

# 英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告

2018 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 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 2019 年 3 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>16</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	22
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.....	22
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>23</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	23
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.....	23
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.....	23
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>24</b>
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	24
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>27</b>
7.1 资产负债表.....	27
7.2 利润表.....	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	29
7.4 报表附注.....	30
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 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.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60

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 .....	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3 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 .....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
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 .....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8 其他重大事件 .....	67
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>71</b>
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 .....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>72</b>
13.1 备查文件目录 .....	72
13.2 存放地点 .....	72
13.3 查阅方式 .....	72

## § 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	
场内简称	-	
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	152,013,762.03 份	
基金合同存续期	-	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	英大睿盛 A	英大睿盛 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	003713	003714
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	152,008,179.90 份	5,582.13 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。	
	英大睿盛 A	英大睿盛 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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	石立平
	联系电话	010-59112020	010-63639180
	电子邮箱	liuyi@ydamc.com	shiliping@cebbank.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	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ydamc.com">http://www.ydamc.com</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
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、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 1 期间 数据 和 指标	2018 年		2017 年		2016 年 12 月 1 日(基金合同 生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	英大睿盛 A	英大睿盛 C	英大睿盛 A	英大睿盛 C	英大睿盛 A	英大睿盛 C
本期 已 实现 收益	1,078,286.90	131.53	18,202,167.78	1,096.43	227,924.16	10.87
本期 利 润	-26,109,555.58	-1,384.52	18,196,964.91	1,131.13	1,737,259.86	95.39
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	-0.1705	-0.2137	0.0910	0.0842	0.0087	0.0085
本 期 加 权 平	-17.62%	-21.95%	8.73%	8.08%	0.87%	0.85%

均 净 值 利 润 率						
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	-17.64%	-16.93%	9.06%	8.85%	0.87%	0.85%
3.1. 2 期 末 数 据 和 指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	-24,345,848.47	-863.89	2,429,281.23	134.76	227,924.16	10.87
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利	-0.1602	-0.1548	0.0121	0.0098	0.0011	0.0010



润						
期末基金资产净值	127,662,331.43	4,718.24	203,942,416.46	13,920.87	201,748,387.05	11,295.39
期末基金份额净值	0.8398	0.8452	1.0197	1.0174	1.0087	1.0085
3.1.3 累计期末指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
基金份额累计净值增长率	-9.40%	-8.81%	10.00%	9.77%	0.87%	0.85%

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
过去三个月	-10.36%	1.66%	-4.51%	0.84%	-5.85%	0.82%
过去六个月	-14.17%	1.45%	-6.54%	0.74%	-7.63%	0.71%
过去一年	-17.64%	1.32%	-12.16%	0.67%	-5.48%	0.65%
自基金合同生效起至今	-9.40%	0.99%	-14.29%	0.54%	4.89%	0.45%

英大睿盛 C

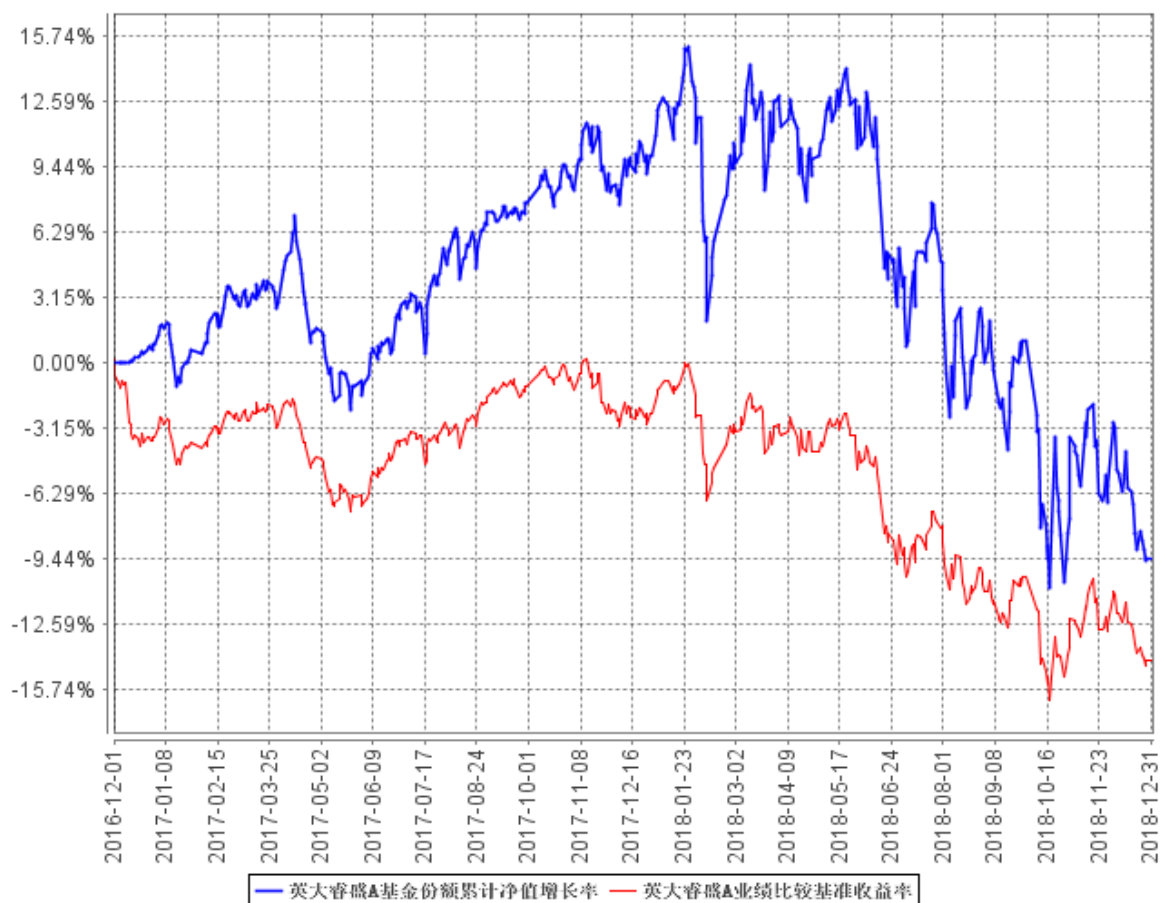
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.44%	1.65%	-4.51%	0.84%	-4.93%	0.81%
过去六个月	-13.32%	1.45%	-6.54%	0.74%	-6.78%	0.71%
过去一年	-16.93%	1.32%	-12.16%	0.67%	-4.77%	0.65%
自基金合同生效起至今	-8.81%	0.99%	-14.29%	0.54%	5.48%	0.45%

