

英大灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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 2017 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 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	622, 150, 763. 03 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, 587, 123. 81 份	118, 563, 639. 22 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		010-59112222	010-68121816

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2016 年		2015 年 5 月 7 日(基金合同生效 日)-2015 年 12 月 31 日		2014 年	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B	英大 灵活 配置 A	英大 灵活 配置 B
本期已实现 收益	34,228,055.22	26,521,535.28	13,179,570.69	26,840,974.77	-	-
本期利润	24,221,103.98	22,293,436.46	22,445,014.28	43,577,592.05	-	-
加权平均基 金份额本期 利润	0.0255	0.0192	0.0145	0.0150	-	-
本期基金份 额净值增长 率	2.81%	2.30%	2.70%	2.50%	-	-
3.1.2 期末 数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期末可供分 配基金份额 利润	0.0059	-0.0014	0.0232	0.0208	-	-
期末基金资 产净值	506,540,763.17	118,397,805.53	1,532,386,190.68	2,451,092,499.82	-	-
期末基金份 额净值	1.0059	0.9986	1.0270	1.0250	-	-

注：

- 1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。
- 4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大灵活配置 A

第 4 页 共 37 页

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.54%	0.16%	0.84%	0.01%	-0.30%	0.15%
过去六个月	1.43%	0.12%	1.69%	0.01%	-0.26%	0.11%
过去一年	2.81%	0.09%	3.42%	0.01%	-0.61%	0.08%
自基金合同生效起至今	5.59%	0.10%	6.03%	0.01%	-0.44%	0.09%

英大灵活配置 B

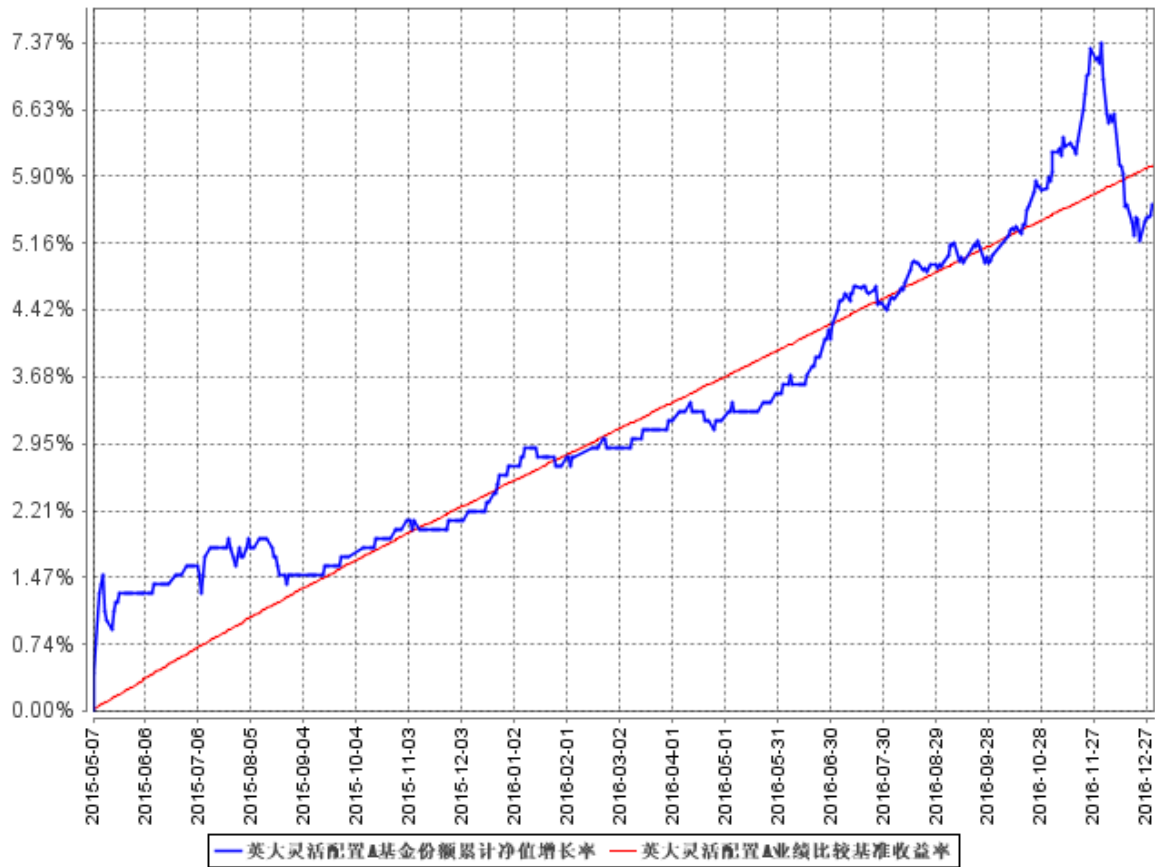
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.42%	0.16%	0.84%	0.01%	-0.42%	0.15%
过去六个月	1.12%	0.12%	1.69%	0.01%	-0.57%	0.11%
过去一年	2.30%	0.09%	3.42%	0.01%	-1.12%	0.08%
自基金合同生效起至今	4.86%	0.10%	6.03%	0.01%	-1.17%	0.09%

