

英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 28 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 27 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 2018 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	50
11.2 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	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	英大睿盛混合	
基金主代码	003713	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 1 日	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	152, 013, 027. 04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	英大睿盛 A	英大睿盛 C
下属分级基金的交易代码:	003713	003714
报告期末下属分级基金的份额总额	152, 008, 187. 04 份	4, 840. 00 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘轶
	联系电话	010-59112020
	电子邮箱	liuyi@ydamc.com
客户服务电话	400-890-5288	95595
传真	010-59112222	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	100020	100033
法定代表人	孔旺	李晓鹏

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
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	英大睿盛 A	英大睿盛 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	3,432,645.16	162.55
本期利润	-5,049,633.53	52.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0327	0.0069
本期加权平均净值利润率	-3.18%	0.68%
本期基金份额净值增长率	-4.05%	-4.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	-3,285,930.29	-120.65
期末可供分配基金份额利润	-0.0216	-0.0249
期末基金资产净值	148,722,256.75	4,719.35
期末基金份额净值	0.9784	0.9751
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	5.55%	5.21%

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

英大睿盛 A

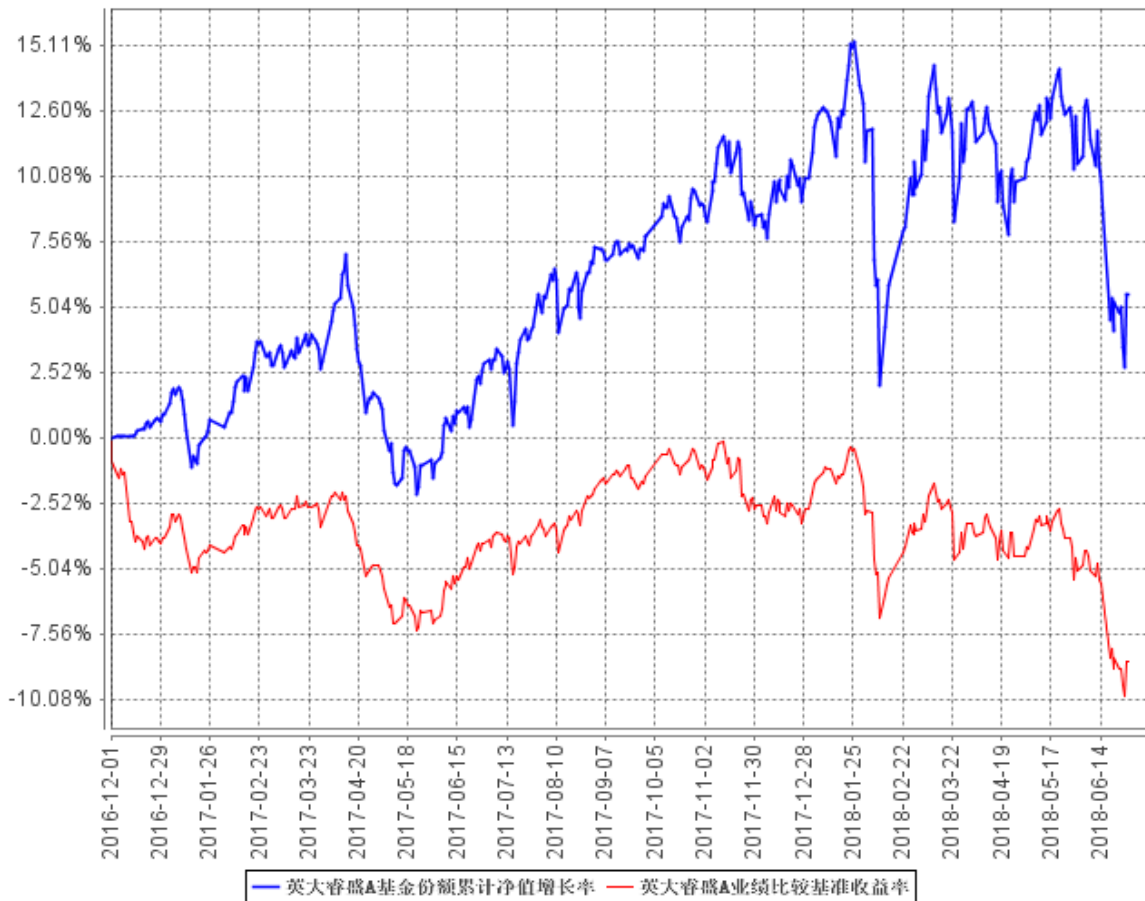
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.08%	1.39%	-4.20%	0.76%	-1.88%	0.63%
过去三个月	-6.28%	1.06%	-5.48%	0.60%	-0.80%	0.46%
过去六个月	-4.05%	1.17%	-6.01%	0.60%	1.96%	0.57%
过去一年	2.64%	0.91%	-4.76%	0.49%	7.40%	0.42%
自基金合同生效起至今	5.55%	0.79%	-8.61%	0.46%	14.16%	0.33%

