
新华行业周期轮换股票型证券投资基金
2012 年年度报告
2012 年 12 月 31 日

基金管理人：新华基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2013 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	4
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1	主要会计数据和财务指标	5
3.2	基金净值表现	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	审计报告	14
6.1	管理层对财务报表的责任	14
6.2	注册会计师的责任	14
6.3	审计意见	15
§ 7	年度财务报表	15
7.1	资产负债表	15
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4	报表附注	19
§ 8	投资组合报告	37
8.1	期末基金资产组合情况	37
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	37
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	39
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	48
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	48
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	48
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	48

8.9	投资组合报告附注	48
§ 9	基金份额持有人信息	49
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
§ 10	开放式基金份额变动	50
§ 11	重大事件揭示	50
11.1	基金份额持有人大会决议.....	50
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
11.4	基金投资策略的改变	50
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
11.8	其他重大事件	52
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§ 13	备查文件目录	56
13.1	备查文件目录	56
13.2	存放地点	56
13.3	查阅方式	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华行业周期轮换股票型证券投资基金
基金简称	新华行业周期轮换股票
基金主代码	519095
交易代码	519095
基金运作方式	契约形开放式
基金合同生效日	2010年7月21日
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	249,119,791.19份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，通过把握行业周期轮换规律，动态调整基金股票资产在不同行业之间的配置比例，力求实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，即在通过深入分析宏观经济周期、估值水平、政策导向以及市场情绪等因素以判断各大类资产配置比例的基础上，借助本公司自行开发的“新华三维行业周期轮换模型（MVQ模型）”，寻找预期能够获得超额收益的行业，并重点配置其中优质上市公司的股票。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的高风险高收益品种，预期风险和收益均高于混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	赵会军
	联系电话	010-88423386	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588
传真		010-88423310	010-66106904
注册地址		重庆市江北区建新东路85号附1号1层1-1	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		重庆市渝中区较场口88号得意商厦	北京市西城区太平桥大街96号中海

	A座7-2;北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座	地产大厦
邮政编码	400010	100140
法定代表人	陈重	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	国富浩华会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年	2010年7月21日(基金合同生效日)至2010年12月31日
本期已实现收益	18,987,946.00	-6,241,304.64	21,280,504.79
本期利润	58,404,736.47	-20,540,865.46	29,202,613.88
加权平均基金份额本期利润	0.3608	-0.1548	0.1284
本期加权平均净值利润率	33.19%	-14.14%	12.18%
本期基金份额净值增长率	28.83%	-14.51%	14.4%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配利润	44,198,443.22	-2,854,418.05	19,942,257.57
期末可供分配基金份额利润	0.1774	-0.0223	0.1203
期末基金资产净值	314,008,819.07	125,048,780.22	189,688,892.72
期末基金份额净值	1.260	0.978	1.144
3.1.3 累计期末指标	2012年末	2011年末	2010年末
基金份额累计净值增长率	26.00%	-2.20%	14.40%

注：1、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；

2、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	12.10%	1.05%	8.18%	1.02%	3.92%	0.03%
过去六个月	15.07%	1.08%	2.46%	0.99%	12.61%	0.09%
过去一年	28.83%	1.20%	7.04%	1.02%	21.79%	0.18%
自基金合同生效起至今	26.00%	1.17%	-4.22%	1.07%	30.22%	0.10%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数，复合业绩比较基准为：80%*沪深 300 指数收益率+20%*上证国债指数收益率。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

新华行业周期轮换股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010年7月21日至2012年12月31日）



注：本基金于 2010 年 7 月 21 日基金合同生效。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华行业周期轮换股票型证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：本基金于 2010 年 7 月 21 日基金合同生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2010 年 7 月 21 日基金合同生效，至 2012 年 12 月 31 日未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新华基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2012 年 12 月 31 日，新华基金管理有限公司旗下管理着九只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮换股票型证券投资基金、新华中小市值优选股票型证券投资基金和新华灵活主题股票型证券投资基金、新华优选消费股票型证券投资基金和新华纯债添利债券发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周永胜	本基金基金经理	2010-07-21	2012-04-25	17	经济学硕士，历任广发证券海南业务总部投资银行部经理、广发证券投资自营总部投资主管、汉唐证券投资管理总部副总经理、红塔证券资产管理总部副总经理、渤海证券投资总部副总经理。现任新华基金管理有限公司研究总监，新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理。
崔建波	本基金基金经理，新华泛资源优势灵活配置混合型证券	2010-07-21	2012-01-10	17	经济学硕士，历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、海融资讯系统有限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究部、理财服务部经理、北方国际信托股份有限公司投资部信托高级投资

	投资基金基金经理;; 公司基金管理部副总监				经理。现任新华基金管理有限公司基金管理部副总监,新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理。
何潇	本基金基金经理	2011-12-01	-	5	经济学硕士,2007年加入新华基金管理有限公司,历任行业分析师;策略分析师及新华优选成长股票型证券投资基金的基金经理助理。现任新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理有限公司作为新华行业周期轮换股票型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易,投资指令统一由中央交易室下达,并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,中央交易室根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由中央交易室报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召

开风险管理委员会，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向中央交易室下达投资指令，中央交易室向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《新华基金管理有限公司公平交易制度》的规定

基金管理人旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明：债券同向交易频率偏低；股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断，即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大，结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，未发生有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年，海外经济缓慢复苏，国内经济逐季下滑，在四季度经济出现了触底回升，由于全年经济增速的下移，微观上大部分行业和企业 在营收和利润上都面临着很大的挑战。

而去年 12 月份以来，蓝筹股触底强势反弹，估值得到了一定程度的修复，但蓝筹反弹的幅度和速度超过了预期。

报告期内，本基金采取了偏防御的投资策略，整体采取了均衡配置精选个股的策略。行业方面，金融、环保和传媒等行业为组合净值贡献了绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.260 元，本报告期份额净值增长率为 28.83%，同期比较基准的增长率为 7.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年，经济出现了弱复苏，房地产销售的复苏带动了部分城市房价上涨，国务院出台了更为严厉的调控政策，但房地产库存的下降将会带动投资的上升，地产产业链将会受益于此，未来的经济和市场走势将更趋复杂，我们将力争为投资者取得好的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的