注：①本基金合同于 2016 年 12 月 1 日生效；

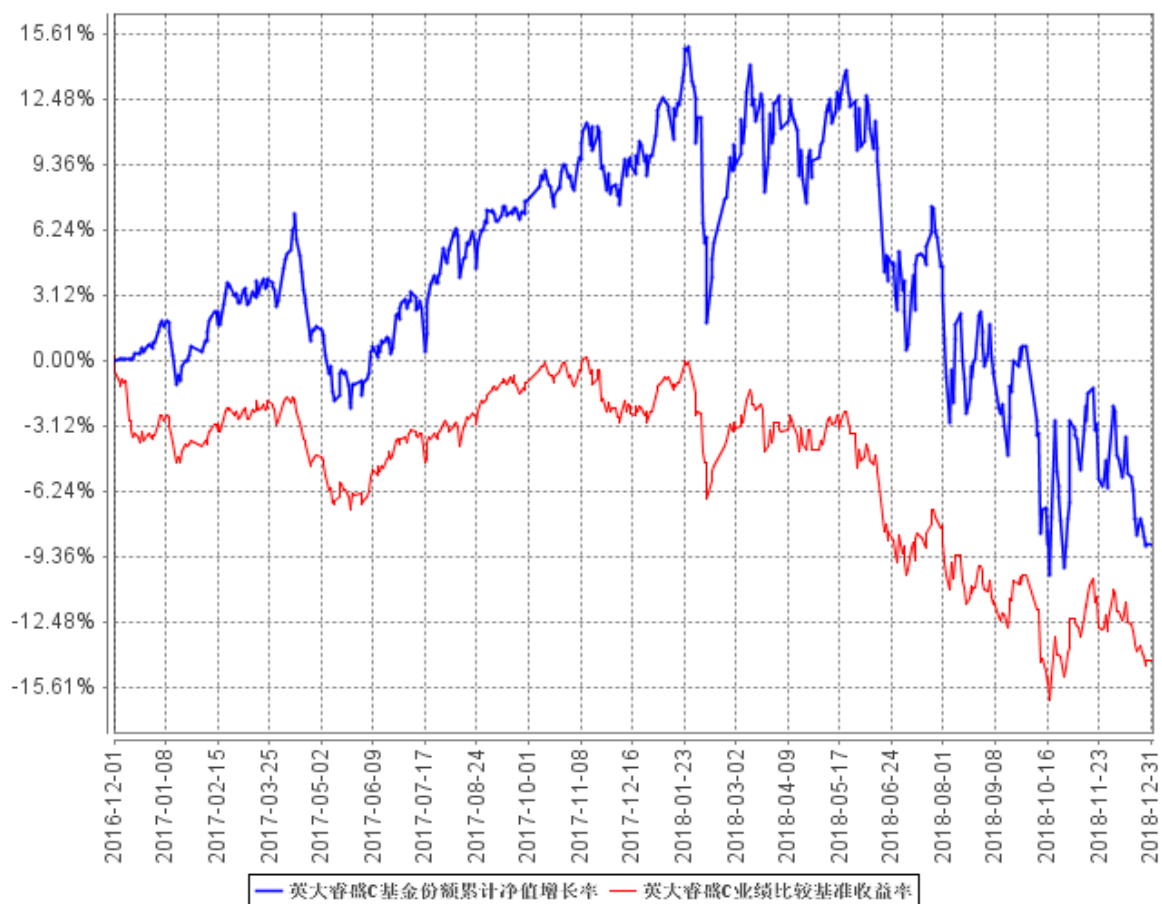
②本基金的业绩比较基准为：50%×中证全指指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

