

英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金 2023 年第 2 季度报告

2023 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 20 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 19 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 2023 年 4 月 1 日起 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 英大中证 ESG120 策略指数 |
| 基金主代码 | 012854 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 3 月 15 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 53,923,685.01 份 |
| 投资目标 | 本基金跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现对标的指数的有效跟踪。 |
| 投资策略 | 本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的预期日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，预期年跟踪误差控制在 4% 以内。主要策略有：股票投资策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；银行存款；同业存单投资策略；股指期货投资策略；流通受限证券投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中证 ESG120 策略指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平 |

| | | |
|-----------------|---|--------------------|
| | 高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 英大基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 英大中证 ESG120 策略指数 A | 英大中证 ESG120 策略指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012854 | 012855 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 50,139,016.81 份 | 3,784,668.20 份 |

§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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|--------------------|
| | 英大中证 ESG120 策略指数 A | 英大中证 ESG120 策略指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | -67,810.91 | 9,399.56 |
| 2. 本期利润 | -1,929,439.12 | -11,999.47 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0385 | -0.0292 |
| 4. 期末基金资产净值 | 46,449,738.63 | 3,646,221.40 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9264 | 0.9634 |

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 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

英大中证 ESG120 策略指数 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 | -3.99% | 0.79% | -4.00% | 0.80% | 0.01% | -0.01% |
| 过去六个月 | -0.66% | 0.80% | 0.96% | 0.82% | -1.62% | -0.02% |
| 过去一年 | -12.19% | 0.91% | -11.60% | 0.95% | -0.59% | -0.04% |
| 自基金合同 | -7.36% | 0.97% | -7.65% | 1.06% | 0.29% | -0.09% |

| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

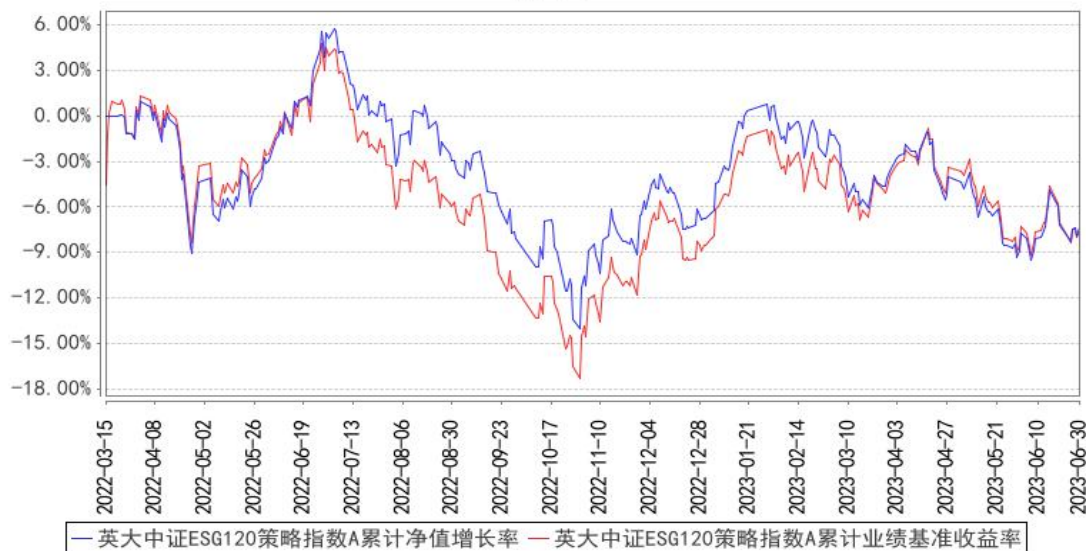
英大中证 ESG120 策略指数 C

| 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 | -4.01% | 0.78% | -4.00% | 0.80% | -0.01% | -0.02% |
| 过去六个月 | -0.62% | 0.80% | 0.96% | 0.82% | -1.58% | -0.02% |
| 过去一年 | -12.19% | 0.92% | -11.60% | 0.95% | -0.59% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.66% | 1.00% | -7.65% | 1.06% | 3.99% | -0.06% |

