

英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2017 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	英大睿鑫混合	
基金主代码	003446	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	286,345,905.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
下属分级基金的交易代码:	003446	003447
报告期末下属分级基金的份额总额	79,044,083.84 份	207,301,821.21 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		英大基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱志	方琦
	联系电话	010-59112189	0755-22168168
	电子邮箱	zhuzhi@ydamc.com	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-890-5288	95511-3
传真		010-59112222	0755-82080387

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	2017 年		2016 年 11 月 23 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日		2015 年	
	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
本期已实现收益	344,082.70	44,972,897.30	38.96	1,155,071.99	-	-
本期利润	601,935.25	50,178,677.17	-501.64	-1,696,511.95	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.1334	0.2891	-0.0357	-0.0162	-	-
本期基金份额净值增长率	32.03%	29.51%	-3.60%	-2.90%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.2686	0.2537	-0.0360	-0.0290	-	-
期末基金资产净值	100,604,055.01	260,686,131.20	13,656.01	77,355,783.30	-	-
期末基金份额净值	1.2728	1.2575	0.9640	0.9710	-	-

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大睿鑫 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.77%	0.48%	-1.34%	0.38%	7.11%	0.10%
过去六个月	11.37%	0.46%	1.33%	0.36%	10.04%	0.10%

过去一年	32.03%	0.52%	1.15%	0.36%	30.88%	0.16%
自基金合同生效起至今	27.28%	0.53%	-2.68%	0.37%	29.96%	0.16%

英大睿鑫 C

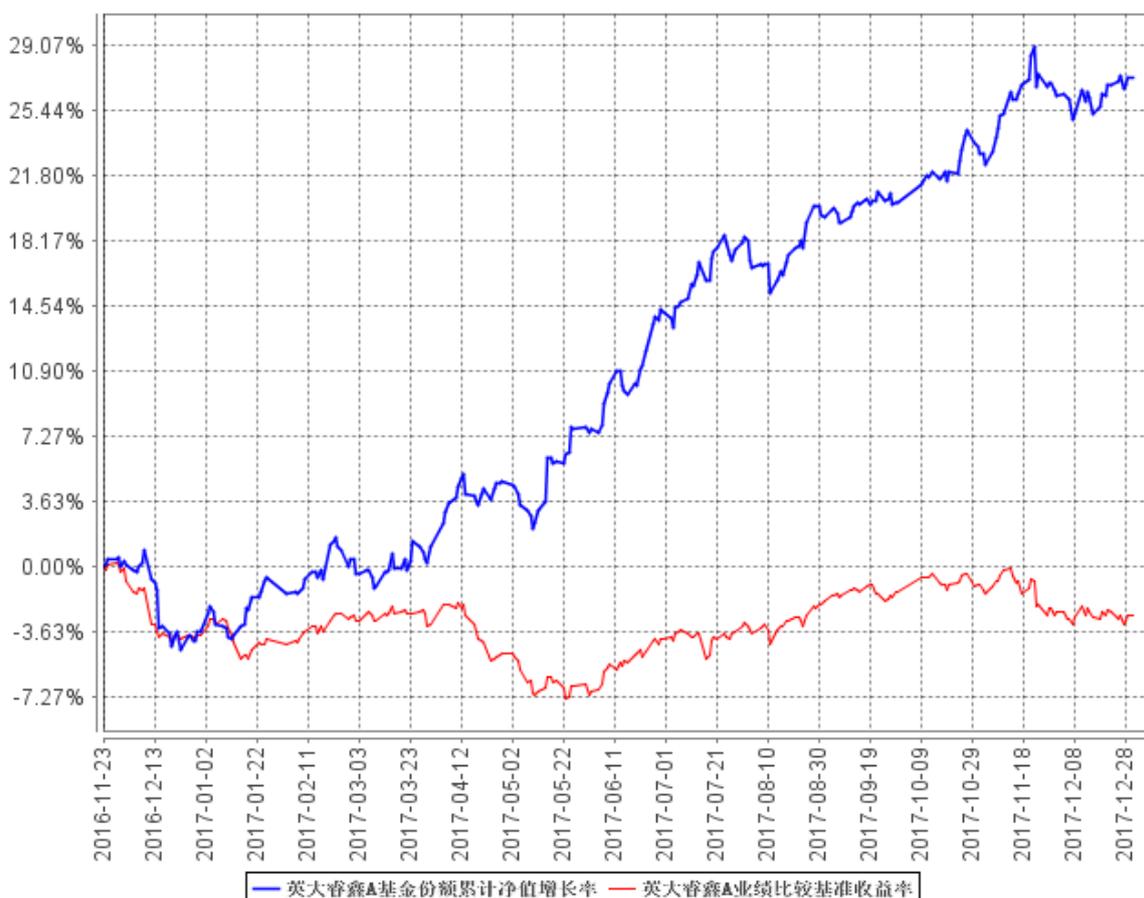
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.71%	0.48%	-1.34%	0.38%	7.05%	0.10%
过去六个月	11.25%	0.46%	1.33%	0.36%	9.92%	0.10%
过去一年	29.51%	0.50%	1.15%	0.36%	28.36%	0.14%
自基金合同生效起至今	25.75%	0.52%	-2.68%	0.37%	28.43%	0.15%