### 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

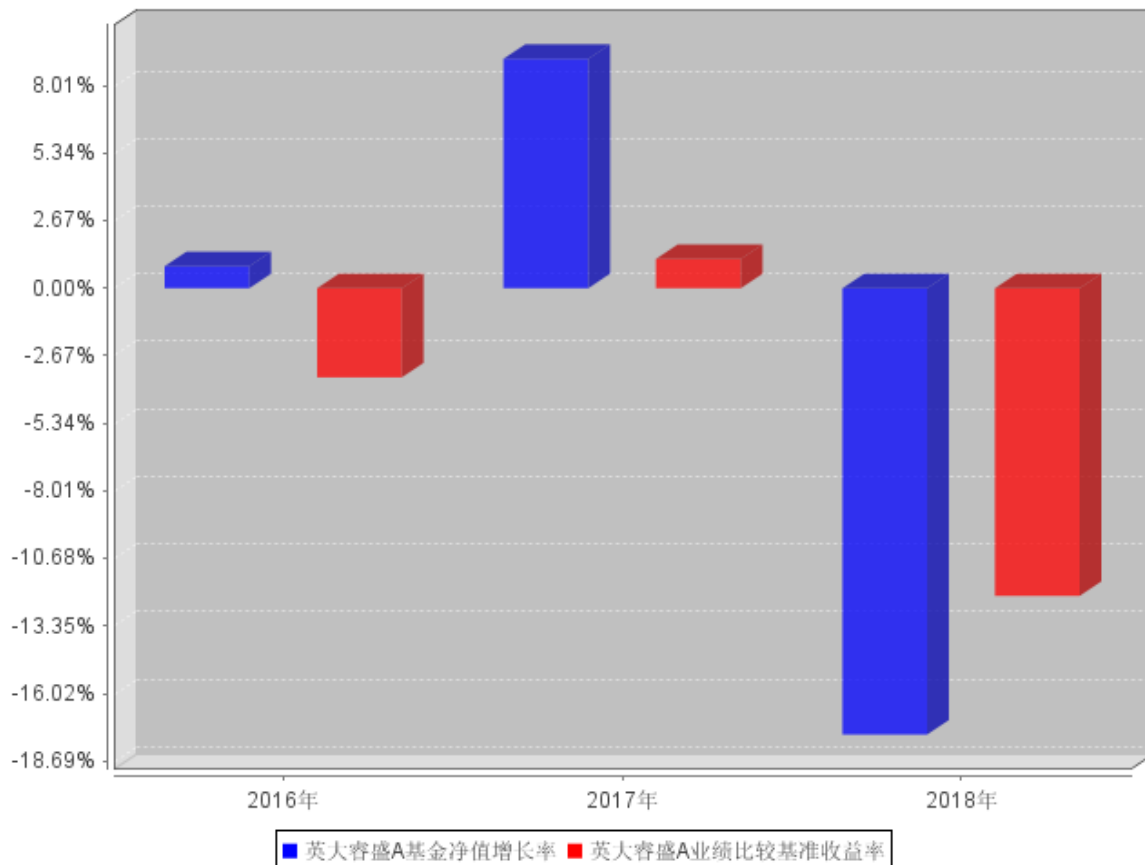


英大睿盛C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

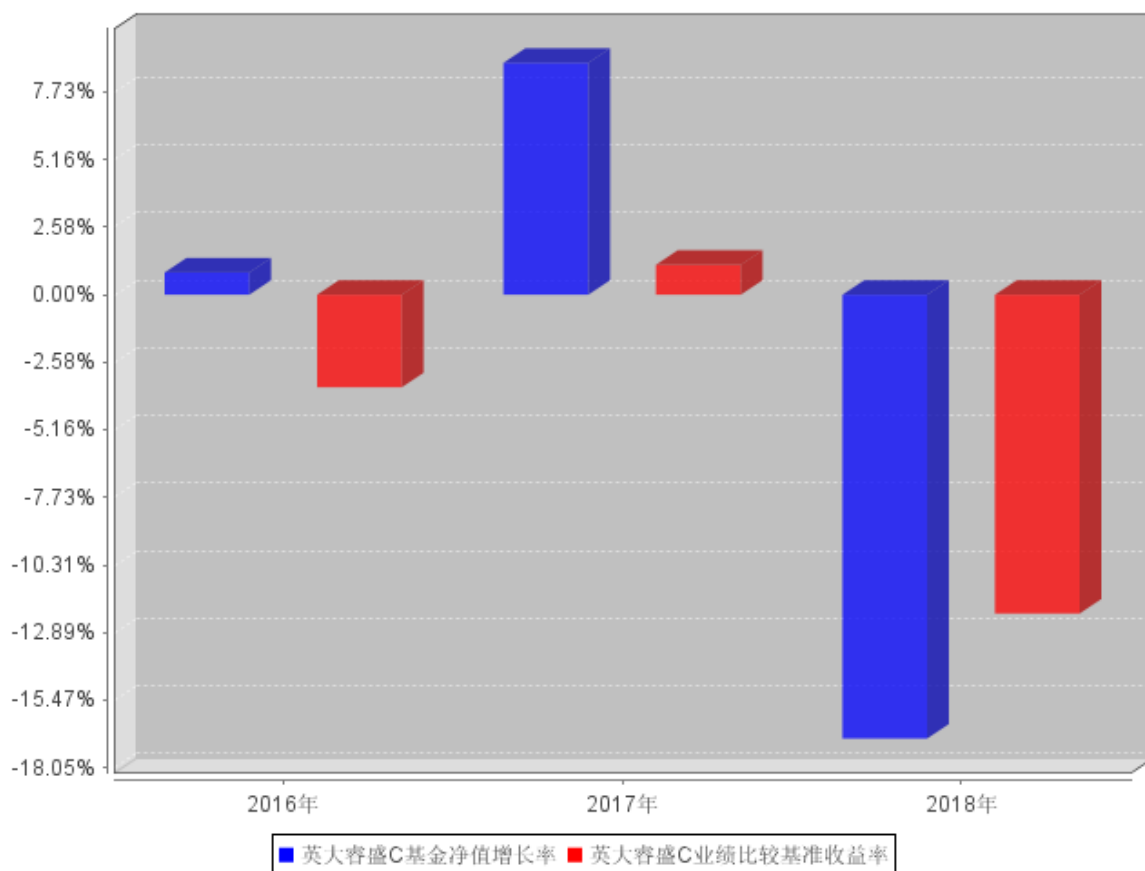


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

英大睿盛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



英大睿盛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 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

英大睿盛 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
2018	-	-	-	-	
2017	0.8000	16,000,725.03	-	16,000,725.03	
2016	-	-	-	-	
合计	0.8000	16,000,725.03	-	16,000,725.03	

单位：人民币元

英大睿盛 C					
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
2018	-	-	-	-	

2017	0.8000	1,094.66	-	1,094.66	
2016	-	-	-	-	
合计	0.8000	1,094.66	-	1,094.66	

## § 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

英大基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2012 年 8 月 17 日，注册资本金为 20,000 万元人民币。现有三家股东，分别是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、航天科工财务有限责任公司，持股比例分别为 49%、36%和 15%。

公司业务范围包括基金募集、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。公司 90%以上的员工来自于基金公司等金融机构，平均行业从业时间超过 10 年，硕士以上学历的员工占员工总数 70%以上，核心团队拥有丰富的经验和行业影响力。

公司自成立就秉承了国有企业诚信、责任、奉献的优良传统，确立了以“诚信、责任、专业、创新”为核心的企业文化，坚持以维护基金持有人利益为经营原则，坚持公募、私募协同发展、两翼齐飞的战略，坚持以市场为导向，坚持价值投资、长期投资理念，注重发展和创新，建立了科学、专业的投研体系和严谨的风控体系，力争成为具有核心竞争力、受人尊敬、业内领先的专业财富管理公司。