科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.7.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、中央交易室、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- 制定估值制度并在必要时修改；
- 确保估值方法符合现行法规；
- 批准证券估值的步骤和方法；
- 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

4.7.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- 获得独立、完整的证券价格信息；
- 每日证券估值；
- 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- 对估值调整和人工估值进行记录；
- 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

4.7.1.3 投资管理部的职责分工

接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
评价并确认基金会计提供的估值报告；
向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.7.1.4 中央交易室的职责分工

对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
评价并确认基金会计提供的估值报告。

4.7.1.5 监察稽核部的职责分工

监督证券的整个估值过程；
确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012 年，本基金托管人在对新华行业周期轮换股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年，新华行业周期轮换股票型证券投资基金的管理人——新华基金管理有限公司在新华行业周期轮换股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新华行业周期轮换股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新华基金管理有限公司编制和披露的新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2013年3月26日

§6 审计报告

国浩审字[2013]404A0011号

新华行业周期轮换股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的新华行业周期轮换股票型证券投资基金（以下简称新华周期基金）财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制和公允列报财务报表是管理层的责任，这种责任包括：(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计

准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，新华周期基金的财务报表在所有重大方面已经按照企业会计准则、《新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了新华周期基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。

国富浩华会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 李荣坤 张吉范

北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

2013-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华行业周期轮换股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	19,969,674.46	19,348,607.45
结算备付金		1,695,160.92	295,744.17
存出保证金		962,421.31	376,485.65

交易性金融资产	7.4.7. 2	295,031,077.99	105,114,660.39
其中：股票投资		295,031,077.99	105,114,660.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		16,807,798.75	566,898.48
应收利息	7.4.7. 3	6,847.78	3,710.34
应收股利		-	-
应收申购款		1,045,980.42	205,338.77
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		335,518,961.63	125,911,445.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		10,275,807.89	-
应付赎回款		8,653,362.34	36,043.36
应付管理人报酬		345,002.97	166,172.43
应付托管费		57,500.51	27,695.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7. 4	1,435,174.11	218,193.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7. 5	743,294.74	414,560.09
负债合计		21,510,142.56	862,665.03
所有者权益：			
实收基金	7.4.7. 6	249,119,791.19	127,903,198.27
未分配利润	7.4.7. 7	64,889,027.88	-2,854,418.05
所有者权益合计		314,008,819.07	125,048,780.22

负债和所有者权益总计		335,518,961.63	125,911,445.25
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.260 元，基金份额总额 249,119,791.19 份。

7.2 利润表

会计主体：新华行业周期轮换股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12 月31日
一、收入		67,092,934.03	-16,314,137.35
1. 利息收入	7.4.7.8	333,575.30	142,735.04
其中：存款利息收入		301,877.70	139,943.38
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		31,697.60	2,791.66
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		26,757,224.05	-2,334,254.59
其中：股票投资收益	7.4.7.9	25,649,862.76	-3,510,848.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.10	1,107,361.29	1,176,593.73
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.11	39,416,790.47	-14,299,560.82
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.12	585,344.21	176,943.02
减：二、费用		8,688,197.56	4,226,728.11
1. 管理人报酬		2,626,310.77	2,188,786.81
2. 托管费		437,718.51	364,797.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.13	5,219,473.95	1,275,323.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.14	404,694.33	397,819.67
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		58,404,736.47	-20,540,865.46

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		58,404,736.47	-20,540,865.46

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华行业周期轮换股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	127,903,198.27	-2,854,418.05	125,048,780.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,404,736.47	58,404,736.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	121,216,592.92	9,338,709.46	130,555,302.38
其中：1.基金申购款	559,501,605.11	60,695,504.43	620,197,109.54
2.基金赎回款	-438,285,012.19	-51,356,794.97	-489,641,807.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	249,119,791.19	64,889,027.88	314,008,819.07
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	165,817,079.27	23,871,813.45	189,688,892.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,540,865.46	-20,540,865.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-37,913,881.00	-6,185,366.04	-44,099,247.04
其中：1.基金申购款	89,431,309.66	9,862,347.10	99,293,656.76
2.基金赎回款	-127,345,190.66	-16,047,713.14	-143,392,903.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	127,903,198.27	-2,854,418.05	125,048,780.22

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：陈重，主管会计工作负责人：孙枝来，会计机构负责人：徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华行业周期轮换股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]593号文件“关于核准新华行业周期轮换股票型证券投资基金募集的批复”批准,由新华基金管理有限公司作为发起人,于2010年6月17日至7月16日向社会公开募集,首次募集资金总额347,740,551.58元,其中募集资金产生利息68,207.90元,并经国富浩华会计师事务所有限公司浩华验字[2010]第72号验资报告予以验证。2010年7月21日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不设定,本基金管理人为新华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华行业周期轮换股票型证券投资基金招募说明书》及《新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资标的物包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票的投资比例占基金资产的60%—95%。固定收益类资产的投资比例占基金资产的5%-40%,具体包括国债、中央票据、金融债、公司债、企业债、次级债券、可转换公司债券、短期融资券、资产支持证券、可分离债、债券回购、银行存款等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具;其中,本基金保持不低于基金净值5%的现金和到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理有限公司于2013年3月23日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础,根据实际发生的交易和事项,按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

（1）金融资产和金融负债的初始确认和终止确认（证券投资基金成本计价方法）

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

a 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

b 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于交易日按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按 7.4.4.4 (1) 1) c 所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。卖出银行间同业市场交易的债券

于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

c 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资，权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

2) 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

3) 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

(2) 金融资产和金融负债的后续计量

本基金持有的金融资产和金融负债的后续计量与其分类相关联。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，按照公允价值后续计量，公允价值变动计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，采用实际利率法，按摊余成本计量。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