英大睿盛 C

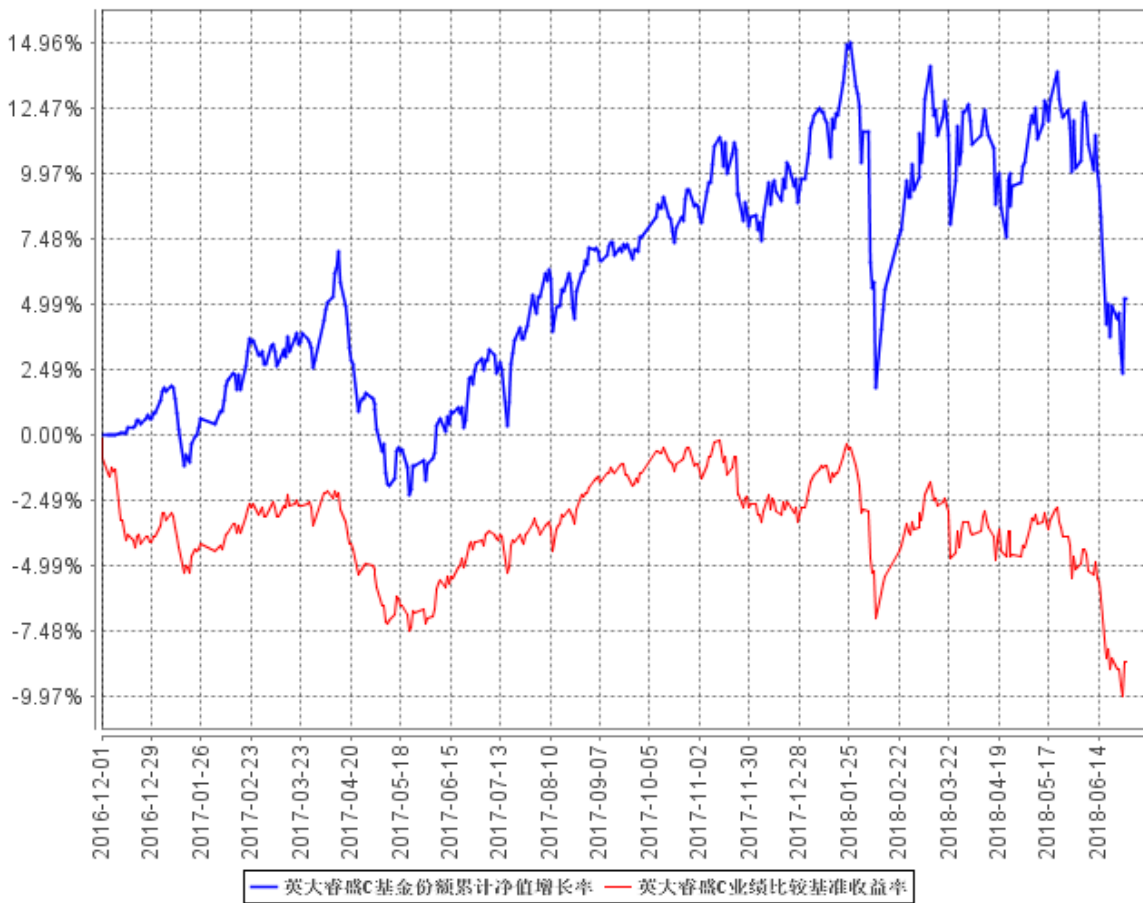
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.09%	1.39%	-4.20%	0.76%	-1.89%	0.63%
过去三个月	-6.33%	1.06%	-5.48%	0.60%	-0.85%	0.46%
过去六个月	-4.16%	1.17%	-6.01%	0.60%	1.85%	0.57%
过去一年	2.42%	0.91%	-4.76%	0.49%	7.18%	0.42%
自基金合同生效起至今	5.21%	0.79%	-8.61%	0.46%	13.82%	0.33%

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

英大睿盛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



英大睿盛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



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会批准，英大基金管理有限公司（简称本公司或本基金管理人）于 2012 年 8 月 17 日在北京成立，经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务等。本公司注册资本 2 亿元人民币，股东为国网英大国际控股集团有限公司、中国交通建设股份有限公司和航天科工财务有限责任公司，持股比例分别为 49%、36%、15%。本公司于 2015 年 9 月 16 日设立全资子公司英大资本管理有限公司，主营特定客户资产管理业务以及法律法规和中国证监会许可的其他业务。

