

中投资组合报告

─报告期末基金资产组

-报告期末按行业分类 的股票投资组合

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。 本报告中财务资料未经审计。

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。 本报告期自2019年4月1日起6月30日止。

基金基本情况 数值 项目 基金简称 英大灵活配置混合 场内简称 基金主代码 001270 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2015-05-07 报告期末基金份额总额 155, 705, 402. 89 投资目标 本基金通过把握宏观经济转折点,灵活配置权益类资产和固定收益类资产,并在严格控制下行风险的基础上,力争实现基金资产较高的长期稳健回报。 投资策略 1、大类资产配置策略; 2、股票投资策略; 3、固定收益品种投资策略; 4、股指期货投资策略; 5、权证投资策略。 业绩比较基准 1年期银行定期存款利率(税后)+2% 风险收益特征 本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。 基金管理人 英大基金管理有限公司 基金托管人 中国农业银行股份有限公司 下属2级基金的基金简称 英大灵活配置A 英大灵活配置B 下属2级基金的场内简称 001271 下属2级基金的交易代码 001270 报告期末下属2级基金的份额总额 695, 427. 19 155, 009, 975. 70 下属2级基金的风险收益特征

主要财务指标	→ 甘人 <i>(二</i>)	英大灵活配置A(元)	英大灵活配置B(元)			
	主基金(元)	2019-04-01 - 2019-06-30	2019-04-01 - 2019-06-30			
本期已实现收益		7, 843. 40	1, 553, 225. 61			
本期利润		41, 672. 70	8, 960, 009. 73			
加权平均基金份额本期利润		0.0685	0.0613			
期末基金资产净值		758, 825. 31	163, 684, 768. 97			
期末基金份额净值		1. 0912	1. 0560			
	基金净值表现					

主要财务指标

单位:人民币元

单位:人民币元

报告期(2019-04-01至2019-06-30)

报告期(2019-06-30)

本期利润			41, 672. 70	8, 960, 009.
加权平均基金份额本期利润			0. 0685	0.06
期末基金资产净值			758, 825. 31	163, 684, 768.
期末基金份额净值			1. 0912	1. 050
		基金净值表现		
本报告期基金份额净值增长率及其	其与同期业绩比较基准收益率的比较			

期木基金份额伊恒			1. 0912			1.05	
			基金净值表现				
本报告期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					
阶段	净值增长率①	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	
	'						

阶段	净值增长率①	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		
注:注:同期业绩比较基准为1年期银行定期存款利率(税后)+2%。								
本报告期基金份额净值增长率及其	其与同期业绩比较基准收益率的比较	ŽΑ						
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	1)-3)	2-4		

过去三个月 0.77 % 5.32 % 6.09 % 1.38 % 0.01 % 1.37 % 本报告期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B 阶段 1-3 2-4 净值增长率① 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 过去三个月 5. 70 % 1.38 % 0.77 % 0.01 % 4.93 % 1.37 %

自基金合同生效以来基金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 自基金合同生效以来基金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A

比图 25.54% 22.99%

英大灵活配置A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对

其他指标

其他指标

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、私募资产管理计划等。



2016-07-30-2017-08-09-2018-08-19-2019-01-16-2015-12-18 2016-03-02-2016-10-13-2017-05-26-2018-01-06 2016-12-27 2016-05-16 2017-03-12 2019-06-15 2017-10-23 2018-03-22 2018-06-05 2019-04-01 ── 英大灵活配置B基金份额累计净值增长率 ── 英大灵活配置B业绩比较基准累计收益率

其他指标

基金经理(或基金经理小组)简介

任本基金的基金经理期限

姓名	职务			证券从业年限	·····································	
<u></u>		任职日期	离任日期	证分 <u>从</u> 业 牛阪	VI VI	
					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	
袁忠伟	本基金基金经理、权益投资部总经理	2015-05-07		10	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	
表心 市	一个至立至立红生、似血仅贝 即心红生	2015-05-07		19	部总经理, 英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基	
					金、英大国企改革主题股票型证券投资基金基金经理。	
			北京大学理学学士,8年以上证券从业经历。2011年8月至2013年8月就职于寰富投资咨询(上			
日光井	→ 甘 人 甘 人 <i>叔</i> 邢	0017 10 00			海)有限公司,任衍生品交易员。2013年10月加入英大基金管理有限公司,历任交易管理部交	
易祺坤	本基金基金经理	2017-12-28	_	8	易员、交易管理部副总经理(主持工作)。现任固定收益部基金经理,英大纯债债券型证券投	
					资基金、英大现金宝货币基金基金经理。	
					中央财经大学金融学博士,3年以上金融从业经验。历任美国友邦保险有限公司北京分公司业	
郑中华	基金经理	2019-03-14	_	3	务主任、兴业银行总行投资银行部研究处宏观及策略研究员,2017年5月加入英大基金管理有	
					限公司权益投资部,现任基金经理。	
			管理人对报告期內	内本基金运作遵规守信情况的说明		
	格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法 基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治				合型发起式证券投资基金招募说明书》的约定,以取信于市场、取信于投资者为宗旨,本着诚实信 ,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。	