3) 当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。

(2) 主要资产的估值方法

1) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,按最近交易日的市场交易收盘价估值;估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票,在同一股票上市交易后,在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

非公开发行股票在锁定期内的估值方法为:若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

2) 债券投资

交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所上市的收盘价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息后的净价为公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日收盘价确定公允价值。估值日无交易但最近交易日后经济环境发生了重大变化的,参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值,如估值技术难以可靠计量,则以成本计量。

交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

全国银行间同业市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种采用估值技术确定公允价值。同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别确定公允价值。

3) 权证投资

因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

4) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内未有其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末未发生差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字[2005]107 号文《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、自 2008 年 4 月 24 日起执行的《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税,自 2008 年 4 月 24 日起按 0.1% 的税率缴纳。经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将现行的对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券(股票)交易印花税,调整为单边征税,即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
活期存款	19,969,674.46	19,348,607.45
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	19,969,674.46	19,348,607.45

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	261,991,739.25	295,031,077.99	33,039,338.74
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	261,991,739.25	295,031,077.99	33,039,338.74
项目	上年度末 2011年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	111,492,112.12	105,114,660.39	-6,377,451.73
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	111,492,112.12	105,114,660.39	-6,377,451.73

7.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	6,084.88	3,577.24
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	762.90	133.10
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	6,847.78	3,710.34

7.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,435,174.11	218,193.76
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,435,174.11	218,193.76

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	28,501.50	135.85
预提费用	634,793.24	414,424.24
审计费	80,000.00	-
合计	743,294.74	414,560.09

7.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,903,198.27	127,903,198.27
本期申购	559,501,605.11	559,501,605.11
本期赎回（以“-”号填列）	-438,285,012.19	-438,285,012.19
本期末	249,119,791.19	249,119,791.19

7.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	7,652,176.37	-10,506,594.42	-2,854,418.05
本期利润	18,987,946.00	39,416,790.47	58,404,736.47
本期基金份额交易产生的变动数	17,558,320.85	-8,219,611.39	9,338,709.46
其中：基金申购款	69,815,506.53	-9,120,002.10	60,695,504.43
基金赎回款	-52,257,185.68	900,390.71	-51,356,794.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,198,443.22	20,690,584.66	64,889,027.88

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
活期存款利息收入	281,932.81	134,500.62
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	19,944.89	5,442.76
其他	-	-
合计	301,877.70	139,943.38

7.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
卖出股票成交总额	1,708,756,943.06	428,521,867.99
减：卖出股票成本总额	1,683,107,080.30	432,032,716.31
买卖股票差价收入	25,649,862.76	-3,510,848.32

7.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,107,361.29	1,176,593.73
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,107,361.29	1,176,593.73

7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日

1. 交易性金融资产	39,416,790.47	-14,299,560.82
——股票投资	39,416,790.47	-14,299,560.82
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	39,416,790.47	-14,299,560.82

7.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
基金赎回费收入	585,152.81	176,810.91
转换费收入	191.40	132.11
合计	585,344.21	176,943.02

7.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
交易所市场交易费用	5,219,473.95	1,275,323.74
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,219,473.95	1,275,323.74

7.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,369.00	299,631.00
债券帐户维护费	16,500.00	13,500.00
汇划手续费	7,825.33	4,688.67
其他	-	-
合计	404,694.33	397,819.67

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

2013年1月18日，因工作调动，孙枝来先生辞去新华基金管理有限公司总经理一职。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
陕西蓝潼投资有限公司	基金管理人股东
上海大众环境产业有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东

注：2012年，陕西蓝潼电子投资有限公司更名为陕西蓝潼投资有限公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,626,310.77	2,188,786.81
其中：支付销售机构的客户维护费	1,229,132.42	778,296.32

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5%/当年天数

2、本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额，上年度可比期间列示的支付销售

机构的客户维护费为当期支付金额。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	437,718.51	364,797.89

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提确认。

其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未进行银行债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用自有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日		2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	19,969,674.46	281,932.81	19,348,607.45	134,500.62
合计	19,969,674.46	281,932.81	19,348,607.45	134,500.62

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无收益分配事项。

7.4.12 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至报告期末本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000602	金马集团	2012-12-24	大股东筹划重大事项	11.15	-	-	1,430,786	13,273,504.17	15,953,263.90	复牌日期尚不确定

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期内未发生银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期内未发生交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年12 月31日	1个月以 内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月-1 年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	-	-	-	-	-	19,969,67 4.46	-	-	-	19,969,67 4.46
结算备付 金	-	-	-	-	-	1,695,160 .92	-	-	-	1,695,160 .92
存出保证	-	-	-	-	-	-	-	-	962,421.3	962,421.3

金									1	1
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	295,031,077.99	295,031,077.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	16,807,798.75	16,807,798.75
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	6,847.78	6,847.78
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,045,980.42	1,045,980.42
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-	-	21,664,835.38	-	-	313,854,126.25	335,518,961.63
负债										
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	10,275,807.89	10,275,807.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	8,653,362.34	8,653,362.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	345,002.97	345,002.97
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	57,500.51	57,500.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	1,435,174.11	1,435,174.11
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	743,294.74	743,294.74
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	21,510,142.56	21,510,142.56
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	21,664,835.38	-	-	292,343,983.69	314,008,819.07
上年度末2011年12月31日	1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	-	-	-	-	-	19,348,607.45	-	-	-	19,348,607.45

结算备付金	-	-	-	-	-	295,744.17	-	-	-	295,744.17
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	376,485.65	376,485.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	105,114.660.39	105,114.660.39
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	566,898.48	566,898.48
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	3,710.34	3,710.34
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	205,338.77	205,338.77
资产总计	-	-	-	-	-	19,644,351.62	-	-	106,267.093.63	125,911.445.25
负债										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	36,043.36	36,043.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	166,172.43	166,172.43
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	27,695.39	27,695.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	218,193.76	218,193.76
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	414,560.09	414,560.09
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	862,665.03	862,665.03
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	19,644,351.62	-	-	105,404.428.60	125,048.780.22