注：①本基金合同于 2015 年 5 月 7 日生效；

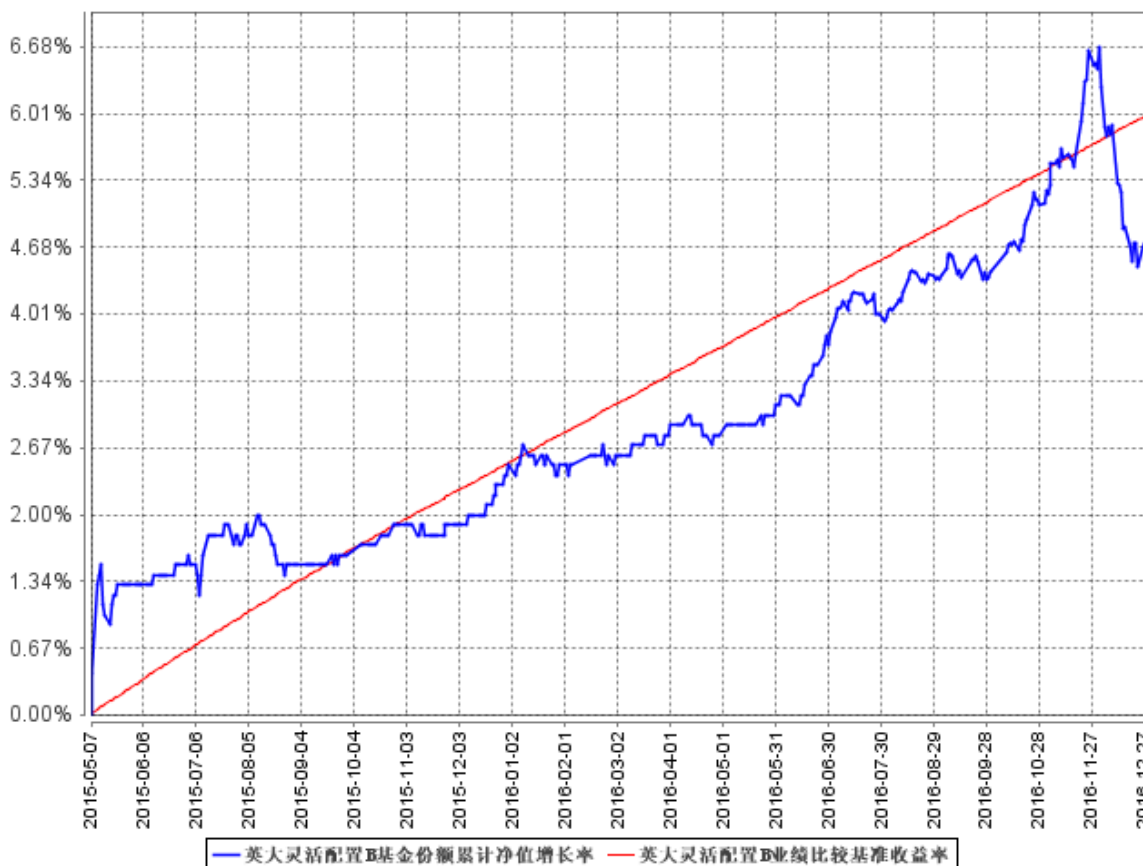
②本基金的业绩比较基准为：1 年期银行定期存款利率（税后）+2%。

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

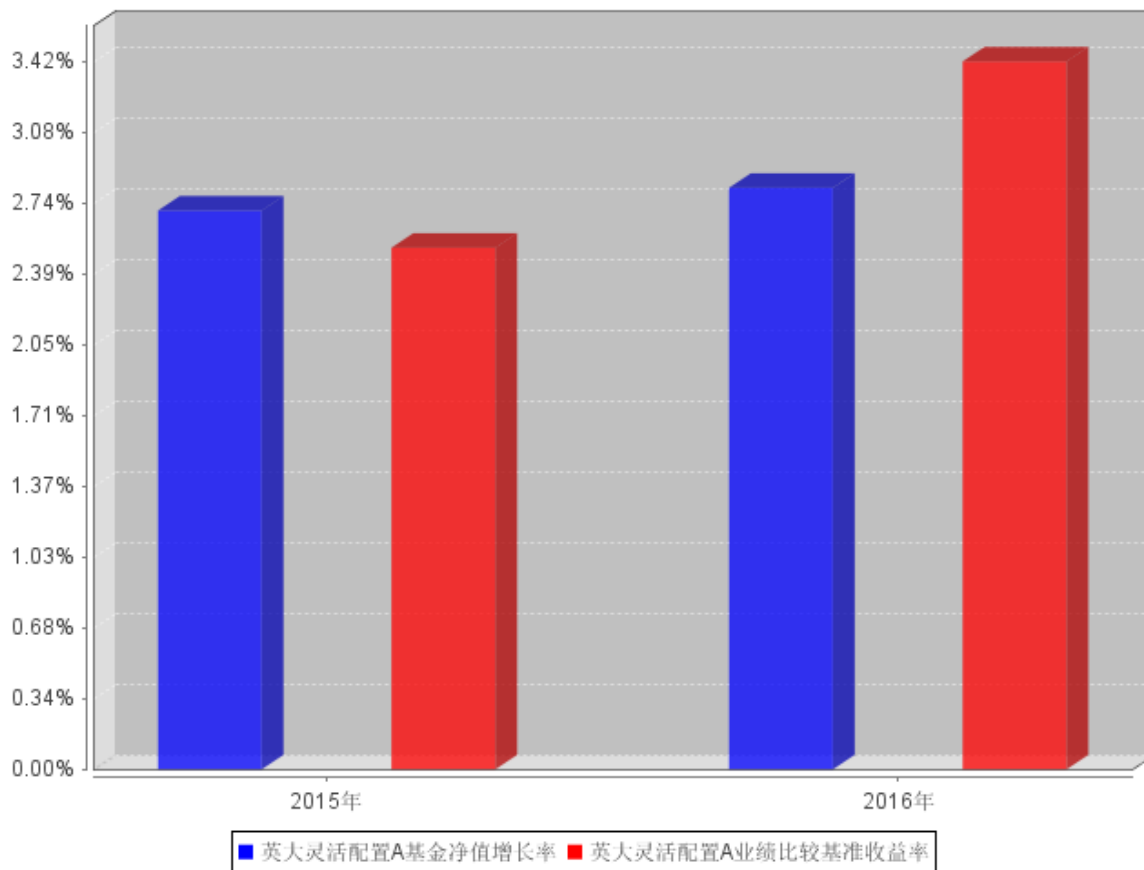


英大灵活配置B基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

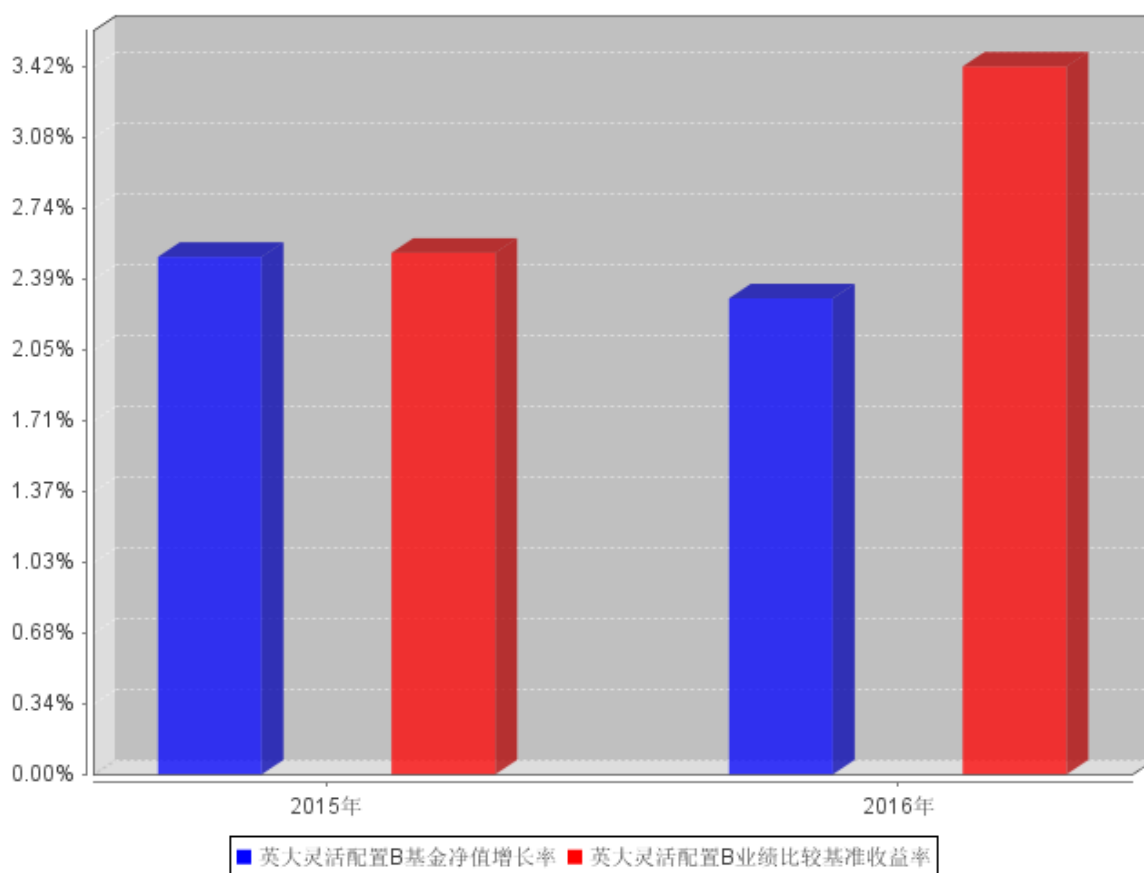


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大灵活配置A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



英大灵活配置B自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 7 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

英大灵活配置 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	0.5000	25,179,351.22	-	25,179,351.22	
2015	-	-	-	-	
合计	0.5000	25,179,351.22	-	25,179,351.22	

英大灵活配置 B					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	0.5000	5,928,181.96	-	5,928,181.96	
