
新华行业周期轮换股票型证券投资基金
2013 年年度报告
2013 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：二〇一四年三月二十八日

§ 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 2014 年 3 月 20 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 2013 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	10
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投资运作合规守信、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	15
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	38
8.1	期末基金资产组合情况	38
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	40
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49

8.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
8.11	投资组合报告附注	50
§9	基金份额持有人信息	51
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
§10	开放式基金份额变动	51
§11	重大事件揭示	52
11.1	基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
11.4	基金投资策略的改变	52
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
11.8	其他重大事件	55
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§13	备查文件目录	57
13.1	备查文件目录	57
13.2	存放地点	57
13.3	查阅方式	58

§ 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	370,482,613.54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	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	93,004,612.60	18,987,946.00	-6,241,304.64
本期利润	57,179,093.66	58,404,736.47	-20,540,865.46
加权平均基金份额本期利润	0.1527	0.3608	-0.1548
本期加权平均净值利润率	11.36%	33.19%	-14.14%
本期基金份额净值增长率	12.70%	28.83%	-14.51%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	155,590,578.15	44,198,443.22	-2,854,418.05
期末可供分配基金份额利润	0.4200	0.1774	-0.0223
期末基金资产净值	526,073,191.69	314,008,819.07	125,048,780.22
期末基金份额净值	1.420	1.260	0.978
3.1.3 累计期末指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	42.00%	26.00%	-2.20%

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①	份额净值增长率标准差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	-3.40%	0.87%	-2.45%	0.90%	-0.95%	-0.03%
过去六个月	11.64%	1.11%	5.06%	1.03%	6.58%	0.08%
过去一年	12.70%	1.16%	-5.30%	1.11%	18.00%	0.05%
过去三年	24.13%	1.16%	-18.57%	1.06%	42.70%	0.10%
自基金合同生效起至今	42.00%	1.16%	-9.29%	1.09%	51.29%	0.07%

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。

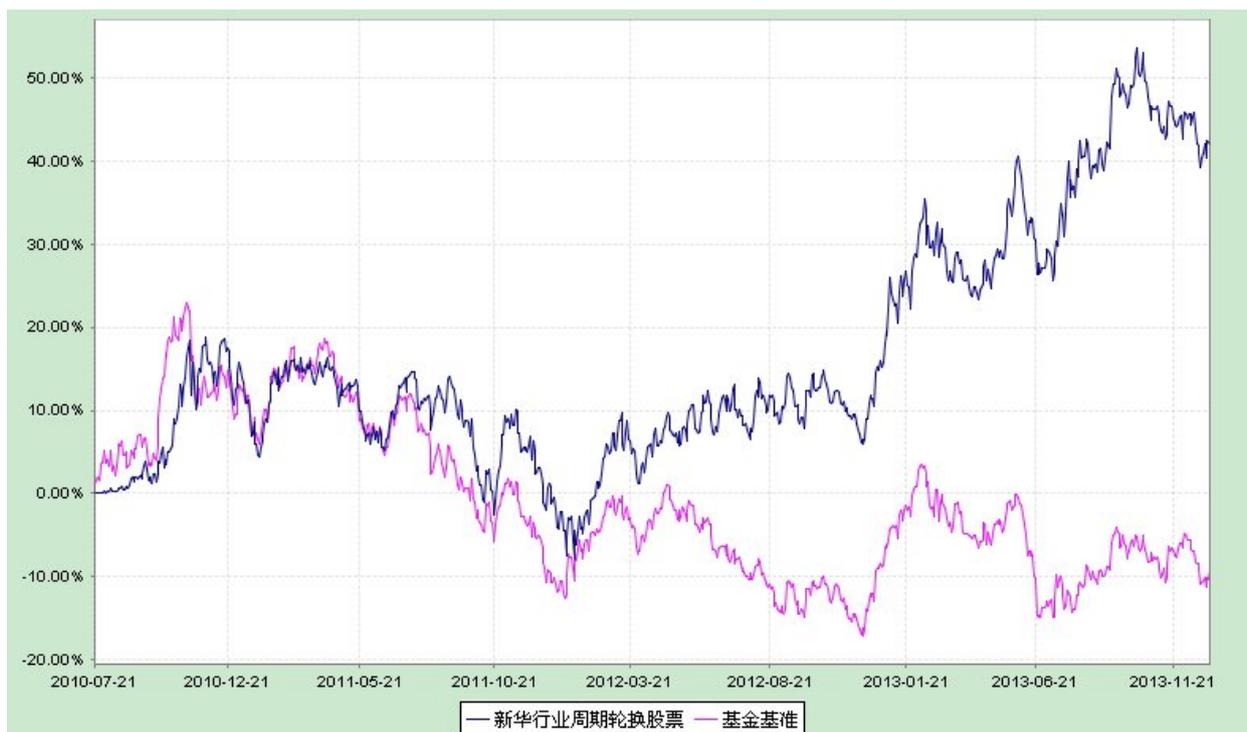
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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 2013 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

基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



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 2013 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 2013 年 12 月 31 日，新华基金管理有限公司旗下管理着十四只开放式基金，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、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、新华纯债添利债券发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航股票型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华信用增益债券型证券投资基金和新华壹诺宝货币市场基金。