注：①本基金合同于 2016 年 11 月 23 日生效；

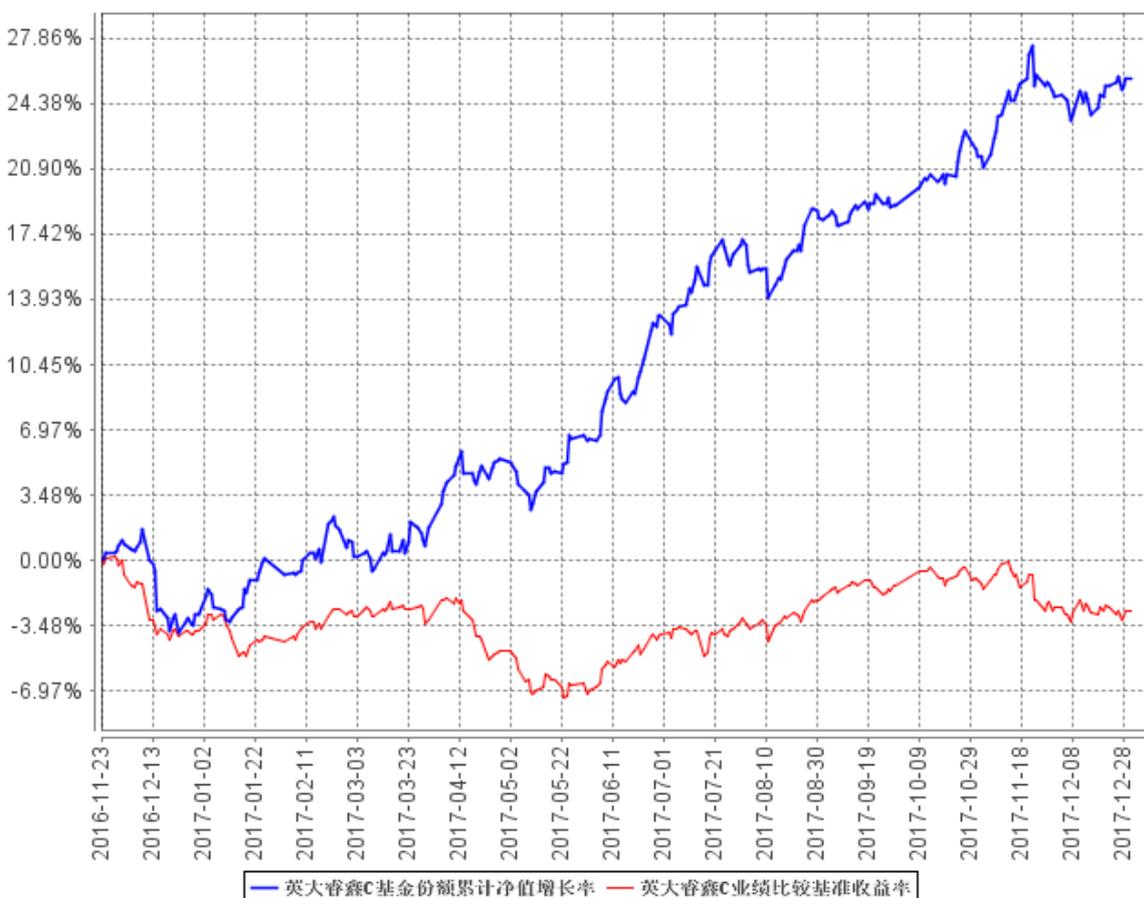
②本基金的业绩比较基准为：50%×中证全指指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

