圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:圆信永丰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年01月22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。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1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2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	圆信永丰优悦生活
基金主代码	004959
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年01月29日
报告期末基金份额总额	1,897,373,959.81份
投资目标	本基金通过投资于优悦生活主题产业和行业中的标的,在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,为基金持有人创造良好的投资回报。
投资策略	本基金通过对国家宏观经济政策的深入分析,在动态跟踪财政政策、货币政策的基础上,判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势,分析不同政策对各类资产的市场影响和预期收益风险,评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值,确定投资组合的资产配置比例,并适时进行调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金,低于股票型基金。
基金管理人	圆信永丰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2018年10月01日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-108,655,614.50
2.本期利润	-201,355,313.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1039
4.期末基金资产净值	1,555,977,867.04
5.期末基金份额净值	0.8201

注1:本期指2018年10月1日至2018年12月31日,上述基金业绩指标不包括基金份额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。

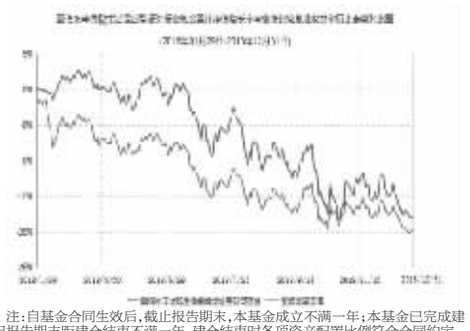
注2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	-11.11%	1.41%	-7.54%	1.06%	-3.57%	0.35%

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



注:自基金合同生效后,截止报告期末,本基金成立不满一年;本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
范妍	本基金基金经理	2018-01-29	-	10年	复旦大学管理学硕士,现任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部总监。历任兴业证券研究中心助理策略分析师、安信证券研究中心高级策略分析师、工银瑞信基金策略研究员、圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部副总监。国籍:中国,获得的相关业务资格:基金从业资格证。
肖世源	本基金基金经理	2018-01-29	-	7年	复旦大学中西医结合临床硕士,现任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部基金经理。历任上海合懿投资管理合伙企业(有限合伙)投研部研究员,上海呈瑞投资管理有限公司投研部研究员,圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员。国籍:中国,获得的相关业务资格:基金从业资格证。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、该基金基金合同的规定。基金经理对个券和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以确保基金管理人的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

基金管理人各类基金资产、特定资产管理计划资产独立运作。对于交易所市场投资,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照价格优先、时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;对于银行间市场投资,基金管理人通过交易对手控制和询价机制,严格防范对手风险并抽检价格公允性;对于申购投资行为,基金管理人遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内,通过每季度和每年度对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,基金管理人未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析,基金管理人未发现存在有可能导致不公平交易和利益输送等的异常交易行为。

基金管理人旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,优悦生活的仓位基本保持在75%附近。自6月初PMI数据发出了经济开始加速下行的信号以来,我们至今还未观察到经济出现好转的迹象,甚至11月开始,工业企业、国有企业的利润增速转负,财政收入中企业所得税收入10月、11月份连续两个月份负增长,而2018年上半年,工业企业利润的增速还在17%。从各种迹象来看,我们判断经济下行的速度可能比较快。因此从行业配置上,我们调整了一些行业的配置比重,例如白酒和保险的配置大幅调减,更加偏向消费中必需消费的部分,比如牛奶、纸巾还有医药。此外,我们看好主要供应受到海外制约的品种,景气周期大概率向上的板块,如原油开采设备行业和农产品行业,并选择一部份受益成本下跌的行业对此作出一定的平衡。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰优悦生活基金份额净值为0.8201元,本报告期内,基金份额净值增长率为-11.11%,同期业绩比较基准收益率为-7.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内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	1,191,072,171.00	76.24
	其中:股票	1,191,072,171.00	76.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	221,547,970.12	14.18
	其中:债券	221,547,970.12	14.18
	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	100,000,000.00	6.40
	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	21,364,036.32	1.37
8	其他资产	28,351,420.47	1.81
9	合计	1,562,335,597.91	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	55,711,512.52	3.58
B	采矿业	48,019,985.30	3.09
C	制造业	863,977,395.59	55.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	69,003,333.86	4.43
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	25,415,677.50	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	412,560.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,908,700.00	0.96
J	金融业	86,276,663.40	5.54
K	房地产业	338,485.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,054,210.00	0.90
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	12,953,647.83	0.83
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,191,072,171.00	76.55