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点		
	1.其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	49,924.19	50,052.09

	市场利率下降 25.00 bp	-49,924.19	-50,052.09
--	-----------------	------------	------------

注：本基金管理人运用 XRisk Suite 风险控制系统对本基金投资组合中的银行存款、结算备付金、债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	295,031,077.99	93.96	105,114,660.39	84.06
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	295,031,077.99	93.96	105,114,660.39	84.06

注：本基金投资组合中股票投资比例范围占基金资产净值的 60%至 95%；固定收益类资产的投资比例占基金资产的 5%至 40%；其中持有的现金和到期日在一年内的政府债券的合计比例不低于 5%。于 2012 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 其他市场变量不变，本基金业绩的比较基准上升 1%		
	1. 其他市场变量不变，本基金业绩的比较基准下降 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
	本基金业绩比较基准上升 1%	3,299,733.30	959,619.53
	本基金业绩比较基准下	-3,299,733.30	-959,619.53

	降 1%		
--	------	--	--

注：1. 本基金的整体业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 × 80% + 上证国债指数收益率 × 20%；

2. 本基金管理人运用 XRISK SUITE 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	295,031,077.99	87.93
	其中：股票	295,031,077.99	87.93
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	21,664,835.38	6.46
6	其他各项资产	18,823,048.26	5.61
7	合计	335,518,961.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,549,935.00	0.49
B	采掘业	13,550,279.56	4.32
C	制造业	142,106,073.23	45.26
C0	食品、饮料	3,233,922.50	1.03
C1	纺织、服装、皮毛	1,749,608.12	0.56
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-

C4	石油、化学、塑胶、塑料	62,219,569.65	19.81
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	4,681,200.00	1.49
C7	机械、设备、仪表	60,578,187.60	19.29
C8	医药、生物制品	9,643,585.36	3.07
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,302,516.54	0.41
E	建筑业	14,139,000.00	4.50
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	16,004,519.12	5.10
H	批发和零售贸易	24,318,380.30	7.74
I	金融、保险业	54,479,650.03	17.35
J	房地产业	1,946,305.54	0.62
K	社会服务业	24,593,418.67	7.83
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,041,000.00	0.33
	合计	295,031,077.99	93.96

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002632	道明光学	1,761,794.00	29,950,498.00	9.54
2	300072	三聚环保	2,206,155.00	26,363,552.25	8.40
3	300201	海伦哲	3,204,330.00	24,609,254.40	7.84
4	300178	腾邦国际	1,721,023.00	24,593,418.67	7.83
5	002640	百圆裤业	2,019,431.00	22,577,238.58	7.19
6	300222	科大智能	1,626,790.00	21,262,145.30	6.77
7	000602	金马集团	1,430,786.00	15,953,263.90	5.08
8	600030	中信证券	1,000,000.00	13,360,000.00	4.25
9	601318	中国平安	259,991.00	11,774,992.39	3.75
10	601166	兴业银行	602,800.00	10,060,732.00	3.20
11	601668	中国建筑	2,450,000.00	9,555,000.00	3.04
12	000157	中联重科	850,000.00	7,828,500.00	2.49
13	002390	信邦制药	400,110.00	6,241,716.00	1.99
14	000728	国元证券	512,341.00	5,707,478.74	1.82
15	601669	中国水电	1,200,000.00	4,584,000.00	1.46
16	601788	光大证券	265,859.00	3,748,611.90	1.19
17	601377	兴业证券	300,000.00	3,684,000.00	1.17

18	600031	三一重工	334,740.00	3,544,896.60	1.13
19	600702	沱牌舍得	112,250.00	3,233,922.50	1.03
20	000422	湖北宜化	289,850.00	3,220,233.50	1.03
21	600123	兰花科创	140,765.00	2,856,121.85	0.91
22	600157	永泰能源	299,998.00	2,822,981.18	0.90
23	002341	新纶科技	271,241.00	2,685,285.90	0.86
24	601699	潞安环能	122,574.00	2,683,144.86	0.85
25	600285	羚锐制药	196,812.00	2,121,633.36	0.68
26	600837	海通证券	200,000.00	2,050,000.00	0.65
27	002378	章源钨业	80,000.00	1,948,800.00	0.62
28	600395	盘江股份	113,200.00	1,926,664.00	0.61
29	601566	九牧王	108,134.00	1,749,608.12	0.56
30	000630	铜陵有色	86,000.00	1,625,400.00	0.52
31	000860	顺鑫农业	116,100.00	1,549,935.00	0.49
32	600000	浦发银行	150,000.00	1,488,000.00	0.47
33	002419	天虹商场	128,598.00	1,432,581.72	0.46
34	600642	申能股份	294,687.00	1,302,516.54	0.41
35	300147	香雪制药	112,400.00	1,280,236.00	0.41
36	002658	雪迪龙	55,800.00	1,275,030.00	0.41
37	600066	宇通客车	50,000.00	1,260,000.00	0.40
38	601857	中国石油	134,718.00	1,217,850.72	0.39
39	600048	保利地产	83,530.00	1,136,008.00	0.36
40	600585	海螺水泥	60,000.00	1,107,000.00	0.35
41	000540	中天城投	150,000.00	1,041,000.00	0.33
42	600403	大有能源	50,300.00	1,035,677.00	0.33
43	601088	中国神华	39,757.00	1,007,839.95	0.32
44	000001	平安银行	59,000.00	945,180.00	0.30
45	601818	光大银行	300,000.00	915,000.00	0.29
46	600383	金地集团	115,427.00	810,297.54	0.26
47	000581	威孚高科	25,027.00	798,361.30	0.25
48	600369	西南证券	83,500.00	745,655.00	0.24
49	002024	苏宁电器	46,400.00	308,560.00	0.10
50	002063	远光软件	3,117.00	45,695.22	0.01
51	002331	皖通科技	500.00	5,560.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值
----	------	------	----------	-----------