截至 2018 年 6 月 30 日，本公司管理 7 只开放式证券投资基金，同时，本公司及子公司分别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 12 月 1 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。
张媛	本基金基金经理	2018 年 1 月 23 日	-	3	研究生学历，博士学位，3 年以上证券从业经历。曾任中国国际期货有限公司资产管理部高级量化分析师，2016 年 9 月加盟英大基金管理有限公司权益投资部，任投资经理助理。

					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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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不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

2018 年上半年，A 股上市企业 ROE 维持相对高位，经济总体有韧性，但市场在结构上出现更复杂的分化。上半年，国内经济活动在社融数据、M2 增速等领先指标上出现边际放缓迹象。一季度，上证指数下跌 5.35%，中小板下跌 2.45%，创业板上涨 2.62%。经历年初下跌后，录得正收益的板块有医药、休闲服务和计算机，概念表现较好的是仿制药、创新药、工业物联网、网络安全等。二季度，中美贸易摩擦的影响超越市场预期。市场成交量下滑、恐慌情绪上扬。季度内上证指数下跌 10.14%，中小板下跌 12.81%，创业板下跌 14.82%。受中美贸易摩擦影响通信行业跌幅居前；部分业绩优秀前期调整更到位的创业板和前期估值更合理位置的价值股的表现稍好。上半

年市场未形成趋势性反弹，在震荡市中本基金以低估值、高分红、有成长前景的公司股票可作为重点投资对象，以大样本、分散化策略构建投资组合，根据季度业绩数据动态调整投资组合；一级市场，本基金积极参与网下新股配售，增进基金收益。

上半年，股票市场主要指数大幅下跌，沪深 300 指数下跌 12.9%，本基金单位净值下跌 4.05%，基金股票组合能较大幅度跑赢沪深 300 指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末英大睿盛 A 基金份额净值为 0.9784 元，本报告期基金份额净值增长率为 -4.05%；截至本报告期末英大睿盛 C 基金份额净值为 0.9751 元，本报告期基金份额净值增长率为 -4.16%；同期业绩比较基准收益率为 -6.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据统计局公布的数据，2018 年二季度 GDP 同比增长 6.7%，上半年 GDP 同比增长 6.8%，整体较为稳定。具体来看，上半年，最终消费支出对 GDP 增长的贡献率为 78.5%，资本形成总额对 GDP 增长的贡献率为 31.4%，货物和服务净出口对 GDP 增长的贡献率为 -9.9%。与上年同期相比，最终消费支出贡献率上升 14.2 个百分点，其中服务消费尤其是居民对于居住、生活服务和医疗服务的消费支出均出现两位数加速上升，这反映了社会消费结构的变化，影响较积极。受固定资产投资增速回落的影响，资本形成总额贡献率下降 3.2 个百分点。因货物贸易的顺差大幅收窄，而服务贸易逆差扩大的影响，货物和服务净出口贡献率下降 11.0 个百分点，考虑到人民币出现一定的贬值，净出口拉动率转负可以预期。2018 年 6 月份全国居民消费价格指数（CPI）和工业生产者出厂价格指数（PPI）数据显示，CPI 环比下降 0.1%，同比上涨 1.9%；PPI 环比上涨 0.3%，同比上涨 4.7%。从同比来看，上半年我国物价保持平稳运行，上下游价格走势趋于协调。展望下半年，物价将延续在温和区间运行。重要商品供应充足，市场预期平稳，物价总水平将延续在温和区间运行，从而为高质量发展营造相对宽松的物价环境。预计下半年国际油价延续震荡态势，不出现严重区域冲突情况下，波动中枢应该维持在 65-75 美元/桶，对国内物价的影响基本可控。

国际方面，全球经济继续稳定复苏，但存在区域差异。2018 年在特朗普扩张性的财政政策和税收改革的刺激下，美国经济上行，支撑美元走强。6 月份，美联储如期加息，美元指数小幅度上升，发达国家主权债券指数和高收益公司债券指数有所恢复，其他全球大类资产指数呈现较为低迷的趋势。美国 CPI、PCE 和核心 PCE 上半年整体呈现上升趋势；工业生产指数和产能利用率等数据显示，美国制造业发展强劲；随着美国居民储蓄的上升，耐用品新增订单持续上涨，而零售和食品服务的销售额有所下降，6 月份居民消费信心指数小幅下滑，失业率达到 20 年来的最低水平。2018 年，欧洲经济复苏势头放缓，工业生产指数和 GDP 增长速率有所下滑，随着欧洲央行货

