英大策略优选混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月19日

§1 重要提示

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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大策略优选混合
场内简称	-
交易代码	001607
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月2日
报告期末基金份额总额	88,290,738.01份
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.股指期货投资策略;5.权证投资策略;6.资产支持证券投资策略。
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	广发银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	英大策略优选混合A	英大策略优选混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001607	001608
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	88,030,444.87份	250,293.14份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	英大策略优选混合A	英大策略优选混合C
1. 本期已实现收益	2,069,747.52	6,430.29
2. 本期利润	1,174,515.42	4,439.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0133	0.0148
4. 期末基金资产净值	111,069,642.06	303,630.16
5. 期末基金份额净值	1.2617	1.2131

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

英大策略优选混合A

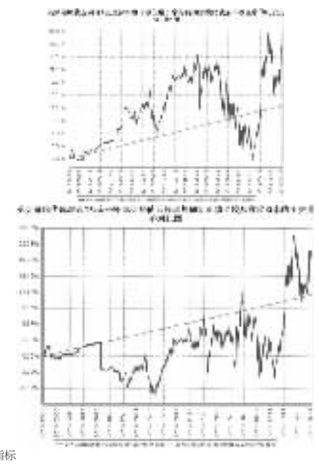
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.07%	1.29%	0.78%	0.01%	0.29%	1.28%

英大策略优选混合C

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	1.01%	1.29%	0.78%	0.01%	0.23%	1.28%

注:同期业绩比较基准为1年期银行定期存款利率(税后)+2%。

3.2.2 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



3.3 其他指标
注:无

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张媛	基金经理	2019年3月11日	-	5	北京工业大学博士,5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,现任英大睿盛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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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《英大策略优选混合型证券投资基金基金合同》、《英大策略优选混合型证券投资基金招募说明书》的约定,以取信于市场、取信于投资者为宗旨,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等国家法律法规和监管部门的规定,公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》,适用于公司所管理的全部公募基金、私募资产管理计划等。

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会。

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,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,且未发现其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

进入二季度以来,国内经济企稳复苏的势头有所减弱,基本面拐点尚不明朗。加之中美贸易谈判波澜,A股在一季度的快速上涨后出现震荡调整。经济数据方面,5月工业企业利润总额同比为-2.3%,企业盈利拐点仍未可见;固定资产投资完成额累计5月同比为增速5.6%,增速继续下降;消费和出口同比数据稍有上升。利率在二季度略有波动,市场流动性在包商银行事件后一度出现紧张情况,但随着多国央行近期开启降息周期,包括美联储6月议息会议上明显转鸽派的态度,预期国内货币政策的宽松空间有一定加大。二季度涨幅较大的行业主要集中在消费、金融、休闲服务行业,随着中美贸易战的缓和,市场风险偏好略有抬升,高端制造、科技新兴行业受益。本基金将继续以大样本、分散化策略构建投资组合,重点布局信息科技、高端制造等行业,同时积极参与一级市场网下配售提升基金业绩。本季度内中证500指数下跌10.76%,沪深300指数下跌1.21%,本基金A份额单位净值上涨1.07%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末英大策略优选混合A基金份额净值为1.2617元,本报告期基金份额净值增长率为1.07%;截至本报告期末英大策略优选混合C基金份额净值为1.2131元,本报告期基金份额净值增长率为1.01%;同期业绩比较基准收益率为0.78%。

4.6 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的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	96,614,629.36	86.54
	其中:股票	96,614,629.36	86.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,764.20	0.02
	其中:债券	17,764.20	0.02
	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	7,000,000.00	6.27
	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	7,977,610.87	7.15
8	其他资产	31,413.94	0.03
9	合计	111,641,418.37	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,439,168.00	3.99
C	制造业	30,225,641.12	27.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,177,326.00	3.75
E	建筑业	2,082,650.00	1.87
F	批发和零售业	2,082,256.54	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	2,071,608.00	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,717,896.76	10.52
J	金融业	34,906,833.94	31.34
K	房地产业	1,995,664.00	1.79
L	租赁和商务服务业	2,916,585.00	2.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	96,614,629.36	86.75

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	63,200	5,600,152.00	5.03
2	601166	兴业银行	302,400	5,530,896.00	4.97
3	600276	恒瑞医药	83,700	5,524,200.00	4.96
4	600036	招商银行	144,500	5,199,110.00	4.67
5	601398	工商银行	714,000	4,206,460.00	3.78
6	600519	贵州茅台	3,400	3,345,600.00	3.00
7	601939	建设银行	426,800	3,175,392.00	2.85
8	601888	中国国旅	32,900	2,916,585.00	2.62
9	002916	深南电路	25,860	2,635,651.20	2.37
10	601899	紫金矿业	628,000	2,367,560.00	2.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	17,764.20	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,764.20	0.02

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110056	亨通转债	180	17,764.20	0.02

5.6 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。

5.7 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贵金属。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

本期内本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定,也均在基金的备选股票池之内。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,768.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,585.43
5	应收申购款	60.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,413.94

5.11.4 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债券。

5.11.5 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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	英大策略优选混合A	英大策略优选混合C
报告期期初基金份额总额	88,027,936.36	429,892.36
报告期期间基金总申购份额	7,302.24	61,047.38
减:报告期期间基金总赎回份额	4,793.73	240,646.60
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	88,030,444.87	250,293.14