截至 2018 年 12 月 31 日，本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、英大睿盛混合型证券投资基金 8 只开放式证券投资基金，同时，管理过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	-	18	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工作。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	-	4	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。

## 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《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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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、私募资产管理计划、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，且未发现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

2018 年，中国全年国内生产总值比上年增长 6.6%，略低于市场预期。全年大部分资产负收益，债券优于股票。在经济动能减弱、贸易摩擦影响下，全球经济增长放缓预期在 18 年第四季度以来愈加明显，国内“去杠杆”及美联储收紧货币政策在 2018 年都对资产价格带来冲击。大类资产中，

股票跌幅居前，受贸易摩擦影响的出口型企业首当其冲；原油及基本金属等强周期商品价格回落，并带动商品价格整体下跌。2019 年企业盈利预期恶化，包括美联储在内的主要央行货币政策维持乃至进一步宽松的可能性加大。国内财政政策有望在 2019 年进一步宽松，减税、土地制度改革、金融改革及区域协调发展政策等有望出台；随着 PPI 通缩来临，国内货币政策的重心大概率转向解决融资贵的问题，下半年降准概率较大。在此背景下，短期内权益市场难以获得基本面的支撑，全球市场仍有可能面临大幅震荡。本基金以股票市场为投资重点，二级市场主要把握结构性机会，一级市场积极参与网下新股配售。

## 2、股票投资

2017 年底，以上证 50、沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹相对于中小创板块具有显著的估值优势，且宏观经济环境、市场制度建设等支持具有国际竞争力的公司快发展壮大。本公司 2018 年初制定投资策略时有效地把握了上述重点，基金坚持以机构投资理念配置稳健增值资产，以低估值、高分红、有成长前景的大盘蓝筹股票作为重点投资对象，根据季度业绩数据动态调整投资组合。一级市场方面，本基金积极参与网下新股配售，以期为客户提供稳健的投资收益。

### 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 0.8398 元，本报告期基金份额净值增长率为 -17.64%；英大睿盛 C 基金份额净值为 0.8452 元，本报告期基金份额净值增长率为 -16.93%；同期业绩比较基准收益率为 -12.16%。

## 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 年全球经济增长放缓明显，而美国经济一枝独秀。预计 2019 年主要发达经济体经济增速或将同步回落。对于美国，2019 年经济增速大概率出现回落，主要原因在于美联储加息影响增强和减税刺激减弱。对于欧洲，民粹主义崛起制约了其经济的复苏，英国脱欧前景也仍不明朗，预计 2019 年欧洲经济增速继续回落。对于日本，全球经济放缓可能继续拖累其出口，预计 2019 年日本经济增速仍处低位，而 2019 年日本提高消费税率也可能对私人消费产生负面影响。2019 年中国经济增长仍有下行压力，进口可能放缓。据 IMF 测算中国、美国和欧元区在 2018 年对世界经济增长的贡献率分别达到 21%、16%和 9%，中美合计超过 1/3，可以说是全球最重要的两大需求引擎，2019 年两大需求引擎放缓，叠加逆全球化抬头，又使贸易摩擦不断升级，未来影响深远。

A 股经过 2018 年的调整，目前估值处于历史底部区域的偏低水平。基于绝对估值，全部 A 股、剔除银行 A 股、全部 A 股中位数三个角度均与历次熊市底部水平相差无几。从今年政策出台看，

高层已认识到经济下行的压力，多次释放维护金融市场稳定的积极信号，有关民营企业纾困政策也密集出台。市场政策已有转向，但是公司业绩的回升尚待观察政策落实执行力度。2019 年金融市场的制度改革将进一步展开。科创板的创立今年料将给 A 股带来新的活力和更多优质公司。资金面上，我国正积极引导国内外长线资金进入 A 股。外资方面，A 股业已纳入 MSCI 新兴市场指数，富时罗素也将在 2019 年 6 月开始将 A 股纳入其指数体系。预计 2019 年外资流入 A 股的规模约在 3000-4000 亿元人民币。国内长线资金主要包括社保基金与基本养老金、企业年金和职业年金以及保险公司资金。目前我国养老目标基金与个税递延养老保险都已在推进中，基本养老金也逐步入市，我们预计 2019 年广义保险资金入市资金规模在 3000 亿元人民币左右。

随着中美贸易谈判结果逐渐明朗、国外市场风险逐步释放、国内股票质押商誉减值等业绩黑天鹅事件的陆续暴露，投资者风险偏好逐步修复。2019 年我们看好国内外机构投资者的底部做多操作，行业方面看好高端制造、逆周期行业。在选股层面，本基金将继续以机构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。本基金将继续奉行英大基金管理有限公司“诚信责任专业创新”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 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，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性：公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是

及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决：通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是继续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和风险的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效的得到落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，向监管机构报送监察稽核季报。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

#### 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。估值委员会主任由分管投资的副总经理或实际履行上述职务的其他人员担任；成员包括基金运营部、监察稽核部的负责人及其他根据议题需要指定的相关人员；委员会秘书由基金运营部负责人担任。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**

无。

#### **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元的情形。

## § 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。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	毕马威华振审字第 1901398 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	英大睿盛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>我们审计了后附的英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“英大睿盛基金”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了英大睿盛基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值变动情况。</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（以下简称“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，我们独立于英大睿盛基金，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	-
其他事项	-
其他信息	<p>英大睿盛基金管理人英大基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括英大睿盛基金 2018 年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	英大睿盛基金管理人英大基金管理有限公司管理层负责按照中华



责任	<p>中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，英大睿盛基金管理人英大基金管理有限公司管理层负责评估英大睿盛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，除非英大睿盛基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>英大睿盛基金管理人英大基金管理有限公司治理层负责监督英大睿盛基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>(1) 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>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价英大睿盛基金管理人英大基金管理有限公司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>(4) 对英大睿盛基金管理人英大基金管理有限公司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，就可能导致对英大睿盛基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是</p>