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		
何潇	本基金基金经理，新华优选成长股票型证券投资基金基金经理、新华行业灵活配置混合型证券投资基金	2011-12-01	-	6	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，新华优选成长股票型证券投资基金基金经理，新华行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

	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合规守信情况的说明

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

2013 年，中国经济依然处在结构调整的过程中，部分中上游行业都处在产能过剩和结构调整的阵痛之中，微观上很多企业在营收和利润继续保持高速增长上面临着很大的挑战。

在结构调整的过程中，信息消费、传媒和电子行业保持了良好的增长势头，这些行业跟经济结构调整有关，同时也跟居民可支配收入的不断增长有关，股票市场上这些行业也表现的非常强劲。

本报告期内，本基金采取了审慎的原则，通过自下而上精选个股策略，行业方面，环保和 TMT 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 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.420 元，本报告期份额净值增长率为 12.70%，同期比较基准的增长率为-5.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年，中国经济依然会保持在一个合理的增速范围，结构调整依然会继续进行，未来相对看好环保、垄断行业的破冰和国企改革相关的机会。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：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 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：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 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；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 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

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；

-
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
 - ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
 - ④ 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

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 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；
- ③ 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

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 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

本报告期内，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投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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 2013 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

2014 年 3 月 20 日

§ 6 审计报告

瑞华审字[2014]37100014 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（以下简称新华行业基金）财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 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

一、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，上述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，公允反映了新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况。

瑞华会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 李荣坤 张吉范
北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层
2014-03-26

§ 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：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2013年12月31日	2012年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	64,178,848.55	19,969,674.46
结算备付金		15,961,190.92	1,695,160.92
存出保证金		931,026.63	962,421.31
交易性金融资产	7.4.7.2	332,228,021.15	295,031,077.99
其中：股票投资		332,228,021.15	295,031,077.99
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	7.4.7.3	157,600,000.00	-
应收证券清算款		6,090,000.00	16,807,798.75
应收利息	7.4.7.4	13,661.00	6,847.78
应收股利		-	-
应收申购款		388,405.38	1,045,980.42
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		577,391,153.63	335,518,961.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		45,851,195.25	10,275,807.89
应付赎回款		763,593.27	8,653,362.34
应付管理人报酬		562,253.54	345,002.97
应付托管费		93,708.94	57,500.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.5	3,664,675.78	1,435,174.11
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	382,535.16	743,294.74
负债合计		51,317,961.94	21,510,142.56
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.7	370,482,613.54	249,119,791.19
未分配利润	7.4.7.8	155,590,578.15	64,889,027.88
所有者权益合计		526,073,191.69	314,008,819.07
负债和所有者权益总计		577,391,153.63	335,518,961.63

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.420 元，基金份额总额 370,482,613.54 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12 月31日
一、收入		77,580,315.13	67,092,934.03
1.利息收入	7.4.7.9	2,661,866.16	333,575.30
其中：存款利息收入		802,563.58	301,877.70
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		1,859,302.58	31,697.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		108,908,462.44	26,757,224.05
其中：股票投资收益	7.4.7.10	104,327,134.88	25,649,862.76
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	7.4.7.11	4,581,327.56	1,107,361.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	-35,825,518.94	39,416,790.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	1,835,505.47	585,344.21
减：二、费用		20,401,221.47	8,688,197.56
1. 管理人报酬		7,587,167.03	2,626,310.77
2. 托管费		1,264,527.80	437,718.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.14	11,146,244.45	5,219,473.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.15	403,282.19	404,694.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		57,179,093.66	58,404,736.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填		57,179,093.66	58,404,736.47

列			
---	--	--	--

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：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	249,119,791.19	64,889,027.88	314,008,819.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,179,093.66	57,179,093.66
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）	121,362,822.35	33,522,456.61	154,885,278.96
其中：1.基金申购款	1,241,750,420.01	398,462,452.95	1,640,212,872.96
2.基金赎回款	-1,120,387,597.66	-364,939,996.34	-1,485,327,594.00
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）	370,482,613.54	155,590,578.15	526,073,191.69
项目	上年度可比期间 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

报表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：张宗友，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,存续期不限定,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2014年3月26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2012年11月16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 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 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
活期存款	64,178,848.55	19,969,674.46
定期存款	-	-
存款期限1月以内	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	64,178,848.55	19,969,674.46

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	335,014,201.35	332,228,021.15	-2,786,180.20
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	335,014,201.35	332,228,021.15	-2,786,180.20
项目	上年度末 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

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	157,600,000.00	-
合计	157,600,000.00	-
项目	上年度末 2012年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
合计	-	-

7.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应收活期存款利息	6,059.60	6,084.88
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	7,601.40	762.90
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	13,661.00	6,847.78

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

7.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,664,675.78	1,435,174.11
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,664,675.78	1,435,174.11

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,535.16	28,501.50
应付后端申购费	-	-
债券利息税	-	-

预提费用	380,000.00	714,793.24
银行手续费	-	-
合计	382,535.16	743,294.74

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	249,119,791.19	249,119,791.19
本期申购	1,241,750,420.01	1,241,750,420.01
本期赎回（以“-”号填列）	-1,120,387,597.66	-1,120,387,597.66
本期末	370,482,613.54	370,482,613.54

