258.97	1,738,713.84

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 0.25% 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×0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B	合计
英大基金管理有限公司	-	5,223,563.64	5,223,563.64
合计	-	5,223,563.64	5,223,563.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效日)至2015年6月30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	-	2,606,644.57	2,606,644.57
合计	-	2,606,644.57	2,606,644.57

注：①B类基金份额的销售服务费年费率为0.50%。在通常情况下，B类基金份额的销售服务费按前一日B类基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：日B类基金份额销售服务费=前一日B类基金份额资产净值×0.50%/当年天数，销售服务费每日计提，按月支付。B类基金份额的销售服务费主要用于本基金的持续销售以及基金份额持有人的服务。

②A类基金份额不收取销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
基金合同生效日（2015年5月7日）持有的基金份额	9,999,450.00	-
期初持有的基金份额	9,999,450.00	-

期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,450.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.9100%	-

项目	上年度可比期间	
	2015 年 5 月 7 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
基金合同生效日 (2015 年 5 月 7 日)持有的基金份额	9,999,450.00	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,450.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.1300%	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

6.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 5 月 7 日(基金合同生效日)至 2015 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
农业银行股份有限公司	3,972,643.47	432,837.17	404,627,967.99	1,033,483.64

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.10.1.1 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
002781	奇信股份	2015 年 12 月 16 日		新股流通受限	13.31	43.35	204,545	2,722,493.95	8,867,025.75	
002791	坚朗五金	2016 年 3 月 22 日		新股流通受限	21.57	53.77	121,285	2,616,117.45	6,521,494.45	
002792	通宇通讯	2016 年 3 月 21 日		新股流通受限	22.94	59.80	77,621	1,780,625.73	4,641,735.80	
300508	维宏股份	2016 年 4 月 12 日		新股流通受限	20.08	254.50	10,383	208,490.64	2,642,473.50	
601611	中国核建	2016 年 5 月 27 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	3.47	20.92	37,059	128,594.73	775,274.28	
601127	小康股份	2016 年 6 月 2 日	2016 年 7 月 11 日	新股流通受限	5.81	23.87	8,662	50,326.22	206,761.94	
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 19 日	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	
603131	上海沪工	2016 年 5 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.09	60.70	1,263	12,743.67	76,664.10	
300515	三德科技	2016 年 6 月 1 日	2016 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.57	46.87	1,354	11,603.78	63,461.98	
300518	盛讯达	2016 年 6 月 17 日	2016 年 7 月 21 日	新股流通受限	22.22	46.85	1,306	29,019.32	61,186.10	
002799	环球印务	2016 年 5 月 31 日	2016 年 7 月 12 日	新股流通受限	7.98	43.64	1,080	8,618.40	47,131.20	
603958	哈森股份	2016 年 6 月 21 日	2016 年 7 月 19 日	新股流通受限	9.15	14.50	2,372	21,703.80	34,394.00	

			日							
603909	合诚股份	2016年6月20日	2016年7月22日	新股流通受限	10.55	18.38	1,095	11,552.25	20,126.10	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月25日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	-	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	-	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000651	格力电器	2016年2月22日	临时停牌	19.22	-	-	400,000	7,638,100.94	7,688,000.00	-
300488	恒锋工具	2016年5月4日	临时停牌	72.10	-	-	71,341	1,434,667.51	5,143,686.10	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 409,999,065.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
041562053	15 黑牡丹 CP002	2016 年 7 月 4 日	100.76	500,000	50,380,000.00
041654005	16 水电七局 CP001	2016 年 7 月 4 日	100.19	200,000	20,038,000.00
041556039	15 沪华信 CP001	2016 年 7 月 4 日	100.57	500,000	50,285,000.00

011699189	16 农四师 SCP001	2016 年 7 月 4 日	100.32	200,000	20,064,000.00
011699215	16 沪华信 SCP001	2016 年 7 月 4 日	100.12	120,000	12,014,400.00
041662004	16 鲁宏桥 CP002	2016 年 7 月 4 日	100.02	500,000	50,010,000.00
041562033	15 协鑫发电 CP001	2016 年 7 月 4 日	101.04	600,000	60,624,000.00
041564072	15 健康元 CP001	2016 年 7 月 4 日	100.71	500,000	50,355,000.00
011699247	16 国电 SCP002	2016 年 7 月 4 日	100.10	500,000	50,050,000.00
071633003	16 华融证券 CP003	2016 年 7 月 4 日	100.05	500,000	50,025,000.00
合计				4,120,000	413,845,400.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元。

6.4.10 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	53,395,918.56	3.44
	其中：股票	53,395,918.56	3.44
2	固定收益投资	1,465,917,290.00	94.58
	其中：债券	1,465,917,290.00	94.58
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,056,059.75	0.26

7	其他各项资产	26,612,765.64	1.72
8	合计	1,549,982,033.95	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	31,130,526.53	2.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,642,300.03	0.85
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	2,712,965.90	0.24
J	金融业	9,890,000.00	0.87
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	20,126.10	0.00
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	53,395,918.56	4.70

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600015	华夏银行	1,000,000	9,890,000.00	0.87
2	002781	奇信股份	204,545	8,867,025.75	0.78
3	000651	格力电器	400,000	7,688,000.00	0.68
4	002792	通宇通讯	116,431	6,962,573.80	0.61
5	002791	坚朗五金	121,285	6,521,494.45	0.57
6	300488	恒锋工具	71,341	5,143,686.10	0.45
7	000625	长安汽车	200,000	2,734,000.00	0.24
8	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	0.23
9	000063	中兴通讯	100,000	1,434,000.00	0.13
10	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.07

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于英大基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