	<p>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睿盛基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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>我们与英大睿盛基金管理人英大基金管理有限公司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>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	左艳霞   刘珊珊
会计师事务所的地址	北京市东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,849,551.54	8,861,292.68
结算备付金		13,636.36	1,659,156.12
存出保证金		21,447.85	20,766.47
交易性金融资产	7.4.7.2	115,035,567.84	146,135,918.51
其中：股票投资		115,035,567.84	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	6,000,000.00	47,000,000.00
应收证券清算款		-	3,035,239.45
应收利息	7.4.7.5	8,242.04	25,640.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		127,928,445.63	206,738,013.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,253,243.37
应付赎回款		18.61	10.05
应付管理人报酬		67,020.19	107,988.78
应付托管费		16,755.07	26,997.20
应付销售服务费		0.93	2.48
应付交易费用	7.4.7.7	17,601.15	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	7.4.7.8	160,000.01	160,000.00
负债合计		261,395.96	2,781,676.30
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	152,013,762.03	200,022,730.16
未分配利润	7.4.7.10	-24,346,712.36	3,933,607.17
所有者权益合计		127,667,049.67	203,956,337.33
负债和所有者权益总计		127,928,445.63	206,738,013.63

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，英大睿盛 A 净值人民币 0.8398 元，基金份额总额 152,008,179.90 份，英大睿盛 C 净值人民币 0.8452 元，基金份额总额 5,582.13 份，总份额合计 152,013,762.03 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-24,624,611.81	22,741,990.18
1.利息收入		490,738.10	2,549,709.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	84,152.47	136,720.23
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		406,585.63	2,412,989.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,073,955.90	20,197,441.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-438,011.72	18,564,528.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,511,967.62	1,632,913.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-27,189,358.53	-5,168.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	52.72	6.49
<b>减：二、费用</b>		1,486,328.29	4,543,894.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	888,739.26	1,502,356.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	222,184.86	312,549.03
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	12.88	27.44
4. 交易费用	7.4.7.19	196,466.29	2,515,806.13
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	7.4.7.20	178,925.00	213,155.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-26,110,940.10	18,198,096.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-26,110,940.10	18,198,096.04

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	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）	-	-26,110,940.10	-26,110,940.10
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）	-48,008,968.13	-2,169,379.43	-50,178,347.56
其中：1. 基金申购款	12,762.12	-918.12	11,844.00
2. 基金赎回款	-48,021,730.25	-2,168,461.31	-50,190,191.56
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)	152,013,762.03	-24,346,712.36	127,667,049.67
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	18,198,096.04	18,198,096.04
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)	402.97	-24.43	378.54
其中: 1. 基金申购款	5,052.01	247.71	5,299.72
2. 基金赎回款	-4,649.04	-272.14	-4,921.18
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)	-	-16,001,819.69	-16,001,819.69
五、期末所有者权益(基金净值)	200,022,730.16	3,933,607.17	203,956,337.33

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:

<u>孔旺</u>	<u>朱志</u>	<u>陈畅</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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 200,022,327.19 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 200,022,327.19 份基金份额（其中英大睿盛 A 基金份额为 20,0011,127.19 份，英大睿盛 C 基金份额为 11,200 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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证券监督管理委员会（以下简称“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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券

投资行业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 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的说明

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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

(2) 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

(3) 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。



满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- (2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- (3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- (1) 所转移金融资产的账面价值
- (2) 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(未弥补亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

其他费用根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额列入当期基金费用。

如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法，在受益期内分摊计入本期和以后各期。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告 [2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法估值技术进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告 [2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012]85 号文《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 [2015]101 号《财政部国家税务总局证监会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 [2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税

[2008]1 号文《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[2016]36 号文《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] 46 号《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》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(2) 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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品基金在 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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。免征增值税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	6,849,551.54	8,861,292.68
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：	6,849,551.54	8,861,292.68

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	140,720,674.32	115,035,567.84	-25,685,106.48
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	140,720,674.32	115,035,567.84	-25,685,106.48
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	144,631,666.46	146,135,918.51	1,504,252.05
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	144,631,666.46	146,135,918.51	1,504,252.05

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本年末期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/（负债）。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-
项目	上年度末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	47,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	47,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	2,343.33	2,269.03
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	6.71	821.37

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	5,881.44	22,539.77
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	10.56	10.23
合计	8,242.04	25,640.40

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本期末及上年度末，本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	17,601.15	233,434.42
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	17,601.15	233,434.42

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.01	-
预提费用	160,000.00	160,000.00
合计	160,000.01	160,000.00

#### 7.4.7.9 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12月31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	1,205.21	1,205.21
本期赎回（以“-”号填列）	-48,002,072.20	-48,002,072.20
- 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	152,008,179.90	152,008,179.90

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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,683.27	13,683.27
本期申购	11,556.91	11,556.91
本期赎回（以“-”号填列）	-19,658.05	-19,658.05
- 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	5,582.13	5,582.13

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 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	1,078,286.90	-27,187,842.48	-26,109,555.58
本期基金份额交易产生的变动数	-634,614.32	-1,535,048.14	-2,169,662.46
其中：基金申购款	19.50	-127.59	-108.09
基金赎回款	-634,633.82	-1,534,920.55	-2,169,554.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,872,953.81	-27,218,802.28	-24,345,848.47

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	131.53	-1,516.05	-1,384.52
本期基金份额交易产生的变动数	-133.27	416.30	283.03
其中：基金申购款	110.93	-920.96	-810.03

基金赎回款	-244.20	1,337.26	1,093.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133.02	-996.91	-863.89

注：本表涉及报告期内未分配利润的变动项目中，如为利润减少或亏损，以“-”号填列。

#### 7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31 日
活期存款利息收入	72,693.84	88,896.87
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	11,161.77	47,004.27
其他	296.86	819.09
合计	84,152.47	136,720.23

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
卖出股票成交总额	76,453,840.91	949,562,754.62
减：卖出股票成本总额	76,891,852.63	930,998,225.92
买卖股票差价收入	-438,011.72	18,564,528.70

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

注：本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,511,967.62	1,632,913.19
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,511,967.62	1,632,913.19