币政策正常化进程不断推进，逐步考虑退出 QE 政策，欧元区 M3 先大幅下滑，4、5 月份有所回升，欧洲后续经济发展有待政策支持。美国经济下半年美强欧弱或将持续，美德利差仍在高位，利好美元，预期下半年美元加息 2-3 次。中美贸易战对美元的影响偏中性，但对美债可能带来利好。如果美债收益率曲线继续平坦化，或将导致美联储放缓加息。

展望下半年国内经济和资本市场的走势，预计下半年出口数据进一步下落；去年享受高利润的上游行业是支撑上半年制造业企稳回升的主力，今年利润仍然集中在上游，下半年在出口加速回落的拖累下，制造业投资回升重点取决于上游投资回升和中下游投资下滑两股力量的角力。二季度土地购置、新开工、施工面积的大幅回升意味着下半年地产建安的回升将对其他费用项的回落形成对冲。扩大内需将成为下半年经济增长的重点措施，尤其是涉及乡村振兴的农村消费大概率发力；调结构促进实体经济发展，财政政策确定围绕补短板、增后劲、惠民生推动有效投资的措施此外，未来大概率基建相关行业将受益，基建投资增速可能触底反弹，后续将重点关注。

资本市场方面，在“去杠杆”政策主导下，金融环境在 2018 年下半年处于收缩周期，货币政策可能延续“宽货币、紧信用”的特征，对市场整体的估值水平仍有一定压制。当前沪深 300 指数 PE 估值约 12 倍，从历史比较和国际比较两个维度来看，估值水平相对较低。预计股票市场在下半年总体可能以“震荡行情”为主要特征。行业方面，大消费、周期品、金融行业及科技创新行业仍将大概率呈现轮动特征。本基金在下半年继续以价值投资理念配置稳健增值资产，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；与此同时，一级市场方面，积极参与网下新股配售，尽可能获取低风险增值资产。

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历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未进行利润分配，本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金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，中国光大银行股份有限公司在英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——英大基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——英大基金管理有限公司编制的《英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,857,140.72	8,861,292.68
结算备付金		368,181.69	1,659,156.12
存出保证金		14,403.41	20,766.47
交易性金融资产	6.4.7.2	123,734,546.23	146,135,918.51
其中：股票投资		123,734,546.23	146,135,918.51
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	16,000,000.00	47,000,000.00
应收证券清算款		-	3,035,239.45
应收利息	6.4.7.5	16,675.49	25,640.40
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		152,990,947.54	206,738,013.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,018,951.08	2,253,243.37
应付赎回款		-	10.05
应付管理人报酬		75,423.95	107,988.78
应付托管费		18,856.00	26,997.20
应付销售服务费		0.90	2.48
应付交易费用	6.4.7.7	11,398.16	233,434.42
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	139,341.35	160,000.00
负债合计		4,263,971.44	2,781,676.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	152,013,027.04	200,022,730.16
未分配利润	6.4.7.10	-3,286,050.94	3,933,607.17
所有者权益合计		148,726,976.10	203,956,337.33
负债和所有者权益总计		152,990,947.54	206,738,013.63

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，英大睿盛 A 基金份额净值 0.9784 元，基金份额总额 152,008,187.04 份；英大睿盛 C 基金份额净值 0.9751 元，基金份额总额 4,840.00 份。英大睿盛份额总额合计为 152,013,027.04 份。

6.2 利润表

会计主体：英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-4,249,696.77	6,172,672.28
1.利息收入		337,940.00	1,104,988.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,618.29	73,747.60
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		295,321.71	1,031,241.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,894,752.17	3,696,994.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,164,721.00	2,602,750.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	1,730,031.17	1,094,244.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,482,388.94	1,370,682.02
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	-	6.49

减：二、费用		799,884.46	2,239,974.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	470,761.36	755,976.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	117,690.34	151,195.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8.03	12.32
4. 交易费用	6.4.7.19	123,083.38	1,250,449.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	88,341.35	82,341.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,049,581.23	3,932,697.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,049,581.23	3,932,697.58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	200,022,730.16	3,933,607.17	203,956,337.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,049,581.23	-5,049,581.23
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）	-48,009,703.12	-2,170,076.88	-50,179,780.00
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-48,009,703.12	-2,170,076.88	-50,179,780.00
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）	152,013,027.04	-3,286,050.94	148,726,976.10

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	200,022,327.19	1,737,355.25	201,759,682.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,932,697.58	3,932,697.58
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)	1,475.46	55.37	1,530.83
其中：1.基金申购款	4,945.12	244.48	5,189.60
2.基金赎回款	-3,469.66	-189.11	-3,658.77
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)	200,023,802.65	5,670,108.20	205,693,910.85

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：

孔旺 柴元春 陈畅
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

英大睿盛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 2118 号《关于核准英大睿盛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《英大睿盛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 200022327.19 元,业经瑞华会计师事务所有限责任公司(2016)瑞华验字第 01390018 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200022327.19 份基金份额(其中英大睿盛 A 基金份额为 200011127.19 份,英大

