

东方策略成长混合型基金

2018年第四季度报告

超过该证券当日成交5%的情况。

44 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年4季度，市场中贸易摩擦的持续加码和经济下行压力的悲观预期之下，出

现了较大程度的下跌，但年来的中央经济工作会议释放了继续稳经济的政策信号，同时元旦后

的全面降准也预示看2019年货币政策将继续保持宽松状态。

wind显示，4季度上证综指下跌1.61%，深圳成指下跌13.82%，创业板指下跌11.39%，沪深

300下跌12.46%，上证50下跌12.03%，跌幅均超过2018年的3季度。分行业看，4季度实现正收

益的行业只有通信、非银金融；近期板块和TMT板块跌幅较少；其次是消费品板块；跌幅最大

的行业为煤炭、采掘、化工等周期板块。

4季度的整体修复态势基本符合我们的判断，消费品出现了补跌，逆周期板块也显示了其

在防御性，虽然2018年下半年以来我们判断，但目前看市场下行趋势还没有发生变化。本产

品在4季度维持了中性仓位，并将结构向逆周期板块倾斜，同时增配了低估值低息标的，提升

了整体组合的防御性。

45 报告期内基金的业绩表现

2018年10月1日起至2018年12月31日，本基金净值增长率为-12.27%，业绩比较基准收

益率为-12.27%，高于业绩比较基准4.00%。

46 报告期内基金持有人数量或基金资产净值变动说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产

净值低于五千万元的情形。

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 227,596,080.26 69.73

其中：股票 227,596,080.26 69.73

2 固定收益 58,572,372.78 16.93

其中：债券 58,572,372.78 16.93

资产支持证券 -- --

3 贵金属投资 -- --

4 金融衍生品投资 -- --

5 买入返售金融资产 30,000,000.00 8.89

6 其他资产 2,067,280.75 0.61

7 银行承兑票据和备付金合计 15,516,099.46 4.48

8 其他资产 6,387,280.75 1.81

9 合计 326,257,881.27 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 8,061,000.00 2.56

C 制造业 82,082,402.11 24.97

D 电力、热力、燃气及生产供应业 23,001,000.00 7.00

E 建筑业 18,333,000.00 5.59

F 批发和零售业 -- --

G 交通运输、仓储和邮政业 26,306,107.78 7.93

H 住宿和餐饮业 -- --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 18,106,644.43 5.54

J 金融业 19,749,160.00 6.01

K 房地产业 40,362,176.18 11.97

L 租赁和商务服务业 -- --

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 房地产业、建筑业和其他服务业 -- --

P 教育 -- --

Q 公共事业管理 -- --

R 文化、体育和娱乐业 -- --

S 综合 -- --

合计 227,596,080.26 70.01

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

代码 名称 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 牧、林、牧、渔业 -- --

B 采矿业 -- --

C 制造业 3,302,916.60 40.97

D 电力、热力、燃气及生产供应业 -- --

E 建筑业 -- --

F 批发和零售业 265,000.00 3.08

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 213,000.00 2.07

J 金融业 -- --

K 房地产业 382,240.00 4.62

L 租赁和商务服务业 -- --

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 房地产业、建筑业和其他服务业 -- --

P 教育 -- --

Q 公共事业管理 -- --

R 文化、体育和娱乐业 -- --

S 综合 -- --

合计 4,072,914.00 96.43

5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未有沪港通投资股票。

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 002971 北方导航 8,500 303,900.00 3.88

2 600489 中润资源 8,000 297,040.00 3.47

3 600487 宁波海运 8,000 286,480.00 3.46

4 603103 横店影视 12,000 287,000.00 3.53

5 300003 乐普医疗 12,700 264,272.00 3.23

6 000998 华鲁恒升 8,400 262,560.00 3.17

7 000006 中国国贸 16,000 260,700.00 3.16

8 601007 上海医药 15,000 266,000.00 3.25

9 000766 中国钢材 17,000 243,080.00 2.82

10 002011 太阳纸业 27,000 230,080.00 2.67

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有债券投资。

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有债券投资。

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有权证投资。

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有股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资策略

本基金本报告期末未有股指期货持仓。

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 本期国债期货投资持仓和损益明细

根据本基金的基金合同约，本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金的基金合同约，本基金的投资范围不包括国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 40,918.40

2 应收证券清算款 --

3 应收股利 --

4 应收利息 120,547.93

5 应收申购款 288.21

6 其他应收款 --

7 其他资产 --

8 合计 166,764.14

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 期末受限情况（元） 占基金资产净值比例（%） 流通受限情况说明

1 600000 中国国贸 2,881,000.00 3.72 融资融券

5.11.6 投资组合报告附注的其他事项描述

由于四舍五入的原因，比例之和与合计可能有尾差。

5 开放式基金份额变动

单位：份

报告期末基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74

报告期基金份额总额 120,761,691.74