

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

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 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人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。

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
§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	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
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	43
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45

§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
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的情况.....	47
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
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	
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	
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	张传良	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	中国证券报、证券时报、上海证券报
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

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

§ 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
本期加权平均净值利润率	1.16%	0.80%
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)	
期末可供分配利润	17,552,698.59	17,932,728.65
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	4.10%	3.70%

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

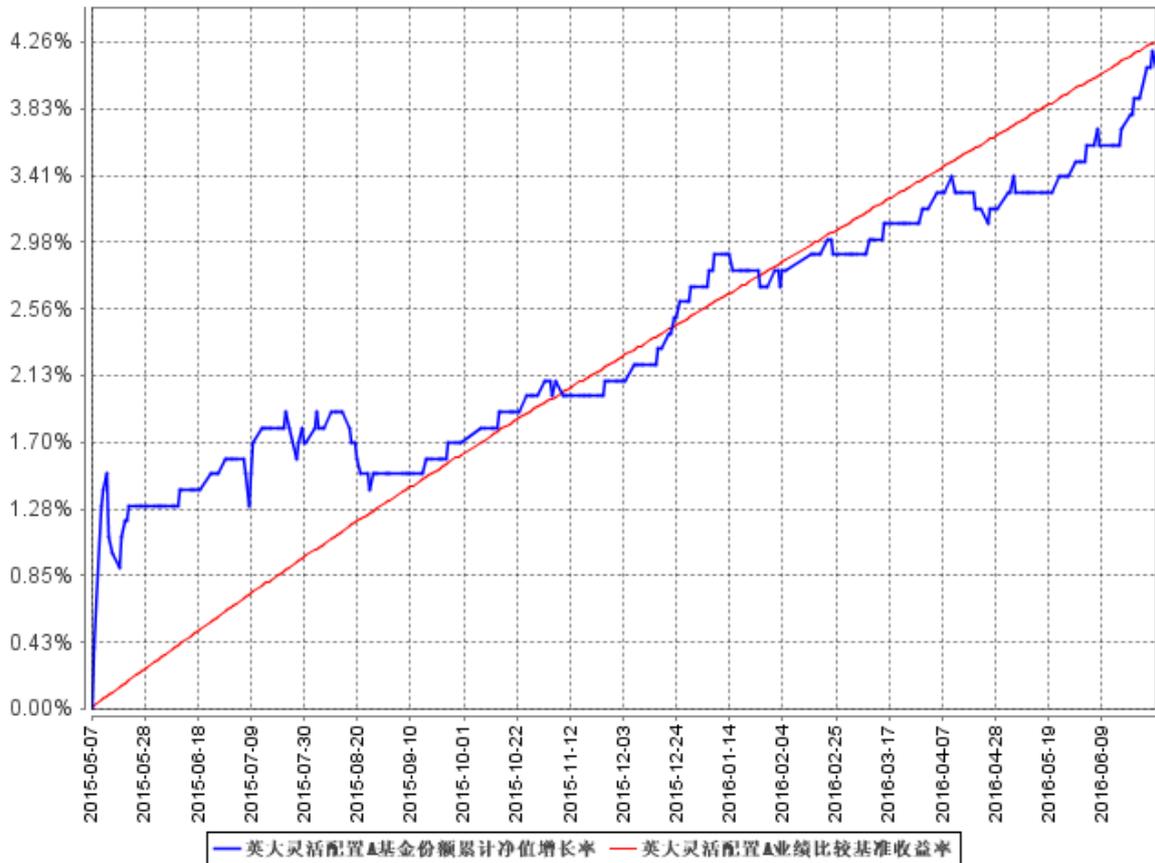
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.58%	0.06%	0.28%	0.01%	0.30%	0.05%
过去三个月	0.88%	0.06%	0.84%	0.01%	0.04%	0.05%
过去六个月	1.17%	0.06%	1.70%	0.01%	-0.53%	0.05%
过去一年	2.17%	0.06%	3.60%	0.01%	-1.43%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.70%	0.09%	4.26%	0.01%	-0.56%	0.08%

