英大恒先利保险分型发起式证券投资基金2019年第2季度报告

2019-07-20

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

报告合同日期：2019-07-20

目录及摘要 目录及摘要
§1 重要提示
§2 基金产品概况
§3 主要财务指标和基金净值表现
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 报告期内基金投资组合情况
§7 报告期内股票投资组合的重大变动
§8 报告期内基金利润分配情况
§9 报告期内发行人的重大事件
§10 备查文件目录

§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07月15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01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

项目	数据
基金简称	英大恒先利保险分
场内简称	-
基金主代码	000328
交易代码	000328
运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010-02-05
报告期末基金份额总额	47,486,288.39 份
投资目标	本基金主要采用定量规模策略与概念分析相结合的策略，在规避较强风险为基础分散投资风险的前提下，通过基金资产大规模建设债，以期为投资者提供最大收益。
投资策略	本基金以以上海证券交易所上市的上证180指数成分股股票为投资对象，并对股票投资比例进行动态调整，当本基金为股票型基金，则一定股票投资比例不低于80%，以风险管理为前提，通过上述策略优化组合的风险收益比，最终获得较为稳定的收益。本基金为保证投资组合的流动性，将以国债、短期融资券、回购等工具作为投资对象。
业绩比较基准	100%×沪深300指数+100%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于较高风险，较高预期收益的基金产品。
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

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-01-01 至 2019-03-31）
本期已实现收益	178,323.35
本期利润	944,021.49
加权平均基金份额本期利润	-0.0197
期末基金资产净值	48,124,992.48
期末基金份额净值	0.3000

注：1)、已列出报告期内实现的有关人民币或美元基金的净利润，以上费用后实际收益为基金净值变动的主要因素。

注本期已实现收益指基金本期利润减去本期公允价值变动损益后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

本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

单位：%

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	-1.40 %	1.37 %	-0.06 %	0.77 %	-1.34 %	0.60 %

注：2)、间隔日期比较基为0年1个月0天0份额累计净值增长率。

自基金合同生效以来基金累计份额增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

英大恒先利保险分基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

§4 管理人报告

§5 托管人报告

§6 报告期内基金投资组合情况

§7 报告期内股票投资组合的重大变动

§8 报告期内基金利润分配情况

§9 报告期内发行人的重大事件

§10 备查文件目录

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-01-02至2019-06-30）
其他指标	报告期（2019-06-30）

注：无。

基金管理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
高宏伟	本基金基金经理，权益投资部总经理	2015-07-08	-	19	博士学位，具有证券从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司资产管理业务部投资经理，国泰君安证券资产管理有限公司投资总监，国泰君安证券资产管理有限公司权益投资部总经理，现任英大基金管理有限公司权益投资部总经理。具有证券从业资格。本报告期内为本基金基金经理。本报告期内共管理2只公募基金。

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《英大恒先利保险分型发起式证券投资基金基金合同》、《英大恒先利保险分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，以诚信了了信原则，恪守了信原则，为了了信原则，本基金管理人在投资决策、基金管理人内部管理、投资决策和风险控制方面，为基金份额持有人利益谋利益。

公平交易专项说明

公平交易制度执行情况

为确保公平对待所有投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规及监管部门的规定，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，未来若产管理计划等。

公平交易制度主要内容：公平对待公司旗下所有投资组合，对投资决策委员会、投资决策委员会、投资决策委员会、