## 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
1. 交易性金融资产	-27,189,358.53	-5,168.17
——股票投资	-27,189,358.53	-5,168.17
——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	-27,189,358.53	-5,168.17

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
基金赎回费收入	52.72	6.49
合计	52.72	6.49

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
交易所市场交易费用	196,466.29	2,515,806.13
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	196,466.29	2,515,806.13

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
乙类帐户维护费	18,000.00	12,000.00
银行费用	925.00	1,155.00
其他	-	40,000.00
合计	178,925.00	213,155.00

**7.4.7.21 分部报告**

无。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

**7.4.9 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
中国光大银行股份有限公司	基金托管人
国网英大国际集团	基金管理人的股东
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	888,739.26	1,502,356.54
其中：支付销售机构的客户维护费	0.58	-

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 0.60% 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 × 0.60% / 当年天数。

②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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	222,184.86	312,549.03

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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$ 。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	-	12.53	12.53
合计	-	12.53	12.53
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 12 月 31 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	-	27.44	27.44
合计	-	27.44	27.44

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下： $\text{C 类基金份额每日应计提的销售服务费} = \text{C 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：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。

**7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017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
中国光大银行股份有限公司	6,849,551.54	72,693.84	8,861,292.68	88,896.87

注：本基金通过“光大银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2018年12月31日的相关余额为人民币35,084.21元。（2017年12月31日：人民币1,679,922.59元）

**7.4.10.6 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。

**7.4.10.7 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。

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期无利润分配事项。

**7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-



注：根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018年12月25日	重大资产重组	16.01	2019年1月10日	17.15	140,600	2,492,368.00	2,251,006.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末及上年度末，本基金未持有交易所市场债券正回购。

#### 7.4.13 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。

##### 7.4.13.1 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。

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末未持有债券投资组合。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末未持有同业存单。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末未持有债券投资组合。

##### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

##### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末未持有同业存单。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。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场所进行交易，除前文所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

对流动性风险的监控和管理，本基金管理人根据对市场特征和发展形势等方面的分析和判断，

并由独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标持续性持续的检测和分析。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	6,849,551.54	-	-	-	-	-	6,849,551.54
结算备付金	13,636.36	-	-	-	-	-	13,636.36
存出保证金	21,447.85	-	-	-	-	-	21,447.85
交易性金融资产	-	-	-	-	-	115,035,567.84	115,035,567.84
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	-	-	6,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	8,242.04	8,242.04
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,884,635.75	-	-	-	-	115,043,809.88	127,928,445.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	18.61	18.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,020.19	67,020.19
应付托管费	-	-	-	-	-	16,755.07	16,755.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.93	0.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	17,601.15	17,601.15
其他负债	-	-	-	-	-	160,000.01	160,000.01
负债总计	-	-	-	-	-	261,395.96	261,395.96
利率敏感度缺口	12,884,635.75	-	-	-	-	-114,782,413.92	127,667,049.67
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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金不持有债券，现金资产以活期利率计息。因此，本年度和上年度利率变动对本基金资产净值无影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 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	115,035,567.84	90.11	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	115,035,567.84	90.11	146,135,918.51	71.65

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	沪深 300 指数上升 5%		沪深 300 指数下降 5%	
	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）			
分析	相关风险变量的变动	本期末（2018 年 12 月		上年度末（2017 年 12 月

		31 日 )	31 日 )
	沪深 300 指数上升 5%	12,062,036.19	7,896,894.76
	沪深 300 指数下降 5%	-12,062,036.19	-7,896,894.76

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末( 2018 年 12 月 31 日 )	上年度末( 2017 年 12 月 31 日 )

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	115,035,567.84	89.92
	其中：股票	115,035,567.84	89.92
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	6,000,000.00	4.69
	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	6,863,187.90	5.36
8	其他各项资产	29,689.89	0.02
9	合计	127,928,445.63	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	1,337,949.60	1.05
B	采矿业	4,435,106.00	3.47
C	制造业	50,647,558.81	39.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,587,725.24	7.51
E	建筑业	860,071.20	0.67
F	批发和零售业	4,047,942.28	3.17
G	交通运输、仓储和邮政业	4,329,211.75	3.39
H	住宿和餐饮业	1,684,830.00	1.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,418,924.36	12.86
J	金融业	12,733,115.20	9.97

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,528,078.40	4.33
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	3,425,055.00	2.68
S	综合	-	-
	合计	115,035,567.84	90.11

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：报告期末（2018年12月31日），本基金未持有沪港通股票。

### 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	601888	中国国旅	68,400	4,117,680.00	3.23
2	600570	恒生电子	66,200	3,441,076.00	2.70
3	000895	双汇发展	132,222	3,119,116.98	2.44
4	300188	美亚柏科	215,680	2,808,153.60	2.20
5	002153	石基信息	107,206	2,783,067.76	2.18
6	600886	国投电力	316,800	2,550,240.00	2.00
7	300059	东方财富	201,960	2,443,716.00	1.91
8	601988	中国银行	672,300	2,427,003.00	1.90
9	601100	恒立液压	122,500	2,426,725.00	1.90
10	300122	智飞生物	62,500	2,422,500.00	1.90
11	601318	中国平安	41,524	2,329,496.40	1.82
12	600030	中信证券	140,600	2,251,006.00	1.76
13	002179	中航光电	63,220	2,129,249.60	1.67
14	002311	海大集团	89,500	2,073,715.00	1.62
15	603345	安井食品	56,200	2,068,160.00	1.62
16	600436	片仔癀	23,700	2,053,605.00	1.61
17	300036	超图软件	109,900	2,014,467.00	1.58
18	600036	招商银行	79,500	2,003,400.00	1.57
19	601899	紫金矿业	595,900	1,990,306.00	1.56



