

# 英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 31 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 2020 年 8 月 26 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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>6</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 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        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 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.....                 | 14        |
| 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.....       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>16</b> |
| 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 16        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>17</b> |
| 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        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>46</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 46        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 46        |
| 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.....     | 47        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 49        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 50        |
| 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.....    | 50        |
| 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..... | 50        |
| 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..... | 50        |
| 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.....    | 50        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 50        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 51        |
| 7.12 市场中性策略执行情况.....                       | 51        |
| 7.13 投资组合报告附注.....                         | 51        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>53</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 53        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 53        |
| 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.....     | 53        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>54</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>55</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 55        |
| 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.....      | 55        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 55        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 55        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 55        |
| 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.....         | 55        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 55        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 56        |

---

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....          | <b>59</b> |
| 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 ..... | 59        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 59        |
| <b>§12 备查文件目录</b> .....                  | <b>60</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 60        |
| 12.2 存放地点.....                           | 60        |
| 12.3 查阅方式.....                           | 60        |

## § 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              |                |
| 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      | 154,083,153.89 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         |
| 下属分级基金场内简称:     | -                 | -              |
| 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 | 152,070,762.01 份  | 2,012,391.88 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   | 刘康喜             | 石立平                   |
|         | 联系电话 | 010-59112026    | 010-63639180          |
|         | 电子邮箱 | liukx@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  | 马晓燕                          | 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  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ydamc.com">http://www.ydamc.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 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(2020年1月1日 - 2020年6月30日) | 报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 18,723,709.90               | 230,540.47                  |
| 本期利润          | 23,584,861.96               | 255,363.19                  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1551                      | 0.1387                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 13.19%                      | 11.42%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 13.60%                      | 13.48%                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日)            |                             |
| 期末可供分配利润      | 19,049,032.41               | 325,125.83                  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1253                      | 0.1616                      |
| 期末基金资产净值      | 197,041,926.91              | 2,689,959.93                |
| 期末基金份额净值      | 1.2957                      | 1.3367                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020年6月30日)            |                             |
| 基金份额累计净值增长率   | 52.80%                      | 57.24%                      |

#### 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      | 10.95%   | 0.75%       | 3.48%      | 0.41%         | 7.47%  | 0.34% |
| 过去三个月      | 17.65%   | 0.91%       | 6.66%      | 0.49%         | 10.99% | 0.42% |
| 过去六个月      | 13.60%   | 1.47%       | 4.92%      | 0.78%         | 8.68%  | 0.69% |
| 过去一年       | 35.09%   | 1.17%       | 9.71%      | 0.64%         | 25.38% | 0.53% |
| 过去三年       | 48.60%   | 1.20%       | 10.15%     | 0.64%         | 38.45% | 0.56% |
| 自基金合同生效起至今 | 52.80%   | 1.11%       | 5.69%      | 0.61%         | 47.11% | 0.50% |

英大睿盛 C

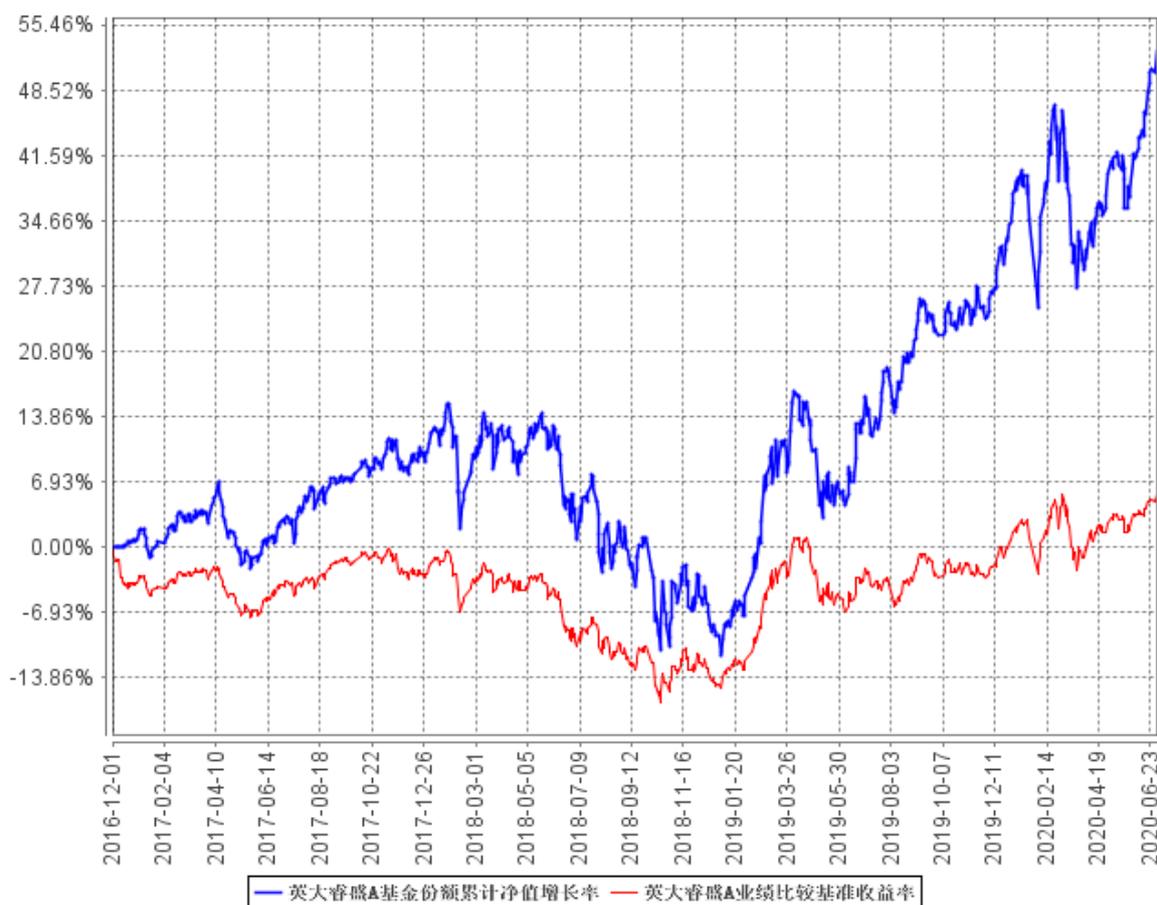
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一个月      | 10.94% | 0.75% | 3.48%  | 0.41% | 7.46%  | 0.34% |
| 过去三个月      | 17.59% | 0.91% | 6.66%  | 0.49% | 10.93% | 0.42% |
| 过去六个月      | 13.48% | 1.48% | 4.92%  | 0.78% | 8.56%  | 0.70% |
| 过去一年       | 36.15% | 1.17% | 9.71%  | 0.64% | 26.44% | 0.53% |
| 过去三年       | 53.07% | 1.20% | 10.15% | 0.64% | 42.92% | 0.56% |
| 自基金合同生效起至今 | 57.24% | 1.11% | 5.69%  | 0.61% | 51.55% | 0.50% |