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

英大睿鑫A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

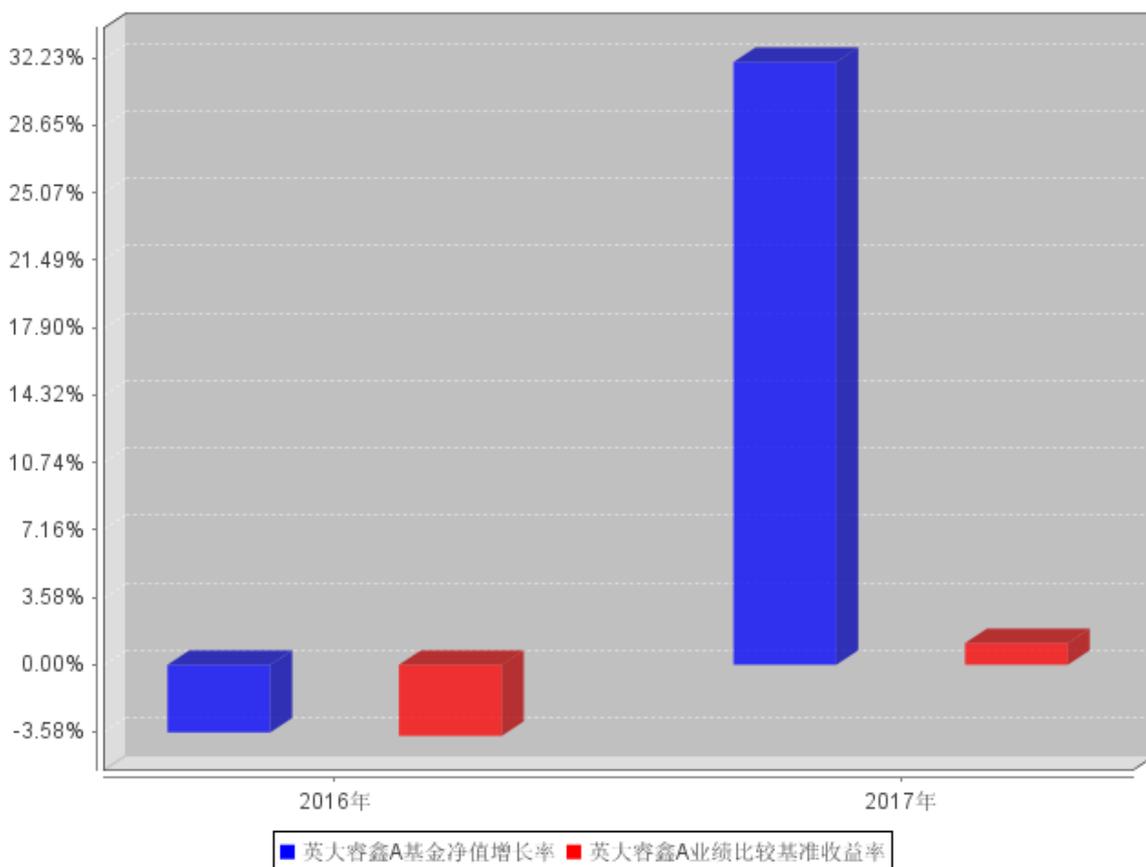


英大睿鑫C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

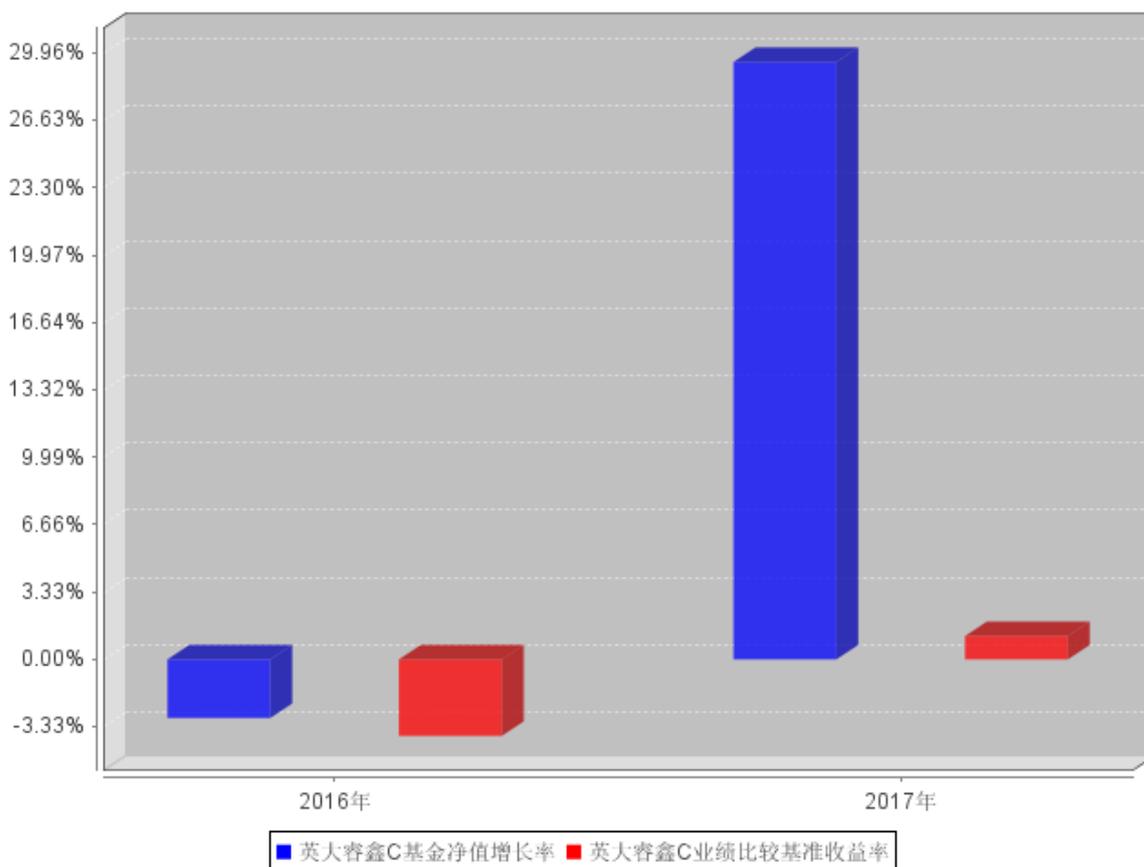


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大睿鑫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