7.4.7.8 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	44,198,443.22	20,690,584.66	64,889,027.88
本期利润	93,004,612.60	-35,825,518.94	57,179,093.66
本期基金份额交易产生的变动数	30,383,040.87	3,139,415.74	33,522,456.61
其中：基金申购款	346,760,688.20	51,701,764.75	398,462,452.95
基金赎回款	-316,377,647.33	-48,562,349.01	-364,939,996.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	167,586,096.69	-11,995,518.54	155,590,578.15

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
	活期存款利息收入	698,523.78
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	104,039.80	19,944.89
其他	-	-
合计	802,563.58	301,877.70

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
卖出股票成交总额	3,784,221,677.99	1,708,756,943.06
减：卖出股票成本总额	3,679,894,543.11	1,683,107,080.30
买卖股票差价收入	104,327,134.88	25,649,862.76

7.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,581,327.56	1,107,361.29
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,581,327.56	1,107,361.29

7.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
1.交易性金融资产	-35,825,518.94	39,416,790.47
——股票投资	-35,825,518.94	39,416,790.47
——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	-35,825,518.94	39,416,790.47

7.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
基金赎回费收入	1,657,688.80	585,152.81
其他	32,335.12	-
转换费收入	145,481.55	191.40
合计	1,835,505.47	585,344.21

注：根据 2012 年 7 月下发的《关于降低证券、期货市场监管费手续费标准等问题的通知》(发改价格[2012]2119 号)规定,自 2012 年 1 月 1 日期对股票交易监管费用按交易额的 0.04%调整为 0.02%;对基金和债券免收交易监管费;其他指中登公司退还的 2012 年 1 月至 2012 年 8 月期间多收取的、已确认为基金资产的交易监管费。

7.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
交易所市场交易费用	11,146,244.45	5,219,473.95
银行间市场交易费用	-	-
合计	11,146,244.45	5,219,473.95

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	299,068.84	300,369.00
债券托管账户维护费	9,000.00	16,500.00
汇划手续费	15,213.35	7,825.33
其他	-	-
合计	403,282.19	404,694.33

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 2013 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

截至本报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

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
恒泰证券股份有限公司	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：本报告期内，本公司原有股东陕西蓝潼投资有限公司将其持有的 30% 股权、上海大众环境产业有限公司将其持有的 13.75% 股权转让给恒泰证券股份有限公司，并已完成证监会审批和工商变更登记手续。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
恒泰证券	867,976,211.84	11.52%	-	-

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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
恒泰证券	616,611.83	9.55%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
恒泰证券	-	-	-	-

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,587,167.03	2,626,310.77
其中：支付销售机构的客户维护费	2,269,986.39	1,229,132.42

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。

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
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,264,527.80	437,718.51

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固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固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	
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	2012年1月1日至2012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	64,178,848.55	698,523.78	19,969,674.46	281,932.81

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（2013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

截至报告期期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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同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 2013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	-	-	-	-	-	64,178,84 8.55	-	-	-	64,178,84 8.55
结算备付 金	-	-	-	-	-	15,961,19 0.92	-	-	-	15,961,19 0.92
存出保证 金	-	-	-	-	-	931,026.6 3	-	-	-	931,026.6 3
交易性金 融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	332,228,0 21.15	332,228,0 21.15
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-	157,600,0 00.00	-	-	-	157,600,0 00.00
应收证券	-	-	-	-	-	-	-	-	6,090,000	6,090,000

清算款									.00	.00
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	13,661.00	13,661.00
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	388,405.38	388,405.38
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-	-	238,671,066.10	-	-	338,720,087.53	577,391,153.63
负债										
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	45,851,195.25	45,851,195.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	763,593.27	763,593.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	562,253.54	562,253.54
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	93,708.94	93,708.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	3,664,675.78	3,664,675.78
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	382,535.16	382,535.16
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	51,317,961.94	51,317,961.94
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	238,671,066.10	-	-	287,402,125.59	526,073,191.69
上年度末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										
资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	-	-	-	-	-	19,969,674.46	-	-	-	19,969,674.46
结算备付金	-	-	-	-	-	1,695,160.92	-	-	-	1,695,160.92

存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	962,421.31	962,421.31
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

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	
	2.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：人民币万元）

		本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
	市场利率上升 25.00 bp	596,677.67	49,924.19
	市场利率下降 25.00 bp	-596,677.67	-49,924.19

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银行存款、结算备付金、债券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 2013年12月31日		上年度末 2012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	332,228,021.15	63.15	295,031,077.99	93.96
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	332,228,021.15	63.15	295,031,077.99	93.96

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 2013 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,本基金业绩比较基准上升 1%		
	2.其他市场变量不变,本基金业绩比较基准下降 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：人民币万元）	
		本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日

本基金业绩比较基准上升 1%	2,744,202.76	3,299,733.30
本基金业绩比较基准下降 1%	-2,744,202.76	-3,299,733.30

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	332,228,021.15	57.54
	其中：股票	332,228,021.15	57.54
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	157,600,000.00	27.30
	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	80,140,039.47	13.88
6	其他各项资产	7,423,093.01	1.29
7	合计	577,391,153.63	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	7,937,521.68	1.51
B	采矿业	20,716,709.03	3.94
C	制造业	177,886,990.47	33.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	12,766,400.00	2.43
F	批发和零售业	13,221,746.80	2.51
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	48,976,643.15	9.31
K	房地产业	46,292,178.82	8.80
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	4,429,831.20	0.84
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	332,228,021.15	63.15