睿盛 C 基金份额为 11200 份), 认购资金利息折合 0 份基金份额。本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司, 基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大睿盛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、同业存单、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。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《英大纯债债券型证券投资基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况及 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止期间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。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.4.3 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。

6.4.5 税项

1、增值税

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以及金融同业往来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，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	12,857,140.72
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	12,857,140.72

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	130,712,683.12	123,734,546.23	-6,978,136.89
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	130,712,683.12	123,734,546.23	-6,978,136.89

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2018年6月30日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	16,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	16,000,000.00	-

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2018 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。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,126.89
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	165.70
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	14,376.50
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.40
合计	16,675.49

6.4.6.6 其他资产

本报告期末（2018 年 6 月 30 日），本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	11,398.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,398.16

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	139,341.35
合计	139,341.35

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

英大睿盛 A

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	200,009,046.89	200,009,046.89
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-48,000,859.85	-48,000,859.85
- 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	152,008,187.04	152,008,187.04

金额单位：人民币元

英大睿盛 C		
项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	13,683.27	13,683.27
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-8,843.27	-8,843.27
- 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	4,840.00	4,840.00

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

英大睿盛 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,429,281.23	1,504,088.34	3,933,369.57
本期利润	3,432,645.16	-8,482,278.69	-5,049,633.53
本期基金份额交易产生的变动数	-634,610.97	-1,535,055.36	-2,169,666.33
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-634,610.97	-1,535,055.36	-2,169,666.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,227,315.42	-8,513,245.71	-3,285,930.29

单位：人民币元

英大睿盛 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	134.76	102.84	237.60
本期利润	162.55	-110.25	52.30
本期基金份额交易产生的变动数	-147.92	-262.63	-410.55
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-147.92	-262.63	-410.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	149.39	-270.04	-120.65

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	35,732.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,725.26
其他	160.71
合计	42,618.29

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	52,280,733.97
减：卖出股票成本总额	50,116,012.97
买卖股票差价收入	2,164,721.00

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

本报告期（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金无债券投资收益。

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益**6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无贵金属投资收益。

6.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.6.15 衍生工具收益**6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,730,031.17
基金投资产生的股利收益	-

合计	1,730,031.17
----	--------------

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,482,388.94
——股票投资	-8,482,388.94
——债券投资	-
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-8,482,388.94

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

6.4.6.18 其他收入

本基金本报告期未发生其他收入。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	123,083.38
银行间市场交易费用	-
合计	123,083.38

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
乙类帐户维护费	9,000.00
合计	88,341.35

6.4.6.21 分部报告

无。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

经中国证监会核准（证监许可[2018]872号），本公司原股东英大国际信托有限责任公司将所持本公司 49%股权转让给国网英大国际控股集团有限公司，相关工商变更登记手续于 2018 年 6 月 14 日办结。

6.4.8.2 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
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 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。

6.4.9.1.2 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。

6.4.9.1.3 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。

6.4.9.1.4 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。

6.4.9.1.5 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。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	470,761.36	755,976.42
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 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.6% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	117,690.34	151,195.23

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.9.2.3 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		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大睿盛 A	英大睿盛 C	合计
英大基金管理有限公司	-	0.90	0.90
合计	-	0.90	0.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	英大睿盛 A	英大睿盛 C	合计

英大基金管理有限公司	-	12.32	12.32
合计	-	12.32	12.32

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。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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

本基金本报告期末其他关联方未持有本基金。

6.4.9.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国光大银行股份有限公司	12,857,140.72	35,732.32	8,423,724.94	50,044.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

6.4.9.6 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。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.10 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配事项。

6.4.11 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.11.2 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
000022	深赤湾	2017年11月20日	重大事项	22.82	-	-	99,100	2,553,906.00	2,261,462.00	-

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由

风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

6.4.12.2 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。报告期本基金无债券投资。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无债券投资。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期内无资产支持证券投资。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期内无同业存单投资。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无债券投资。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期内无资产支持证券投资。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期内无同业存单投资。

6.4.12.3 流动性风险

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，除本报告所披露的流通受限基金资产的内容外，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。

6.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本报告期末，除股票投资以外，本基金买入返售金融资产 1600 万元，皆为上交所质押式国债回购 7 天期品种（GC007），主要用于基金流动性管理，T+7 日自动到期回款，该金融工具具有极低的流动性风险。无金融负债。

6.4.12.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在投资端，报告期末，本基金主要持有沪深交易所股票、交易所买入返售证券和现金资产，股票投资采用分散化组合投资策略，单只股票占净值比最高未超过 3%，在市场成交量不发生重大系统性降低情况下，除少量停牌股票、首次公开发行时申购的暂未上市股票部分外，所持股票基本可在一个交易日左右变现。