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2019.04.01-2019.06.30	88,000,000.00	-	-		88,000,000.00	99.68%
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准英大策略优选混合型证券投资基金设立的文件

《英大策略优选混合型证券投资基金基金合同》

《英大策略优选混合型证券投资基金招募说明书》

《英大策略优选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

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所

9.3 查阅方式

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

公司网站:http://www.ydamc.com/

英大基金管理有限公司
2019年7月19日

英大纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月19日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大纯债债券
场内简称	-
交易代码	650001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月24日
报告期末基金份额总额	1,719,128,217.99份
投资目标	本基金投资于固定收益类资产,在有效控制投资组合风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益,追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金依据宏观经济运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场收益特征、分析判断市场利率水平变动趋势,并预测下一阶段的利率水平,结合各类别资产的收益性、风险性和流动性特征,进行大类资产配置。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,该类基金长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,但高于货币市场基金,属于中低风险和收益水平的投资品种。
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	英大纯债债券A	英大纯债债券C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	650001	650002
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	1,654,771,043.72份	64,357,174.27份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	英大纯债债券A	英大纯债债券C
1. 本期已实现收益	8,798,463.92	618,462.20
2. 本期利润	2,659,055.91	-507,595.70
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0026	-0.0064
4. 期末基金资产净值	1,862,515,118.49	71,312,176.06
5. 期末基金份额净值	1.1255	1.1081

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

英大纯债债券A

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	-0.05%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.19%	0.04%

英大纯债债券C

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	-0.14%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.10%	0.04%

注:同期业绩比较基准为中债综合指数。

3.2.2 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

3.3 其他指标
注:无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易祺坤	本基金基金经理	2017年12月28日	-	8	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月就职于管理投资咨询(上海)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,英大现金宝货币基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《英大领先回报混合型发起式证券投资基金基金合同》、《英大领先回报混合型发起式证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于投资者为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等国家法律法规和监管部门的规定,公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》,适用于公司所管理的全部公募基金、私募资产管理计划等。

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会。

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,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,且未发现其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度,央行继续维持稳健的货币政策,通过定向降准和公开市场操作等方式对冲流动性缺口,维护货币市场流动性"合理充裕"。经济数据方面,在一季度经济数据短暂企稳以后,二季度基本面回归下行通道,叠加中美贸易冲突出现反复,债市收益率出现小幅下行。

受四月PMI数据亮眼、三月经济数据超预期表现导致经济企稳预期升温影响,债券市场长端在4四月上半月出现大幅调整,收益率大幅上行。随后资金面转向宽松,中美贸易冲突出现反复,叠加四、五月经济数据走弱,包商银行被接管使得市场担忧信用收缩,经济基本面重回下行通道,债市收益率震荡下行。二季度债市长端收益率呈现"倒V型"走势。

本基金二季度保持高评级、低杠杆和适度久期运作,调整了债券持仓结构,增加了金融债占比,降低了信用债占比,在信用风险频发、流动性风险加剧的环境下,严控产品信用风险和流动性风险,保持稳健的风格。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,英大纯债A类基金累计份额净值为1.1255元,报告期基金份额净值增长率为-0.05%;英大纯债C类基金累计份额净值为1.1081元,报告期基金份额净值增长率为-0.14%;同期业绩比较基准增长率为-0.24%。

4.6 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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,881,951,000.00	97.18
	其中:债券	1,881,951,000.00	97.18
	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	24,872,469.44	1.28
8	其他资产	29,711,534.53	1.53
9	合计	1,936,535,003.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

5.3 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	176,767,000.00	9.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,634,921,000.00	84.54
	其中:政策性金融债	1,158,249,000.00	59.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,279,000.00	2.60
6	中期票据	19,984,000.00	1.03
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,881,951,000.00	97.32

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190205	19国开05	2,000,000	195,900,000.00	10.13
2	190203	19国开03	1,900,000	188,784,000.00	9.76
3	190210	19国开10	1,500,000	150,480,000.00	7.78
4	180017	18附息国债17	1,000,000	102,140,000.00	5.28
5	190404	19农发04	1,000,000	99,950,000.00	5.17

5.6 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。

5.7 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贵金属。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未参与国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未参与国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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

5.10.2

本基金本报期末无股票持仓。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,061.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,590,353.52
5	应收申购款	119,102.50
6	其他应收款	16.75
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,711,534.53

5.10.4 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债券。

5.10.5 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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	英大纯债债券A	英大纯债债券C
报告期期初基金份额总额	862,438,235.61	127,180,338.52
报告期期间基金总申购份额	815,045,485.66	10,459,169.97
减:报告期期间基金总赎回份额	22,712,677.55	73,282,334.22
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,654,771,043.72	64,357,174.27

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2019.04.01-2019.06.30	88,000,000.00	-	-		88,000,000.00	99.68%
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准英大纯债债券型证券投资基金设立的文件

《英大纯债债券型证券投资基金基金合同》

《英大纯债债券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

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所

9.3 查阅方式

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

公司网站:http://www.ydamc.com/

英大基金管理有限公司
2019年7月19日

英大国企改革主题股票型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:英大基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月19日

§1 重要提示

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。

基金托管人广发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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大国企改革股票
场内简称	-
交易代码	001678
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月22日
报告期末基金份额总额	9,984,110.51份
投资目标	深入