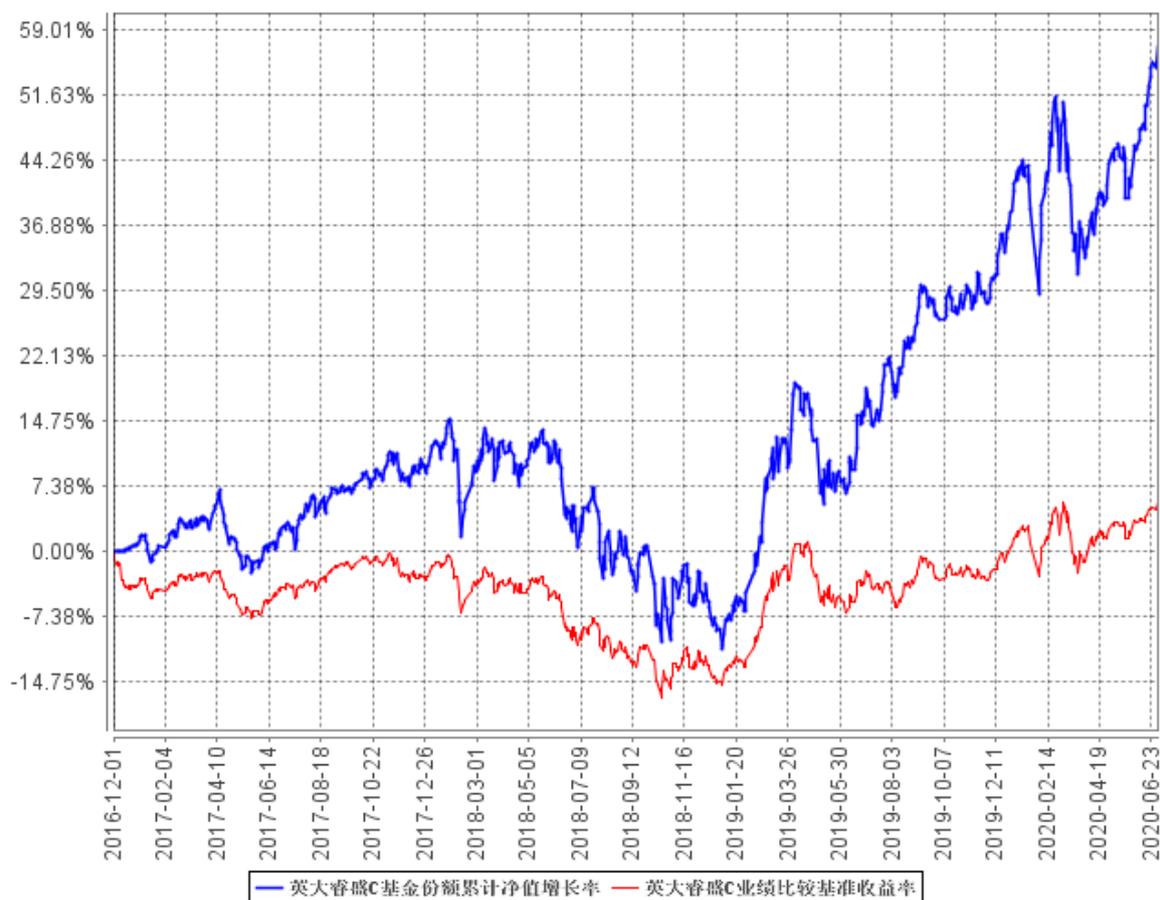
注：同期业绩比较基准为  $50\% \times \text{中证全指指数收益率} + 50\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

### 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



### 3.3 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

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，注册资本为 31,600 万元人民币。现有三家股东，分别是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、航天科工财务有限责任公司，持股比例分别为 67.7%、22.8%和 9.5%。

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。公司员工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“梦想、真诚、专业、稳健”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、专户协同发展、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 2020 年 6 月 30 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、英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金 10 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 |        |   |
| 张媛 | 本基金基金经理 | 2018 年 1 月 23 日 | -    | 6      | 北京工业大学博士，6 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 月加入英大基金管理有限公司权益投资部，现任英大策略优选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、英大睿鑫灵 |

|  |  |  |  |  |                   |
|--|--|--|--|--|-------------------|
|  |  |  |  |  | 活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------------|

注：本基金管理人于 2020 年 5 月 30 日发布公告，张媛女士因休产假自 2020 年 5 月 29 日起暂不能正常履职，休假期间由本公司基金经理郑中华代为履职。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

### 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

##### （一）基金投资策略

2020 年上半年，全球和中国的权益市场体现出大幅波动的特征，一季度受新冠疫情的爆发而出现大幅下跌，二季度受到新冠疫情的有效控制而显著修复。

一季度，对市场形成显著下跌的主要因素包括：首先，疫情逐渐在世界范围内呈指数型增长；其次，部分经济体疫情防控措施缺乏有效性，投资者对经济前景展望极度悲观；再次，全球范围的流动性危机进一步加强了市场下跌的负循环，致使全球市场跌幅显著超越其合理水平。

二季度，对市场形成显著支撑的主要因素包括：首先，全球主要经济体逐渐形成联防联控的

疫情控制机制，有效降低了新冠疫情无序爆发的悲观预期；其次，欧洲主要国家疫情得到了有效控制，有效控制国家的逐渐增多，进一步加强了新冠疫情得以控制的信心；再次，全球主要经济体均采取了大规模的货币和财政刺激政策，降低了大规模企业破产潮出现的概率，并为经济重启注入信心。在多措并举的托底措施下，伴随新冠疫情的逐步稳定、政策资金对市场的强力托底，投资者悲观情绪被逐渐修复，全球市场逐渐从底部走出。

2020 年上半年，英大睿盛的投资操作策略为：基金在持仓方面保持分散投资的原则，根据市场变化，进行一定风格择时。在股票选择方面采用自上而下和自下而上相结合的配置思路。一方面，在自上而下的行业选择上，立足于对宏观经济和市场节奏的判断，看好科技与基建回暖；另一方面，在自下而上的标的选择上，综合考量盈利能力、现金流质量及成长能力，筛选优秀个股，并积极参与一级市场网下配售提升基金业绩。

