

英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券  
投资基金  
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	英大安盈 30 天滚动持有债券发起	
基金主代码	014511	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 21 日	
报告期末基金份额总额	10,776,750.79 份	
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。	
投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、信用债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、银行存款、同业存单投资策略。	
业绩比较基准	中债-综合财富(1 年以下)指数收益率×80%+人民币活期存款利率(税后)×20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。	
基金管理人	英大基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	英大安盈 30 天滚动持有债券发起 A	英大安盈 30 天滚动持有债券发起 C
下属分级基金的交易代码	014511	014512
报告期末下属分级基金的份额总额	151,643.28 份	10,625,107.51 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	英大安盈 30 天滚动持有债券发起 A	英大安盈 30 天滚动持有债券发起 C
1. 本期已实现收益	771.32	41,803.68
2. 本期利润	-1,923.77	-93,339.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0089	-0.0086
4. 期末基金资产净值	154,527.91	10,799,288.87
5. 期末基金份额净值	1.0190	1.0164

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

英大安盈 30 天滚动持有债券发起 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	-0.79%	0.05%	0.35%	0.01%	-1.14%	0.04%
过去六个月	-0.39%	0.04%	0.97%	0.01%	-1.36%	0.03%
过去一年	2.76%	0.13%	1.89%	0.01%	0.87%	0.12%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.11%	3.05%	0.01%	-1.15%	0.10%

英大安盈 30 天滚动持有债券发起 C

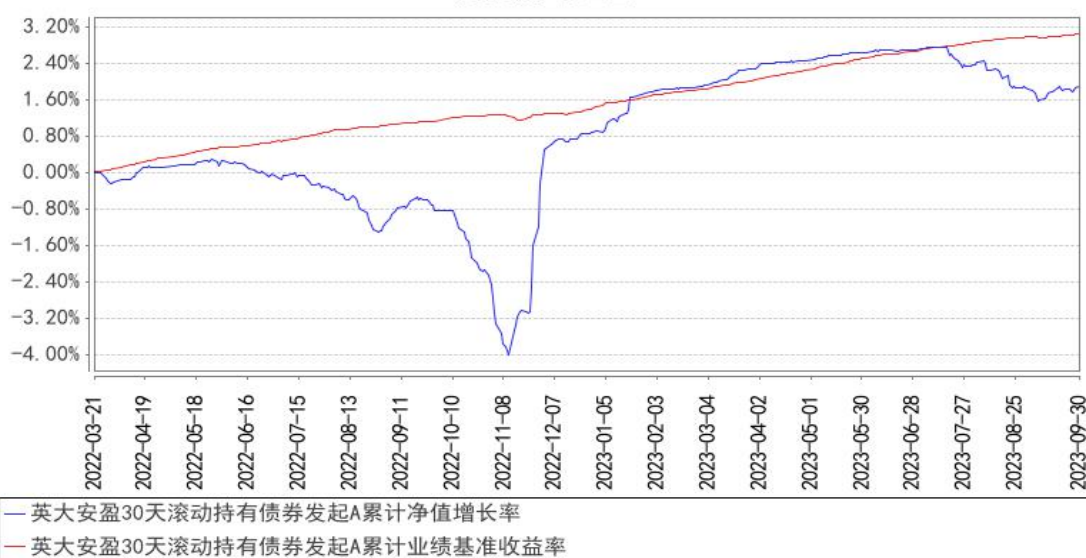
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.83%	0.05%	0.35%	0.01%	-1.18%	0.04%
过去六个月	-0.49%	0.04%	0.97%	0.01%	-1.46%	0.03%

过去一年	2.60%	0.13%	1.89%	0.01%	0.71%	0.12%
自基金合同生效起至今	1.64%	0.11%	3.05%	0.01%	-1.41%	0.10%

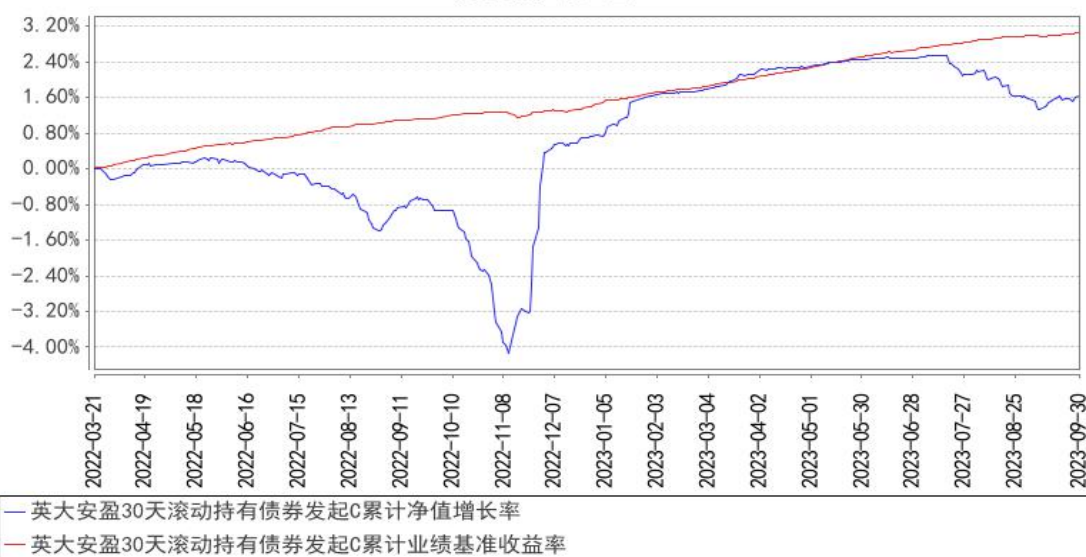
注：同期业绩比较基准为中债-综合财富(1年以下)指数收益率×80%+人民币活期存款利率(税后)×20%。