				比例(%)
1	601318	中国平安	61,238,087.92	48.97
2	002375	亚厦股份	45,849,169.84	36.67
3	300072	三聚环保	43,256,918.82	34.59
4	000157	中联重科	40,401,271.72	32.31
5	600031	三一重工	35,434,240.09	28.34
6	000728	国元证券	32,265,446.81	25.80
7	600030	中信证券	29,057,461.22	23.24
8	601939	建设银行	28,991,980.96	23.18
9	601166	兴业银行	28,565,482.83	22.84
10	600036	招商银行	27,643,763.55	22.11
11	300178	腾邦国际	26,898,794.01	21.51
12	002632	道明光学	24,127,341.78	19.29
13	600519	贵州茅台	23,859,333.20	19.08
14	600048	保利地产	22,971,880.52	18.37
15	601857	中国石油	22,877,282.29	18.29
16	300201	海伦哲	22,312,580.19	17.84
17	300222	科大智能	22,151,557.24	17.71
18	002325	洪涛股份	21,930,083.92	17.54
19	002482	广田股份	21,794,344.69	17.43
20	600837	海通证券	21,787,471.50	17.42
21	601288	农业银行	21,107,101.87	16.88
22	601336	新华保险	20,310,164.98	16.24
23	002589	瑞康医药	19,979,698.33	15.98
24	002024	苏宁电器	19,661,033.93	15.72
25	600016	民生银行	19,391,191.96	15.51
26	002640	百圆裤业	19,139,170.89	15.31
27	300182	捷成股份	18,842,966.87	15.07
28	002065	东华软件	17,999,341.36	14.39
29	000002	万科A	17,401,863.75	13.92
30	300170	汉得信息	16,353,069.73	13.08
31	601788	光大证券	15,653,438.34	12.52
32	002051	中工国际	15,176,802.27	12.14
33	600376	首开股份	14,981,255.84	11.98
34	600546	山煤国际	14,223,731.27	11.37
35	002116	中国海诚	14,146,326.92	11.31
36	601088	中国神华	14,056,799.68	11.24
37	600050	中国联通	13,410,226.09	10.72
38	600157	永泰能源	13,324,904.25	10.66
39	000602	金马集团	13,273,504.17	10.61
40	002341	新纶科技	12,672,863.97	10.13

41	600383	金地集团	12,500,081.72	10.00
42	600809	山西汾酒	11,841,503.30	9.47
43	000401	冀东水泥	11,534,547.47	9.22
44	000001	平安银行	11,123,308.64	8.90
45	002063	远光软件	10,971,845.28	8.77
46	601169	北京银行	10,971,039.20	8.77
47	000718	苏宁环球	10,899,830.27	8.72
48	002331	皖通科技	10,781,613.53	8.62
49	300079	数码视讯	10,737,374.87	8.59
50	000069	华侨城 A	10,723,580.76	8.58
51	600720	祁连山	10,559,994.76	8.44
52	601668	中国建筑	10,315,000.00	8.25
53	600900	长江电力	10,106,825.10	8.08
54	000558	莱茵置业	9,802,476.47	7.84
55	002469	三维工程	9,708,897.32	7.76
56	000983	西山煤电	9,505,767.77	7.60
57	601006	大秦铁路	9,502,000.00	7.60
58	600509	天富热电	9,495,333.52	7.59
59	000581	威孚高科	9,328,770.54	7.46
60	000858	五粮液	9,150,829.54	7.32
61	600702	沱牌舍得	9,023,993.52	7.22
62	601377	兴业证券	8,851,390.06	7.08
63	300168	万达信息	8,845,868.13	7.07
64	600067	冠城大通	8,681,903.95	6.94
65	601618	中国中冶	8,679,981.70	6.94
66	600582	天地科技	8,529,958.98	6.82
67	600111	包钢稀土	8,513,189.00	6.81
68	002310	东方园林	8,396,297.17	6.71
69	002144	宏达高科	8,314,903.35	6.65
70	600000	浦发银行	8,298,341.56	6.64
71	600597	光明乳业	8,234,376.94	6.58
72	002564	张化机	7,935,279.15	6.35
73	002304	洋河股份	7,897,696.81	6.32
74	600403	大有能源	7,884,738.05	6.31
75	600252	中恒集团	7,794,004.20	6.23
76	600028	中国石化	7,694,810.40	6.15
77	000970	中科三环	7,396,939.61	5.92
78	000338	潍柴动力	7,277,877.49	5.82
79	002433	太安堂	7,141,104.44	5.71
80	601717	郑煤机	7,112,610.56	5.69
81	600585	海螺水泥	7,093,318.01	5.67

82	002089	新海宜	6,961,025.05	5.57
83	600123	兰花科创	6,845,372.50	5.47
84	000596	古井贡酒	6,814,806.20	5.45
85	002378	章源钨业	6,456,340.68	5.16
86	002390	信邦制药	6,382,677.83	5.10
87	000100	TCL 集团	6,370,000.00	5.09
88	300197	铁汉生态	6,286,221.51	5.03
89	000651	格力电器	6,273,610.92	5.02
90	300147	香雪制药	6,177,176.22	4.94
91	000024	招商地产	6,106,129.00	4.88
92	300226	上海钢联	6,066,270.40	4.85
93	600019	宝钢股份	6,066,000.00	4.85
94	002285	世联地产	5,958,239.42	4.76
95	002431	棕榈园林	5,922,195.66	4.74
96	000823	超声电子	5,776,216.00	4.62
97	601886	江河幕墙	5,716,714.16	4.57
98	002450	康得新	5,419,645.87	4.33
99	600320	振华重工	5,397,355.98	4.32
100	002038	双鹭药业	5,383,628.26	4.31
101	000669	领先科技	5,285,060.00	4.23
102	600246	万通地产	5,194,248.75	4.15
103	300082	奥克股份	5,166,500.37	4.13
104	601998	中信银行	5,068,767.00	4.05
105	600375	华菱星马	5,023,318.90	4.02
106	002594	比亚迪	4,926,976.51	3.94
107	601699	潞安环能	4,831,411.00	3.86
108	000635	英力特	4,794,096.70	3.83
109	600710	常林股份	4,733,187.60	3.79
110	002535	林州重机	4,624,499.20	3.70
111	600166	福田汽车	4,621,232.41	3.70
112	300216	千山药机	4,585,639.60	3.67
113	300020	银江股份	4,459,199.99	3.57
114	600594	益佰制药	4,358,239.00	3.49
115	002140	东华科技	4,340,226.03	3.47
116	000917	电广传媒	4,284,061.99	3.43
117	300347	泰格医药	4,244,066.70	3.39
118	000425	徐工机械	4,241,692.25	3.39
119	600257	大湖股份	4,153,305.55	3.32
120	600332	广州药业	4,119,737.17	3.29
121	600426	华鲁恒升	4,017,416.00	3.21
122	600549	厦门钨业	4,010,919.12	3.21