2015	-	-	-	-	
合计	0.5000	5,928,181.96	-	5,928,181.96	

§ 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 7 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本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》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、特定客户资产管理组合、社保基金、企业年金等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括公司的投资决策实行投资决策委员会领导下的基金经理/投资经理负责制，明确各自的投资权限，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，交易执行部门与投资决策部门严格分离，业绩与风险评估以数量分析为基础，对投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程，明确投资各环节的业务职责，防范投资风险。公司的所有投资组合共享公司统一的投资研究平台，投资研究团队使用同一研究报告系统，确保公募基金、特定客户资产管理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公司建立交易分配公平的内部控制流程，将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并确保公平交易可操作、可稽核、可持续。公司在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，以技术措施保障公平交易的实现。

监察稽核部定期对公司的不同投资组合（尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合）在连续四个季度期间内、不同时间窗下（1日内、3日内、5日内等）的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控

等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 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。上半年，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，以低仓位应对股票市场的大幅下跌。下半年，在股票市场风险释放、积极因素开始增加时，股票投资占净资产的比例在 4%~16.5%波动，以积极有效的股票组合获取投资收益。2016 年，通过债券稳健投资和股票仓位合理调整，低风险资产配置策略使基金净值稳步提升。

2、股票投资

本基金全年采取“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，虽然年初市场大幅下跌也使股票投资在前两月出现一定程度的亏损，但市场企稳后积极增仓二级市场股票，全年股票投资贡献数百万元盈利。同时，辛勤参与网下新股配售，新股配售贡献盈利近 2000 万元。2016 年，股票一、二级市场投资均实现盈利，为基金净值增长贡献了力量。