## （二）上半年运作分析

2020 年上半年，上证指数半年度涨幅-2.15%，上证 50 涨幅-3.95%，沪深 300 半年度涨幅 1.64%，万得全 A 涨幅 6.95%，英大睿盛 A 和 C 的半年度涨幅分别为 13.60%和 13.48%。报告期内产品净值涨幅显著高于上证指数、上证 50 及主要业绩比较基准。

### 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 1.2957 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.60%；截至本报告期末英大睿盛 C 基金份额净值为 1.3367 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.48%；同期业绩比较基准收益率为 4.92%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

#### （一）经济：全球增速逐季改善，疫情控制决定改善幅度

1. 在有效疫苗正式面世之前，预期新冠疫情在“新常态”中与人类并存。一方面，中国和欧洲主要经济体疫情防控相对有效。虽然各国的新增病例，因管控程度的差异而不尽相同，但基本都趋于稳定，为世界经济的重新启动提供了积极信号。另一方面，个别国家疫情数据出现反复，增大了二次疫情爆发的可能性，且会加强世界经济复苏前景的担忧。最后，中性预期下，伴随全球防护设备产能的不断扩张，检测手段有效性的逐渐提升，防控经验的积累，预期世界范围内大规模爆发二次疫情的概率相对较小。

2. 全球经济预期环比逐季改善。假设各国政府在疫情的“新常态”中逐渐合理地重启经济，且新增病例数不出现指数级升级。那么，可以合理预期下半年全球经济将逐渐改善。

3. 中国经济预期率先并持续改善。一方面，中国疫情管控在全球范围内都具有领先和垂范性，

为经济重启提供了强有力的现实保障。在国内疫情得到有效控制的前提下，以内需为代表的投资和消费需求会逐季出现改善。与此同时，前期受疫情冲击的旅游、酒店、餐饮、交运和电影等社会服务类行业也开始逐渐重启，为经济的恢复性增长带来有效支撑；另一方面，假设外围经济如预期般逐级改善，会进一步拉动外需，对出口形成一定支撑。综上，虽然新冠疫情对 2020 年上半年的经济增长带来显著负面冲击，但预期下半年的经济会逐级改善，并逐渐恢复甚至超越去年同期水平。

#### （二）投资策略：市场空间仍存，结构精选制胜

基金操作方面，将综合 A 股市场估值结构和市场主体格局，采取自上而下和自下而上相结合的策略并分散投资。一方面，在自上而下的行业选择上，立足于对宏观经济和市场节奏的判断，看好新科技领域的继续发酵，包括计算机、车联网、电子行业尤其因供给不足而加速涨价周期的半导体企业，值得关注；另一方面，在自下而上的标的选择上，综合考量盈利能力、现金流质量及成长能力，筛选优秀个股。同时以积极审慎态度参与科创板及主板网下配售，努力在 2020 年为投资者带来好的净值表现。

### 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。估值委员会主任由公司总经理担任；成员包括督察长、投资总监、运营分管领导及基金运营部、监察稽核部、风险管理部（筹）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。

### 4.7 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。

### 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（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集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，对本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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集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 托管人对本中期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编制的《英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告》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（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。

## § 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 46,362,162.38                  | 6,083,690.39                     |
| 结算备付金           |            | 992,401.47                     | 1,204,654.30                     |
| 存出保证金           |            | 28,464.44                      | 24,867.66                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 152,605,584.86                 | 154,867,009.82                   |
| 其中：股票投资         |            | 152,605,584.86                 | 149,864,009.82                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | 5,003,000.00                     |
| 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    | -                              | 12,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 25,456.99                      | 1,002,165.48                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 8,451.41                       | 111,297.87                       |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 717.65                         | 1,934.97                         |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 200,023,239.20                 | 175,295,620.49                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 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          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 21.80                          | 192.39                           |
| 应付管理人报酬         |            | 93,592.26                      | 87,172.89                        |
| 应付托管费           |            | 23,398.07                      | 21,793.21                        |
| 应付销售服务费         |            | 419.56                         | 245.95                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 79,913.07                      | 110,251.88                       |
| 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  | 94,007.60      | 180,000.00     |
| 负债合计          |          | 291,352.36     | 399,656.32     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 154,083,153.89 | 153,289,082.32 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 45,648,732.95  | 21,606,881.85  |
| 所有者权益合计       |          | 199,731,886.84 | 174,895,964.17 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 200,023,239.20 | 175,295,620.49 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，英大睿盛 A 基金份额净值 1.2957 元，基金份额总额 152,070,762.01 份；英大睿盛 C 基金份额净值 1.3367 元，基金份额总额 2,012,391.88 份。英大睿盛份额总额合计为 154,083,153.89 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 24,798,782.79                            | 32,672,332.39                                 |
| 1.利息收入                |            | 186,981.21                               | 69,380.41                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 80,769.83                                | 44,514.29                                     |
| 债券利息收入                |            | 51,423.28                                | 85.53   |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 54,788.10                                | 24,780.59                                     |
| 证券出借利息收入              |            | -  | -   |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 19,724,130.12                            | -8,914,742.51                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 18,204,862.94                            | -10,280,617.55                                |
| 基金投资收益                |            | -26,000.00                               | 14,085.21                                     |
| 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   | 1,545,267.18                             | 1,351,789.83                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 4,885,974.78                             | 41,517,419.51                                 |
| 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   | 1,696.68      | 274.98        |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 958,557.64    | 949,558.89    |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 539,939.70    | 440,147.29    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 134,984.98    | 110,036.76    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 2,201.32      | 16.49         |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 178,424.04    | 301,745.28    |
| 5. 利息支出                    |            | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | -             |
| 6. 税金及附加                   |            | -             | 0.43          |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 103,007.60    | 97,612.64     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 23,840,225.15 | 31,722,773.50 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 23,840,225.15 | 31,722,773.50 |

### 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：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2020年1月1日至2020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）                   | 153,289,082.32             | 21,606,881.85 | 174,895,964.17 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                          | 23,840,225.15 | 23,840,225.15  |
| 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） | 794,071.57                 | 201,625.95    | 995,697.52     |
| 其中：1.基金申购款                        | 1,510,635.17               | 317,369.58    | 1,828,004.75   |
| 2.基金赎回款                           | -716,563.60                | -115,743.63   | -832,307.23    |
| 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）                        | 154,083,153.89                  | 45,648,732.95  | 199,731,886.84 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019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）                        | 152,013,762.03                  | -24,346,712.36 | 127,667,049.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 31,722,773.50  | 31,722,773.50  |
| 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）      | 15,369.99                       | -49.32         | 15,320.67      |
| 其中：1.基金申购款                             | 68,895.01                       | 2,158.42       | 71,053.43      |
| 2.基金赎回款                                | -53,525.02                      | -2,207.74      | -55,732.76     |
| 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）                        | 152,029,132.02                  | 7,376,011.82   | 159,405,143.84 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