### 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

英大安盈30天滚动持有债券发起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



英大安盈30天滚动持有债券发起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：本基金的业绩比较基准为：中债-综合财富(1年以下)指数收益率×80%+人民币活期存款利率

(税后) × 20%。

### 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		
吕一楠	本基金的基金经理	2022 年 3 月 21 日	-	13 年	澳大利亚新南威尔士大学精算学、统计学硕士双学位，历任香港大新保险服务有限公司投资部投资分析师，中国人寿养老保险股份有限公司投资管理中心投资经理助理，交银施罗德基金管理有限公司固定收益部基金经理助理、专户投资部投资经理，北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理（拟任），现任英大基金管理有限公司固定收益部基金经理，英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大安益中短债债券型证券投资基金、英大安悦纯债债券型证券投资基金、英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、英大通佑纯债一年定期开放债券型证券投资基金、英大安旻纯债债券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《英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金基金合同》《英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金招募说明书》的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，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，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

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，且不存在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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度，随着稳增长政策的陆续出台，市场对经济的悲观预期也有所改善，国内经济基本面出现一定阶段性企稳迹象。资金面整体维持宽松，央行于 8 月再次降息，于 9 月降准，政策持续发力，进一步支持稳增长。

债券市场方面，7 月发布的二季度经济数据不及预期，债市整体偏强，但 7 月政治局会议后债市收益率探底并快速反弹。8 月中旬央行超量续作 7 天 OMO 及 1 年期 MLF，并分别下调利率 10bp 和 15bp，收益率下行至年内低点。进入 9 月，由于各项稳增长政策的密集出台，尤其是针对房地产“认房不认贷”、调降存量房贷利率，叠加 8 月经济数据低位企稳，以及临近月末资金价格上行，债市出现一波明显调整，收益率较 8 月低点上行 15-20bp。截至三季度末，1 年期国债收益率位于 2.17% 附近，10 年期国债收益率位于 2.7% 附近。三季度 R001 中位数 1.9%，较二季度上行；R007 中位数 2.0%，较二季度小幅下行。

报告期内，本基金以高等级信用债作为底仓，中短期利率债波段操作，保持了一定杠杆，严控组合流动性风险。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末英大安盈 30 天滚动持有债券发起 A 基金份额净值为 1.0190 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.79%；截至本报告期末英大安盈 30 天滚动持有债券发起 C 基金份额净值为 1.0164 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.83%；业绩比较基准收益率为 0.35%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

## §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	11,963,163.07	99.31
	其中：债券	11,963,163.07	99.31
	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	73,007.89	0.61
8	其他资产	10,199.94	0.08
9	合计	12,046,370.90	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

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

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,126,157.53	65.06
	其中：政策性金融债	7,126,157.53	65.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,027,988.52	18.51
6	中期票据	842,295.73	7.69
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,966,721.29	17.95
9	其他	-	-
10	合计	11,963,163.07	109.21

## 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	220216	22 国开 16	50,000	5,074,623.29	46.33
2	112311110	23 平安银行 CD110	15,000	1,471,362.39	13.43
3	220412	22 农发 12	10,000	1,026,054.79	9.37
4	190203	19 国开 03	10,000	1,025,479.45	9.36
5	042380459	23 云能投 CP010	10,000	1,018,767.21	9.30

## 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。

#### 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 5.9.2 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。

##### 5.9.3 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 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，本基金投资的前十名证券的发行主体本期，除以下情形外，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。

23 平安银行 CD110：2023 年 1 月 18 日披露，平安银行作为相关债务融资工具联席主承销商，未按发行文件约定，取利率区间上限开展余额包销，相关行为挤占了其他市场投资人的份额，损害了其他投资人权益，并影响了发行利率，对市场正常秩序造成了一定不良影响，被中国银行间市场交易商协会予以通报批评并责令其针对暴露问题进行全面深入整改；2023 年 7 月 7 日，平安银行因违反账户管理规定、其他危及支付机构稳健运行、损害客户合法权益或危害支付服务市场的违法违规行为等十项违法行为被中国人民银行警告，没收违法所得并罚款。

基金管理人通过对上述发行人进一步了解分析后，认为以上处罚不会对所持有证券的投资价值构成实质性影响。

##### 5.10.2 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

本基金不投资于股票。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,199.94
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,199.94

### 5.10.4 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。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不投资于股票。

### 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	英大安盈 30 天滚动持有 债券发起 A	英大安盈 30 天滚动持有债 券发起 C
报告期期初基金份额总额	273,698.07	10,863,933.66
报告期期间基金总申购份额	17,580.39	14,873.10
减：报告期期间基金总赎回份额	139,635.18	253,699.25
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	151,643.28	10,625,107.51

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	10,000,200.00
--------------	---------------

基金份额	
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	10,000,200.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	92.79

## 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,200.00	92.79	10,000,200.00	92.79	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.00	92.79	10,000,200.00	92.79	3年

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	20230701 - 20230930	10,000,200.00	0.00	0.00	10,000,200.00	92.7900

#### 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。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

中国证监会批准英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金设立的文件

《英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金基金合同》

《英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金托管协议》

《英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金招募说明书》

《英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式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

### 10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所。

### 10.3 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 10 月 24 日