3、债券投资

2016 年整体债券市场属于震荡走势，其中一季度收益率上行，二三季度收益率下行，四季度收益率再度上行。市场对整体宏观经济在二季度和三季度悲观情绪浓厚，超长期利率债表现异常突出，而后随着 PPI 由负转正，经济回暖或者说没有预期的悲观，叠加央行去杠杆意图显现，债市在 12 月经历了大幅下跌。本基金全年对组合久期和杠杆的控制较为理想，跟随市场变化投资策略做出相应调整，前期激进，后期提前做了风险防范，收益较好。

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 1.0559 元，报告期基金份额净值增长率为 2.81%；英大灵活配置 B 类基金累计份额净值为 1.0486 元，报告期基金份额净值增长率为

2.30%；同期业绩比较基准增长率为 3.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年经济增长在 6.5%左右；2017 年的货币政策将比 2016 年有所收紧，货币供应量增速会有所减缓，利率会有所提升；无风险利率处于提升过程中，股市投资者风险偏好将逐步下降。预计 2017 年股票市场估值重心仍将下移，具有估值优势和成长性的公司股票才能真正贡献正收益。

2017 年，上证 50 指数和沪深 300 指数下跌空间有限：GDP 增速为 6.5%左右，上市公司利润增速在 10%左右。沪深 300 指数估值波动区间为 16 倍~20 倍，以 2016 年末指数 3310 为基准，沪深 300 指数收益波动区间为-8%~14%，对应指数波动区间 3045~3774。

股票投资策略：二级市场方面，以机构投资理念配置稳健增值资产，低估值、高分红、有成长前景的公司股票可作为重点投资对象，根据季度业绩数据动态调整投资组合。一级市场新股配售方面，从 2016 年网下配售收益分析，在合规询价配售条件下，网下配售可为经济规模基金贡献较高的投资收益，一级市场网下配售仍是 2017 年基金收益的重要来源。

债券投资策略：市场结构从 2016 年调整以来，监管层更多的注意到银行理财积累的风险，银行理财在市场中占比较大，监管政策的变化将左右银行理财的配置思路，更加左右着市场走向，叠加央行公开市场操作力度放大，各种政策工具更加丰富，对市场的控制较以往更加强烈。通胀水平虽然较去年有所提高，但是持续性存疑，并且绝对水平不高，而宏观经济方面受影响因素较多，诸如房地产市场走势和大宗商品价格的波动，叠加海外美联储的进一步加息步骤，对债券市场影响较大。因此，总体判断 2017 年不确定性风险较大。在操作上，我们更加倾向于灵活，选择顺势而为，增加流动性资产占比，信用债久期缩短，全年保持谨慎的投资策略。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人管理的基金整体运作合法合规，依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度，在督察长的指导和监察稽核部的努力下，开展了一系列监察稽核工作。采取的主要措施如下：

1) 据国家法律法规的变化和公司业务发展的需要，按照规定程序对公司基本管理制度进行全面梳理，对内部控制大纲、风险控制制度等基本制度进行修订，进一步完善公司的内部控制体系；

2) 保持与监管机构的联系，以“守住三条底线”、防控内幕交易为基础，多次组织各业务条线学习最新的监管要求和法律法规，加强全体员工的合规和风险意识；

3) 监督检查基金资产运作，就资产运作的合法合规性和有效性进行独立、客观的分析，并向

督察长汇报；

4) 根据监管机构的要求以及基金资产运作情况开展公司的监察稽核工作，出具监察稽核报告，并按照规定程序上报督察长、公司董事和监管机构；

5) 对基金投资与专户投资的公平交易、异常交易情况进行分析，并出具交易分析报告；

6) 按照公司的内部管理制度开展反洗钱、反不正当竞争和商业贿赂、反内幕交易等工作，并按照公司《信息披露管理制度》的有关规定开展信息披露工作；

7) 对基金合同、宣传推介材料、涉及基金份额持有人和公司利益的对外言论等进行审查，并出具合规意见，有效防范风险，规避违法违规行为的发生；

8) 配合监管部门和外聘会计师事务所开展本基金的审计事务，并向公司员工提供法律咨询服务。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会。估值委员会主任由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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金实施了利润分配，英大灵活配置 A 于 2016 年 12 月 16 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 25,179,351.22 元，本期利润分配合计为 25,179,351.22 元；英大灵活配置 B 于 2016 年 12 月 16 日每 10 份基金份额分红 0.5 元，现金形式发放总额为 5,928,181.96 元，本期利润分配合计为 5,928,181.96 元，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，自本基金合同生效之日起至报告期末本基金合同生效未满三年，根据