          马晓燕  岳喜伟  李婷            
 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 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。本基金投资组合资产配置比例：股票资产占基金资产的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管 理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

#### 6.4.2 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。

### 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况及 2020 年 1 月 1 日起至 2020 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 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 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。

#### 6.4.4.3 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。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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，根据企业会计准则的规定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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)”。

#### 6.4.4.9 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。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### **6.4.4.11 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。

#### **6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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《中国证券监督管理委员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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》,在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

(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。

(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，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。

(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。

(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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 46,362,162.38          |
| 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：            | 46,362,162.38          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                |               |
|-------------------|------------------------|----------------|---------------|
|                   | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票                | 125,167,762.96         | 152,605,584.86 | 27,437,821.90 |
| 贵金属投资-金交所<br>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                | 125,167,762.96         | 152,605,584.86 | 27,437,821.90 |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2020 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末（2020 年 6 月 30 日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 7,992.01               |
| 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  | 446.60                 |
| 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 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 应收出借证券利息   | -                      |
| 其他         | 12.80                  |
| 合计         | 8,451.41               |

#### 6.4.7.6 其他资产

本报告期末（2020 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）。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 79,913.07              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 79,913.07              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 94,007.60              |
| 合计          | 94,007.60              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 英大睿盛 A        |                                       |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 152,018,307.24                        | 152,018,307.24 |
| 本期申购          | 64,633.73                             | 64,633.73      |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -12,178.96                            | -12,178.96     |
| - 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           | 152,070,762.01                        | 152,070,762.01 |

金额单位：人民币元

| 英大睿盛 C        |                                       |              |
|---------------|---------------------------------------|--------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |              |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额         |
| 上年度末          | 1,270,775.08                          | 1,270,775.08 |
| 本期申购          | 1,446,001.44                          | 1,446,001.44 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -704,384.64                           | -704,384.64  |
| - 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           | 2,012,391.88                          | 2,012,391.88 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 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           | 322,022.30    | 21,058,818.92 | 21,380,841.22 |
| 本期利润           | 18,723,709.90 | 4,861,152.06  | 23,584,861.96 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,300.21      | 2,161.51      | 5,461.72      |
| 其中：基金申购款       | 3,831.26      | 3,992.27      | 7,823.53      |
| 基金赎回款          | -531.05       | -1,830.76     | -2,361.81     |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 19,049,032.41 | 25,922,132.49 | 44,971,164.90 |

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           | 45,318.13  | 180,722.50 | 226,040.63  |
| 本期利润           | 230,540.47 | 24,822.72  | 255,363.19  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 49,267.23  | 146,897.00 | 196,164.23  |
| 其中：基金申购款       | 85,602.96  | 223,943.09 | 309,546.05  |
| 基金赎回款          | -36,335.73 | -77,046.09 | -113,381.82 |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -           |
| 本期末            | 325,125.83 | 352,442.22 | 677,568.05  |

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。

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 74,494.61            |
| 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 | 5,987.95             |
| 其他        | 287.27               |
| 合计        | 80,769.83            |

**6.4.7.12 股票投资收益**

**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 67,466,366.57              |
| 减：卖出股票成本总额 | 49,261,503.63              |
| 买卖股票差价收入   | 18,204,862.94              |

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -26,000.00                 |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | -26,000.00                 |

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 10,310,000.00              |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 10,026,000.00              |
| 减：应收利息总额                | 310,000.00                 |
| 买卖债券差价收入                | -26,000.00                 |

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

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。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

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。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本报告期及上年度可比区间，本基金无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本报告期，本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |
|---------------|----------------------|
|               | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 1,545,267.18         |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                    |
| 基金投资产生的股利收益   | -                    |
| 合计            | 1,545,267.18         |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 4,885,974.78         |

|                            |              |
|----------------------------|--------------|
| ——股票投资                     | 4,889,474.78 |
| ——债券投资                     | -3,500.00    |
| ——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<br>增值税 | -            |
| 合计                         | 4,885,974.78 |

注：当期发生的公允价值变动损失以“-”号填列。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 1,696.68             |
| 合计      | 1,696.68             |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 178,424.04           |
| 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        | 178,424.04           |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                   |
|-------|----------------------|
|       | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 审计费用  | 29,835.26            |
| 信息披露费 | 59,672.34            |

|         |            |
|---------|------------|
| 证券出借违约金 | -          |
| 乙类帐户维护费 | 13,500.00  |
| 合计      | 103,007.60 |

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 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      |
|--------------|--------------|
| 中国光大银行股份有限公司 | 基金托管人        |
| 英大基金管理有限公司   | 基金管理人、注册登记机构 |

注：①下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

②本报告期本基金关联方未发生变化。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                   | 上年度可比期间              |
|-----------------|----------------------|----------------------|
|                 | 2020年1月1日至2020年6月30日 | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 539,939.70           | 440,147.29           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,201.32             | 14.58                |

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 0.6% 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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2020年1月1日至2020年6月30日 | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 134,984.98           | 110,036.76           |

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。

#### 6.4.10.2.3 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<br>2020年1月1日至2020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     | -                               | 26.75  | 26.75 |
| 合计             | -                               | 26.75  | 26.75 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019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     | -                               | 5.23   | 5.23  |
| 合计             | -                               | 5.23   | 5.23  |

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：C 类基金份额每日应计提的销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.20% ÷ 当年天数

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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。

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

本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

**6.4.10.6 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<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019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 | 46,362,162.38              | 74,494.61 | 10,108,866.51                   | 42,789.92 |

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2020年6月30日的相关余额为人民币1,020,865.91元。（2019年6月30日：人民币99,7604.70元）

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

| 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日      |        |      |      |           |            |
|---------------------------------|--------|------|------|-----------|------------|
| 关联方名称                           | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |            |
|                                 |        |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额        |
| 光大证券股份有限公司                      | 688600 | 皖仪科技 | 网下发行 | 5,468     | 84,754.00  |
| 光大证券股份有限公司                      | 002988 | 豪美新材 | 网下发行 | 1,097     | 12,001.18  |
| 光大证券股份有限公司                      | 300842 | 帝科股份 | 网下发行 | 455       | 7,261.80   |
| 光大证券股份有限公司                      | 688360 | 德马股份 | 网下发行 | 5,574     | 140,018.88 |
| 光大证券股份有限公司                      | 300839 | 博汇股份 | 网下发行 | 502       | 8,162.52   |
| 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |        |      |      |           |            |
| 关联方名称                           | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |            |
|                                 |        |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额        |
| -                               | -      | -    | -    | -         | -          |