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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年未进行利润分配。

§ 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2017年12月31日，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、权益投资部总经理	2016年11月23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。
管瑞龙	本基金基金经理	2017年2月17日	-	10	曾任深圳利通控股有限公司、深圳鹏元资信有限公司、中国建设银行博士后工作站、中信银行资产管理业务中心，从事证券投资与研究。2016年11月加入英大基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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/专户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

2017 年中国经济增速 6.9%，上市公司业绩增速维持较好势头。国际货币环境由宽松缓步回归常态，国内货币政策保持稳健中性，参考现金宝收益率和国债利率，目前无风险利率在 4%左右；金融去杠杆力度边际放缓，市场风险偏好略有改善。基于经济增长、无风险收益率和风险偏好三

个因素考虑，我们对 A 股全年“震荡上行”的预判基本符合市场运行特征，2017 年业绩状况是决定震荡中枢的主要因素，具有估值优势和业绩成长性的公司股票才能真正贡献正收益。本基金股票市值配置策略：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；与此同时，一级市场方面，本基金积极参与网下新股配售。

在具体运作上，上半年适当加大了低估值大盘蓝筹的持股集中度，投资组合与 A 股市场“龙马行情”的契合度较高；三季度在控制仓位比例的基础上对周期性行业适当加大配置力度，较好把握了周期股行业；四季度预计以“震荡市”为主要特征，做好组合管理与均衡化配置，2017 年股票仓位大致控制在 2/3 以内。

2017 年 A 股市场呈现“震荡上行”走势，沪深 300 指数上涨 21.78%，中证 500 指数下跌 -0.20%，英大睿鑫 C、睿鑫 A 单位净值分别上涨 29.51%、32.03%，显著跑赢市场主要指数和基金业绩基准。我们坚持价值投资策略，从风险可控、收益可期两个维度构建投资组合来获取投资收益。在注重高股息率、低估值品种的配置价值的同时，对于成长性较好、基本面改善且估值回落至合理区间的新兴产业成长股也采取了择机介入的投资策略。同时，积极参与一级市场网下配售提升基金业绩。基金全年净收益 5080 万元，其中：新股配售贡献 1100 万元，二级市场投资扣除基金费用后贡献 3980 万元。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，英大睿鑫 A 类基金份额净值为 1.2728 元，报告期基金份额净值增长率为 32.03%；英大睿鑫 C 类基金份额净值为 1.2575 元，报告期基金份额净值增长率为 29.51%；同期业绩比较基准增长率为 1.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年经济主线是上下波动幅度受限，在震荡筑底过程中增强内生动力；政策主线是化解风险、提质增效，主要体现为去杠杆、补短板。全年 GDP 增长目标仍在 6.5% 左右，一方面可以保持政策的连续性和稳定性，另一方面也具有现实可行性；在此背景下，上市公司整体业绩增长可达 10% 左右，这为股市稳步上升提供动力。在金融严监管的环境下，2018 年 M2 增速仍将保持低位，社融增速或有所回落，但仍将明显高于 M2 增速，无风险利率处于提升过程中；在此背景下，预计 2018 年股票市场整体估值重心有下降的要求，但上市公司利润增长完全可以弥补估值重心下降的幅度，具有估值优势且增长的公司股票却能继续贡献正收益。

2018 年在震荡行情中获取适当收益应是对全年市场的理性期待。经过 2017 年的结构性行情，

2018 年创业板与沪深 300 走势裂口有望收窄，我们将对中小创板块中的真成长公司给予一定的配置比例，但优质蓝筹股性价比依然较高，我们将继续以低估值、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。行业方面重点关注的有：性价比更优的金融、业绩增长的必需消费品行业、先进制造业、新兴消费（品牌优势、服务升级）。

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) 根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

本报告期内未进行利润分配，本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

4.10 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

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由英大基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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【2018】01390024 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“英大睿鑫基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了英大睿鑫基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于英大睿鑫基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>英大睿鑫基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>英大睿鑫基金的基金管理人英大基金管理有限公司管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则和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，使其实现公允反映，并设</p>

	<p>计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估英大睿鑫基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理层计划清算英大睿鑫基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。</p> <p>（三）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对英大领先回报基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致英大领先回报基金不能持续经营。</p>

	<p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> <p>我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明, 并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项, 以及相关的防范措施。</p>	
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张琴	束成林
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	2018 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		17,367,986.15	684,883.83
结算备付金		4,221,077.38	3,322,586.98
存出保证金		210,184.89	20,540.13
交易性金融资产		211,256,345.43	64,291,515.10
其中: 股票投资		211,256,345.43	64,291,515.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		131,000,000.00	-
应收证券清算款		267,330.29	10,008,355.56
应收利息		-1,538.25	2,810.31
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		364,321,385.89	78,330,691.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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		1,859,204.10	753,166.79
应付赎回款		125.42	-
应付管理人报酬		204,497.74	49,961.13
应付托管费		40,899.53	9,992.24
应付销售服务费		44,125.03	13,320.65
应付交易费用		722,347.86	134,811.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		160,000.00	-
负债合计		3,031,199.68	961,252.60
所有者权益:			
实收基金		286,345,905.05	79,681,315.21
未分配利润		74,944,281.16	-2,311,875.90
所有者权益合计		361,290,186.21	77,369,439.31
负债和所有者权益总计		364,321,385.89	78,330,691.91

