

英大睿鑫靈活配置混合型證券投資基金

2018年上半年GDP同比增长6.8%，预计下半年经济增速稳中趋降，全年经济增速可能在6.6%—6.8%之间。6月份CPI同比增长1.9%，PPI同比4.7%，预计下半年物价总体稳定；这样，2018年名义GDP增速可能接近14%。预计全年A股上市公司业绩增速将高于名义GDP增速，但低于2017年18%的业绩增速水平。下半年“去杠杆”政策主导下金融环境处于收缩周期，货币政策可能继续“宽货币、紧信用”特征，对市场估值水平仍有一定压制。国际方面，需要持续关注中美贸易摩擦进程对A股产生的影响。

宏观经济与金融环境决定股票市场在下半年难有大幅上涨的机会和下跌空间，整体以“震荡波动”为主。板块方面，消费、周期、金融、科技等行业仍将大概率呈现轮动特征。本基金在下半年继续以价值投资理念配置稳健增值资产。二级市场方面，以低估值、高分红、有成长前景的公司股票作为重点投资对象。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。通过一级市场和二级市场共同贡献收益有效提升基金净值。

4.6 管理人对于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约定的估值方法、估值程序进行估值，基金估值无争议后以电子签名形式发送给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和相关法规的规定予以公布。月末、年中和中年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规性、净值计算、利润分配等情况的说明
报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核，未发现本托管人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金报告期内未进行利润分配。

5.3 基金管理人对于本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
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数据、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中“金融工具风险及影响”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。

6.1 资产负债状况
会计主体：英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2018年6月30日

6.2 利润表
会计主体：英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金
报告期间：2018年1月1日至2018年6月30日

6.3 所有者权益变动表
会计主体：英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金
报告期间：2018年1月1日至2018年6月30日

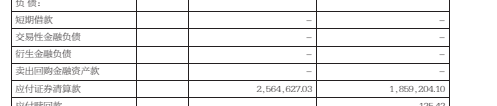
6.4 基金净值表现
注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平低于所列数字。2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。4、本期可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的最低数。

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
英大睿鑫A

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	超额收益	①-②	②-③
过去一个月	-6.30%	1.23%	-4.23%	0.76%	-0.17%
过去三个月	-7.99%	1.07%	-1.44%	0.00%	-2.21%
过去六个月	-10.32%	1.02%	-1.61%	0.00%	-4.32%
过去一年	-11.31%	0.79%	-4.79%	0.46%	4.67%
自基金成立起至今	14.14%	0.72%	-10.53%	0.46%	0.23%

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	超额收益	①-②	②-③
过去一个月	-6.11%	1.23%	-4.39%	0.76%	-0.17%
过去三个月	-7.77%	1.07%	-1.64%	0.00%	-2.25%
过去六个月	-10.25%	1.02%	-1.61%	0.00%	-4.24%
过去一年	-10.92%	0.79%	-4.96%	0.46%	4.07%
自基金成立起至今	13.03%	0.71%	-10.53%	0.46%	0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率的比较
注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。



注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

注：本基金合同于2018年6月17日生效，截至本报告期末本基金尚处于建仓期，业绩比较基准仅供参考，不作为业绩考核的依据。

复)核准,由英大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金合同》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20041846.97元,认购期间本基金共收到有效认购款项20163.33元,累计认购资金20041846.97元,经会计师事务所验资认为(2016)粤中会验字第390017号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金合同》于2016年11月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200053866.09份,其中英大睿鑫A基金份额为14039.74份,英大睿鑫C基金份额为200039816.35份,认购资金利息折合1210.04份基金份额(其中英大睿鑫A基金份额为4.05份,英大睿鑫C基金份额为1206.33份)。本基金的基本管理人为英大基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金合同》及《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,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,而是从本基金各类型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类基金份额分别计提基金净值,由于基金费用的不同,本基金A类、C类基金份额分别计算基金份额净值并单独公布。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金A类基金份额和C类基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金合同》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(包括科创板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、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、银行存款、货币存款等法律法规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%-96%;权证投资占基金资产净值的比例不超过3%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其投资比例不超过基金资产的5%;每个交易日日终在扣除股指期货保证金后,本基金保持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%。

6.4.2 会计报表的编制基础
本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金合同》和中国证监会、中国证监会业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他相关规定的说明
本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况及2018年1月1日起至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。此外,本财务报表在重大方面符合中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》中有关财务报表及其附注的披露要求。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
6.4.4.1 会计政策变更的说明
本基金本报告期无会计政策变更。
6.4.4.2 会计估计变更的说明
本基金本报告期无会计估计变更。
6.4.4.3 差错更正的说明
本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.5 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税。
根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,金融同业开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。
根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。
根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。
根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称“资管产品运营业务”),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择其他或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。
根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的收盘价为买入价。按照1个交易日内(含)买入和卖出同一交易日内于停牌期间的股票,为停牌最后(一个交易日的收盘)价;债券估值、基金份额净值、非货物期货结算价(买入价)计算销售额。
2. 企业所得税
根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税[2008]1号)的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
3. 个人所得税
根据财政部、国家税务总局《关于证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[1998]95号)的规定,对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利和利息收入时代扣代缴20%的个人所得税,基金向个人投资者分配股息、红利、利息时,不再扣缴个人所得税。
4. 印花税法
根据财政部、国家税务总局决定从2008年9月19日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据(指按1%的税率对买卖双方单边征收的证券(股票)交易印花税,暂调整为单边征收,即以买卖单边征收印花税。A股股权转让书据的出让按1%的税率征收印花税(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