**6.4.10.8 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。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期无利润分配事项。

## 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 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

| 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<br>(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 688568               | 中科星图 | 2020年6月30日 | 2020年7月8日 | 新股流通受限 | 16.21 | 16.21  | 7,989        | 129,501.69 | 129,501.69 |    |
| 688277               | 天智航  | 2020年6月24日 | 2020年7月7日 | 新股流通受限 | 12.04 | 12.04  | 8,810        | 106,072.40 | 106,072.40 |    |
| 688528               | 秦川物联 | 2020年6月19日 | 2020年7月1日 | 新股流通受限 | 11.33 | 11.33  | 8,337        | 94,458.21  | 94,458.21  |    |
| 688377               | 迪威尔  | 2020年6月29日 | 2020年7月8日 | 新股流通受限 | 16.42 | 16.42  | 5,555        | 91,213.10  | 91,213.10  |    |
| 688027               | 国盾量子 | 2020年6月30日 | 2020年7月9日 | 新股流通受限 | 36.18 | 36.18  | 2,452        | 88,713.36  | 88,713.36  |    |
| 688600               | 皖仪科技 | 2020年6月23日 | 2020年7月3日 | 新股流通受限 | 15.50 | 15.50  | 5,468        | 84,754.00  | 84,754.00  |    |
| 300847               | 中船汉光 | 2020年6月29日 | 2020年7月9日 | 新股流通受限 | 6.94  | 6.94   | 1,421        | 9,861.74   | 9,861.74   |    |
| 300845               | 捷安高科 | 2020年6月24日 | 2020年7月3日 | 新股流通受限 | 17.63 | 17.63  | 470          | 8,286.10   | 8,286.10   |    |
| 300843               | 胜蓝股份 | 2020年6月23日 | 2020年7月2日 | 新股流通受限 | 10.01 | 10.01  | 751          | 7,517.51   | 7,517.51   |    |
| 300840               | 酷特智能 | 2020年6月30日 | 2020年7月8日 | 新股流通受限 | 5.94  | 5.94   | 1,185        | 7,038.90   | 7,038.90   |    |
| 300846               | 首都在线 | 2020年6月22日 | 2020年7月1日 | 新股流通受限 | 3.37  | 3.37   | 1,131        | 3,811.47   | 3,811.47   |    |
| 688177               | 百奥   | 2020年      | 2020      | 新股锁    | 32.76 | 57.02  | 6,818        | 223,357.68 | 388,762.36 |    |

|        |      |            |             |        |       |       |       |            |            |  |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|--|
|        | 泰    | 2月13日      | 年8月21日      | 定受限    |       |       |       |            |            |  |
| 688228 | 开普云  | 2020年3月19日 | 2020年9月27日  | 新股锁定受限 | 59.26 | 73.20 | 1,739 | 103,053.14 | 127,294.80 |  |
| 688555 | 泽达易盛 | 2020年6月12日 | 2020年12月23日 | 新股锁定受限 | 19.49 | 56.80 | 3,004 | 58,547.96  | 170,627.20 |  |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

#### 6.4.13 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。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风

险。

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、风险管理部（筹）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。

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。

#### **6.4.13.2 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。报告期本基金无债券投资。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金于本年末及上年末均未持有短期信用债券投资。

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

注：本基金于本年末及上年末均未持有短期资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金于本年末及上年末均未持有短期同业存单。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金于本年末及上年末均未持有长期信用债券投资。

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

注：本基金于本年末及上年末均未持有长期资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金于本年末及上年末均未持有长期同业存单。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持有的证券均在银行间本币市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

本基金本报告期末持有资产全部为股票和现金，未持有金融负债，不存在到期期限分析问题。

#### **6.4.13.3.2 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 10%，占净值比较高的股票大多属于流通市值较高的股票，在市场成交量不发生重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、首次公开发行时申购的附有锁定期的老股转让部分外，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基金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。

#### **6.4.13.4 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的。

##### **6.4.13.4.1 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。报告期本基金无债券投资。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年6月30<br>日   | 1个月以内         | 1-3个月 | 3个月-1<br>年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|-------------------------|---------------|-------|------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                      |               |       |            |      |      |                |                |
| 银行存款                    | 46,362,162.38 | -     | -          | -    | -    | -              | 46,362,162.38  |
| 结算备付金                   | 992,401.47    | -     | -          | -    | -    | -              | 992,401.47     |
| 存出保证金                   | 28,464.44     | -     | -          | -    | -    | -              | 28,464.44      |
| 交易性金融资产                 | -             | -     | -          | -    | -    | 152,605,584.86 | 152,605,584.86 |
| 应收证券清算款                 | -             | -     | -          | -    | -    | 25,456.99      | 25,456.99      |
| 应收利息                    | -             | -     | -          | -    | -    | 8,451.41       | 8,451.41       |
| 应收申购款                   | -             | -     | -          | -    | -    | 717.65         | 717.65         |
| 其他资产                    | -             | -     | -          | -    | -    | -              | -              |
| 资产总计                    | 47,383,028.29 | -     | -          | -    | -    | 152,640,210.91 | 200,023,239.20 |
| 负债                      |               |       |            |      |      |                |                |
| 应付赎回款                   | -             | -     | -          | -    | -    | 21.80          | 21.80          |
| 应付管理人报酬                 | -             | -     | -          | -    | -    | 93,592.26      | 93,592.26      |
| 应付托管费                   | -             | -     | -          | -    | -    | 23,398.07      | 23,398.07      |
| 应付销售服务费                 | -             | -     | -          | -    | -    | 419.56         | 419.56         |
| 应付交易费用                  | -             | -     | -          | -    | -    | 79,913.07      | 79,913.07      |
| 其他负债                    | -             | -     | -          | -    | -    | 94,007.60      | 94,007.60      |
| 负债总计                    | -             | -     | -          | -    | -    | 291,352.36     | 291,352.36     |
| 利率敏感度缺口                 | 47,383,028.29 | -     | -          | -    | -    | 152,348,858.55 | 199,731,886.84 |
| 上年度末<br>2019年12月31<br>日 | 1个月以内         | 1-3个月 | 3个月-1<br>年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                      |               |       |            |      |      |                |                |
| 银行存款                    | 6,083,690.39  | -     | -          | -    | -    | -              | 6,083,690.39   |
| 结算备付金                   | 1,204,654.30  | -     | -          | -    | -    | -              | 1,204,654.30   |
| 存出保证金                   | 24,867.66     | -     | -          | -    | -    | -              | 24,867.66      |
| 交易性金融资产                 | 5,003,000.00  | -     | -          | -    | -    | 149,864,009.82 | 154,867,009.82 |
| 买入返售金融资产                | 12,000,000.00 | -     | -          | -    | -    | -              | 12,000,000.00  |
| 应收证券清算款                 | -             | -     | -          | -    | -    | 1,002,165.48   | 1,002,165.48   |

