

英大策略优选混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

通、美国经济增长持续强劲,美联储鹰派与退出量化宽松进程使得全球流动性进一步趋紧,新兴市场资金流出加大,11月初的美国中期选举结果将决定外溢压力是否将进一步放大,中国货币政策8月份以来受到稳汇率的制约,当前历史较佳的国债期限利差以及中美利率都将制约中国一年期国债利率进一步下行,市场目前难觅见底,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,努力在四季度为投资者带来较好的业绩表现。

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1.1224元,本报告期基金份额净值增长率为-1.86%;截至本报告期末英大策略优选混合C基金份额净值为1.0704元,本报告期基金份额净值增长率为1.65%;同期业绩比较基准收益率为0.81%。

4.6 报告期内基金持有人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元的情形。

§ 5 投资组合报告

序号	投资组合	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	76,865,200.46	70.62
2	其中:股票	76,865,200.46	70.62
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	20,400,732.59	23.33
10	合计	100,311,000.34	100.00

5.1 报告期末基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物	5,207,101.00	5.28
B	IT	2,239,524.61	2.26
C	制造业	7,610,020.00	7.62
D	电力、热力、燃气及生产供应	2,639,520.00	2.65
E	建筑业	-	-
F	金融、地产	3,351,500.00	3.35
G	交通运输、仓储和邮政	2,721,000.00	2.72
H	公用事业	9,004,342.52	9.04
I	信息技术、软件和信息技术服务业	15,540,313.00	15.61
J	金融业	900,190.00	0.90
K	房地产业	5,921,546.49	5.93
L	综合类	-	-
M	其他	76,865,200.46	76.62
N	合计	100,311,000.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	IT	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑业	-	-
F	金融、地产	-	-
G	交通运输、仓储和邮政	-	-
H	公用事业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	综合类	-	-
M	其他	-	-
N	合计	-	-

5.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	IT	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑业	-	-
F	金融、地产	-	-
G	交通运输、仓储和邮政	-	-
H	公用事业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	综合类	-	-
M	其他	-	-
N	合计	-	-

5.4 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	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	48,829,560.00	28.02
4	企业债券	48,829,560.00	28.02
5	企业短期融资券	10,079,000.00	5.93
6	中期票据	10,040,000.00	5.90
7	可转债(可交换)	187,197.60	0.33
8	债券回购	-	-
9	其他	98,021,000.00	29.01
10	合计	138,036,717.60	79.23

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十名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	48,829,560.00	28.02
4	企业债券	48,829,560.00	28.02
5	企业短期融资券	10,079,000.00	5.93
6	中期票据	10,040,000.00	5.90
7	可转债(可交换)	187,197.60	0.33
8	债券回购	-	-
9	其他	98,021,000.00	29.01
10	合计	138,036,717.60	79.23

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	48,829,560.00	28.02
4	企业债券	48,829,560.00	28.02
5	企业短期融资券	10,079,000.00	5.93
6	中期票据	10,040,000.00	5.90
7	可转债(可交换)	187,197.60	0.33
8	债券回购	-	-
9	其他	98,021,000.00	29.01
10	合计	138,036,717.60	79.23

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

序号	贵金属名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中国工商银行	38,427.72	0.04
2	建设银行	-	-
3	农业银行	-	-
4	中国银行	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	合计	38,427.72	0.04

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

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中国工商银行	38,427.72	0.04
2	建设银行	-	-
3	农业银行	-	-
4	中国银行	-	-
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	合计	38,427.72	0.04