公平交易专项说明

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

公司保障投资决策公平的控制方法包括: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。所有投资组合共享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

公司保障交易分配公平的控制方法包括: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。 监察稽核部定期对不同投资组合(尤其是同一位投资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。 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。

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和运作分析

一、报告期内基金的投资策略和运作分析 1、基金投资策略 二季度基金资产配置方面,主要立足于结构制胜的思路。在股票投资的选择上,继续坚持价值投资理念,在综合研判经济周期、政策周期以及市场周期之后,以具有相对基本面优势的消费和科技龙头股作为重点投资对象,并根据市场涨跌节奏,适时调整价值股与成长

股的配置比例,灵活参与权益市场结构性机会。债券投资方面,二季度本基金逐渐调整持仓结构并减少债券配置仓位。 2、二季度运作分析 2019年二季度,上证50指数下跌6.78%,沪深300指数下跌1.21%,英大灵活配置A单位净值上涨6.09%,灵活配置B单位净值上涨5.7%,报告期内产品净值涨幅高于沪深300指数,基金股票投资占比70%-75%左右、投资组合通过上下结合的方式,总体特征为"消费+科技", 这同时也是产品净值涨幅超越沪深300的主要因素。 本基金于分别于2019年4月15日、2019年6月11日进行了分红。英大灵活配置混合A类每10份基金份额配送0.5元,英大灵活配置混合B类每10份基金份额配送0.5元。

二、2019年二季度业绩排名 截至报告期末,灵活配置A累计份额净值为1.2412元,灵活配置B累计份额净值为1.2060元。二季度,灵活配置A和B基金单位净值增长幅度在同类基金中分别排名54/1844和65/1844,二季度灵活配置净值表现在同类基金中处于前3.23%水平。

序号

3

其中:债券

贵金属投资

合计

金融衍生品投资

租赁和商务服务业

股票代码

I 电信服务

J 公用事业

序号

300014

600519

000858

600763

央行票据

金融债券

企业债券

中期票据

同业存单

其他

合计

代码

公允价值变动总额合计(元)

股指期货投资本期收益(元)

股指期货投资本期公允价值变动(元)

本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

本期国债期货投资政策

其他资产构成

序号

存出保证金

应收股利

应收利息

应收申购款

其他应收款

投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期期末基金份额总额

基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额

报告期期末管理人持有的本基金份额

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)

项目

报告期期间买入/申购总份额

报告期期间卖出/赎回总份额

合计

基金管理人固有资金

基金经理等人员

基金管理人股东

其他

基金管理人高级管理人员

(1) 赎回申请延期办理的风险

项目

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。

应收证券清算款

本基金本报告期末无国债期货投资。

其中: 政策性金融债

企业短期融资券

可转债(可交换债)

债券代码

2

3

4

5

6

7

8

9

10

序号

K 房地产

资产支持证券

17.50%

15.31%

13.12%

10.94%

8.75%

6.56%

4.37%

2.19%

公平交易制度的执行情况

项目

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。

报告期内基金的业绩表现

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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。 投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

权益类投资 1 123, 671, 723. 87 其中: 股票 123, 671, 723. 87 固定收益投资 2

金额(元)

164, 855, 664. 80

6, 515, 775. 00

公允价值(元)

公允价值(元)

公允价值变动(元)

公允价值变动(元)

金额(元)

8, 088, 196. 10

7, 650, 600. 00

7, 560, 595. 00

6, 812, 571. 00

占基金总资产的比例(%)

75. 02

75. 02

18. 20

6. 73

0.06

100.00

3.96

占基金资产净值比例(%)

占基金资产净值比例(%)

风险说明

风险指标说明

单位:人民币元

77, 992. 01

7, 791. 78

2, 787. 87

6, 314. 96

单位:份

145, 124, 511. 10

10, 142, 085. 41

155, 009, 975. 70

256, 620. 81

单位:份

0.0000

英大灵活配置B

英大灵活配置B

5, 000, 000. 00

5, 000, 000. 00

3年

3年

3年

3年

适用费率

发起份额承诺持有期限

4. 92

4.65

4.60

4. 14

4. 12

3. 98

3.96

3.65

3.64

3. 60

买入返售金融资产 5 30, 000, 000. 00 其中: 买断式回购的买入返售金融资产 6 银行存款和结算备付金合计 11, 089, 054. 31 其他资产 7 94, 886. 62