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	600759	正和股份	4,005,800	31,926,226.00	6.07
2	002226	江南化工	1,704,852	24,157,752.84	4.59
3	600104	上汽集团	1,442,372	20,395,140.08	3.88
4	601939	建设银行	4,662,942	19,304,579.88	3.67
5	601288	农业银行	7,135,644	17,696,397.12	3.36
6	000939	凯迪电力	2,854,859	17,614,480.03	3.35
7	002594	比亚迪	448,700	16,907,016.00	3.21
8	600315	上海家化	346,257	14,622,433.11	2.78
9	002157	正邦科技	1,705,289	13,267,148.42	2.52
10	601117	中国化学	1,595,800	12,766,400.00	2.43
11	002221	东华能源	1,112,836	11,606,879.48	2.21
12	600803	威远生化	898,125	11,145,731.25	2.12
13	600867	通化东宝	669,803	10,254,683.93	1.95
14	300285	国瓷材料	308,153	9,774,613.16	1.86
15	002557	洽洽食品	395,139	9,538,655.46	1.81
16	601238	广汽集团	1,005,158	8,282,501.92	1.57
17	000024	招商地产	382,570	7,949,804.60	1.51
18	002477	雏鹰农牧	767,652	7,937,521.68	1.51

19	600062	华润双鹤	307,883	6,887,342.71	1.31
20	601988	中国银行	2,565,419	6,721,397.78	1.28
21	000876	新希望	466,178	6,680,330.74	1.27
22	600887	伊利股份	150,016	5,862,625.28	1.11
23	600109	国金证券	309,621	5,254,268.37	1.00
24	002241	歌尔声学	132,295	4,640,908.60	0.88
25	000826	桑德环境	127,294	4,429,831.20	0.84
26	002475	立讯精密	122,600	4,097,292.00	0.78
27	000860	顺鑫农业	253,955	3,900,748.80	0.74
28	601588	北辰实业	1,421,199	3,823,025.31	0.73
29	300164	通源石油	187,900	3,102,229.00	0.59
30	600085	同仁堂	140,233	3,000,986.20	0.57
31	000402	金融街	495,817	2,593,122.91	0.49
32	000816	江淮动力	416,650	1,824,927.00	0.35
33	000501	鄂武商A	126,557	1,614,867.32	0.31
34	000970	中科三环	123,185	1,581,695.40	0.30
35	300214	日科化学	116,589	1,064,457.57	0.20

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	600048	保利地产	109,483,244.93	34.87
2	601288	农业银行	93,474,792.00	29.77
3	601939	建设银行	84,721,246.76	26.98
4	600837	海通证券	70,006,359.65	22.29
5	601318	中国平安	65,775,816.74	20.95
6	600383	金地集团	63,703,992.01	20.29
7	601166	兴业银行	58,130,444.52	18.51
8	601668	中国建筑	57,373,138.00	18.27
9	002226	江南化工	51,223,551.79	16.31
10	002431	棕榈园林	50,051,548.74	15.94
11	002024	苏宁云商	49,174,989.84	15.66
12	300193	佳士科技	48,595,540.29	15.48
13	000001	平安银行	47,310,086.63	15.07
14	600036	招商银行	46,480,895.02	14.80
15	300052	中青宝	45,209,907.85	14.40
16	600157	永泰能源	44,489,188.04	14.17

17	002482	广田股份	42,040,431.12	13.39
18	600104	上汽集团	41,783,154.85	13.31
19	000069	华侨城A	40,969,364.51	13.05
20	601699	潞安环能	40,548,542.61	12.91
21	000002	万科A	39,970,411.16	12.73
22	601238	广汽集团	39,715,342.27	12.65
23	000024	招商地产	39,201,345.97	12.48
24	601886	江河创建	37,405,314.53	11.91
25	000428	华天酒店	34,027,064.06	10.84
26	600759	正和股份	31,854,736.39	10.14
27	600000	浦发银行	31,726,083.20	10.10
28	300039	上海凯宝	29,546,426.89	9.41
29	600060	海信电器	28,946,227.01	9.22
30	002557	洽洽食品	27,250,270.07	8.68
31	300154	瑞凌股份	26,399,977.91	8.41
32	000860	顺鑫农业	26,227,027.75	8.35
33	002628	成都路桥	26,018,051.47	8.29
34	600867	通化东宝	25,894,612.72	8.25
35	002649	博彦科技	25,890,054.35	8.25
36	300285	国瓷材料	25,031,671.61	7.97
37	600518	康美药业	24,385,374.92	7.77
38	000402	金融街	23,957,795.69	7.63
39	002650	加加食品	23,738,465.00	7.56
40	601628	中国人寿	23,719,748.94	7.55
41	002612	朗姿股份	23,564,460.23	7.50
42	600880	博瑞传播	22,401,946.81	7.13
43	600270	外运发展	22,170,260.37	7.06
44	600373	中文传媒	21,934,344.97	6.99
45	600016	民生银行	21,692,326.52	6.91
46	300110	华仁药业	21,421,024.68	6.82
47	601377	兴业证券	21,209,951.80	6.75
48	000157	中联重科	21,176,575.37	6.74
49	000937	冀中能源	20,879,447.58	6.65
50	002221	东华能源	20,878,340.85	6.65
51	600889	南京化纤	20,373,873.62	6.49
52	002317	众生药业	20,333,473.99	6.48
53	000525	红太阳	20,072,476.40	6.39
54	600809	山西汾酒	20,065,865.02	6.39
55	601117	中国化学	19,948,219.00	6.35
56	601788	光大证券	19,911,092.56	6.34
57	000876	新希望	19,368,193.26	6.17