注：①本基金合同于 2015 年 5 月 7 日生效；

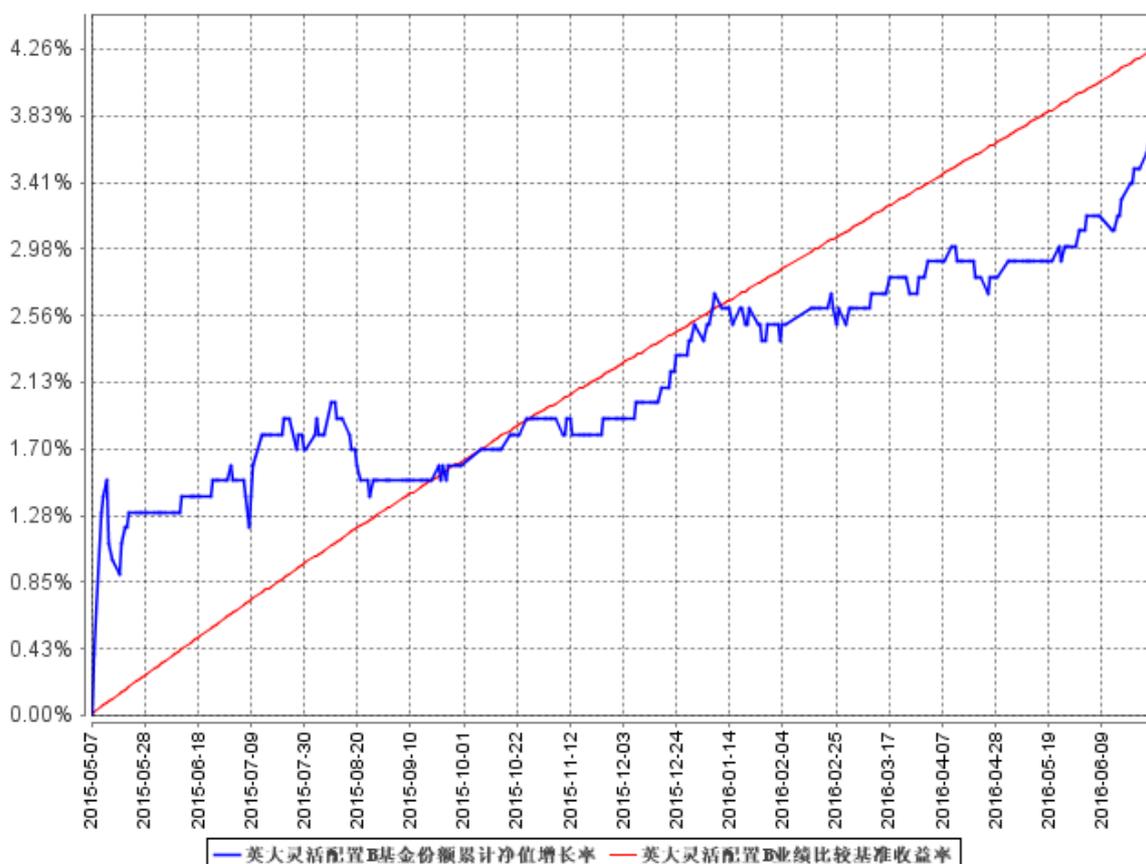
②本基金的业绩比较基准为：1 年期银行定期存款利率（税后）+2%。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁忠伟	本基金	2015年5月7日	-	15	曾任中国民族证券证券投资

	基金经 理				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，从风险可控、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的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，英大基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	1,717,002,215.50
应收证券清算款		403,136.70	-
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
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	6.4.7.3	-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	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	6.4.7.9	1,093,493,023.04	3,883,796,188.15
未分配利润	6.4.7.10	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	6.4.7.11	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	6.4.7.12	11,012,775.84	4,422,056.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,760,751.88	-6,974.24
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	206,502.59	34,301.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,072,131.66	20,189,380.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	128,114.64	142,024.24
减：二、费用		32,865,903.74	13,547,749.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,298,843.23	8,345,826.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,437,258.97	1,738,713.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,223,563.64	2,606,644.57
4. 交易费用	6.4.7.19	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	6.4.7.20	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：

<u>杨峰</u>	<u>赵照</u>	<u>吕向鹏</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

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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前以交易目的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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的

其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。卖出债券的成本按移动加权平均法逐日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具

有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金及适用利率逐日计提。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时采用合同利率）在回购期内逐日计提。

(2) 投资收益

债券投资收益于交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

(3) 公允价值变动收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理人报酬按照前一日基金资产净值的 1.2% 的年费率逐日计提。