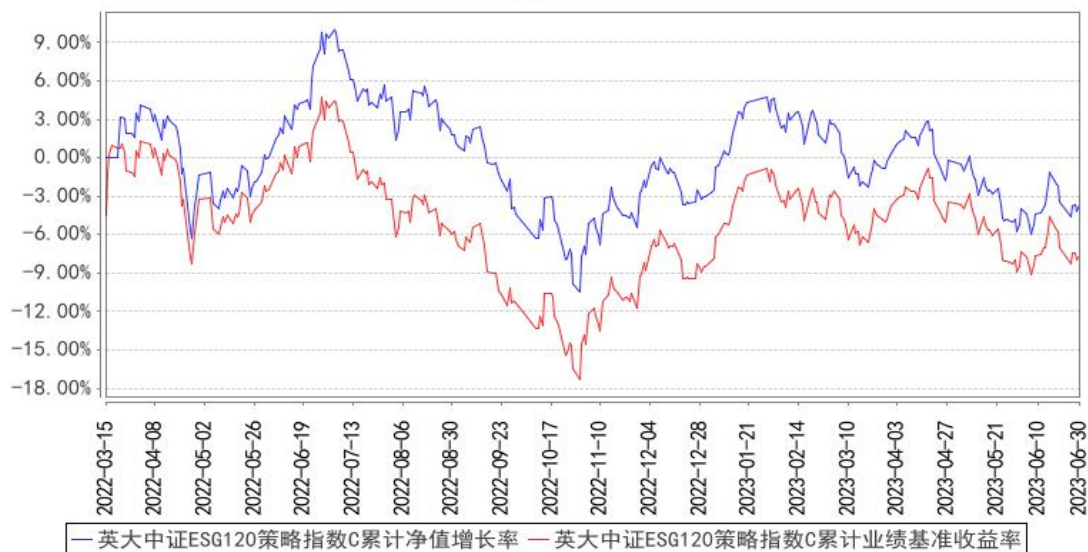
注：同期业绩比较基准为中证 ESG120 策略指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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

英大中证 ESG120 策略指数 A 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



英大中证 ESG120 策略指数 C 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



注：1. 本基金合同生效日为 2022 年 3 月 15 日。

2. 本基金建仓期为本基金合同生效之日起六个月内，截止报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

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 | 本基金的基金经理 | 2022 年 3 月 15 日 | - | 9 年 | 北京工业大学博士。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、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、英大碳中和混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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

无。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金基金合同》、《英大中证 ESG120 策略指数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，以技术措施保障公平交易的实现。

风险管理部定期对不同投资组合（尤其是同一位投资经理管理的不同投资组合）在连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内等）的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

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

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不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

（一）基金投资策略

2023 年上半年，我国经济经历了快速反弹推升预期阶段和实际恢复数据疲软引发悲观预期升温两个阶段，伴随着预期与现实的对撞，A 股呈现“倒 V”字型宽幅震荡。

第一个阶段从去年 11 月到今年 2 月底，在此阶段市场快速兑现了经济的复苏预期。年初人员流动的恢复带来偏社交属性的消费板块快速反弹；同时包括地产、出口的累积需求一次性释放，也带来相应数据的同比高增长，市场对经济整体恢复的预期上行。在此阶段资产价格快速上涨，其中沪深 300 指数上涨约 16%，大宗商品价格上行，而 10 年期国债收益率也上行约 30 个基点。进入 3 月份，各项经济指标表现不及预期，市场信心受到一定冲击，A 股整体震荡下跌。一方面，房地产销售数据边际放缓，工业企业利润同比负增速，制造业投资不及预期。另一方面，三年疫情带来的居民资产负债表受损，在此时反应出来的是居民的超额储蓄，消费在短暂的复苏回弹后步调开始减弱；CPI、PPI 数据处于低位，引发市场对于经济通缩的担忧。

临近季度末，市场将对经济复苏情况的认知逐渐变得理性客观。同时，从各行业观察，企业端去库存显著，结构性向上的迹象显现，而宏观数据的触底有利于市场重拾对经济修复的理性定价。另一方面，下半年政策空间充足，内外部环境配合之下，财政、货币乃至产业政策虽不必以大力推动经济增速为目标，但有助于稳定明年的增速预期。

对下半年的经济基本面，我们仍认为内部因素重于外部。从国内整体情况来看，经济全面重启后的内生动力以及库存周期见底企稳将是推动企业盈利改善的最关键因素。同时，从政策角度，近期国常会指出，针对经济形势的变化，必须采取“更加有力的措施，增强发展动能，优化经济结构，推动经济持续回升向好”；下半年政策性开发性金融工具落地仍有较大概率；汽车、家电等促消费稳增长政策的推出带来积极因素。从外部环境来看，美联储预期仍将有一到两次加息，但金融条件的紧张态势已经边际缓和。其偏低的失业率、强劲的消费数据等给经济衰退带来缓冲，假设外部经济下半年出现软着陆，对我国的出口将带来较大助力。国内库存周期触底与海外紧缩政策的退出，有助于制造业企业的盈利恢复。随着下半年经济的边际好转、就业的改善，可选消

费具备继续好转的基础。

二季度，本基金保持对标的指数收益率的紧密跟踪，将跟踪误差控制在较低水平，较好地实现了基金的投资目标。在投资策略方面，作为投资于中证 ESG120 策略指数的被动型投资产品，本基金基本采取完全复制指数的投资策略，严格控制每日基金净值与业绩基准波动的偏差，使基金回报紧密跟踪目标指数的收益，降低跟踪偏离度。

（二）二季度运作分析

2023 年二季度，市场主要指数均出现震荡下跌，其中上证指数区间下跌 2.16%，沪深 300 下跌 5.97%，中证 500 下跌 5.38%，创业板指下跌 7.69%，万得全 A 下跌 3.20%，中证 ESG120 指数下跌 4.22%，英大中证 ESG120A 单位净值下跌 3.99%，英大中证 ESG120C 单位净值下跌 4.01%。