在份额端，存在单一机构巨额赎回的可能性。在发生巨额赎回时，本基金将在维护存量持有人和申请赎回持有人利益公平的原则下，审慎确认赎回申请，适当使用《公开募集开放式证券投资流动性风险管理规定》中规定的流动性风险管理工具，防范流动性风险发生。

6.4.12.4 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。本基金管理人已建立了一套完整的系统性风险预警和监控系统，利用不同参数下的情景模型和压力模型监控和管理市场风险。

6.4.12.4.1 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。报告期本基金无债券投资。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	12,857,140.72	-	-	-	-	-	12,857,140.72
结算备付金	368,181.69	-	-	-	-	-	368,181.69
存出保证金	14,403.41	-	-	-	-	-	14,403.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	123,734,546.23	123,734,546.23
买入返售金融资产	16,000,000.00	-	-	-	-	-	16,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	16,675.49	16,675.49
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	29,239,725.82	-	-	-	-	123,751,221.72	152,990,947.54
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,018,951.08	4,018,951.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	75,423.95	75,423.95

应付托管费	-	-	-	-	-	18,856.00	18,856.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.90	0.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,398.16	11,398.16
其他负债	-	-	-	-	-	139,341.35	139,341.35
负债总计	-	-	-	-	-	4,263,971.44	4,263,971.44
利率敏感度缺口	29,239,725.82	-	-	-	-	-119,487,250.28	148,726,976.10
上年度末 2017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	8,861,292.68	-	-	-	-	-	8,861,292.68
结算备付金	1,659,156.12	-	-	-	-	-	1,659,156.12
存出保证金	20,766.47	-	-	-	-	-	20,766.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-146,135,918.51	146,135,918.51
买入返售金融资产	47,000,000.00	-	-	-	-	-	47,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,035,239.45	3,035,239.45
应收利息	-	-	-	-	-	25,640.40	25,640.40
资产总计	57,541,215.27	-	-	-	-	-149,196,798.36	206,738,013.63
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,253,243.37	2,253,243.37
应付赎回款	-	-	-	-	-	10.05	10.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	107,988.78	107,988.78
应付托管费	-	-	-	-	-	26,997.20	26,997.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2.48	2.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	233,434.42	233,434.42
其他负债	-	-	-	-	-	160,000.00	160,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,781,676.30	2,781,676.30
利率敏感度缺口	57,541,215.27	-	-	-	-	-146,415,122.06	203,956,337.33

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

报告期本基金无债券投资。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	123,734,546.23	83.20	146,135,918.51	71.65
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	123,734,546.23	83.20	146,135,918.51	71.65

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数变化 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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	6,186,727.31	7,306,795.93
	沪深 300 指数下降 5%	-6,186,723.31	-7,306,795.93

6.4.13 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	123,734,546.23	80.88
	其中：股票	123,734,546.23	80.88
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	16,000,000.00	10.46
	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	13,225,322.41	8.64
8	其他各项资产	31,078.90	0.02
9	合计	152,990,947.54	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	1,704,981.72	1.15
B	采矿业	5,133,774.00	3.45
C	制造业	61,585,575.25	41.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,560,588.65	2.39
E	建筑业	1,159,226.40	0.78
F	批发和零售业	7,680,181.30	5.16
G	交通运输、仓储和邮政业	9,771,995.15	6.57
H	住宿和餐饮业	2,923,536.00	1.97
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,855,540.80	7.97
J	金融业	9,905,975.92	6.66
K	房地产业	1,572,044.10	1.06
L	租赁和商务服务业	2,575,861.20	1.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.05

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	4,224,039.60	2.84
S	综合	-	-
	合计	123,734,546.23	83.20

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002563	森马服饰	303,900	4,345,770.00	2.92
2	300003	乐普医疗	116,250	4,264,050.00	2.87
3	300188	美亚柏科	215,680	3,946,944.00	2.65
4	600570	恒生电子	60,200	3,187,590.00	2.14
5	600754	锦江股份	79,100	2,923,536.00	1.97
6	300122	智飞生物	62,500	2,858,750.00	1.92
7	300059	东方财富	201,960	2,661,832.80	1.79
8	002027	分众传媒	269,160	2,575,861.20	1.73
9	601100	恒立液压	122,500	2,557,800.00	1.72
10	002179	中航光电	63,220	2,465,580.00	1.66
11	600859	王府井	112,000	2,382,240.00	1.60
12	600309	万华化学	52,423	2,381,052.66	1.60
13	000895	双汇发展	89,022	2,351,071.02	1.58
14	600030	中信证券	140,600	2,329,742.00	1.57
15	300537	广信材料	159,982	2,308,540.26	1.55
16	600886	国投电力	316,800	2,303,136.00	1.55
17	300251	光线传媒	223,400	2,274,212.00	1.53
18	000022	深赤湾	99,100	2,261,462.00	1.52
19	600535	天士力	86,664	2,237,664.48	1.50
20	002003	伟星股份	262,155	2,220,452.85	1.49
21	601318	中国平安	37,724	2,209,871.92	1.49
22	601988	中国银行	611,200	2,206,432.00	1.48
23	601333	广深铁路	515,300	2,190,025.00	1.47
24	601899	紫金矿业	595,900	2,151,199.00	1.45
25	600019	宝钢股份	273,800	2,132,902.00	1.43
26	600176	中国巨石	205,512	2,102,387.76	1.41