截至本报告期末,英大灵活配置A基金份额净值为1.0912元,本报告期基金份额净值增长率为6.09%;英大灵活配置B基金份额净值为1.056元,本报告期基金份额净值增长率为5.7%;同期业绩比较基准收益率为0.77%。

		报告期末按行业分类的股票投资组合	
报告期末的	安行业分类的境内股票投资组合		
序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6, 537, 278. 00	3. 98
В	采矿业	_	_
С	制造业	79, 503, 284. 78	48. 35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	_	_
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	7, 047, 824. 39	4. 29
G	交通运输、仓储和邮政业	10, 235, 640. 00	6. 22
Н	住宿和餐饮业	_	_
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39, 603. 76	0.02
J	金融业	6, 979, 746. 94	4. 24
K	房地产业	_	_

科学研究和技术服务业 N 水利、环境和公共设施管理业 居民服务、修理和其他服务业 教育 卫生和社会工作 6, 812, 571. 00 4. 14 文化、体育和娱乐业 S 综合 合计 75. 21 123, 671, 723. 87 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) A 基础材料 B 消费者非必需品 2 消费者常用品 D 能源 E 金融 F 医疗保健 G 工业 H 信息技术

注: 本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

数量(股)

265, 535

7, 775

64, 100

76, 900

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5	603043	广州酒家	209, 500	6, 773, 135. 0	0
6	300498	温氏股份	182, 300	6, 537, 278. 0	0
7	601888	中国国旅	73, 500	6, 515, 775. 0	0
8	000063	中兴通讯	184, 590	6, 004, 712. 7	0
9	600436	片仔癀	51, 900	5, 978, 880. 0	0
10	600872	中炬高新	138, 213	5, 919, 662. 7	9
		报告期	期末按债券品种分类的债券投资组合		
	建光 日新		八分於法 (二)	L-t	主人次文洛店业局(0/)
序号 	债券品利		公允价值(元) 	白苕	基金资产净值比例(%)
1	国家债券			_	

股票名称

债券名称

亿纬锂能

贵州茅台

通策医疗

五粮液

注: 本基金本报告期末未持有债券投资组合。							
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细							
注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。							
		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				
序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)		
		注: 本基金本持	报告期末未持有贵金属。				
		报告期末按公允价值占基金资产净值日	北例大小排名的前五名权证投资明细				
注: 本基金本报告期末未持有权证。							
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明							
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细							

注: 本基金本报告期末无股指期货投资。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

合约市值(元)

持仓量(买/卖)

注: 本基金本报告期末未持有债券投资组合。

数量(张)

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债券投资明细

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动总额合计(元) 国债期货投资本期收益(元) 国债期货投资本期公允价值变动(元)

名称

名称

本期国债期货投资评价
本基金本报告期末无国债期货投资。
投资组合报告附注
受到调查以及处罚情况
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。
申明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。

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	94, 886.
报告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	· 期的可转换信券
	在: 中至並中IV口別不不可行处 1 校成	
报告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。

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

英大灵活配置混合

持有份额占基金总份额比例

155, 705, 402. 89

11, 181, 138. 52

4, 995, 504. 05

16, 176, 642. 57

10.39

4, 995, 504. 05

发起份额总数

英大灵活配置A

英大灵活配置A

578, 972. 17

407, 356. 27

290, 901. 25

695, 427. 19

交易金额 (元)

6. 42 %

0.00 %

0.00 %

-%

发起份额占基金总份额比例

英大灵活配置混合 项目 报告期期初基金份额总额 报告期期间基金总申购份额 减:报告期期间基金总赎回份额 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)

基金管理人运用	目固有资金投资本基金交易明细			
序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	
1	申购	2019-06-20	4, 995, 504. 0)5

10.39 %

0.00 %

0.00 %

-%

持有份额总数

16, 176, 642. 57

92.36

4, 960. 32

—		'		,			,	
合计		16, 181, 695. 25	10. 39 %	10, 005, 510. 36	6.43 %		3年	
			报告期内单一投资者持有	可基金份额比例达到或超过20%的情况				
机次之米则		报告期内持有基金份额变化情况 报告期末持有基金恰					况	
投资者类别	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	2019. 04. 01–2019. 06. 30		118, 460, 019. 74			118, 460, 019. 74	76. 08
个人	_	_		_			_	
			Ĵ	·····································		·		

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

9, 999, 450. 00

1, 100. 04

4, 960. 32

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。
(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。
(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。
(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。
(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。
影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

基金管理人业务资格批件和营业执照 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告 存放地点 基金管理人和基金托管人住所

中国证监会批准英大灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

《英大灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

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/

查阅方式