《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，基金管理人不对本基金持有人数及基金资产净值进行监控。

§ 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 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，英大基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，英大基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	瑞华审字【2017】01390111

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	英大灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的英大灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“英大灵活配置基金”)的财务报表,包括 2016 年 12

	月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是英大灵活配置基金的基金管理人英大基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述英大灵活配置基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了英大灵活配置基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	张琴 石文余
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层
审计报告日期	2017 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款		2,201,675.43	101,477,021.25
结算备付金		441,906.98	524,615.50
存出保证金		46,994.86	673,377.80
交易性金融资产		543,479,050.53	2,138,955,831.71
其中：股票投资		102,645,050.53	49,898,981.71
基金投资		-	-
债券投资		440,834,000.00	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		73,000,549.50	1,717,002,215.50
应收证券清算款		-	-
应收利息		7,585,832.96	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		626,756,010.26	3,991,019,478.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31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		-	-
应付证券清算款		424,311.85	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		654,164.77	4,043,694.11
应付托管费		136,284.30	842,436.27
应付销售服务费		51,655.95	1,036,813.95
应付交易费用		141,024.69	1,537,843.61
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		410,000.00	80,000.00
负债合计		1,817,441.56	7,540,787.94
所有者权益：			
实收基金		622,150,763.03	3,883,796,188.15
未分配利润		2,787,805.67	99,682,502.35
所有者权益合计		624,938,568.70	3,983,478,690.50
负债和所有者权益总计		626,756,010.26	3,991,019,478.44

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 622,150,763.03 份。其中 A 类基金份额净值

1.0059 元，基金份额总额 503,587,123.81 份；B 类基金份额净值 0.9986 元，基金份额总额 118,563,639.22 份。

7.2 利润表

会计主体：英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 7 日(基金 合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		87,380,318.69	125,733,624.62
1.利息收入		74,972,604.04	73,815,711.71
其中：存款利息收入		3,431,585.66	26,949,786.13
债券利息收入		63,752,346.35	36,078,627.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,788,672.03	10,787,298.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,514,634.52	19,988,276.53
其中：股票投资收益		28,564,145.61	16,508,331.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-3,177,413.68	2,874,431.76
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		1,127,902.59	605,513.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-14,235,050.06	26,002,060.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		128,130.19	5,927,575.51
减：二、费用		40,865,778.25	59,711,018.29
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	26,367,626.50	35,674,260.32
2. 托管费	7.4.8.2.2	5,493,255.45	7,432,137.51
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	6,007,123.20	9,683,998.96
4. 交易费用		649,340.22	3,144,848.85
5. 利息支出		1,839,027.29	3,391,376.27
其中：卖出回购金融资产支出		1,839,027.29	3,391,376.27
6. 其他费用		509,405.59	384,396.38
三、利润总额（亏损总额以“-”		46,514,540.44	66,022,606.33

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,514,540.44	66,022,606.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：英大灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	46,514,540.44	46,514,540.44
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）	-3,261,645,425.12	-112,301,703.94	-3,373,947,129.06
其中：1. 基金申购款	7,901.26	388.61	8,289.87
2. 基金赎回款	-3,261,653,326.38	-112,302,092.55	-3,373,955,418.93
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）	-	-31,107,533.18	-31,107,533.18
五、期末所有者权益（基金净值）	622,150,763.03	2,787,805.67	624,938,568.70
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 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	66,022,606.33	66,022,606.33

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)	3,777,772,644.47	33,659,896.02	3,811,432,540.49
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	-3,714,293,879.40	-61,339,729.62	-3,775,633,609.02
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)	3,883,796,188.15	99,682,502.35	3,983,478,690.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

张传良

赵照

刘伟娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

英大灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]687号《关于准予英大灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由英大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集106,018,863.59元,已经瑞华会计师事务所验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2015年5月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为106,023,543.68份,本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序

后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金投资组合资产配置比例：股票资产占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金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合同》和在财务报表附注四中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。此外，本财务报表在所有重大方面符合中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》中有关财务报表及其附注的披露要求。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

1、增值税

根据财政部、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]36号）的规定,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入,免征增值税。