未来基金管理将继续以被动跟踪和风险控制相结合的投资策略，以获取沪深 300 指数中 ESG 评分以及估值、股息、质量、市场因子综合得分较高组合的长期收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的前提下，构建紧密跟踪标的指数的投资组合进行投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末英大中证 ESG120 策略指数 A 基金份额净值为 0.9264 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.99%；截至本报告期末英大中证 ESG120 策略指数 C 基金份额净值为 0.9634 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.01%；业绩比较基准收益率为-4.00%。

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的情形。

本报告期内，本基金自 2023 年 3 月 31 日至 2023 年 6 月 26 日，出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

截至本报告期末，本基金份额持有人数量不低于二百人，本基金资产净值不低于五千万。

§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 | 43,117,683.04 | 85.87 |
| | 其中：股票 | 43,117,683.04 | 85.87 |
| 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 | 7,090,507.28 | 14.12 |
| 8 | 其他资产 | 5,067.31 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 50,213,257.63 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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 | 354,060.00 | 0.71 |
| B | 采矿业 | 2,147,266.00 | 4.29 |
| C | 制造业 | 24,402,545.80 | 48.71 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,328,572.00 | 2.65 |
| E | 建筑业 | 1,180,617.00 | 2.36 |
| F | 批发和零售业 | 112,762.00 | 0.23 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,274,036.00 | 2.54 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,931,558.64 | 3.86 |
| J | 金融业 | 8,384,267.00 | 16.74 |
| K | 房地产业 | 672,672.00 | 1.34 |
| L | 租赁和商务服务业 | 254,219.00 | 0.51 |
| 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 | 348,942.00 | 0.70 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 42,391,517.44 | 84.62 |

5.2.2 报告期末积极投资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 | - | - |
| C | 制造业 | 65,179.60 | 0.13 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| 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 | | |
| J | 金融业 | | |
| K | 房地产业 | | |
| L | 租赁和商务服务业 | | |
| M | 科学研究和技术服务业 | 660,986.00 | 1.32 |
| 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 | 726,165.60 | 1.45 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资组合。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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 | 600519 | 贵州茅台 | 1,700 | 2,874,700.00 | 5.74 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 9,400 | 2,150,626.00 | 4.29 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 47,900 | 1,569,204.00 | 3.13 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 24,300 | 1,127,520.00 | 2.25 |
| 5 | 601899 | 紫金矿业 | 95,200 | 1,082,424.00 | 2.16 |
| 6 | 002415 | 海康威视 | 29,600 | 980,056.00 | 1.96 |
| 7 | 000333 | 美的集团 | 16,200 | 954,504.00 | 1.91 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 44,400 | 878,232.00 | 1.75 |
| 9 | 600900 | 长江电力 | 38,800 | 855,928.00 | 1.71 |
| 10 | 002594 | 比亚迪 | 3,200 | 826,464.00 | 1.65 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 300887 | 谱尼测试 | 16,700 | 660,986.00 | 1.32 |
| 2 | 300661 | 圣邦股份 | 340 | 27,924.20 | 0.06 |
| 3 | 600197 | 伊力特 | 700 | 19,019.00 | 0.04 |
| 4 | 300628 | 亿联网络 | 520 | 18,236.40 | 0.04 |

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

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

本基金报告期内未参与股指期货投资，报告期末无股指期货持仓。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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，除以下情形外，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。

2023 年 6 月 30 日，中国银行间市场交易商协会公告，平安养老保险股份有限公司作为相关非法人机构投资账户的管理人，于 2021 年 1 月初安排开展了不同账户之间的多笔债券交易以调节债券持仓，交易价格缺乏公允性，不反映正当业务目的或合理经济目的。平安养老未能公平对待管理的各个账户，损害了相关委托人的正当权益，相关行为违反了银行间债券市场相关自律管理规则。根据相关规定，对平安养老予以警告；责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改；对相关账户的投资经理时旻轶予以诫勉谈话。

5.11.2 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库

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 | 5,047.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 20.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,067.31 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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 | 英大中证 ESG120 策略指数 A | 英大中证 ESG120 策略指数 C |
|---------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 50,129,126.12 | 213,915.98 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 27,950.54 | 3,658,604.64 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 18,059.85 | 87,852.42 |
| 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 | 50,139,016.81 | 3,784,668.20 |

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。

§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

单位：份

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 30,094,164.80 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 30,094,164.80 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 55.81 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 | 1 | 20230401 - | 19,999,000.00 | 0.00 | 0.00 | 19,999,000.00 | 37.09 |

| | | | | | | | |
|--|---|------------------------|---------------|------|------|---------------|-------|
| 构 | | 20230630 | | | | | |
| | 2 | 20230401 - 20230630 | 30,094,164.80 | 0.00 | 0.00 | 30,094,164.80 | 55.81 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> | | | | | | | |

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中证 ESG120 策略指数证券投资基金设立的文件

《英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金基金合同》

《英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金托管协议》

《英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金招募说明书》

《英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金产品资料概要》

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

2023 年 7 月 20 日