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 286,345,905.05 份。其中 A 类基金份额净值 1.2728 元，基金份额总额 79,044,083.84；C 类基金份额净值 1.2575 元，基金份额总额 207,301,821.21 份。

7.2 利润表

会计主体：英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月23日(基 金合同生效日)至2016 年12月31日
一、收入		56,908,858.73	-1,370,953.23

1.利息收入		2,098,681.07	153,537.38
其中：存款利息收入		152,993.57	24,537.87
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,945,687.50	128,999.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		49,346,342.76	722,059.61
其中：股票投资收益		46,421,583.28	722,059.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		2,924,759.48	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		5,463,632.42	-2,852,124.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		202.48	605,574.32
减：二、费用		6,128,246.31	326,060.36
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,491,933.18	78,751.06
2. 托管费	7.4.8.2.2	298,386.54	15,750.23
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	387,408.01	20,997.43
4. 交易费用		3,790,518.58	210,161.64
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		160,000.00	400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		50,780,612.42	-1,697,013.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,780,612.42	-1,697,013.59

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	79,681,315.21	-2,311,875.90	77,369,439.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	50,780,612.42	50,780,612.42
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）	206,664,589.84	26,475,544.64	233,140,134.48
其中：1. 基金申购款	303,457,969.69	50,627,261.34	354,085,231.03
2. 基金赎回款	-96,793,379.85	-24,151,716.70	-120,945,096.55
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）	286,345,905.05	74,944,281.16	361,290,186.21
项目	上年度可比期间 2016 年 11 月 23 日(基金合同生效日)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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,697,013.59	-1,697,013.59
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）	79,681,315.21	-614,862.31	79,066,452.90
其中：1. 基金申购款	200,181,426.15	-311.80	200,181,114.35
2. 基金赎回款	-120,500,110.94	-614,550.51	-121,114,661.45
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）	79,681,315.21	-2,311,875.90	77,369,439.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 朱志 _____	_____ 朱志 _____	_____ 苗强 _____
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

英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2016】第 1066 号《关于核准英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由英大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 200041845.69 元，业经瑞华会计师事务所有限责任公司（2016）瑞华验字第 01390017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200053856.09 份基金份额（其中英大睿鑫 A 基金份额为 14039.74 份，英大睿鑫 C 基金份额为 200039816.35 份），认购资金利息折合 12010.4 份基金份额（其中英大睿鑫 A 基金份额为 4.05 份，英大睿鑫 C 基金份额为 12006.35 份）。本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，并报中国证监会备案。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本基金类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类、C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购/申购的基金分类别。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、大额存单、

银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合资产配置比例:股票资产占基金资产的 0%-95%;权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%;每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,本基金保留的现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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 42 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》、《英大睿鑫灵活配置混合型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 2017 年 12 月 31 日的财务状况及 2017 年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

本基金本报告期无会计估计变更。

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
平安银行股份有限公司	基金托管人
英大国际信托有限公司	基金管理人的股东
中国交通建设股份有限公司	基金管理人的股东
航天科工财务有限责任公司	基金管理人的股东
深圳英大资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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

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

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

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

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

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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,491,933.18	78,751.06
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 0.75%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 × 0.75% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付	298,386.54	15,750.23

的托管费		
------	--	--

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%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 × 0.15% / 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 2017年1月1日至2017年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C	合计
	英大基金管理有限公司	-	387,408.01
合计	-	387,408.01	387,408.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年11月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C	合计
	英大基金管理有限公司	-	20,997.43
合计	-	20,997.43	20,997.43

注：①C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%。在通常情况下，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：日C类基金份额销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×0.20%/当年天数，销售服务费每日计提，按月支付。C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

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固有资金投资本基金的情况

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。

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

本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 11 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2016 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
平安银行股份有限公司	17,367,986.15	106,877.64	684,883.83	20,024.55

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

本期末及上年度末，本基金无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2017 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
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
002859	洁美科技	2017 年 3 月 24 日	2018 年 4 月 7 日	老股转让流通受限	11.93	35.65	16,665	198,780.12	594,107.25	-
002860	星帅尔	2017 年 3 月 31 日	2018 年 4 月 12 日	老股转让流通受限	19.81	42.68	7,980	158,083.80	340,586.40	-
002892	科力尔	2017 年 8 月 10 日	2018 年 8 月 17 日	老股转让流通受限	17.56	36.91	11,000	193,160.00	406,010.00	-
300713	英可	2017 年	2018 年	老股转	40.29	84.90	7,008	282,352.32	594,979.20	-