58	601088	中国神华	19,147,258.39	6.10
59	000826	桑德环境	18,808,227.87	5.99
60	600030	中信证券	18,532,652.35	5.90
61	300178	腾邦国际	18,485,086.24	5.89
62	002104	恒宝股份	18,234,282.50	5.81
63	600162	香江控股	18,057,589.80	5.75
64	002331	皖通科技	17,862,066.21	5.69
65	000939	凯迪电力	17,847,288.62	5.68
66	300125	易世达	17,511,287.09	5.58
67	300006	莱美药业	17,483,763.10	5.57
68	002594	比亚迪	17,191,138.77	5.47
69	601989	中国重工	17,150,484.00	5.46
70	002100	天康生物	16,697,918.70	5.32
71	600511	国药股份	16,435,284.29	5.23
72	002604	龙力生物	16,413,270.68	5.23
73	002437	誉衡药业	16,152,820.20	5.14
74	600352	浙江龙盛	16,148,351.06	5.14
75	600067	冠城大通	15,765,346.50	5.02
76	600062	华润双鹤	15,653,274.01	4.98
77	002375	亚厦股份	15,501,564.78	4.94
78	002219	恒康医疗	15,377,893.84	4.90
79	000338	潍柴动力	15,373,679.31	4.90
80	002313	日海通讯	15,256,324.85	4.86
81	601328	交通银行	15,186,877.17	4.84
82	600123	兰花科创	15,166,096.42	4.83
83	601336	新华保险	15,072,967.58	4.80
84	600085	同仁堂	14,548,713.52	4.63
85	600315	上海家化	14,503,528.64	4.62
86	002630	华西能源	14,293,055.32	4.55
87	002396	星网锐捷	14,276,590.21	4.55
88	000917	电广传媒	14,214,217.10	4.53
89	600684	珠江实业	14,056,101.64	4.48
90	601601	中国太保	14,055,579.91	4.48
91	000401	冀东水泥	14,052,532.35	4.48
92	600805	悦达投资	14,014,551.40	4.46
93	002503	搜于特	13,900,709.46	4.43
94	000538	云南白药	13,834,554.99	4.41
95	300164	通源石油	13,763,474.19	4.38
96	002398	建研集团	13,533,152.71	4.31
97	600702	沱牌舍得	13,513,833.01	4.30
98	002157	正邦科技	13,378,186.28	4.26

99	000423	东阿阿胶	12,578,846.69	4.01
100	601169	北京银行	12,384,886.77	3.94
101	000501	鄂武商 A	12,217,237.55	3.89
102	600252	中恒集团	12,205,984.18	3.89
103	000669	金鸿能源	12,040,200.63	3.83
104	600812	华北制药	11,936,334.00	3.80
105	300079	数码视讯	11,901,018.01	3.79
106	002547	春兴精工	11,809,498.74	3.76
107	300266	兴源过滤	11,760,519.04	3.75
108	600031	三一重工	11,640,007.09	3.71
109	600694	大商股份	11,636,354.69	3.71
110	601988	中国银行	11,626,841.00	3.70
111	600429	三元股份	11,607,515.89	3.70
112	002440	闰土股份	11,553,186.33	3.68
113	600261	阳光照明	11,387,475.32	3.63
114	600859	王府井	11,321,049.40	3.61
115	000983	西山煤电	11,304,821.44	3.60
116	000718	苏宁环球	11,230,880.21	3.58
117	600803	威远生化	11,220,574.47	3.57
118	000919	金陵药业	11,057,595.20	3.52
119	600585	海螺水泥	10,683,857.67	3.40
120	300251	光线传媒	10,676,594.35	3.40
121	601010	文峰股份	10,458,449.41	3.33
122	000789	江西水泥	10,433,032.17	3.32
123	002663	普邦园林	10,380,380.32	3.31
124	300194	福安药业	10,374,071.96	3.30
125	300030	阳普医疗	10,325,967.04	3.29
126	000975	银泰资源	10,324,310.86	3.29
127	000043	中航地产	10,251,359.73	3.26
128	002118	紫鑫药业	9,938,525.94	3.17
129	600894	广日股份	9,906,813.47	3.15
130	002340	格林美	9,879,355.84	3.15
131	600409	三友化工	9,707,307.38	3.09
132	002563	森马服饰	9,698,552.59	3.09
133	603008	喜临门	9,621,008.32	3.06
134	600118	中国卫星	9,468,060.50	3.02
135	002311	海大集团	9,374,406.81	2.99
136	600028	中国石化	9,251,165.00	2.95
137	600318	巢东股份	9,129,925.16	2.91
138	000100	TCL 集团	9,100,400.00	2.90
139	600111	包钢稀土	9,099,711.18	2.90