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 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	002179	中航光电	2,034,893	68,535,196.24	4.40
2	600887	伊利股份	2,649,873	60,629,094.24	3.90
3	002572	索菲亚	3,387,140	56,734,595.00	3.65
4	002415	海康威视	2,199,961	56,670,995.36	3.64
5	600011	华能国际	7,418,497	54,748,507.86	3.52
6	000651	格力电器	1,506,000	53,749,140.00	3.45
7	600566	济川药业	1,600,086	53,650,883.58	3.45
8	600583	海油工程	9,799,997	48,019,985.30	3.09
9	600703	三安光电	4,000,064	45,240,723.84	2.91
10	600030	中信证券	2,600,000	41,626,000.00	2.68

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	143,192,938.00	9.20
	其中:政策性金融债	143,192,938.00	9.20
4	企业债券	20,466,000.00	1.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	9,434,032.12	0.61
8	同业存单	48,455,000.00	3.11
9	其他	-	-
10	合计	221,547,970.12	14.24

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	018005	国开1701	602,700	60,535,188.00	3.89
2	111805070	18建设银行CD070	500,000	48,455,000.00	3.11
3	160301	16进出01	300,000	30,006,000.00	1.93
4	1280352	12湘高速债	200,000	20,466,000.00	1.32
5	140209	14国开09	200,000	20,140,000.00	1.29

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

根据基金合同约定,本基金不参与贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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

根据基金合同约定,本基金不参与国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据基金合同约定,本基金不参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同约定,本基金不参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 通过查阅中国证监会、中国银保监会网站公开目录"行政处罚决定"及查阅相关发行主体的公司公告,在基金管理人知悉的范围内,报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	452,427.83
2	应收证券清算款	22,304,398.97
3	应收股利	-
4	应收利息	5,588,267.21
5	应收申购款	6,326.46
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	28,351,420.47

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	41,626,000.00	2.68	由于正在筹划关于公司发行股份购买资产事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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

报告期期初基金份额总额	1,995,017,730.62
报告期期间基金总申购份额	2,157,292.88
减:报告期期间基金总赎回份额	99,801,063.69
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	1,897,373,959.81

§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

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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投资本基金。

§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

报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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

1、中国证监会批准圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金设立的文件;
2、《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同》;
3、《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金托管协议》;
4、报告期内在指定报刊上披露的各项公告;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人圆信永丰基金管理有限公司。
咨询电话:4006070088
公司网址:http://www.gtsfund.com.cn

圆信永丰基金管理有限公司
2019年01月22日

英大策略优选混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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1月22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1月21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2018年10月1日起12月31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	2016年12月2日	
报告期末基金份额总额	88,930,453.69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	88,022,248.35份	908,205.34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(2018年10月1日-2018年12月31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	311,465.46	2,541.67
2. 本期利润	-9,529,697.56	-101,267.17
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1083	-0.1168
4. 期末基金资产净值	89,263,075.19	884,917.79
5. 期末基金份额净值	1.0141	0.9744

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	-9.65%	1.48%	0.80%	0.01%	-10.45%	1.47%

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	-9.64%	1.48%	0.80%	0.01%	-10.44%	1.47%

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		
袁忠伟	本基金基金经理、权益投资部总经理	2015年12月2日	-	18	曾任中国民族证券证券投资部总经理助理、执行总经理;华西证券股份有限公司资产管理总部研究总监。2015年1月加入英大基金管理有限公司,曾任研究发展部副总经理,现任权益投资部总经理。