20	600176	中国巨石	205,512	1,987,301.04	1.56
21	603517	绝味食品	60,000	1,986,600.00	1.56
22	600019	宝钢股份	301,200	1,957,800.00	1.53
23	300203	聚光科技	75,900	1,946,835.00	1.52
24	600038	中直股份	51,100	1,909,096.00	1.50
25	600236	桂冠电力	338,400	1,901,808.00	1.49
26	600642	申能股份	385,400	1,880,752.00	1.47
27	002912	中新赛客	22,900	1,856,274.00	1.45
28	002003	伟星股份	262,155	1,840,328.10	1.44
29	000001	平安银行	195,800	1,836,604.00	1.44
30	601688	华泰证券	113,300	1,835,460.00	1.44
31	600323	瀚蓝环境	129,900	1,822,497.00	1.43
32	002601	佰利联	145,200	1,785,960.00	1.40
33	002389	南洋科技	142,000	1,733,820.00	1.36
34	300144	宋城演艺	80,900	1,727,215.00	1.35
35	300251	光线传媒	223,400	1,697,840.00	1.33
36	600754	锦江股份	79,100	1,684,830.00	1.32
37	600562	国睿科技	130,600	1,680,822.00	1.32
38	600535	天士力	86,664	1,663,948.80	1.30
39	600028	中国石化	328,400	1,658,420.00	1.30
40	601333	广深铁路	515,300	1,628,348.00	1.28
41	600309	万华化学	57,623	1,612,867.77	1.26
42	600859	王府井	112,000	1,518,720.00	1.19
43	001872	招商港口	99,100	1,488,482.00	1.17
44	300537	广信材料	159,982	1,470,234.58	1.15
45	600201	生物股份	88,270	1,465,282.00	1.15
46	002027	分众传媒	269,160	1,410,398.40	1.10
47	000998	隆平高科	90,402	1,337,949.60	1.05
48	300003	乐普医疗	63,000	1,311,030.00	1.03
49	000059	华锦股份	218,200	1,296,108.00	1.02
50	002013	中航机电	193,687	1,260,902.37	0.99
51	600004	白云机场	120,635	1,212,381.75	0.95
52	600967	内蒙一机	109,700	1,140,880.00	0.89
53	300433	蓝思科技	166,000	1,080,660.00	0.85
54	300365	恒华科技	51,300	1,072,170.00	0.84
55	600694	大商股份	43,500	1,052,265.00	0.82
56	300595	欧普康视	26,820	1,039,006.80	0.81
57	600196	复星医药	43,000	1,000,610.00	0.78
58	000541	佛山照明	176,657	915,083.26	0.72

59	600098	广州发展	158,064	894,642.24	0.70
60	600153	建发股份	126,400	891,120.00	0.70
61	601137	博威合金	126,215	860,786.30	0.67
62	000090	天健集团	186,972	860,071.20	0.67
63	002008	大族激光	27,200	825,792.00	0.65
64	600497	驰宏锌锗	191,800	786,380.00	0.62
65	000028	国药一致	14,137	585,837.28	0.46
66	603010	万盛股份	38,580	542,049.00	0.42
67	002479	富春环保	124,200	537,786.00	0.42
68	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.04
69	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.03

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。

## 8.4 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	601888	中国国旅	3,999,520.00	1.96
2	002153	石基信息	3,073,479.14	1.51
3	000895	双汇发展	2,991,192.00	1.47
4	601988	中国银行	2,763,811.00	1.36
5	300537	广信材料	2,455,836.42	1.20
6	603517	绝味食品	2,372,501.00	1.16
7	300203	聚光科技	2,372,459.00	1.16
8	600036	招商银行	2,218,769.00	1.09
9	300036	超图软件	2,111,575.00	1.04
10	002912	中新赛客	2,066,503.00	1.01
11	600201	生物股份	2,038,629.80	1.00
12	600236	桂冠电力	2,019,825.00	0.99
13	600323	瀚蓝环境	2,006,158.00	0.98
14	002092	中泰化学	2,000,565.00	0.98
15	600562	国睿科技	1,987,830.00	0.97
16	600588	用友网络	1,984,080.00	0.97

17	600642	申能股份	1,983,502.00	0.97
18	600060	海信电器	1,978,115.00	0.97
19	300144	宋城演艺	1,977,237.00	0.97
20	603345	安井食品	1,969,910.00	0.97

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	002563	森马服饰	3,569,205.00	1.75
2	600729	重庆百货	2,871,719.20	1.41
3	300144	宋城演艺	2,827,201.31	1.39
4	000581	威孚高科	2,792,566.24	1.37
5	300342	天银机电	2,630,498.30	1.29
6	601607	上海医药	2,496,130.48	1.22
7	000895	双汇发展	2,395,523.00	1.17
8	000601	韶能股份	2,388,558.10	1.17
9	000429	粤高速 A	2,361,795.17	1.16
10	600298	安琪酵母	2,309,586.00	1.13
11	600023	浙能电力	2,302,963.76	1.13
12	002831	裕同科技	2,237,998.00	1.10
13	300408	三环集团	2,220,022.00	1.09
14	600588	用友网络	2,179,476.00	1.07
15	603986	兆易创新	2,156,631.00	1.06
16	600452	涪陵电力	2,129,977.78	1.04
17	601211	国泰君安	2,126,573.00	1.04
18	600089	特变电工	2,112,512.71	1.04
19	600998	九州通	1,842,895.00	0.90
20	600056	中国医药	1,639,280.00	0.80

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	72,980,860.49
卖出股票收入（成交）总额	76,453,840.91

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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所有资产支持证券投资明细

注：本报告期末（2018 年 12 月 31 日），本基金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：报告期内（2018 年 12 月 31 日），本基金未持贵金属。

## 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：报告期末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有权证。

## 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：本基金不参与股指期货投资。

### 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

本基金不参与国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金不参与国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形

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，除以下情形，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。

恒生电子列本基金本报告期末前十大持仓股票中，恒生电子控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司（以下简称“恒生网络”）于 2018 年 7 月 19 日收到北京市西城区人民法院出具的《失信决定书》（文件号为（2018）京 0102 执 2080 号）以及《限制消费令》（文件号为（2018）京 0102 执 2080 号），恒生网络被西城法院纳入了失信被执行人名单，同时，恒生网络及其法定代表人宗梅苓被下达了限制消费令。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	21,447.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,242.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,689.89