140	600802	福建水泥	9,081,992.36	2.89
141	600887	伊利股份	9,065,747.11	2.89
142	600011	华能国际	9,061,347.38	2.89
143	600881	亚泰集团	8,933,898.16	2.85
144	600577	精达股份	8,916,168.95	2.84
145	300170	汉得信息	8,885,683.71	2.83
146	600731	湖南海利	8,712,013.70	2.77
147	002325	洪涛股份	8,698,003.54	2.77
148	002410	广联达	8,683,623.51	2.77
149	002010	传化股份	8,510,533.43	2.71
150	000417	合肥百货	8,385,307.11	2.67
151	002378	章源钨业	8,346,934.99	2.66
152	601857	中国石油	8,195,634.09	2.61
153	002477	雏鹰农牧	8,164,566.20	2.60
154	000759	中百集团	8,103,715.83	2.58
155	300026	红日药业	7,968,582.27	2.54
156	600337	美克股份	7,898,982.16	2.52
157	600276	恒瑞医药	7,755,454.00	2.47
158	300214	日科化学	7,698,654.71	2.45
159	600795	国电电力	7,648,586.30	2.44
160	002638	勤上光电	7,554,994.54	2.41
161	600835	上海机电	7,512,097.95	2.39
162	002405	四维图新	7,504,636.20	2.39
163	600668	尖峰集团	7,498,214.39	2.39
164	002287	奇正藏药	7,292,089.33	2.32
165	002273	水晶光电	7,197,113.28	2.29
166	600125	铁龙物流	7,124,834.00	2.27
167	000590	紫光古汉	7,109,093.60	2.26
168	300072	三聚环保	7,075,802.57	2.25
169	600166	福田汽车	6,930,005.00	2.21
170	000960	锡业股份	6,902,649.20	2.20
171	002042	华孚色纺	6,791,704.54	2.16
172	300291	华录百纳	6,774,090.00	2.16
173	600519	贵州茅台	6,674,384.75	2.13
174	600804	鹏博士	6,616,721.43	2.11
175	000987	广州友谊	6,590,188.18	2.10
176	300301	长方照明	6,503,438.66	2.07
177	300031	宝通带业	6,494,998.90	2.07
178	002035	华帝股份	6,412,049.85	2.04
179	002603	以岭药业	6,400,072.32	2.04

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	600048	保利地产	105,277,633.17	33.53
2	600837	海通证券	77,079,965.64	24.55
3	601318	中国平安	76,510,931.33	24.37
4	601288	农业银行	74,123,233.80	23.61
5	601166	兴业银行	71,011,056.48	22.61
6	601668	中国建筑	64,331,343.94	20.49
7	600383	金地集团	63,514,012.66	20.23
8	601939	建设银行	62,454,899.53	19.89
9	002024	苏宁云商	55,111,778.14	17.55
10	300072	三聚环保	54,154,799.39	17.25
11	000001	平安银行	51,016,285.98	16.25
12	300193	佳士科技	50,964,373.10	16.23
13	002431	棕榈园林	47,838,278.59	15.23
14	600036	招商银行	47,539,873.60	15.14
15	600157	永泰能源	45,459,912.62	14.48
16	300178	腾邦国际	44,496,281.91	14.17
17	002482	广田股份	43,656,827.03	13.90
18	601699	潞安环能	42,593,673.84	13.56
19	000428	华天酒店	42,335,811.91	13.48
20	300052	中青宝	42,099,120.65	13.41
21	601886	江河创建	41,882,683.13	13.34
22	000069	华侨城 A	38,415,774.04	12.23
23	000002	万科 A	38,103,832.14	12.13
24	600000	浦发银行	37,985,852.86	12.10
25	601238	广汽集团	36,394,926.67	11.59
26	300154	瑞凌股份	34,810,000.32	11.09
27	600030	中信证券	34,056,984.83	10.85
28	300039	上海凯宝	31,687,197.62	10.09
29	600060	海信电器	29,946,336.21	9.54
30	002226	江南化工	29,661,998.36	9.45
31	002649	博彦科技	29,154,324.96	9.28
32	300201	海伦哲	27,891,976.49	8.88
33	000024	招商地产	26,989,395.36	8.60
34	000157	中联重科	26,961,834.80	8.59
35	002632	道明光学	26,847,090.03	8.55
36	000860	顺鑫农业	26,325,555.20	8.38