	瑞	10月23日	11月1日	让流通受限						
--	---	--------	-------	-------	--	--	--	--	--	--

7.4.9.2 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
000900	现代投资	2017年10月27日	临时停牌	6.25	-	-	1,156,900	7,020,399.86	7,230,625.00	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	临时停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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交易所市场债券正回购。

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	211,256,345.43	57.99
	其中：股票	211,256,345.43	57.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	131,000,000.00	35.96
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,589,063.53	5.93
8	其他各项资产	475,976.93	0.13
9	合计	364,321,385.89	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	14,535,108.00	4.02
C	制造业	92,989,973.77	25.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	9,020,000.00	2.50
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	27,593,582.94	7.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	48,413,339.32	13.40
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	11,916,198.20	3.30
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	6,772,000.00	1.87
S	综合	-	-
	合计	211,256,345.43	58.47

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	1,000,000	16,990,000.00	4.70
2	600015	华夏银行	1,700,000	15,300,000.00	4.23
3	000651	格力电器	350,000	15,295,000.00	4.23
4	600123	兰花科创	1,200,000	11,004,000.00	3.05
5	600270	外运发展	600,000	10,368,000.00	2.87
6	600585	海螺水泥	350,000	10,265,500.00	2.84
7	600000	浦发银行	800,000	10,072,000.00	2.79
8	601006	大秦铁路	1,100,000	9,977,000.00	2.76
9	600104	上汽集团	300,000	9,612,000.00	2.66
10	000069	华侨城 A	1,127,500	9,572,475.00	2.65

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	600585	海螺水泥	133,068,684.39	171.99
2	600104	上汽集团	98,416,789.59	127.20
3	600309	万华化学	88,514,220.74	114.40
4	601668	中国建筑	84,744,028.21	109.53
5	000651	格力电器	70,410,752.41	91.01
6	601088	中国神华	65,126,252.50	84.18
7	600270	外运发展	62,289,763.36	80.51
8	601318	中国平安	50,390,361.29	65.13
9	601006	大秦铁路	38,810,955.00	50.16
10	600373	中文传媒	38,662,256.79	49.97
11	000063	中兴通讯	35,209,791.38	45.51
12	601111	中国国航	33,600,059.00	43.43

13	002202	金风科技	28,504,598.70	36.84
14	600000	浦发银行	27,202,480.73	35.16
15	601166	兴业银行	25,569,800.00	33.05
16	600089	特变电工	25,058,665.39	32.39
17	601186	中国铁建	24,391,175.35	31.53
18	600409	三友化工	22,770,161.97	29.43
19	000625	长安汽车	21,431,382.00	27.70
20	000776	广发证券	20,053,293.48	25.92
21	600741	华域汽车	18,439,399.60	23.83
22	000830	鲁西化工	16,948,318.86	21.91
23	601211	国泰君安	16,766,000.00	21.67
24	000900	现代投资	16,565,931.96	21.41
25	600177	雅戈尔	15,746,402.25	20.35
26	002142	宁波银行	15,717,762.56	20.32
27	601098	中南传媒	15,226,303.26	19.68
28	000623	吉林敖东	15,168,864.25	19.61
29	000338	潍柴动力	13,420,758.00	17.35
30	601601	中国太保	12,920,266.90	16.70
31	600079	人福医药	12,351,622.00	15.96
32	600519	贵州茅台	12,120,477.00	15.67
33	600066	宇通客车	11,778,044.00	15.22
34	000069	华侨城 A	11,187,088.00	14.46
35	000876	新希望	10,768,579.46	13.92
36	000488	晨鸣纸业	10,695,274.83	13.82
37	600060	海信电器	10,242,095.00	13.24
38	600123	兰花科创	10,213,899.00	13.20
39	603369	今世缘	9,597,712.07	12.41
40	000001	平安银行	9,384,049.12	12.13
41	000858	五粮液	9,374,827.55	12.12
42	000429	粤高速 A	9,040,501.63	11.68
43	600015	华夏银行	8,512,300.00	11.00
44	002394	联发股份	8,357,236.91	10.80
45	002146	荣盛发展	7,697,597.00	9.95
46	000600	建投能源	7,634,195.04	9.87
47	600004	白云机场	7,034,873.00	9.09
48	600522	中天科技	6,756,000.00	8.73