#### **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**

注：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
英大睿盛A	121	1,256,265.95	152,000,000.00	99.99%	8,179.90	0.01%
英大睿盛C	131	42.61	0.00	0.00%	5,582.13	100.00%
合计	252	603,229.21	152,000,000.00	99.99%	13,762.03	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）。

### 9.2 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	120.00	2.1497%
	合计	317.48	0.0002%

### 9.3 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	0~10
	英大睿盛C	0
	合计	0~10
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

## § 10 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
本报告期期间基金总申购份额	1,205.21	11,556.91
减:本报告期期间基金总赎回份额	48,002,072.20	19,658.05
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	152,008,179.90	5,582.13



## § 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 2018 年 1 月 30 日发布公告，自 2018 年 1 月 27 日起，宗宽广因个人原因不再担任公司督察长职务。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 2 月 23 日发布公告，自 2018 年 2 月 14 日起，公司总经理朱志代任督察长。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 6 日起，柴元春正式担任英大基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 7 月 26 日发布公告，自 2018 年 7 月 25 日起，刘轶任督察长，总经理朱志不再代任督察长。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 11 月 30 日发布公告，自 2018 年 11 月 28 日起，倪枫担任英大基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，基金管理人于 2018 年 12 月 14 日发布公告，自 2018 年 12 月 12 日起，范育晖担任英大基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，基金托管人自 2018 年 5 月起，聘任张博先生担任投资与托管业务部总经理职务。

本报告期内，基金托管人自 2018 年 11 月起，聘任葛海蛟先生担任中国光大银行股份有限公司行长。

### 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

报告期内本基金的审计机构由瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本年度审计费用为 60,000 元。本次会计师事务所的变更已经基金管理人董事会批准，并履行了必要的程序。

## 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

2016 年 10 月，公司未按期报送总经理离任审计报告。北京证监局于 2018 年 12 月 27 日对公司给予警告，并处以 1 万元罚款。前述事项不属于重大违法违规行为，与公募基金、专户业务无关，不影响公司产品投资运作，且发生以来，公司立行整改，严格按照要求，加强内部管理，及时报送有关材料，进一步提升了内控合规水平。

## 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	
东兴证券		2146,357,718.27	100.00%	107,031.42	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
东兴证券	-	-	1,066,400,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	英大基金关于旗下基金 2017 年年度最后一个市场交易日资产净值的公告	中国证券报、公司官网	2018 年 1 月 2 日
2	英大睿鑫灵活配置招募说明书（更新）及摘要（2017 年第 2 次）	中国证券报、公司官网	2018 年 1 月 11 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	中国证券报、公司官网	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	中国证券报、公司官网	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	中国证券报、公司官网	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	中国证券报、公司官网	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	中国证券报、公司官网	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	中国证券报、公司官网	2018 年 3 月 28 日

9	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	中国证券报、公司官网	2018 年 3 月 30 日
10	英大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	中国证券报、公司官网	2018 年 4 月 20 日
11	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	中国证券报、公司官网	2018 年 4 月 23 日
12	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	中国证券报、公司官网	2018 年 4 月 24 日
13	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、公司官网	2018 年 6 月 8 日
14	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	中国证券报、公司官网	2018 年 6 月 20 日
15	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	中国证券报、公司官网	2018 年 6 月 25 日
16	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	中国证券报、公司官网	2018 年 6 月 25 日
17	英大基金关于旗下基金 2018 年半年度最后一个市场交易日资产净值的公告	中国证券报、公司官网	2018 年 7 月 2 日
18	英大基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2018 年 7 月 2 日
19	英大基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2018 年 7 月 2 日
20	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）及摘要（2018 年第 1 号）	中国证券报、公司官网	2018 年 7 月 11 日
21	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	中国证券报、公司官网	2018 年 7 月 19 日
22	英大基金管理有限公司关于	中国证券报、公司官	2018 年 7 月 23 日

	增加大同证券有限责任公司为旗下基金销售机构的公告	网	
23	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、公司官网	2018年7月26日
24	英大基金管理有限公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2018年8月1日
25	英大基金管理有限公司关于增加招商证券股份有限公司为公司旗下部分证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、公司官网	2018年8月17日
26	关于英大基金管理有限公司因系统升级维护暂停网上交易、手机 APP 服务的公告	中国证券报、公司官网	2018年8月27日
27	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告及摘要	中国证券报、公司官网	2018年8月28日
28	英大基金管理有限公司关于增加泰诚财富（大连）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2018年8月31日
29	英大基金管理有限公司关于 App 暂停银联通道光大银行开户及申购等业务的公告	中国证券报、公司官网	2018年9月3日
30	英大基金管理有限公司关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2018年9月6日
31	英大基金管理有限公司关于增加开源证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2018年9月11日
32	英大基金管理有限公司关于参加开源证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、公司官网	2018年9月11日
33	关于网上交易、手机 APP 因系统升级维护暂停旗下全部基金交易服务的公告	中国证券报、公司官网	2018年10月19日
34	英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中国证券报、公司官网	2018年10月24日
35	英大基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金销售机	中国证券报、公司官网	2018年10月25日

	构的公告		
36	英大基金管理有限公司关于增加深圳众禄基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2018年10月25日
37	英大基金管理有限公司关于增加苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、公司官网	2018年10月29日
38	英大基金管理有限公司关于增加万联证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、公司官网	2018年11月9日
39	英大基金管理有限公司关于旗下基金参加万联证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、公司官网	2018年11月9日
40	英大基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	中国证券报、公司官网	2018年11月24日
41	英大基金管理有限公司关于基金改聘会计师事务所的更正公告	中国证券报、公司官网	2018年11月27日
42	关于网上交易、手机 APP 因系统升级维护暂停旗下全部基金交易服务的公告	中国证券报、公司官网	2018年11月29日
43	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、公司官网	2018年11月30日
44	英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、公司官网	2018年12月14日

## § 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	2018. 1. 1-2018. 12. 31	199, 999, 000. 00	-	47, 999, 000. 00	152, 000, 000. 00	99. 99%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
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>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201

### 13.3 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

2019 年 3 月 28 日