123	601818	光大银行	3,975,000.00	3.18
124	000528	柳 工	3,953,869.82	3.16
125	600860	北人股份	3,907,987.40	3.13
126	002397	梦洁家纺	3,906,101.90	3.12
127	601669	中国水电	3,896,000.00	3.12
128	600062	华润双鹤	3,835,943.21	3.07
129	000680	山推股份	3,817,503.34	3.05
130	600887	伊利股份	3,763,802.00	3.01
131	600642	申能股份	3,761,186.00	3.01
132	002029	七 匹 狼	3,753,912.88	3.00
133	002221	东华能源	3,731,582.90	2.98
134	000430	张家界	3,680,491.60	2.94
135	000550	江铃汽车	3,679,227.00	2.94
136	600790	轻纺城	3,543,245.00	2.83
137	000861	海印股份	3,373,135.20	2.70
138	000789	江西水泥	3,321,927.00	2.66
139	600260	凯乐科技	3,283,599.59	2.63
140	601798	蓝科高新	3,219,464.00	2.57
141	000527	美的电器	3,165,162.00	2.53
142	600787	中储股份	3,137,880.00	2.51
143	600823	世茂股份	3,108,560.88	2.49
144	600261	阳光照明	3,073,413.92	2.46
145	000422	湖北宜化	3,072,611.95	2.46
146	600970	中材国际	3,021,360.29	2.42
147	000751	*ST 锌业	3,013,640.00	2.41
148	000630	铜陵有色	2,955,830.62	2.36
149	600395	盘江股份	2,905,308.00	2.32
150	002419	天虹商场	2,893,946.48	2.31
151	002299	圣农发展	2,868,367.25	2.29
152	002385	大北农	2,763,942.41	2.21
153	600288	大恒科技	2,736,034.08	2.19
154	300027	华谊兄弟	2,731,792.50	2.18
155	002664	信质电机	2,710,537.83	2.17
156	601117	中国化学	2,701,759.00	2.16
157	002496	辉丰股份	2,678,514.20	2.14
158	002226	江南化工	2,675,592.10	2.14
159	601688	华泰证券	2,649,649.35	2.12
160	000848	承德露露	2,517,724.73	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	50,700,731.14	40.54
2	002375	亚厦股份	45,911,572.19	36.71
3	000157	中联重科	33,580,049.33	26.85
4	600031	三一重工	32,951,743.40	26.35
5	600036	招商银行	31,723,335.72	25.37
6	601939	建设银行	31,473,079.02	25.17
7	300072	三聚环保	27,796,735.52	22.23
8	000728	国元证券	26,935,111.97	21.54
9	600048	保利地产	25,678,520.61	20.53
10	601166	兴业银行	25,122,292.74	20.09
11	002482	广田股份	23,739,782.94	18.98
12	600519	贵州茅台	23,739,138.90	18.98
13	000002	万科A	23,359,496.13	18.68
14	300182	捷成股份	23,177,292.00	18.53
15	002589	瑞康医药	23,115,647.87	18.49
16	002325	洪涛股份	21,658,256.76	17.32
17	601857	中国石油	21,551,101.82	17.23
18	601288	农业银行	21,444,140.00	17.15
19	601336	新华保险	20,705,955.98	16.56
20	002024	苏宁电器	20,220,535.65	16.17
21	600837	海通证券	20,116,821.73	16.09
22	300170	汉得信息	19,216,229.39	15.37
23	600016	民生银行	18,848,895.85	15.07
24	002065	东华软件	18,142,589.75	14.51
25	600030	中信证券	16,985,988.62	13.58
26	002051	中工国际	16,409,119.40	13.12
27	002116	中国海诚	15,189,368.20	12.15
28	600376	首开股份	14,926,216.10	11.94
29	600546	山煤国际	13,644,910.76	10.91
30	601088	中国神华	13,470,873.87	10.77
31	000001	平安银行	13,274,529.00	10.62
32	600050	中国联通	12,590,823.00	10.07
33	600887	伊利股份	11,935,653.81	9.54
34	601788	光大证券	11,894,435.79	9.51
35	600809	山西汾酒	11,889,786.07	9.51
36	000069	华侨城A	11,762,597.35	9.41
37	000401	冀东水泥	11,466,110.23	9.17
38	600000	浦发银行	11,389,128.96	9.11