(2) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提。

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

(4) 其他费用根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额列入当期基金费用。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，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[2008]38号《关于进一步规范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。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	3,972,643.47
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计：	3,972,643.47

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,757,020.92	53,395,918.56	21,638,897.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	989,856.62	986,290.00
	银行间市场	1,461,636,401.81	1,464,931,000.00
	合计	1,462,626,258.43	1,465,917,290.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,494,383,279.35	1,519,313,208.56	24,929,929.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016年6月30日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末（2016年6月30日），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（2016年6月30日），本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,584.64
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	37.50
应收债券利息	26,137,866.02
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	31.10
合计	26,140,519.26

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2016年6月30日）未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	833,296.50
银行间市场应付交易费用	28,763.59
合计	862,060.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	283,878.22
合计	283,878.22

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

英大灵活配置 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,491,917,727.30	1,491,917,727.30
本期申购	2,399.94	2,399.94
本期赎回(以“-”号填列)	-988,331,269.97	-988,331,269.97
- 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	503,588,857.27	503,588,857.27

金额单位：人民币元

英大灵活配置 B

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,391,878,460.85	2,391,878,460.85
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-1,801,974,295.08	-1,801,974,295.08
- 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	589,904,165.77	589,904,165.77

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	34,609,562.83	5,858,900.55	40,468,463.38
本期利润	16,577,908.91	341,867.85	16,919,776.76
本期基金份额交易产生的变动数	-33,634,773.15	-2,921,718.63	-36,556,491.78
其中：基金申购款	80.52	12.59	93.11
基金赎回款	-33,634,853.67	-2,921,731.22	-36,556,584.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,552,698.59	3,279,049.77	20,831,748.36

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	49,848,390.03	9,365,648.94	59,214,038.97
本期利润	18,110,855.59	-1,413,999.51	16,696,856.08
本期基金份额交易产生的变动数	-50,026,516.97	-4,125,491.23	-54,152,008.20
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-50,026,516.97	-4,125,491.23	-54,152,008.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,932,728.65	3,826,158.20	21,758,886.85

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入

定期存款利息收入	2,931,250.03
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,437.95
其他	2,093.93
合计	3,369,619.08

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	185,248,558.29
减：卖出股票成本总额	174,235,782.45
买卖股票差价收入	11,012,775.84

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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	-1,760,751.88
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	-1,760,751.88

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,270,829,811.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,209,798,706.36
减：应收利息总额	62,791,856.68
买卖债券差价收入	-1,760,751.88

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无贵金属投资收益赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无贵金属投资收益申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无衍生工具收益其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	206,502.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	206,502.59

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,072,131.66
——股票投资	4,693,813.02
——债券投资	-5,765,944.68
——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	-
合计	-1,072,131.66

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	128,114.64
合计	128,114.64

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	414,814.26
银行间市场交易费用	25,892.50
合计	440,706.76

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	164,096.66
银行费用	43,626.24
其他	400.00
乙类帐户维护费	18,000.00
合计	265,904.46

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

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
英大基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
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。

6.4.10 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年6月30日	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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	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。

6.4.10.2.3 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		
	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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 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。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）无利润分配事项。

6.4.12 期末（2016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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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	
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	-
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	-

6.4.12.2 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	2016年	临时	72.10	-	-	71,341	1,434,667.51	5,143,686.10	-

	工具	5月4日	停牌						
--	----	------	----	--	--	--	--	--	--

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

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

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公

司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	512,512,000.00	310,880,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	571,677,000.00	1,313,866,000.00
合计	1,084,189,000.00	1,624,746,000.00

注：表中列示的未评级债券为国家债券、央行票据、国家政策性金融债和超短期融资券。

6.4.13.2.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	31,425,290.00	40,609,850.00
未评级	350,303,000.00	423,701,000.00
合计	381,728,290.00	464,310,850.00

注：表中列示的未评级债券为国家债券、央行票据及政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时

进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持交易性金融资产均在证券交易所上市，除前文所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

对流动性风险的监控和管理，本基金管理人根据对市场特征和发展形势等方面的分析和判断，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、VAR 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	3,972,643.47	-	-	-	-	-	3,972,643.47
结算备付金	83,416.28	-	-	-	-	-	83,416.28
存出保证金	69,109.68	-	-	-	-	-	69,109.68
交易性金融资产	271,458,000.00	371,916,290.00	571,617,000.00	240,931,000.00	9,995,000.00	53,395,918.56	1,519,313,208.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-	403,136.70	403,136.70
应收利息	-	-	-	-	-	26,140,519.26	26,140,519.26
资产总计	275,583,169.43	371,916,290.00	571,617,000.00	240,931,000.00	9,995,000.00	79,939,574.52	1,549,982,033.95
负债							