37	002628	成都路桥	25,693,107.68	8.18
38	600518	康美药业	25,031,459.61	7.97
39	002612	朗姿股份	24,565,546.79	7.82
40	601788	光大证券	23,986,912.13	7.64
41	601377	兴业证券	23,516,540.34	7.49
42	601628	中国人寿	23,259,077.96	7.41
43	600016	民生银行	22,481,755.19	7.16
44	300110	华仁药业	22,374,760.29	7.13
45	002650	加加食品	22,235,464.07	7.08
46	600270	外运发展	21,716,642.54	6.92
47	002317	众生药业	21,696,873.08	6.91
48	600373	中文传媒	21,245,760.93	6.77
49	000937	冀中能源	21,111,923.67	6.72
50	002640	百圆裤业	20,902,119.67	6.66
51	000402	金融街	20,872,166.76	6.65
52	600889	南京化纤	20,833,506.63	6.63
53	600104	上汽集团	20,554,647.10	6.55
54	002557	洽洽食品	20,529,783.55	6.54
55	300222	科大智能	20,453,425.98	6.51
56	600880	博瑞传播	20,185,228.35	6.43
57	600352	浙江龙盛	19,965,074.41	6.36
58	002375	亚厦股份	19,798,196.41	6.30
59	601088	中国神华	19,771,218.08	6.30
60	002331	皖通科技	19,630,049.44	6.25
61	300125	易世达	19,392,434.14	6.18
62	000525	红太阳	19,334,550.71	6.16
63	000602	金马退市	19,052,876.52	6.07
64	600511	国药股份	18,966,466.08	6.04
65	600162	香江控股	18,676,647.24	5.95
66	600809	山西汾酒	17,570,695.82	5.60
67	600123	兰花科创	17,408,625.10	5.54
68	002219	恒康医疗	17,198,908.70	5.48
69	300285	国瓷材料	17,060,936.07	5.43
70	300006	莱美药业	17,038,237.02	5.43
71	002100	天康生物	16,986,160.98	5.41
72	601989	中国重工	16,977,744.95	5.41
73	002104	恒宝股份	16,923,638.10	5.39
74	600867	通化东宝	16,794,873.50	5.35
75	002437	誉衡药业	16,464,201.99	5.24
76	600031	三一重工	15,895,069.60	5.06
77	601328	交通银行	15,825,936.00	5.04

78	601336	新华保险	15,779,612.96	5.03
79	000338	潍柴动力	15,706,796.48	5.00
80	000538	云南白药	15,439,922.64	4.92
81	600702	沱牌舍得	15,246,267.55	4.86
82	002440	闰土股份	15,149,473.34	4.82
83	002604	龙力生物	15,081,981.52	4.80
84	002630	华西能源	15,069,913.49	4.80
85	002313	日海通讯	14,939,995.51	4.76
86	000826	桑德环境	14,484,549.82	4.61
87	600805	悦达投资	14,447,963.31	4.60
88	000876	新希望	14,325,911.92	4.56
89	000401	冀东水泥	14,301,887.08	4.55
90	000917	电广传媒	14,030,117.77	4.47
91	002396	星网锐捷	14,021,011.23	4.47
92	601601	中国太保	13,951,190.09	4.44
93	600067	冠城大通	13,814,288.10	4.40
94	600429	三元股份	13,698,760.18	4.36
95	002503	搜于特	13,540,282.30	4.31
96	000669	金鸿能源	13,493,338.69	4.30
97	000919	金陵药业	13,462,371.85	4.29
98	002398	建研集团	13,457,008.80	4.29
99	600684	珠江实业	13,200,025.78	4.20
100	002118	紫鑫药业	13,068,258.94	4.16
101	300079	数码视讯	13,014,995.10	4.14
102	300266	兴源过滤	12,831,170.66	4.09
103	601169	北京银行	12,780,838.16	4.07
104	600261	阳光照明	12,668,343.60	4.03
105	000423	东阿阿胶	12,311,397.93	3.92
106	600252	中恒集团	12,124,573.41	3.86
107	600585	海螺水泥	11,807,284.47	3.76
108	300194	福安药业	11,779,198.30	3.75
109	600812	华北制药	11,723,913.32	3.73
110	600894	广日股份	11,694,481.08	3.72
111	002547	春兴精工	11,592,303.67	3.69
112	600694	大商股份	11,525,022.36	3.67
113	600085	同仁堂	11,417,178.39	3.64
114	000728	国元证券	11,268,392.03	3.59
115	000501	鄂武商A	11,151,772.29	3.55
116	300251	光线传媒	10,872,162.59	3.46
117	300164	通源石油	10,824,351.54	3.45
118	600409	三友化工	10,797,882.60	3.44

119	002663	普邦园林	10,771,585.33	3.43
120	000983	西山煤电	10,533,502.70	3.35
121	000975	银泰资源	10,333,716.19	3.29
122	000789	江西水泥	10,202,583.35	3.25
123	002563	森马服饰	10,119,907.68	3.22
124	300030	阳普医疗	9,998,375.14	3.18
125	002378	章源钨业	9,959,275.36	3.17
126	000043	中航地产	9,885,660.69	3.15
127	000718	苏宁环球	9,833,863.98	3.13
128	000100	TCL 集团	9,821,158.85	3.13
129	300170	汉得信息	9,805,504.94	3.12
130	002311	海大集团	9,694,579.97	3.09
131	600859	王府井	9,519,103.70	3.03
132	002340	格林美	9,463,493.43	3.01
133	601857	中国石油	9,430,318.08	3.00
134	600111	包钢稀土	9,382,581.02	2.99
135	601010	文峰股份	9,290,561.66	2.96
136	600318	巢东股份	9,248,506.64	2.95
137	603008	喜临门	9,220,403.67	2.94
138	002410	广联达	9,164,897.00	2.92
139	002221	东华能源	9,135,950.10	2.91
140	600802	福建水泥	8,885,777.03	2.83
141	002325	洪涛股份	8,775,885.62	2.79
142	002010	传化股份	8,702,145.17	2.77
143	600011	华能国际	8,668,920.44	2.76
144	600028	中国石化	8,663,443.44	2.76
145	600881	亚泰集团	8,499,000.00	2.71
146	600118	中国卫星	8,493,448.73	2.70
147	002287	奇正藏药	8,415,348.54	2.68
148	600337	美克股份	8,296,765.49	2.64
149	600731	湖南海利	8,203,655.59	2.61
150	002273	水晶光电	8,031,064.00	2.56
151	000417	合肥百货	7,977,744.10	2.54
152	600062	华润双鹤	7,924,630.00	2.52
153	002042	华孚色纺	7,909,793.39	2.52
154	600577	精达股份	7,903,388.00	2.52
155	601117	中国化学	7,849,351.73	2.50
156	300026	红日药业	7,726,506.00	2.46
157	600835	上海机电	7,467,729.71	2.38
158	600276	恒瑞医药	7,285,954.40	2.32
159	600795	国电电力	6,916,569.24	2.20