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	601166	兴业银行	34,736,504.00	0.87
2	000333	美的集团	27,938,362.69	0.70
3	600015	华夏银行	25,818,626.32	0.65
4	000623	吉林敖东	19,983,434.87	0.50
5	000063	中兴通讯	9,620,078.86	0.24
6	002202	金风科技	8,594,288.50	0.22
7	000651	格力电器	7,638,100.94	0.19
8	000858	五粮液	4,749,401.00	0.12
9	000625	长安汽车	4,672,109.28	0.12
10	600004	白云机场	4,670,000.00	0.12
11	000966	长源电力	4,430,340.39	0.11

12	000100	TCL 集团	3,820,000.00	0.10
13	600104	上汽集团	3,013,200.00	0.08
14	000001	平安银行	3,002,000.00	0.08
15	002791	坚朗五金	2,616,117.45	0.07
16	002792	通宇通讯	1,780,625.74	0.04
17	601328	交通银行	1,560,000.00	0.04
18	600741	华域汽车	1,400,528.00	0.04
19	000402	金融街	939,000.00	0.02
20	300508	维宏股份	208,490.64	0.01

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	601166	兴业银行	35,152,886.00	0.88
2	000333	美的集团	28,287,748.50	0.71
3	600015	华夏银行	27,900,233.76	0.70
4	000623	吉林敖东	20,084,676.50	0.50
5	000063	中兴通讯	14,877,236.40	0.37
6	002202	金风科技	8,761,000.00	0.22
7	000001	平安银行	5,539,500.00	0.14
8	000858	五粮液	4,845,028.89	0.12
9	600004	白云机场	4,724,056.00	0.12
10	000966	长源电力	4,476,440.65	0.11
11	000100	TCL 集团	3,850,000.00	0.10
12	600104	上汽集团	3,042,725.56	0.08
13	601328	交通银行	1,536,000.00	0.04
14	300496	中科创达	1,488,448.00	0.04
15	600741	华域汽车	1,425,428.81	0.04
16	000625	长安汽车	1,408,000.00	0.04
17	603508	思维列控	1,358,964.00	0.03
18	603999	读者传媒	984,161.40	0.02
19	603800	道森股份	958,529.40	0.02
20	000402	金融街	946,000.00	0.02

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。

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	173,038,906.28
卖出股票收入（成交）总额	185,248,558.29

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	350,303,000.00	30.83
	其中：政策性金融债	350,303,000.00	30.83
4	企业债券	100,290.00	0.01
5	企业短期融资券	1,084,189,000.00	95.43
6	中期票据	30,439,000.00	2.68
7	可转债（可交换债）	886,000.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,465,917,290.00	129.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160204	16 国开 04	1,000,000	99,880,000.00	8.79
2	150223	15 国开 23	900,000	90,153,000.00	7.94
3	011699811	16 苏国信 SCP004	900,000	90,072,000.00	7.93
4	011699190	16 天士力 SCP002	800,000	80,184,000.00	7.06
4	011699187	16 欧亚 SCP001	800,000	80,184,000.00	7.06

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本期内未发现本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到

公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本期内本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定，也均在基金的备选股票池之内。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	69,109.68
2	应收证券清算款	403,136.70
3	应收股利	-
4	应收利息	26,140,519.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,612,765.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末（2016年6月30日），本基金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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002781	奇信股份	8,867,025.75	0.78	新股流通受限
2	000651	格力电器	7,688,000.00	0.68	临时停牌
3	002792	通宇通讯	6,962,573.80	0.61	新股流通受限
4	002791	坚朗五金	6,521,494.45	0.57	新股流通受限
5	300488	恒锋工具	5,143,686.10	0.45	临时停牌
6	300508	维宏股份	2,642,473.50	0.23	新股流通受限
7	601611	中国核建	775,274.28	0.07	新股流通受限

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
英大灵活配置 A	5	100,717,771.45	503,581,878.43	100.00%	6,978.84	0.00%
英大灵活配置 B	12	49,158,680.48	588,943,731.49	99.84%	960,434.28	0.16%
合计	17	64,323,119.00	1,092,525,609.92	99.91%	967,413.12	0.09%

8.3 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	99.21	0.0000%
	英大灵活配置 B	1,490.05	0.0001%
	合计	1,589.26	0.0001%

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）。

8.4 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	英大灵活配置 A	0
	英大灵活配置 B	0~10

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

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,450.00	0.91	9,999,450.00	0.91	3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	3 年
基金经理等人员	1,100.04	0.00	1,100.04	0.00	3 年
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	3 年
其他	4,960.32	0.00	4,960.32	0.00	3 年
合计	10,005,510.36	0.91	10,005,510.36	0.91	3 年

§9 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	1,491,917,727.30	2,391,878,460.85
本报告期基金总申购份额	2,399.94	0.00
减：本报告期基金总赎回份额	988,331,269.97	1,801,974,295.08
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	503,588,857.27	589,904,165.77

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2016 年 3 月 17 日发布公告，宗宽广先生自 2016 年 3 月 16 日起担任英大基金管理有限公司督察长，副总经理赵照先生自 2016 年 3 月 16 日起不再代任督察长职务。相关变更事项已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内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

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽核或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国联证券	1	197,761,804.28	56.18%	85,294.71	43.05%	-
光大证券	2	130,527,098.48	37.08%	95,454.50	48.18%	-
东兴证券	1	23,749,534.38	6.75%	17,368.06	8.77%	-

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评估，确定选用交易单元的券商。

- iii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国联证券	4,452,091.91	14.71%	-	-	-	-
光大证券	11,445,579.30	37.83%	25,000,000.00	100.00%	-	-
东兴证券	14,358,481.50	47.46%	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

英大基金管理有限公司
2016 年 8 月 25 日