卖出回购 金融资产 款	409,999,065.00	-	-	-	-	-	409,999,065.00
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	1,922,558.74	1,922,558.74
应付托管 费	-	-	-	-	-	400,533.08	400,533.08
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	342,749.83	342,749.83
应付交易 费用	-	-	-	-	-	862,060.09	862,060.09
应付利息	-	-	-	-	-	87,530.74	87,530.74
其他负债	-	-	-	-	-	283,878.22	283,878.22
负债总计	409,999,065.00	-	-	-	-	3,899,310.70	413,898,375.70
利率敏感 度缺口	-134,415,895.57	371,916,290.00	571,617,000.00	240,931,000.00	9,995,000.00	76,040,263.82	1,136,083,658.25
上年度末 2015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	101,477,021.25	-	-	-	-	-	101,477,021.25
结算备付 金	524,615.50	-	-	-	-	-	524,615.50
存出保证 金	673,377.80	-	-	-	-	-	673,377.80
交易性金 融资产	611,813,000.00	331,343,000.00	911,835,850.00	71,525,000.00	162,540,000.00	49,898,981.71	2,138,955,831.71
买入返售 金融资产	1,716,997,000.00	-	-	-	-	-	1,716,997,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	32,386,416.68	32,386,416.68
其他资产	-	-	-	-	-	5,215.50	5,215.50
资产总计	2,431,485,014.55	331,343,000.00	911,835,850.00	71,525,000.00	162,540,000.00	82,290,613.89	3,991,019,478.44
负债							
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	4,043,694.11	4,043,694.11
应付托管 费	-	-	-	-	-	842,436.27	842,436.27
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	1,036,813.95	1,036,813.95
应付交易 费用	-	-	-	-	-	1,537,843.61	1,537,843.61
其他负债	-	-	-	-	-	80,000.00	80,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	7,540,787.94	7,540,787.94
利率敏感	2,431,485,014.55	331,343,000.00	911,835,850.00	71,525,000.00	162,540,000.00	74,749,825.95	3,983,478,690.50

度缺口							
-----	--	--	--	--	--	--	--

6.4.13.4.1.2 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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-2,082,482.86	-4,351,967.00
市场利率下降 25 个基点	2,098,966.19	4,437,135.22	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 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。

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 2016年6月30日		上年度末 2015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	53,395,918.56	4.70	49,898,981.71	1.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,465,917,290.00	129.03	2,089,056,850.00	52.44
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	1,519,313,208.56	133.73	2,138,955,831.71	53.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	65,303,291.47	18,809,622.86
	业绩比较基准下降 5%	-65,303,291.47	-18,809,622.86

注：本基金业绩比较基准为：一年期定期存款利率（税后）+2%。业绩比较基准出现+5%和-5%的概率较小，净值波动数据仅供参考。因参与股票网下配售，本基金单日净资产变动幅度大于纯债型基金。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	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（元）	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	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

11	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
12	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.02
13	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
14	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.01
15	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
16	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
17	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
18	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
19	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
20	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
21	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

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所有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%

8.2 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	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）。

8.3 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	0~10
	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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	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	10,005,501.63	96,018,042.05

额总额		
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查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国联证券	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%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	英大基金关于旗下基金 2015 年年度最后一个市场交易日资产净值的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 1 月 1 日
2	英大基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所指数发生不可恢复熔断的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
3	英大基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 1 月 7 日
4	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	三大报、公司网站	2016 年 1 月 22 日
5	英大基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 3 月 17 日
6	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年度报告及摘要	三大报、公司网站	2016 年 3 月 30 日
7	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	三大报、公司网站	2016 年 4 月 21 日
8	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	三大报、公司网站	2016 年 6 月 21 日
9	关于修改英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额净值计算精准度及修改基金合同、托管协议的公告	三大报、公司网站	2016 年 6 月 30 日

§ 11 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灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

基金管理人业务资格批件和营业执照

报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

12.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.ydamc.com>

英大基金管理有限公司
2016年8月25日