|         |               |   |   |   |                 |                |
|---------|---------------|---|---|---|-----------------|----------------|
| 应收利息    | -             | - | - | - | 111,297.87      | 111,297.87     |
| 应收申购款   | -             | - | - | - | 1,934.97        | 1,934.97       |
| 其他资产    | -             | - | - | - | -               | -              |
| 资产总计    | 24,316,212.35 | - | - | - | 150,979,408.14  | 175,295,620.49 |
| 负债      | -             | - | - | - | -               | -              |
| 应付赎回款   | -             | - | - | - | 192.39          | 192.39         |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | - | 87,172.89       | 87,172.89      |
| 应付托管费   | -             | - | - | - | 21,793.21       | 21,793.21      |
| 应付销售服务费 | -             | - | - | - | 245.95          | 245.95         |
| 应付交易费用  | -             | - | - | - | 110,251.88      | 110,251.88     |
| 其他负债    | -             | - | - | - | 180,000.00      | 180,000.00     |
| 负债总计    | -             | - | - | - | 399,656.32      | 399,656.32     |
| 利率敏感度缺口 | 24,316,212.35 | - | - | - | -150,579,751.82 | 174,895,964.17 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                   |
|----|--------------------|---------------------------------|-------------------|
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                    | 本期末（2020年6月30日）                 | 上年度末（2019年12月31日） |
|    | 利率下降25个基点          | -                               | 582.98            |
|    | 利率上升25个基点          | -                               | -582.98           |

注：本报告期末，本基金不持有债券，现金资产以活期利率计息。因此，市场利率变动对本基金资产净值无影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020年6月30日 |                          | 上年度末<br>2019年12月31日 |                       |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
|               | 公允价值              | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 152,605,584.86    | 76.41                    | 149,864,009.82      | 85.69                 |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                 | -                        | -                   | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | -                 | -                        | 5,003,000.00        | 2.86                  |
| 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            | 152,605,584.86    | 76.41                    | 154,867,009.82      | 88.55                 |

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|-------------------------|-----------------------------|-------------------|
| 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（2020年6月30日）             | 上年度末（2019年12月31日） |
|    | 沪深 300 指数上升 5%          | 8,676,383.43                | 7,156,151.06      |
|    | 沪深 300 指数下降 5%          | -8,676,383.43               | -7,156,151.06     |

## 6.4.13.4.4 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<br>(单位：人民币元) | 本期末（2020年6月30日） | 上年度末（2019年12月31日） |
|    | -                 | -               | -                 |
|    | 合计                | -               | -                 |

## 6.4.14 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。

## § 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              | 152,605,584.86 | 76.29         |
|    | 其中：股票             | 152,605,584.86 | 76.29         |
| 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          | -              | -             |
|    | 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      | 47,354,563.85  | 23.67         |
| 8  | 其他各项资产            | 63,090.49      | 0.03          |
| 9  | 合计                | 200,023,239.20 | 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         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 6,233,890.36  | 3.12          |
| C  | 制造业              | 59,106,033.54 | 29.59         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,119,062.32  | 1.56          |
| E  | 建筑业              | 2,578,662.00  | 1.29          |
| F  | 批发和零售业           | -             | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 29,109,826.04 | 14.57         |
| J  | 金融业              | 34,446,311.60 | 17.25         |
| K  | 房地产业             | 6,075,160.00  | 3.04          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 5,745,319.00  | 2.88          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 2,579,080.00  | 1.29          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| 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     | 3,612,240.00   | 1.81  |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 152,605,584.86 | 76.41 |