2、企业所得税

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税 [2008]1 号）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《关于证券投资基金有关税收问题的通知》（财税[1998]55 号）的规定,对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税,基金向个人投资者分配股息、红利、利息时,不再代扣个人所得税;

根据财政部、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[2012]85 号）和《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税 [2015] 101 号）的规定,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税;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;上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1%的税率对双方当事人征收证券(股票)交易印花税,调整为单边征税,即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
英大基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
英大国际信托有限公司	对基金管理人具有重大影响的股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**7.4.8.1.1 股票交易**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	26,367,626.50	35,674,260.32
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.2% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,493,255.45	7,432,137.51

注：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。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B	合计
英大基金管理有限公司	-	6,007,122.30	6,007,122.30
合计	-	6,007,122.30	6,007,122.30
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B	合计
英大基金管理有限公司	-	9,683,998.96	9,683,998.96
合计	-	9,683,998.96	9,683,998.96

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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 12 月 31 日	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
基金合同生效日（2015 年 5 月 7 日）持有的基金份额	9,999,450.00	-
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	1.6100%	-
-----------------------	---------	---

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12月31日	
	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
基金合同生效日(2015年5月7日)持有的基金份额	9,999,450.00	-
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	0.6702%	-

7.4.8.4.2 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

份额单位:份

英大灵活配置 B				
关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
英大国际信托有 限责任公司	118,460,019.74	19.0400%	118,460,019.74	3.0500%

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,201,675.43	493,402.89	1,477,021.25	2,415,324.45

注:本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本报告期及上年度可比期间,本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本期末及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.10.1.1 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
002791	坚朗五金	2016年3月22日	-	新股流通受限	21.57	54.60	121,285	2,616,117.45	6,622,161.00	-
002792	通宇通讯	2016年3月21日	-	新股流通受限	15.29	54.26	116,431	1,780,625.74	6,317,546.06	-
300508	维宏股份	2016年4月12日	-	新股流通受限	20.08	121.49	10,383	208,490.64	1,261,430.67	-
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年3月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末（2016 年 12 月 31 日）未持有需披露的暂时停牌股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期期末未持有交易所市场债券正回购。

7.4.10 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	102,645,050.53	16.38
	其中：股票	102,645,050.53	16.38
2	固定收益投资	440,834,000.00	70.34
	其中：债券	440,834,000.00	70.34
	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	73,000,549.50	11.65
	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	2,643,582.41	0.42
7	其他各项资产	7,632,827.82	1.22
8	合计	626,756,010.26	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	55,031,839.86	8.81

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	1,261,430.67	0.20
J	金融业	46,351,780.00	7.42
K	房地产业		-
L	租赁和商务服务业		-
M	科学研究和技术服务业		-
N	水利、环境和公共设施管理业		-
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	102,645,050.53	16.42

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	601166	兴业银行	1,400,000	22,596,000.00	3.62
2	000651	格力电器	620,000	15,264,400.00	2.44
3	600015	华夏银行	1,200,000	13,020,000.00	2.08
4	000063	中兴通讯	700,000	11,165,000.00	1.79
5	601318	中国平安	300,000	10,629,000.00	1.70
6	000625	长安汽车	550,000	8,217,000.00	1.31
7	600104	上汽集团	300,000	7,035,000.00	1.13

8	002791	坚朗五金	121,285	6,622,161.00	1.06
9	002792	通宇通讯	116,431	6,317,546.06	1.01
10	300508	维宏股份	10,383	1,261,430.67	0.20

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	58,221,436.25	1.46
2	600015	华夏银行	48,528,126.32	1.22
3	000333	美的集团	27,938,362.69	0.70
4	000063	中兴通讯	25,708,078.86	0.65
5	000623	吉林敖东	19,983,434.87	0.50
6	000651	格力电器	15,105,996.94	0.38
7	000625	长安汽车	14,712,573.27	0.37
8	601318	中国平安	12,794,418.00	0.32
9	002202	金风科技	11,024,017.50	0.28
10	600104	上汽集团	10,015,207.56	0.25
11	000966	长源电力	5,077,340.39	0.13
12	000858	五粮液	4,749,401.00	0.12
13	600004	白云机场	4,670,000.00	0.12
14	600056	中国医药	3,838,672.32	0.10
15	000100	TCL 集团	3,820,000.00	0.10
16	000001	平安银行	3,002,000.00	0.08
17	000600	建投能源	2,801,167.05	0.07
18	002791	坚朗五金	2,616,117.45	0.07
19	002792	通宇通讯	1,780,625.74	0.04
20	601398	工商银行	1,760,000.00	0.04

