

2019-06-30
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：2019-07-19

目录
重要提示
基金管理人承诺
基金投资组合
基金业绩
基金净值表现
基金费用
基金资产净值
基金管理人
基金托管人
备查文件目录

重要提示
基金管理人承诺
基金投资组合
基金业绩
基金净值表现
基金费用
基金资产净值
基金管理人
基金托管人
备查文件目录

重要提示

基金管理人承诺
基金管理人承诺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。
基金托管人承诺
基金托管人承诺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。
基金业绩
基金业绩的过往业绩并不预示其未来表现，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。
基金净值表现
基金净值表现的过往业绩并不预示其未来表现，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。
基金费用
基金费用的过往业绩并不预示其未来表现，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。
基金资产净值
基金资产净值的过往业绩并不预示其未来表现，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。
基金管理人
基金管理人的过往业绩并不预示其未来表现，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。
基金托管人
基金托管人的过往业绩并不预示其未来表现，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。
备查文件目录
备查文件目录的过往业绩并不预示其未来表现，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。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Rows include: 基金名称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 报告期 (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan). Rows include: 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Period Profit), etc.

基金净值表现

本报告期内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

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 业绩比较基准收益率 (Benchmark Return), etc.

注: 同期业绩比较基准为80%×中证国企改革指数收益率+20%×中证全指指数收益率。

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

英大国企改革主题股票型证券投资基金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



其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

基金管理人(或基金经理)简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks).

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《英大国企改革主题股票型证券投资基金基金合同》、《英大国企改革主题股票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公司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。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

为规范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》、《证券投资基金投资交易管理业务管理办法》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、私募基金管理计划等。

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，也未发现其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

1、基金投资策略
2019年度，A股市场风险与机遇并存。一方面，短期风险主要体现在全球贸易保护主义和地缘政治风险因素仍存，中国年度GDP同比增速仍有下行压力，上市公司整体盈利能力拐点未至，投资者风险偏好仍受压制等因素；另一方面，中长期利多因素逐渐显现，宏观政策已开始逆周期调节，财政政策有望更加积极，货币降准空间开启后，实体经济流动性有望继续改善，民营及中小企业融资成本和违约风险有所修复，中长期积极因素正在逐渐积累。5月16日以后，基金处于建仓期，基金以持有现金为主；5月20日以后，基金处于正常运作期，基金投资组合采用“指数增强型投资”，即将国企改革主题的行政权重和300指数的行业权重进行对比分析，并配置调整组合的行政权重，从选股逻辑中精选符合行政权重构建投资组合，基金投资组合收益率较大幅度跑赢沪深300指数和国企改革指数，阶段业绩排名在同类20%左右。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.1736元；本报告期基金份额净值增长率为8.29%，业绩比较基准收益率为-2.16%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2019年4月3日至2019年6月30日，本基金资产净值出现低于5000万元的情形，已触发连续60个工作日低于5000万元。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十九条，公司已召开基金份额持有人大会，并提出解决方案及措施，在后续运作中将严格按照基金合同约定，努力提升本基金的资产规模，提高合规程度。同时，公司将集中自身优势资源，加强宣传推广力度，积极开展持续营销，有针对性地开展销售机构拓展渠道和客户营销，尽快提升本基金的资产规模。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets).

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按行业分类的港股股票投资组合

Table with columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousand), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 资产代码 (Asset Code), 资产名称 (Asset Name), 数量 (份) (Quantity in Units), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 权证代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 数量 (份) (Quantity in Units), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注: 本基金本报告期末未持有股指期货投资。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position in Buy/Sell), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

本基金投资股指期货的投资政策

注: 本基金本报告期末未持有股指期货投资。

报告期末本基金投资的国债期货持仓交易情况说明

注: 本基金本报告期末未持有国债期货投资。

本期国债期货投资政策

注: 本基金本报告期末未持有国债期货投资。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position in Buy/Sell), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Statement).

本期国债期货投资评价

注: 本基金本报告期末未持有国债期货投资。

投资组合报告附注

经查询上海证券交易、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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票

注: 本基金本报告期末未持有股票。

其他资产构成

Table with columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

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可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末未持有流通受限股票。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 数量 (份) (Quantity in Shares), 单位: 份 (Unit: Shares).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金份额 (Fund Shares), 单位: 份 (Unit: Shares).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额 (份) (Transaction Amount in Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额余额 (份) (Holding Shares), 持有份额占基金份额总额比例 (%) (Percentage of Total Shares), 发起份额总额 (份) (Total Issued Shares), 发起份额占基金份额总额比例 (%) (Percentage of Total Shares), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period).

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

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Initial Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Holding Shares), 份额占比 (Shareholding Ratio).

影响投资者决策的其他重要信息

注: 无。

备查文件目录

中国证监会核准英大国企改革主题股票型证券投资基金设立的文件
《英大国企改革主题股票型证券投资基金基金合同》
《英大国企改革主题股票型证券投资基金招募说明书》
《英大国企改革主题股票型证券投资基金托管协议》
基金管理人业务资格和营业执照
报告期内基金管理人信息披露的各项公告

存放地点

基金管理人及基金托管人住所

查阅方式

投资者可到基金管理人住所及网站或基金托管人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印件或复印件。
公司网站: http://www.ydmc.com/