### 7.2.2 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（2020年6月30日），本基金未持有沪港通股票。

### 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  | 600030 | 中信证券 | 300,800 | 7,252,288.00 | 3.63         |
| 2  | 300496 | 中科创达 | 89,400  | 6,946,380.00 | 3.48         |
| 3  | 600038 | 中直股份 | 144,000 | 5,914,080.00 | 2.96         |
| 4  | 601888 | 中国中免 | 37,300  | 5,745,319.00 | 2.88         |
| 5  | 600276 | 恒瑞医药 | 58,080  | 5,360,784.00 | 2.68         |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 73,724  | 5,263,893.60 | 2.64         |
| 7  | 002601 | 龙麟佰利 | 276,200 | 5,109,700.00 | 2.56         |
| 8  | 300059 | 东方财富 | 246,480 | 4,978,896.00 | 2.49         |
| 9  | 300383 | 光环新网 | 183,400 | 4,781,238.00 | 2.39         |
| 10 | 300003 | 乐普医疗 | 124,300 | 4,539,436.00 | 2.27         |
| 11 | 300408 | 三环集团 | 161,500 | 4,473,550.00 | 2.24         |
| 12 | 600570 | 恒生电子 | 40,768  | 4,390,713.60 | 2.20         |
| 13 | 600380 | 健康元  | 255,880 | 4,155,491.20 | 2.08         |
| 14 | 002025 | 航天电器 | 112,600 | 4,118,908.00 | 2.06         |
| 15 | 300146 | 汤臣倍健 | 197,600 | 3,890,744.00 | 1.95         |
| 16 | 600309 | 万华化学 | 77,823  | 3,890,371.77 | 1.95         |
| 17 | 600547 | 山东黄金 | 100,000 | 3,662,000.00 | 1.83         |
| 18 | 300470 | 中密控股 | 116,100 | 3,657,150.00 | 1.83         |
| 19 | 300036 | 超图软件 | 143,900 | 3,623,402.00 | 1.81         |
| 20 | 300144 | 宋城演艺 | 208,800 | 3,612,240.00 | 1.81         |
| 21 | 002153 | 石基信息 | 85,306  | 3,329,493.18 | 1.67         |
| 22 | 600048 | 保利地产 | 217,200 | 3,210,216.00 | 1.61         |
| 23 | 600760 | 中航沈飞 | 96,000  | 3,150,720.00 | 1.58         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 24 | 601211 | 国泰君安 | 182,400 | 3,148,224.00 | 1.58 |
| 25 | 000651 | 格力电器 | 55,200  | 3,122,664.00 | 1.56 |
| 26 | 002368 | 太极股份 | 71,200  | 3,110,728.00 | 1.56 |
| 27 | 600642 | 申能股份 | 525,600 | 3,106,296.00 | 1.56 |
| 28 | 601398 | 工商银行 | 598,700 | 2,981,526.00 | 1.49 |
| 29 | 600837 | 海通证券 | 236,000 | 2,968,880.00 | 1.49 |
| 30 | 002138 | 顺络电子 | 117,500 | 2,931,625.00 | 1.47 |
| 31 | 000002 | 万科 A | 109,600 | 2,864,944.00 | 1.43 |
| 32 | 600036 | 招商银行 | 82,000  | 2,765,040.00 | 1.38 |
| 33 | 601166 | 兴业银行 | 167,800 | 2,647,884.00 | 1.33 |
| 34 | 603859 | 能科股份 | 75,500  | 2,579,080.00 | 1.29 |
| 35 | 601668 | 中国建筑 | 540,600 | 2,578,662.00 | 1.29 |
| 36 | 601088 | 中国神华 | 179,101 | 2,571,890.36 | 1.29 |
| 37 | 300075 | 数字政通 | 187,800 | 2,488,350.00 | 1.25 |
| 38 | 000001 | 平安银行 | 190,600 | 2,439,680.00 | 1.22 |
| 39 | 600741 | 华域汽车 | 93,148  | 1,936,546.92 | 0.97 |
| 40 | 002396 | 星网锐捷 | 51,600  | 1,823,028.00 | 0.91 |
| 41 | 688177 | 百奥泰  | 6,818   | 388,762.36   | 0.19 |
| 42 | 688555 | 泽达易盛 | 3,004   | 170,627.20   | 0.09 |
| 43 | 688568 | 中科星图 | 7,989   | 129,501.69   | 0.06 |
| 44 | 688228 | 开普云  | 1,739   | 127,294.80   | 0.06 |
| 45 | 688277 | 天智航  | 8,810   | 106,072.40   | 0.05 |
| 46 | 688528 | 秦川物联 | 8,337   | 94,458.21    | 0.05 |
| 47 | 688377 | 迪威尔  | 5,555   | 91,213.10    | 0.05 |
| 48 | 688027 | 国盾量子 | 2,452   | 88,713.36    | 0.04 |
| 49 | 688600 | 皖仪科技 | 5,468   | 84,754.00    | 0.04 |
| 50 | 603087 | 甘李药业 | 624     | 62,587.20    | 0.03 |
| 51 | 300837 | 浙矿股份 | 737     | 33,187.11    | 0.02 |
| 52 | 300824 | 北鼎股份 | 1,954   | 26,789.34    | 0.01 |
| 53 | 300842 | 帝科股份 | 455     | 18,527.60    | 0.01 |
| 54 | 600956 | 新天绿能 | 2,533   | 12,766.32    | 0.01 |
| 55 | 300839 | 博汇股份 | 502     | 11,751.82    | 0.01 |
| 56 | 300847 | 中船汉光 | 1,421   | 9,861.74     | 0.00 |
| 57 | 300845 | 捷安高科 | 470     | 8,286.10     | 0.00 |
| 58 | 300843 | 胜蓝股份 | 751     | 7,517.51     | 0.00 |
| 59 | 300840 | 酷特智能 | 1,185   | 7,038.90     | 0.00 |
| 60 | 300846 | 首都在线 | 1,131   | 3,811.47     | 0.00 |

## 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  | 600048 | 保利地产 | 3,278,639.00 | 1.87           |
| 2  | 300075 | 数字政通 | 3,011,406.00 | 1.72           |
| 3  | 600038 | 中直股份 | 2,990,973.00 | 1.71           |
| 4  | 300059 | 东方财富 | 2,985,554.00 | 1.71           |
| 5  | 601888 | 中国中免 | 2,964,877.00 | 1.70           |
| 6  | 603859 | 能科股份 | 2,962,179.00 | 1.69           |
| 7  | 600380 | 健康元  | 2,953,295.60 | 1.69           |
| 8  | 002661 | 克明面业 | 2,935,740.56 | 1.68           |
| 9  | 002368 | 太极股份 | 2,918,865.00 | 1.67           |
| 10 | 688116 | 天奈科技 | 2,031,549.78 | 1.16           |
| 11 | 688016 | 心脉医疗 | 2,022,384.46 | 1.16           |
| 12 | 002396 | 星网锐捷 | 2,017,925.00 | 1.15           |
| 13 | 688029 | 南微医学 | 2,012,696.00 | 1.15           |
| 14 | 601928 | 凤凰传媒 | 2,011,425.00 | 1.15           |
| 15 | 688388 | 嘉元科技 | 2,002,291.00 | 1.14           |
| 16 | 002230 | 科大讯飞 | 1,980,140.00 | 1.13           |
| 17 | 601077 | 渝农商行 | 728,654.00   | 0.42           |
| 18 | 688169 | 石头科技 | 291,725.12   | 0.17           |
| 19 | 688177 | 百奥泰  | 223,357.68   | 0.13           |
| 20 | 688588 | 凌志软件 | 198,512.73   | 0.11           |

### 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  | 688116 | 天奈科技 | 8,898,855.88 | 5.09           |
| 2  | 002624 | 完美世界 | 5,841,851.00 | 3.34           |
| 3  | 603993 | 洛阳钼业 | 5,056,887.00 | 2.89           |
| 4  | 600754 | 锦江酒店 | 4,232,999.00 | 2.42           |
| 5  | 600048 | 保利地产 | 3,416,668.08 | 1.95           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 6  | 002661 | 克明面业 | 3,336,624.96 | 1.91 |
| 7  | 601601 | 中国太保 | 2,972,173.00 | 1.70 |
| 8  | 601939 | 建设银行 | 2,733,927.00 | 1.56 |
| 9  | 688016 | 心脉医疗 | 2,675,963.54 | 1.53 |
| 10 | 600115 | 东方航空 | 2,356,918.00 | 1.35 |
| 11 | 688029 | 南微医学 | 2,351,297.00 | 1.34 |
| 12 | 002230 | 科大讯飞 | 2,259,048.00 | 1.29 |
| 13 | 688388 | 嘉元科技 | 2,239,741.02 | 1.28 |
| 14 | 601928 | 凤凰传媒 | 1,938,346.00 | 1.11 |
| 15 | 601077 | 渝农商行 | 1,417,295.08 | 0.81 |
| 16 | 601916 | 浙商银行 | 1,165,012.20 | 0.67 |
| 17 | 688588 | 凌志软件 | 820,657.50   | 0.47 |
| 18 | 688019 | 安集科技 | 739,099.22   | 0.42 |
| 19 | 688233 | 神工股份 | 562,854.00   | 0.32 |
| 20 | 688169 | 石头科技 | 527,320.00   | 0.30 |