49	000423	东阿阿胶	6,118,948.00	7.91
50	600690	青岛海尔	5,878,800.00	7.60
51	000402	金融街	5,369,889.00	6.94
52	000539	粤电力 A	5,166,694.40	6.68
53	000059	华锦股份	4,997,152.00	6.46
54	002152	广电运通	4,851,535.61	6.27
55	600068	葛洲坝	4,725,000.00	6.11
56	002250	联化科技	4,721,109.64	6.10
57	000157	中联重科	4,707,990.00	6.09
58	601877	正泰电器	4,703,436.00	6.08
59	000552	靖远煤电	4,665,667.00	6.03
60	000898	鞍钢股份	4,657,465.00	6.02
61	600271	航天信息	4,616,545.00	5.97
62	000581	威孚高科	4,173,817.36	5.39
63	000726	鲁泰 A	4,148,561.01	5.36
64	000860	顺鑫农业	4,108,839.00	5.31
65	000719	大地传媒	4,067,896.98	5.26
66	601225	陕西煤业	3,995,000.00	5.16
67	600019	宝钢股份	3,920,000.00	5.07
68	000100	TCL 集团	3,870,000.00	5.00
69	601398	工商银行	3,728,000.00	4.82
70	000725	京东方 A	3,663,000.00	4.73
71	601012	隆基股份	3,592,950.57	4.64
72	000002	万科 A	3,260,487.80	4.21
73	002094	青岛金王	3,138,978.00	4.06
74	000685	中山公用	2,966,840.05	3.83
75	600048	保利地产	2,937,000.00	3.80
76	002128	露天煤业	2,793,422.60	3.61
77	600551	时代出版	2,667,900.00	3.45
78	000521	美菱电器	2,526,302.00	3.27
79	600383	金地集团	2,397,305.00	3.10
80	000826	桑德环境	2,343,600.00	3.03
81	000732	泰禾集团	2,319,800.00	3.00
82	002074	国轩高科	2,254,884.30	2.91
83	000789	万年青	2,203,262.00	2.85
84	000983	西山煤电	2,183,681.00	2.82

85	000709	河刚股份	2,100,000.00	2.71
86	000587	金洲慈航	2,034,080.00	2.63
87	002433	太安堂	2,027,286.00	2.62
88	002398	建研集团	2,013,997.00	2.60
89	002026	山东威达	2,006,865.31	2.59
90	000701	厦门信达	1,988,469.80	2.57
91	000541	佛山照明	1,927,800.00	2.49
92	600668	尖峰集团	1,728,403.00	2.23
93	000698	沈阳化工	1,715,719.00	2.22

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	600585	海螺水泥	127,424,163.53	164.70
2	600104	上汽集团	95,887,276.38	123.93
3	600309	万华化学	91,775,557.52	118.62
4	601668	中国建筑	76,342,617.48	98.67
5	000651	格力电器	66,780,870.61	86.31
6	601088	中国神华	63,524,395.19	82.11
7	601318	中国平安	59,262,195.80	76.60
8	600270	外运发展	53,094,780.61	68.63
9	000063	中兴通讯	44,687,361.10	57.76
10	601111	中国国航	34,394,548.54	44.45
11	600373	中文传媒	31,126,765.98	40.23
12	601006	大秦铁路	29,608,380.18	38.27
13	002202	金风科技	28,310,571.34	36.59
14	600089	特变电工	25,582,414.33	33.07
15	000776	广发证券	25,533,413.63	33.00
16	601186	中国铁建	24,723,987.00	31.96
17	000625	长安汽车	22,871,526.53	29.56
18	600741	华域汽车	18,489,186.33	23.90
19	600000	浦发银行	17,510,018.90	22.63
20	601211	国泰君安	16,915,500.00	21.86
21	600409	三友化工	16,874,529.60	21.81
22	601166	兴业银行	16,396,254.41	21.19
23	600177	雅戈尔	15,825,146.01	20.45

24	000830	鲁西化工	14,607,186.80	18.88
25	601098	中南传媒	14,506,474.58	18.75
26	601601	中国太保	12,887,022.60	16.66
27	000488	晨鸣纸业	12,468,591.36	16.12
28	600079	人福医药	12,353,033.28	15.97
29	600519	贵州茅台	12,270,748.00	15.86
30	600066	宇通客车	11,897,842.56	15.38
31	601398	工商银行	11,240,000.00	14.53
32	002142	宁波银行	10,770,293.00	13.92
33	000001	平安银行	10,358,474.00	13.39
34	000623	吉林敖东	10,255,152.99	13.25
35	600060	海信电器	10,135,789.81	13.10
36	000338	潍柴动力	10,031,696.10	12.97
37	000900	现代投资	9,855,168.25	12.74
38	603369	今世缘	9,801,682.24	12.67
39	002146	荣盛发展	9,408,004.00	12.16
40	000429	粤高速 A	9,129,033.91	11.80
41	002394	联发股份	8,577,173.59	11.09
42	000600	建投能源	8,119,834.36	10.49
43	600004	白云机场	7,506,989.49	9.70
44	000858	五粮液	6,915,508.20	8.94
45	600522	中天科技	6,887,000.00	8.90
46	000876	新希望	6,058,094.30	7.83
47	600690	青岛海尔	6,016,300.00	7.78
48	000539	粤电力 A	5,312,564.80	6.87
49	000402	金融街	5,061,417.55	6.54
50	000552	靖远煤电	4,887,623.00	6.32
51	002250	联化科技	4,778,527.72	6.18
52	601877	正泰电器	4,768,311.60	6.16
53	000059	华锦股份	4,759,922.48	6.15
54	600271	航天信息	4,675,651.58	6.04
55	000898	鞍钢股份	4,652,892.00	6.01
56	002152	广电运通	4,606,210.28	5.95
57	600068	葛洲坝	4,530,000.00	5.86
58	000581	威孚高科	4,180,877.16	5.40
59	002128	露天煤业	4,082,100.00	5.28
60	000726	鲁泰 A	4,080,231.00	5.27
61	601225	陕西煤业	4,040,000.00	5.22