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

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,通过公司公平交易系统监测和人工复核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非公平交易的情况。

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

通过研究分析,我们预测2018年四季度股票市场以下跌或震荡为主,权益投资策略应以防御为主。在下跌或震荡市中,我们选择"低估值、抗跌性强、震荡市中有正收益"的股票构建投资组合,行业投资偏重于银行业。在操作中,坚持投资组合中重点行业投资比例不变、适度波段操作其他行业个股的策略。积极参与新股配售、及时获利兑现,获取低风险收益。2018年四季度,上证50指数下跌12.03%,沪深300指数下跌12.45%,基金A、C单位净值分别下跌9.65%和下跌9.64%。

展望2019年一季度,固定资产投资、消费、净出口整体趋弱,预计一季度A股非金融企业的盈利下滑更为明显;宏观政策已开始逆向调节,降准空间开启后,实体经济流动性有望逐渐改善,预计A股市场下行压力有所缓解,但波动性仍然较大。从中长期来看,积极因素正在逐渐积累。外部方面,2019年美联储加息将逐渐进入尾声,新兴市场再次受到国际资金关注。国内方面,宏观政策结构性放松对经济减速发挥托底作用,供给侧改革逐渐取得成效,部分行业产能出清后出现恢复性增长,技术创新带动新兴产业发展。但市场目前震荡寻底仍需过程,本基金将灵活参与权益市场结构性机会,审慎投资,精选个股,降低风险,努力在一季度为投资者带来好的净值表现。

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1.0141元,本报告期基金份额净值增长率为-9.65%;截至本报告期末英大策略优选混合C基金份额净值为0.9744元,本报告期基金份额净值增长率为-9.64%;同期业绩比较基准收益率为0.80%。

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	73,113,489.85	80.68
	其中:股票	73,113,489.85	80.68
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	12,500,000.00	13.79
	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	4,965,982.81	5.48
8	其他资产	41,281.32	0.05
9	合计	90,620,753.98	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	4,855,221.00	5.39
C	制造业	23,923,138.81	26.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,219,953.00	9.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,999,765.00	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	2,495,900.00	2.77
H	住宿和餐饮业	2,160,170.04	2.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,542,571.60	8.37
J	金融业	13,937,766.80	15.46
K	房地产业	844,728.00	0.94
L	租赁和商务服务业	5,173,525.60	5.74
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	960,750.00	1.07
S	综合	-	-
	合计	73,113,489.85	81.10

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	600038	中直股份	112,000	4,184,320.00	4.64
2	600030	中信证券	241,800	3,871,218.00	4.29
3	601888	中国国旅	63,400	3,816,680.00	4.23
4	601688	华泰证券	223,900	3,627,180.00	4.02
5	300188	美亚柏科	237,280	3,089,385.60	3.43
6	600886	国投电力	333,300	2,683,065.00	2.98
7	601100	恒立液压	128,740	2,550,339.40	2.83
8	601988	中国银行	672,300	2,427,003.00	2.69
9	603345	安井食品	63,600	2,340,480.00	2.60
10	601318	中国平安	38,600	2,165,460.00	2.40

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资组合。

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

注:本基金本报告期末未持有债券投资组合。

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

本基金本报告期内未参与股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。

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

本基金本报告期内未参与国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

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: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

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	26,300.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,940.51
5	应收申购款	40.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,281.32

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	3,871,218.00	4.29	临时停牌

注:除中信证券临时停牌外,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	88,019,207.36	1,048,142.84
报告期期间基金总申购份额	7,579.81	436,615.28
减:报告期期间基金总赎回份额	4,538.82	576,552.78
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	88,022,248.35	908,205.34

§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	2018.10.1-2018.12.31	88,000,000.00	0.00	0.00		88,000,000.00	98.95%
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1月22日

英大纯债债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

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1月22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1月21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2018年10月1日起至12月31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	393,789,736.05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