#### 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 | 47,113,603.89 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 67,466,366.57 |

#### 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投资。

#### 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

报告期末（2020年6月30日），本基金未持有权证。

#### 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

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

-

## 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

无

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无

## 7.12 市场中性策略执行情况

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

龙麟佰利联集团股份有限公司因某生产线未经竣工环境保护验收即投入生产被河南省生态环境厅出具《行政处罚决定书》（豫环罚决字【2019】5 号）；因未依法报批建设项目环境影响评价文件被河南省生态环境厅出具《行政处罚决定书》（豫环罚决字【2019】7 号）；在已要求停止建设，在项目未取得建设项目安全审查书的情况下，项目仍有开工行为，被焦作市应急管理局出具《行政处罚决定书》（焦安监罚【2019】72 号）。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 7.13.3 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   | 28,464.44 |
| 2  | 应收证券清算款 | 25,456.99 |

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 3 | 应收股利  | -         |
| 4 | 应收利息  | 8,451.41  |
| 5 | 应收申购款 | 717.65    |
| 6 | 其他应收款 | -         |
| 7 | 待摊费用  | -         |
| 8 | 其他    | -         |
| 9 | 合计    | 63,090.49 |

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 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。

#### 7.13.6 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 | 149      | 1,020,609.14 | 152,000,000.00 | 99.95% | 70,762.01    | 0.05%   |
| 英大睿盛 C | 175      | 11,499.38    | -              | -      | 2,012,391.88 | 100.00% |
| 合计     | 304      | 506,852.48   | 152,000,000.00 | 98.65% | 2,083,153.89 | 1.35%   |

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 | 80.13     | 0.0001%  |
|                  | 英大睿盛 C | 89.85     | 0.0045%  |
|                  | 合计     | 169.98    | 0.0001%  |

### 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 | 0~10              |
|                                | 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                 |
|                                | 合计     | 0                 |

## § 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                   | 152,018,307.24 | 1,270,775.08 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 64,633.73      | 1,446,001.44 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 12,178.96      | 704,384.64   |
| 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                   | 152,070,762.01 | 2,012,391.88 |

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 2020 年 1 月 9 日发布公告，自 2020 年 1 月 7 日起，朱志先生离任英大基金管理有限公司总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2020 年 1 月 9 日发布公告，自 2020 年 1 月 7 日起，范育晖先生新任英大基金管理有限公司总经理职务。

本报告期内，基金管理人于 2020 年 2 月 8 日发布公告，自 2020 年 2 月 6 日起，岳喜伟先生任英大基金管理有限公司总经理助理兼财务总监，自 2020 年 2 月 6 日开始履行高级管理人员职务。

本报告期内，基金管理人于 2020 年 5 月 30 日发布公告，基金经理张媛女士因休产假，自 2020 年 5 月 29 日起将暂不能正常履职。张媛女士休假期间，英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金的经理职责由本公司基金经理郑中华先生代为履行。共同管理上述基金的其他经理正常履职。

### 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

无

### 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      | 93,396,832.91 | 85.47%       | 68,301.43 | 85.47%     | -  |
| 安信证券 | 2      | 15,878,128.06 | 14.53%       | 11,611.64 | 14.53%     | -  |

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 | 5,026,500.00 | 100.00%      | 435,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 安信证券 | -            | -            | -              | -              | -    | -            |

### 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  | 英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告               | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020年1月9日  |
| 2  | 英大基金管理有限公司关于增加喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会         | 2020年1月17日 |

|    |   |   |                 |
|----|---|---|-----------------|
|    |   | 基金电子披露网站                                    |                 |
| 3  | 英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告              | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2020 年 1 月 20 日 |
| 4  | 英大基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告的提示性公告           | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报                       | 2020 年 1 月 20 日 |
| 5  | 英大基金管理有限公司高级管理人员变更公告                          | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 2 月 8 日  |
| 6  | 关于英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购(含转换转入及定期定额投资)业务的公告  | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2020 年 3 月 9 日  |
| 7  | 关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告                    | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 27 日 |
| 8  | 英大基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告               | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报                       | 2020 年 3 月 31 日 |
| 9  | 英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2019 年度报告                   | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2020 年 3 月 31 日 |
| 10 | 英大基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 4 月 9 日  |
| 11 | 中国光大银行“投资与托管业务部”名称变更为“资产托管部”                  | 中国证监会指定的媒介                                  | 2020 年 4 月 15 日 |
| 12 | 英大基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告的提示性公告           | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报                       | 2020 年 4 月 17 日 |
| 13 | 英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告              | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2020 年 4 月 17 日 |
| 14 | 英大基金管理有限公司关于旗下英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金关联交易的          | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网                   | 2020 年 5 月 12 日 |

|    | 公告   | 站   |                 |
|----|--|---|-----------------|
| 15 | 英大基金管理有限公司关于增加旗下部分产品参与万联证券基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 5 月 14 日 |
| 16 | 英大基金管理有限公司关于旗下英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金关联交易的公告         | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2020 年 5 月 26 日 |
| 17 | 英大基金管理有限公司关于增加中信证券华南股份有限公司为旗下基金销售机构的公告         | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 5 月 28 日 |
| 18 | 英大基金管理有限公司关于因系统升级维护暂停手机 APP 及微信交易系统服务的公告       | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 5 月 29 日 |
| 19 | 英大基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责的公告                      | 上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站      | 2020 年 5 月 30 日 |
| 20 | 英大基金管理有限公司关于旗下英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金关联交易的公告         | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2020 年 6 月 13 日 |
| 21 | 英大基金管理有限公司关于旗下英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金关联交易的公告         | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2020 年 6 月 20 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              | 2020.1.1 - 2020.6.30    | 152,000,000.00 | -    | -    | 152,000,000.00 | 98.65% |
| 个人    | -              | -                       | -              | -    | -    | -              | -      |

#### 产品特有风险

- (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。
- (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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|   |
|---|
| - |
|---|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准英大睿盛灵活配置混合型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

北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201

### 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

2020 年 8 月 31 日