27	002153	石基信息	71,006	2,059,174.00	1.38
28	600038	中直股份	51,100	2,043,489.00	1.37
29	600998	九州通	120,400	2,041,984.00	1.37
30	000429	粤高速 A	278,400	2,010,048.00	1.35
31	002343	慈文传媒	103,880	1,949,827.60	1.31
32	300203	聚光科技	75,900	1,943,040.00	1.31
33	600028	中国石化	298,500	1,937,265.00	1.30
34	002389	南洋科技	142,000	1,922,680.00	1.29
35	002311	海大集团	89,500	1,888,450.00	1.27
36	002601	佰利联	145,200	1,877,436.00	1.26
37	600196	复星医药	43,000	1,779,770.00	1.20
38	601919	中远海控	351,900	1,731,348.00	1.16
39	600056	中国医药	94,200	1,721,034.00	1.16
40	000998	隆平高科	90,402	1,704,981.72	1.15
41	600060	海信电器	120,900	1,618,851.00	1.09
42	000001	平安银行	178,000	1,618,020.00	1.09
43	600004	白云机场	120,635	1,579,112.15	1.06
44	001979	招商蛇口	82,522	1,572,044.10	1.06
45	601688	华泰证券	103,000	1,541,910.00	1.04
46	600201	生物股份	88,270	1,508,534.30	1.01
47	000059	华锦股份	218,200	1,503,398.00	1.01
48	002013	中航机电	193,687	1,466,210.59	0.99
49	600694	大商股份	43,500	1,414,185.00	0.95
50	600967	内蒙一机	109,700	1,397,578.00	0.94
51	002008	大族激光	24,700	1,313,793.00	0.88
52	002092	中泰化学	133,371	1,285,696.44	0.86
53	300595	欧普康视	26,820	1,202,072.40	0.81
54	000090	天健集团	186,972	1,159,226.40	0.78
55	600153	建发股份	126,400	1,136,336.00	0.76
56	000541	佛山照明	176,657	1,058,175.43	0.71
57	600497	驰宏锌锗	191,800	1,045,310.00	0.70
58	601137	博威合金	126,215	1,019,817.20	0.69
59	603345	安井食品	28,800	1,008,000.00	0.68
60	603517	绝味食品	23,700	1,006,065.00	0.68
61	603010	万盛股份	38,580	728,004.60	0.49
62	000028	国药一致	14,137	705,436.30	0.47
63	002479	富春环保	124,200	701,730.00	0.47
64	600098	广州发展	75,064	484,162.80	0.33
65	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.05

66	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.03
67	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.03
68	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.02
69	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

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	601988	中国银行	2,548,128.00	1.25
2	300537	广信材料	2,455,836.42	1.20
3	300203	聚光科技	2,372,459.00	1.16
4	002153	石基信息	2,043,589.14	1.00
5	600201	生物股份	2,038,629.80	1.00
6	002092	中泰化学	2,000,565.00	0.98
7	600060	海信电器	1,978,115.00	0.97
8	000002	万科 A	1,558,378.00	0.76
9	601137	博威合金	1,500,052.20	0.74
10	600028	中国石化	1,490,222.00	0.73
11	600694	大商股份	1,480,587.00	0.73
12	600497	驰宏锌锗	1,477,831.00	0.72
13	600153	建发股份	1,466,340.00	0.72
14	600967	内蒙一机	1,459,733.00	0.72
15	603345	安井食品	1,010,835.00	0.50
16	600579	天华院	999,554.00	0.49
17	600570	恒生电子	997,920.00	0.49
18	603517	绝味食品	995,400.00	0.49
19	603010	万盛股份	960,733.20	0.47
20	600392	盛和资源	921,185.80	0.45

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	600729	重庆百货	2,871,719.20	1.41