39	600383	金地集团	11,375,022.15	9.10
40	002063	远光软件	11,300,334.05	9.04
41	002469	三维工程	11,208,519.10	8.96
42	600157	永泰能源	11,164,218.65	8.93
43	000718	苏宁环球	11,109,209.80	8.88
44	002341	新纶科技	10,929,744.38	8.74
45	601169	北京银行	10,806,725.54	8.64
46	300079	数码视讯	10,804,006.29	8.64
47	002331	皖通科技	10,687,139.84	8.55
48	600720	祁连山	10,569,682.54	8.45
49	600900	长江电力	10,340,767.04	8.27
50	600509	天富热电	10,296,365.21	8.23
51	300168	万达信息	10,192,385.16	8.15
52	000558	莱茵置业	10,166,715.59	8.13
53	601006	大秦铁路	10,057,000.00	8.04
54	000983	西山煤电	9,976,687.63	7.98
55	600187	国中水务	9,720,000.39	7.77
56	000858	五粮液	9,394,000.35	7.51
57	600111	包钢稀土	9,290,823.00	7.43
58	000581	威孚高科	9,255,461.17	7.40
59	002310	东方园林	8,726,126.76	6.98
60	600067	冠城大通	8,702,681.70	6.96
61	002564	张化机	8,538,948.70	6.83
62	002144	宏达高科	8,506,211.61	6.80
63	601618	中国中冶	8,438,981.70	6.75
64	600028	中国石化	8,400,326.00	6.72
65	600597	光明乳业	8,357,054.29	6.68
66	002304	洋河股份	8,220,650.82	6.57
67	600582	天地科技	8,150,253.27	6.52
68	300216	千山药机	7,724,130.65	6.18
69	002433	太安堂	7,721,298.29	6.17
70	000596	古井贡酒	7,488,296.92	5.99
71	000970	中科三环	7,473,837.55	5.98
72	600252	中恒集团	7,276,998.80	5.82
73	600403	大有能源	7,030,892.95	5.62
74	000338	潍柴动力	6,957,912.13	5.56
75	000024	招商地产	6,929,771.94	5.54
76	300222	科大智能	6,836,805.00	5.47
77	002089	新海宜	6,806,308.93	5.44
78	601717	郑煤机	6,777,962.32	5.42
79	002485	希努尔	6,705,090.17	5.36

80	000651	格力电器	6,591,544.59	5.27
81	000100	TCL 集团	6,458,875.55	5.17
82	000823	超声电子	6,402,021.78	5.12
83	300197	铁汉生态	6,345,437.10	5.07
84	600585	海螺水泥	6,265,514.05	5.01
85	600019	宝钢股份	6,185,500.00	4.95
86	002285	世联地产	6,054,472.11	4.84
87	601886	江河幕墙	5,980,181.16	4.78
88	002431	棕榈园林	5,780,615.21	4.62
89	600702	沱牌舍得	5,748,835.11	4.60
90	002038	双鹭药业	5,710,338.81	4.57
91	002450	康得新	5,707,406.16	4.56
92	601998	中信银行	5,655,000.00	4.52
93	000669	领先科技	5,611,007.90	4.49
94	300226	上海钢联	5,554,519.43	4.44
95	300147	香雪制药	5,400,476.91	4.32
96	601377	兴业证券	5,397,727.90	4.32
97	002535	林州重机	5,261,332.64	4.21
98	300082	奥克股份	5,201,612.70	4.16
99	600694	大商股份	5,145,735.88	4.11
100	600246	万通地产	5,117,838.29	4.09
101	600320	振华重工	5,079,072.52	4.06
102	600375	华菱星马	5,037,882.13	4.03
103	002594	比亚迪	5,036,185.91	4.03
104	300178	腾邦国际	4,983,750.90	3.99
105	000635	英力特	4,850,270.28	3.88
106	300347	泰格医药	4,778,933.72	3.82
107	600594	益佰制药	4,666,870.63	3.73
108	002378	章源钨业	4,605,267.68	3.68
109	000917	电广传媒	4,590,812.00	3.67
110	600549	厦门钨业	4,477,601.14	3.58
111	600461	洪城水业	4,436,520.72	3.55
112	600332	广州药业	4,435,430.71	3.55
113	600062	华润双鹤	4,316,693.53	3.45
114	600710	常林股份	4,279,044.04	3.42
115	600860	北人股份	4,277,057.80	3.42
116	600166	福田汽车	4,275,960.67	3.42
117	300020	银江股份	4,249,895.56	3.40
118	600123	兰花科创	4,244,236.00	3.39
119	002221	东华能源	4,182,955.64	3.35
120	600257	大湖股份	4,151,936.49	3.32

121	300119	瑞普生物	4,106,145.22	3.28
122	000528	柳 工	4,100,604.80	3.28
123	002140	东华科技	4,094,771.03	3.27
124	000425	徐工机械	3,945,475.96	3.16
125	000430	张家界	3,879,796.00	3.10
126	600426	华鲁恒升	3,818,291.00	3.05
127	002029	七 匹 狼	3,771,991.96	3.02
128	002397	梦洁家纺	3,721,434.57	2.98
129	000680	山推股份	3,705,515.04	2.96
130	600260	凯乐科技	3,574,091.62	2.86
131	000789	江西水泥	3,559,297.33	2.85
132	000861	海印股份	3,438,037.52	2.75
133	601818	光大银行	3,414,000.00	2.73
134	000550	江铃汽车	3,368,033.16	2.69
135	600790	轻纺城	3,338,204.52	2.67
136	600823	世茂股份	3,308,572.41	2.65
137	601798	蓝科高新	3,227,998.00	2.58
138	000527	美的电器	3,063,243.00	2.45
139	000422	湖北宜化	3,046,111.74	2.44
140	002441	众业达	2,925,923.00	2.34
141	600015	华夏银行	2,914,868.00	2.33
142	600288	大恒科技	2,834,428.10	2.27
143	002503	搜于特	2,833,333.32	2.27
144	601117	中国化学	2,812,571.00	2.25
145	002299	圣农发展	2,739,606.19	2.19
146	600787	中储股份	2,736,363.50	2.19
147	002226	江南化工	2,734,938.25	2.19
148	601668	中国建筑	2,704,000.00	2.16
149	600705	中航投资	2,700,000.00	2.16
150	600261	阳光照明	2,696,289.42	2.16
151	000751	*ST 锌业	2,682,124.53	2.14
152	600970	中材国际	2,680,234.95	2.14
153	000848	承德露露	2,670,299.25	2.14
154	601699	潞安环能	2,666,653.00	2.13
155	600801	华新水泥	2,666,461.49	2.13
156	002385	大北农	2,661,759.74	2.13
157	000671	阳 光 城	2,653,530.08	2.12
158	002664	信质电机	2,651,051.76	2.12
159	600362	江西铜业	2,650,341.00	2.12
160	300027	华谊兄弟	2,648,395.37	2.12
161	600642	申能股份	2,635,952.16	2.11

