

新华策略精选股票型证券投资基金

2018年第四季度报告

净值 (pa) 三者结合起来甄选个股,特别是ROIC,由现金流良好的优质公司重点配置的对象。我们相信,随着时间的推移,高ROIC的优质公司一定会给投资者创造丰厚的回报。我们将一如既往地坚持价值投资的方向不动摇,不畏短期波动,不追风口,不去博弈,减少换手,坚持在能力范围内进行投资,投资上有所为有所不为,努力去做胜率性高且确定性强的,我们坚信只有合理的估值空间,买入优质的公司,中长期持有,才能给股东创造真正的价值。放眼全球,海外成熟发达国家的证券市场比我国公司成长走势,已经给我们提供了非常好的指引方向。特别是2019年A股在MSCI指数权重将大幅提升,近期又加入了标普道琼斯指数,也将加入富时罗素指数,外资将会持续流入,中国也会更加开放,A股市场的估值和定价体系也必将逐渐与国际接轨,因此我们要以国际化的眼光去筛选公司,更加注重公司核心竞争力、财务状况和估值性价比。

展望2019年,我们认为在宏观经济对冲调控政策的作用下,中国经济有望触底企稳。股票市场在经历2018年大幅下跌的情况下,连续再大幅下跌的概率不大。目前估值处于历史低位,积累了反弹的动力。因此,我们对2019年的行情不悲观,或者说至少看到结构性机会,我们更关注从下而上的优质个股机会,积极寻找能够穿越周期真正成长的公司。

4.0报告期内本基金持有人人数或基金份额净值预警说明

本报告期末基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二十人或基金资产净值低于五千万元的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	426,747,860.85	92.08
2	固定收益投资	426,747,860.85	92.08
3	其中:债券	596,000.00	0.01
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	-	-
9	待摊费用、递延所得税资产	34,156,040.03	7.22
10	其他流动资产	2,345,020.02	0.05
11	合计	473,226,380.80	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	-	-	-
C 制造业	-	-	-
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	-	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-	-
O 房地产业	-	-	-
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	-	426,747,860.85	92.08

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	005272	伟思新材	2,100,077	32,561,500.27	6.08
2	000048	保利地产	2,523,100	29,747,349.00	5.52
3	000498	蓝光发展	1,000,000	29,290,000.00	5.35
4	002238	厦门钨业	500,000	28,100,000.00	5.26
5	000859	山西广济	800,137	28,046,904.88	5.07
6	600060	青岛海尔	2,000,000	27,700,000.00	5.09
7	000418	小天鹅A	606,691	26,196,136.76	4.87
8	001079	泊松新材	1,500,000	26,025,000.00	4.84
9	000052	广药A	889,803	21,197,449.46	4.01
10	000408	招商局A	424,354	16,236,634.08	3.03

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110049	国开转债	9,980	986,000.00	0.21

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资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110049	国开转债	9,980	986,000.00	0.21

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	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110049	国开转债	9,980	986,000.00	0.21

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	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110049	国开转债	9,980	986,000.00	0.21

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十名权证投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110049	国开转债	9,980	986,000.00	0.21

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

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.9.3 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.5 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.6 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.7 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.45 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.46 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.47 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.48 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.49 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.50 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.51 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.52 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.53 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.54 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.55 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.56 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.57 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.58 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.59 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.60 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.61 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.62 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.63 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.64 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.65 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.66 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.67 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.68 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.69 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.71 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.72 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.73 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.74 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.75 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.76 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.77 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.78 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.79 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.80 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.81 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.82 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.83 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.84 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.85 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.86 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.87 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.88 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.89 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.90 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.91 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.92 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.93 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.94 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.95 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.96 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.97 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.98 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.99 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.100 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.101 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.102 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.103 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.104 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.105 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.106 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.107 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.108 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.109 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.110 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.111 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.112 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.113 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.114 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.115 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.116 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.117 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.118 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.119 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.120 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.121 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.122 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.123 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.124 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.125 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.126 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.127 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.128 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.129 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.130 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.131 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.132 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.133 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.134 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.135 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.136 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.137 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.138 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.139 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.140 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.141 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.142 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.143 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.144 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.145 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.146 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.147 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.148 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.149 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.150 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.151 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.152 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.153 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.154 报告期末本基金投资的股指期货持仓和