2	300144	宋城演艺	2,827,201.31	1.39
3	000581	威孚高科	2,792,566.24	1.37
4	300342	天银机电	2,630,498.30	1.29
5	601607	上海医药	2,496,130.48	1.22
6	000601	韶能股份	2,388,558.10	1.17
7	600298	安琪酵母	2,309,586.00	1.13
8	600023	浙能电力	2,302,963.76	1.13
9	002831	裕同科技	2,237,998.00	1.10
10	300408	三环集团	2,220,022.00	1.09
11	603986	兆易创新	2,156,631.00	1.06
12	600452	涪陵电力	2,129,977.78	1.04
13	601211	国泰君安	2,126,573.00	1.04
14	600089	特变电工	2,112,512.71	1.04
15	002008	大族激光	1,624,823.00	0.80
16	600196	复星医药	1,517,321.00	0.74
17	600562	国睿科技	1,500,543.00	0.74
18	000002	万科 A	1,351,139.00	0.66
19	000063	中兴通讯	1,240,212.00	0.61
20	600004	白云机场	1,012,199.86	0.50

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	36,197,029.63
卖出股票收入（成交）总额	52,280,733.97

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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**

本基金不参与股指期货投资。

7.10.2 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。

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**

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

经查询上海证券交易所、深圳证券交易所、中国货币网等公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

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	14,403.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,675.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	31,078.90
---	----	-----------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
英大睿盛A	122	1,245,968.75	152,000,000.00	99.99%	8,187.04	0.01%
英大睿盛C	131	36.95	0.00	0.00%	4,840.00	100.00%
合计	253	600,842.00	152,000,000.00	99.99%	13,027.04	0.01%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	英大睿盛A	197.48	0.0001%
	英大睿盛C	130.00	2.6860%
	合计	327.48	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）。

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	英大睿盛 A	英大睿盛 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 1 日）基金份额总额	200,011,127.19	11,200.00
本报告期期初基金份额总额	200,009,046.89	13,683.27
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	48,000,859.85	8,843.27
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	152,008,187.04	4,840.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2018 年 1 月 30 日发布公告，宗宽广先生自 2018 年 1 月 27 日起不再担任英大基金管理有限公司督察长职务。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 2 月 23 日发布公告，朱志先生自 2018 年 2 月 14 日起代任英大基金管理有限公司督察长职务。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 6 月 8 日发布公告，柴元春先生自 2018 年 6 月 6 日起担任英大基金管理有限公司副总经理职务。

2018 年 5 月 7 日，中国光大银行股份有限公司聘任张博先生担任投资与托管业务部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金管理人有两起涉及同一名原员工的劳动争议诉讼尚未了结，该诉讼不涉及本基金。此外，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略没有发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未变更为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
东兴证券	2	86,344,261.33	100.00%	63,142.87	100.00%	-

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
东兴证券	-	-	601,400,000.00	100.00%	-	-

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	英大睿鑫灵活配置招募说明书(更新)及摘要(2017年第2次)	中国证监会指定媒介	2018年1月11日
2	关于增加北京肯特瑞财富投资管理公司为公司旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2018年1月18日
3	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金2017年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2018年1月19日
4	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2018年1月24日
5	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定媒介	2018年1月30日
6	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定媒介	2018年2月23日
7	关于英大基金管理有限公司参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠公告	中国证监会指定媒介	2018年2月28日
8	英大基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订旗下开放式基金基金合同的公告	中国证监会指定媒介	2018年3月28日

9	英大基金管理有限公司关于旗下基金持有的流通受限股票估值方法调整的公告	中国证监会指定媒介	2018 年 3 月 28 日
10	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告及摘要	中国证监会指定媒介	2018 年 3 月 30 日
11	英大基金基金管理有限公司关于旗下基金持有证券调整估值价的公告	中国证监会指定媒介	2018 年 4 月 20 日
12	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2018 年 4 月 23 日
13	英大基金管理有限公司关于旗下开放式基金开通基金转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018 年 4 月 24 日
14	英大基金管理有限公司关于参加中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018 年 5 月 31 日
15	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定媒介	2018 年 6 月 8 日
16	英大基金管理有限公司关于股权变更及修改《公司章程》的公告	中国证监会指定媒介	2018 年 6 月 20 日
17	英大基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2018 年 6 月 25 日
18	英大基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构的公告	中国证监会指定媒介	2018 年 6 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018.1.1-2018.6.30	199,999,000.00	0.00	47,999,000.00	152,000,000.00	99.99%
产品特有风险							
<p>(1) 赎回申请延期办理的风险 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。</p> <p>(4) 提前终止基金合同的风险 高比例投资者赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p> <p>(5) 对重大事项进行投票表决时面临的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准英大灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件

《英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

《英大睿盛灵活配置混合型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

基金管理人和基金托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：<http://www.ydamc.com/>

英大基金管理有限公司

2018 年 8 月 28 日