162	601688	华泰证券	2,573,645.62	2.06
163	600881	亚泰集团	2,518,190.00	2.01

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,833,606,707.43
卖出股票的收入（成交）总额	1,708,756,943.06

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本报告期末本基金投资的前十名证券没有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。

8.9.2 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	962,421.31
2	应收证券清算款	16,807,798.75
3	应收股利	-

4	应收利息	6,847.78
5	应收申购款	1,045,980.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,823,048.26

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000602	金马集团	15,953,263.90	5.08	大股东筹划重大事项

8.9.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
4,585	54,333.65	101,400,215.51	40.70%	147,719,575.68	59.30%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	3,269,723.18	1.31%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 10-50 万份。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年7月21日)基金份额总额	347,740,551.58
本报告期期初基金份额总额	127,903,198.27
本报告期基金总申购份额	559,501,605.11
减：本报告期基金总赎回份额	438,285,012.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	249,119,791.19

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2013年1月18日，因工作调动，孙枝来先生辞去新华基金管理有限公司总经理一职。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本年度本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所情况。报告年度应支付给其报酬情况是80000元人民币。审计年限为1年。自2010年至2012年，国富浩华会计师事务所为本基金连续提供3年审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	606,453,680.61	17.12%	512,952.58	17.15%	-
长江证券	1	531,944,313.62	15.02%	460,342.77	15.39%	-
国元证券	1	494,776,945.12	13.97%	351,490.55	11.75%	-
广发证券	1	491,068,080.68	13.86%	420,226.12	14.05%	-
海通证券	1	385,945,985.40	10.90%	334,303.97	11.18%	-
中信证券	1	370,163,780.12	10.45%	330,380.97	11.05%	-
民族证券	1	278,802,757.00	7.87%	251,644.40	8.41%	-
招商证券	1	272,910,710.42	7.70%	235,400.94	7.87%	-
国信证券	1	50,448,639.55	1.42%	42,881.16	1.43%	-
新时代证券	1	30,628,629.41	0.86%	26,244.13	0.88%	-
中信万通	1	29,117,168.56	0.82%	24,749.66	0.83%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金报告期内共租用11个交易席位，其中新增国元证券上海证券交易所席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、中央交易室负责落实交易量的实际分配工作。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		股指期货交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	37,000,000.00	40.22%	-	-	-	-
中信证券	-	-	15,000,000.00	16.30%	-	-	-	-
民族证券	-	-	40,000,000.00	43.48%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行有限责任公司网上基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-1-4

2	新华基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司网上基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-1-4
3	新华基金管理有限公司关于旗下基金 2011 年年度最后一个自然日(2011 年 12 月 31 日) 的资产净值公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-1-4
4	新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-1-11
5	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2011 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-1-18
6	新华行业周期轮换股票型证券投资基金招募说明书(更新)全文	公司网站	2012-3-3
7	新华行业周期轮换股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-3-3
8	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金在广发证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务并参加定投业务及网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-3-22
9	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2011 年年度报告(摘要)	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-3-27
10	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2011 年年度报告(正文)	公司网站	2012-3-27
11	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-3-31
12	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司网上基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-4-7
13	新华基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-4-12
14	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-4-24
15	新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-4-26
16	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司手机	中国证券报、证券时报、上海证券报、公	2012-4-28

	银行基金申购费率优惠活动的公告	司网站	
17	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为代销机构、开通基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-5-9
18	新华基金管理有限公司关于旗下基金参加重庆银行个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-5-19
19	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-5-21
20	新华基金管理有限公司旗下部分基金增加中信证券（浙江）有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-6-12
21	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-6-28
22	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信银行股份有限公司电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-6-29
23	新华行业周期轮换股票型证券投资基金非货币市场基金半年度最后一日净值公告（非分类）	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-7-2
24	新华基金管理有限公司关于旗下基金增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构并参加相关交易费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-7-18
25	新华行业周期轮换股票型证券投资基金2012年第2季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-7-19
26	新华基金管理有限公司关于旗下基金增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-7-30
27	新华优选成长股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-7-31
28	新华基金管理有限公司关于旗下基金在华西证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-8-3
29	关于新华基金管理有限公司基金经理购买本人所管理基金基金份额的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-8-13
30	新华行业周期轮换股票型证券投资基金2012年半年度报告（正文）	公司网站	2012-8-24

31	新华行业周期轮换股票型证券投资基金2012年半年度报告（摘要）	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-8-24
32	新华行业周期轮换股票型证券投资基金招募说明书（更新）全文	公司网站	2012-9-3
33	新华行业周期轮换股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-9-3
34	新华基金管理有限公司关于旗下基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加相关交易费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-9-4
35	关于旗下基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构并参加相关交易费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-9-14
36	新华基金管理有限公司关于旗下基金通过农行卡进行网上直销费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-9-19
37	关于旗下基金增加深圳众禄基金销售有限公司为代销机构并参加相关交易费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-9-19
38	新华行业周期轮换股票型证券投资基金2012年第3季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-10-24
39	新华基金管理有限公司关于增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-11-3
40	新华基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-11-12
41	新华基金管理有限公司关于开通网上交易网上下单汇款交易业务及开展费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-11-17
42	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中信建投证券股份有限公司定期定额投资业务及网银渠道基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-12-28

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准新华行业周期轮换股票型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华行业周期轮换股票型证券投资基金之法律意见书
- (三)《新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金合同》
- (四)《新华行业周期轮换股票型证券投资基金托管协议》
- (五)《新华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (六)《新华行业周期轮换股票型证券投资基金招募说明书》
- (七)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八)基金托管人业务资格批件及营业执照

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过基金管理人网站查阅。

新华基金管理有限公司

二〇一三年三月三十日