5.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113000	国债	403,624.40	0.24
2	121000	国债	403,624.40	0.24
3	121000	国债	403,624.40	0.24
4	121000	国债	403,624.40	0.24
5	121000	国债	403,624.40	0.24
6	121000	国债	403,624.40	0.24
7	121000	国债	403,624.40	0.24
8	121000	国债	403,624.40	0.24
9	121000	国债	403,624.40	0.24
10	121000	国债	403,624.40	0.24
11	121000	国债	403,624.40	0.24
12	121000	国债	403,624.40	0.24
13	121000	国债	403,624.40	0.24
14	121000	国债	403,624.40	0.24
15	121000	国债	403,624.40	0.24
16	121000	国债	403,624.40	0.24
17	121000	国债	403,624.40	0.24
18	121000	国债	403,624.40	0.24
19	121000	国债	403,624.40	0.24
20	121000	国债	403,624.40	0.24
21	121000	国债	403,624.40	0.24
22	121000	国债	403,624.40	0.24
23	121000	国债	403,624.40	0.24
24	121000	国债	403,624.40	0.24
25	121000	国债	403,624.40	0.24
26	121000	国债	403,624.40	0.24
27	121000	国债	403,624.40	0.24
28	121000	国债	403,624.40	0.24
29	121000	国债	403,624.40	0.24
30	121000	国债	403,624.40	0.24
31	121000	国债	403,624.40	0.24
32	121000	国债	403,624.40	0.24
33	121000	国债	403,624.40	0.24
34	121000	国债	403,624.40	0.24
35	121000	国债	403,624.40	0.24
36	121000	国债	403,624.40	0.24
37	121000	国债	403,624.40	0.24
38	121000	国债	403,624.40	0.24
39	121000	国债	403,624.40	0.24
40	121000	国债	403,624.40	0.24
41	121000	国债	403,624.40	0.24
42	121000	国债	403,624.40	0.24
43	121000	国债	403,624.40	0.24
44	121000	国债	403,624.40	0.24
45	121000	国债	403,624.40	0.24
46	121000	国债	403,624.40	0.24
47	121000	国债	403,624.40	0.24
48	121000	国债	403,624.40	0.24
49	121000	国债	403,624.40	0.24
50	121000	国债	403,624.40	0.24
51	121000	国债	403,624.40	0.24
52	121000	国债	403,624.40	0.24
53	121000	国债	403,624.40	0.24
54	121000	国债	403,624.40	0.24
55	121000	国债	403,624.40	0.24
56	121000	国债	403,624.40	0.24
57	121000	国债	403,624.40	0.24
58	121000	国债	403,624.40	0.24
59	121000	国债	403,624.40	0.24
60	121000	国债	403,624.40	0.24
61	121000	国债	403,624.40	0.24
62	121000	国债	403,624.40	0.24
63	121000	国债	403,624.40	0.24
64	121000	国债	403,624.40	0.24
65	121000	国债	403,624.40	0.24
66	121000	国债	403,624.40	0.24
67	121000	国债	403,624.40	0.24
68	121000	国债	403,624.40	0.24
69	121000	国债	403,624.40	0.24
70	121000	国债	403,624.40	0.24
71	121000	国债	403,624.40	0.24
72	121000	国债	403,624.40	0.24
73	121000	国债	403,624.40	0.24
74	121000	国债	403,624.40	0.24
75	121000	国债	403,624.40	0.24
76	121000	国债	403,624.40	0.24
77	121000	国债	403,624.40	0.24
78	121000	国债	403,624.40	0.24
79	121000	国债	403,624.40	0.24
80	121000	国债	403,624.40	0.24
81	121000	国债	403,624.40	0.24
82	121000	国债	403,624.40	0.24
83	121000	国债	403,624.40	0.24
84	121000	国债	403,624.40	0.24
85	121000	国债	403,624.40	0.24
86	121000	国债	403,624.40	0.24
87	121000	国债	403,624.40	0.24
88	121000	国债	403,624.40	0.24
89	121000	国债	403,624.40	0.24
90	121000	国债	403,624.40	0.24
91	121000	国债	403,624.40	0.24
92	121000	国债	403,624.40	0.24
93	121000	国债	403,624.40	0.24
94	121000	国债	403,624.40	0.24
95	121000	国债	403,624.40	0.24
96	121000	国债	403,624.40	0.24
97	121000	国债	403,624.40	0.24
98	121000	国债	403,624.40	0.24
99	121000	国债	403,624.40	0.24
100	121000	国债	403,624.40	0.24

5.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113000	国债	403,624.40	0.24
2	121000	国债	403,624.40	0.24
3	121000	国债	403,624.40	0.24
4	121000	国债	403,624.40	0.24