6.4.6 关联方关系
6.4.6.1 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
中国证监会核准(证监许可[2018]872号),本公司原股东英大国际控股有限公司将所持本公司49%股权转让给中国网信国际控股有限公司,相关工商变更登记手续于2018年6月14日办结。
6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各方
关联方名称
英大基金管理有限公司
基金管理人、基金运营机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司
基金托管人

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.7.1.1 股票交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。
6.4.7.1.2 债券交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。
6.4.7.1.3 债券回购交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。
6.4.7.1.4 权证交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。
6.4.7.1.5 支付关联方款项
本基金本报告期及上年度可比期间均无支付关联方款项。
6.4.7.2 关联方报酬
6.4.7.2.1 基金管理费
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
基金管理费	25,066,307.22	27,177,799.22
基金托管费	4,177,050.37	4,529,632.04
合计	29,243,357.59	31,707,431.26

注:①支付基金管理费的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。
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×0.75%/当年天数。
6.4.7.2.2 销售服务费
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
销售服务费	176,143.81	113,862.89
合计	176,143.81	113,862.89

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。
6.4.7.2.3 销售服务费
单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
销售服务费	176,143.81	113,862.89
合计	176,143.81	113,862.89

注:①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

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	本期	上年度可比期间
买入股票的成本总额	1,106,340.00	915,000.00
卖出股票的收入总额	1,106,340.00	915,000.00

注:①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

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	本期	上年度可比期间
买入股票的成本总额	1,106,340.00	915,000.00
卖出股票的收入总额	1,106,340.00	915,000.00

注:①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

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	本期	上年度可比期间
买入股票的成本总额	1,106,340.00	915,000.00
卖出股票的收入总额	1,106,340.00	915,000.00

注:①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

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	本期	上年度可比期间
买入股票的成本总额	1,106,340.00	915,000.00
卖出股票的收入总额	1,106,340.00	915,000.00

注:①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

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	本期	上年度可比期间
买入股票的成本总额	1,106,340.00	915,000.00
卖出股票的收入总额	1,106,340.00	915,000.00

注:①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

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	本期	上年度可比期间
买入股票的成本总额	1,106,340.00	915,000.00
卖出股票的收入总额	1,106,340.00	915,000.00

注:①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

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	本期	上年度可比期间
买入股票的成本总额	1,106,340.00	915,000.00
卖出股票的收入总额	1,106,340.00	915,000.00

注:①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

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	本期	上年度可比期间
买入股票的成本总额	1,106,340.00	915,000.00
卖出股票的收入总额	1,106,340.00	915,000.00

注:①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

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	本期	上年度可比期间
买入股票的成本总额	1,106,340.00	915,000.00
卖出股票的收入总额	1,106,340.00	915,000.00

注:①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

2018年半年度报告摘要

资产净值×0.2%/当年天数,销售服务费每日计提,按月支付。C类基金份额的销售服务费主要用于本基金的持续销售以及基金份额持有人的服务。
②A类基金份额不收取销售服务费。
6.4.7.1 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本报告期及上年度可比期间,本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.7.4.1 报告期内本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。
6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本基金本报告期未与其他关联方持有本基金。
6.4.7.5 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	本报告期	上年度可比期间
平安银行股份有限公司	10,320,343.11	97,803,022.02

注:本基金的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司,按银行同业利率计息。
6.4.7.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
本报告期及上年度可比期间,本基金未在承销期间内参与认购关联方承销的证券。
6.4.7.7 其他关联交易事项的说明
本基金本报告期及上年度可比期间,本基金无其他关联交易事项。
6.4.8 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.8.1 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

股票代码	证券简称	数量(股)	账面价值(元)	占总市值比例(%)	备注
000639	三安光电	500	5,304	0.0560	
600770	富春精工	13,039	1,705	23.1038	
601010	同仁堂	4,833	4,410	16.4703	
601018	华信新材	124,348	54,861	52.8044	
601099	中信重工	17,756	20,800	11,1000	
300753	欧陆通	22,307	12,014	202.3622	

6.4.8.2 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	证券简称	数量(股)	期末市值(元)	备注
000516	开元股份	17,008	59,600	1,106,340.00

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.8.3.1 报告期内债券正回购截至本报告期末2018年6月30日止,本基金未持有银行间市场债券正回购。
6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2018年6月30日止,本基金未持有交易所市场债券正回购。
6.4.9 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 期末资产组合情况
金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	142,471,520.07	84.96
2	基金投资	142,471,520.07	84.96
3	固定收益投资	-	-
4	股指期货投资	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产	-	-
8	其他	24,909,479.93	14.99
9	合计	167,380,990.00	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

代码	行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,920,792.00	2.96
C	制造业	8,298,794.56	5.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,643,303.96	2.19
E	建筑业	3,447,184.00	2.07
F	批发和零售业	4,893,541.00	2.95
G	信息技术业	8,064,581.00	4.86
H	金融业	32,419,416.00	19.63
I	房地产业	6,412,184.00	3.90
J	医药和卫生服务业	-	-
K	其他服务业	-	-