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超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	600015	华夏银行	49,615,645.24	1.25

2	601166	兴业银行	36,110,777.08	0.91
3	000333	美的集团	28,287,748.50	0.71
4	000063	中兴通讯	20,990,147.38	0.53
5	000623	吉林敖东	20,084,676.50	0.50
6	002202	金风科技	11,180,099.24	0.28
7	002781	奇信股份	6,707,131.10	0.17
8	300488	恒锋工具	6,561,684.70	0.16
9	000625	长安汽车	6,116,000.00	0.15
10	000001	平安银行	5,539,500.00	0.14
11	000966	长源电力	5,113,440.65	0.13
12	000858	五粮液	4,845,028.89	0.12
13	600004	白云机场	4,724,056.00	0.12
14	000100	TCL 集团	3,850,000.00	0.10
15	600056	中国医药	3,846,750.00	0.10
16	600104	上汽集团	3,042,725.56	0.08
17	000600	建投能源	2,784,789.99	0.07
18	601318	中国平安	2,258,910.00	0.06
19	000651	格力电器	2,233,572.00	0.06
20	601398	工商银行	1,788,000.00	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	286,684,127.77
卖出股票收入（成交）总额	257,179,892.85

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	79,598,000.00	12.74
	其中：政策性金融债	79,598,000.00	12.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	351,184,000.00	56.19
6	中期票据	10,052,000.00	1.61

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	440,834,000.00	70.54

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	041662004	16 鲁宏桥 CP002	500,000	50,295,000.00	8.05
2	011699685	16 中建材 SCP004	500,000	50,215,000.00	8.04
3	150417	15 农发 17	500,000	50,090,000.00	8.02
4	041663001	16 洛娃科技 CP001	400,000	40,300,000.00	6.45
5	011698993	16 龙源电力 SCP016	300,000	29,991,000.00	4.80

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	46,994.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,585,832.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,632,827.82

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002791	坚朗五金	6,622,161.00	1.06	新股流通受限
2	002792	通宇通讯	6,317,546.06	1.01	新股流通受限
3	300508	维宏股份	1,261,430.67	0.20	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
英大灵活配置 A	7	71,941,017.69	503,581,878.43	100.00%	5,245.38	0.00%
英大灵活配置 B	11	10,778,512.66	118,460,019.74	99.91%	103,619.48	0.09%
合计	18	34,563,931.28	622,041,898.17	99.98%	108,864.86	0.02%

9.3 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	0.00	0.0000%
	英大灵活配置 B	1,400.05	0.0012%
	合计	1,400.05	0.0002%

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）。

9.4 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

9.5 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	1.61	9,999,450.00	1.61	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	1.61	10,005,510.36	1.61	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大灵活配置 A	英大灵活配置 B
基金合同生效日（2015 年 5 月 7 日）基金份额总额	10,005,501.63	96,018,042.05
本报告期期初基金份额总额	1,491,917,727.30	2,391,878,460.85
本报告期基金总申购份额	4,595.13	3,306.13
减：本报告期基金总赎回份额	988,335,198.62	2,273,318,127.76
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	503,587,123.81	118,563,639.22

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 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。

本报告期内，基金管理人于 2016 年 9 月 5 日发布公告，杨峰先生自 2016 年 9 月 2 日起不再担任英大基金管理有限公司总经理职务，董事长张传良先生自 2016 年 9 月 2 日起代任总经理职务。相关变更事项已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为本基金审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用人民币 80,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	271,538,535.67	50.71%	117,114.58	37.77%	-
东兴证券	1	133,368,323.72	24.91%	97,532.24	31.45%	-
光大证券	2	130,527,098.48	24.38%	95,454.50	30.78%	-
爱建证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

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效果进行估，确定选用交易单元的券商。

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
国联证券	5,698,661.83	18.09%	-	-	-	-
东兴证券	14,358,481.50	45.58%	66,000,000.00	72.53%	-	-
光大证券	11,445,579.30	36.33%	25,000,000.00	27.47%	-	-
爱建证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-

英大基金管理有限公司
2017 年 3 月 31 日