62	000719	大地传媒	3,999,055.49	5.17
63	600019	宝钢股份	3,996,000.00	5.16
64	000860	顺鑫农业	3,864,274.24	4.99
65	000725	京东方 A	3,690,000.00	4.77
66	601012	隆基股份	3,648,078.80	4.72
67	000002	万科 A	3,392,358.23	4.38
68	600048	保利地产	2,967,000.00	3.83
69	000685	中山公用	2,959,353.65	3.82
70	600551	时代出版	2,708,100.00	3.50
71	002094	青岛金王	2,689,743.00	3.48
72	000521	美菱电器	2,507,346.17	3.24
73	600383	金地集团	2,415,512.00	3.12
74	000732	泰禾集团	2,293,671.00	2.96
75	000789	万年青	2,214,054.00	2.86
76	000983	西山煤电	2,072,306.00	2.68
77	000587	金洲慈航	2,052,134.00	2.65
78	000709	河钢股份	2,005,000.00	2.59
79	002074	国轩高科	1,998,481.20	2.58
80	000069	华侨城 A	1,954,076.00	2.53
81	000541	佛山照明	1,950,900.00	2.52
82	000701	厦门信达	1,918,994.43	2.48
83	002398	建研集团	1,905,231.80	2.46
84	002433	太安堂	1,813,900.00	2.34
85	600668	尖峰集团	1,738,421.50	2.25
86	002026	山东威达	1,696,123.84	2.19

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	1,503,485,774.09
卖出股票收入（成交）总额	1,408,406,159.46

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期期末未持贵金属投资。

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

本基金本报告期期末未持有权证。

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

本基金没有参与股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不参与股指期货投资。

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

本基金没有参与国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期本基金未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金没有参与国债期货投资。

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、批评处罚的情况。

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	210,184.89
2	应收证券清算款	267,330.29
3	应收股利	-
4	应收利息	-1,538.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	475,976.93

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
英大睿鑫A	96	823,375.87	79,038,096.74	99.99%	5,987.10	0.01%
英大睿鑫C	151	1,372,859.74	207,059,530.89	99.88%	242,290.32	0.12%
合计	247	1,159,295.16	286,097,627.63	99.91%	248,277.42	0.09%

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	英大睿鑫A	545.32	0.0007%
	英大睿鑫	66,964.85	0.0323%

	C		
	合计	67,510.17	0.0236%

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	英大睿鑫 A	0~10
	英大睿鑫 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	英大睿鑫 A	0
	英大睿鑫 C	0~10
	合计	0~10

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）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大睿鑫 A	英大睿鑫 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 23 日）基金份额总额	14,039.74	200,039,816.35
本报告期初基金份额总额	14,165.81	79,667,149.40
本报告期基金总申购份额	79,088,002.65	224,369,967.04
减：本报告期基金总赎回份额	58,084.62	96,735,295.23
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	79,044,083.84	207,301,821.21

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2017 年 2 月 21 日发布公告，管瑞龙先生自 2017 年 2 月 17 日起担任英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

本报告期内，基金管理人于 2017 年 6 月 15 日发布公告，孔旺先生自 2017 年 6 月 14 日起担任英大基金管理有限公司董事长并代行总经理职务，原董事长张传良先生自 2017 年 6 月 14 日起不再担任董事长及代行总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2017 年 7 月 3 日发布公告，赵照先生自 2017 年 6 月 30 日起不再担任英大基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2017 年 7 月 13 日发布公告，朱志先生自 2017 年 7 月 12 日起担任英大基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2017 年 7 月 28 日发布公告，朱志先生自 2017 年 7 月 25 日起担任英大基金管理有限公司总经理职务，董事长孔旺先生自 2017 年 7 月 25 日起不再代任总经理职务。

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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

基金投资策略没有发生改变。

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 60,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 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，北京证监局对本基金管理人下发了两项责令改正并暂停办理相关业务措施。本基金管理人高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性地制定、实施整改措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力。中国证监会于 2017 年 12 月 12 日决定对公司立案调查。调查事项不涉及基金财产和基金管理业务。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券		12,022,135,169.97	69.61%	1,478,786.69	69.61%	-
东吴证券	1	882,865,648.76	30.39%	645,642.42	30.39%	-

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
国金证券	-	-	4,311,300,000.00	99.84%	-	-
东吴证券	-	-	7,000,000.00	0.16%	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017. 1. 1-2017. 12. 14	79, 512, 000. 00	17, 164, 796. 31	96, 676, 796. 31	0. 00	0. 00%
	2	2017. 12. 12-2017. 12. 31	0. 00	189, 420, 435. 57	0. 00	189, 420, 435. 57	66. 15%

英大基金管理有限公司
2018 年 3 月 30 日