160	002405	四维图新	6,898,472.34	2.20
161	600668	尖峰集团	6,863,584.44	2.19
162	002697	红旗连锁	6,839,699.02	2.18
163	600804	鹏博士	6,828,787.00	2.17
164	002035	华帝股份	6,824,812.01	2.17
165	000759	中百集团	6,818,090.70	2.17
166	300031	宝通带业	6,806,403.50	2.17
167	300214	日科化学	6,622,371.79	2.11
168	600125	铁龙物流	6,543,132.60	2.08
169	000590	紫光古汉	6,463,116.30	2.06
170	300291	华录百纳	6,397,955.00	2.04
171	000960	锡业股份	6,387,201.50	2.03
172	000987	广州友谊	6,305,946.49	2.01
173	002603	以岭药业	6,274,524.63	2.00

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	3,752,917,005.21
卖出股票的收入（成交）总额	3,784,221,677.99

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”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。

8.5 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无股指期货投资。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

8.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	931,026.63
2	应收证券清算款	6,090,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	13,661.00
5	应收申购款	388,405.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,423,093.01

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.11.6 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。

§ 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
4,739	78,177.38	234,883,064.56	63.40%	135,599,548.98	36.60%

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	380,200.35	0.103%

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（行业）份额总量的数量区间为 10-50 万份；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 0 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	249,119,791.19
本报告期基金总申购份额	1,241,750,420.01
减：本报告期基金总赎回份额	1,120,387,597.66

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	370,482,613.54

§ 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。2013年3月22日，因工作调动，张宗友先生担任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。2013年7月1日，国富浩华会计师事务所更名为瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）。报告年度应支付给其报酬80000元人民币。审计年限为1年。自2010年至2013年，瑞华会计师事务所为本基金连续提供4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

本报告期本基金管理人及其副总经理、督察长由于旗下部分基金采取尾市集中下单方式，致使相关股票价格异动，收到重庆证监局监管谈话的决定。

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	1,193,166,694.17	15.84%	1,080,816.60	16.75%	-
国信证券	1	1,092,107,819.42	14.50%	994,251.95	15.41%	-
国元证券	1	1,016,177,532.09	13.49%	721,890.84	11.19%	-
长江证券	1	891,855,006.11	11.84%	805,388.93	12.48%	-
海通证券	1	872,672,457.75	11.58%	794,477.06	12.31%	-
恒泰证券	1	867,976,211.84	11.52%	616,611.83	9.55%	-
广发证券	1	765,960,640.16	10.17%	682,374.03	10.57%	-
中信证券	1	335,878,989.62	4.46%	305,783.67	4.74%	-
民族证券	1	274,542,441.04	3.64%	249,944.14	3.87%	-
新时代证券	1	144,541,613.86	1.92%	131,590.31	2.04%	-
招商证券	1	78,831,415.78	1.05%	70,363.66	1.09%	-
中信万通	-	-	-	-	-	-

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12个交易席位，其中新增恒泰证券深圳交易所席位。

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		其它交易	
	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	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	2,735,400,000.	37.95%	-	-	-	-
国元证券	-	-	1,866,000,000.	25.89%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	1,704,200,000.	23.65%	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	624,800,000.0	8.67%	-	-	-	-
民族证券	-	-	276,800,000.0	3.84%	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-1-4
2	新华基金管理有限公司关于旗下基金 2012 年年度资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-1-4
3	新华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-1-21
4	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2012 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	2013-1-22
5	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	2013-3-7
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	2013-3-7
7	新华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-3-28
8	新华基金管理有限公司关于继续参加中国工商银行股份有限公司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、证券日报、公司网站	2013-3-29
9	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2012 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	2013-3-30
10	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2012 年年度报告（正文）	公司网站	2013-3-30
11	新华基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-4-3
12	新华基金管理有限公司关于设立子公司的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2013-4-19
13	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2013 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	2013-4-20

14	新华基金管理有限公司关于开通支付宝公司网上直销业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-5-11
15	新华基金管理有限公司关于增加代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-5-16
16	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加重庆银行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、证券日报、公司网站	2013-5-20
17	新华基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-6-14
18	新华基金管理有限公司旗下基金所聘审计机构更名的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-6-18
19	新华基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-6-25
20	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金直销渠道转换费率的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-6-27
21	新华基金管理有限公司关于旗下基金 2013 年半年度最后一个交易日资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-6-29
22	新华基金管理有限公司关于旗下基金 2013 年半年度资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-7-1
23	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2013 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	2013-7-17
24	新华基金管理有限公司关于旗下基金在第三方基金销售机构开通定投、转换业务以及参加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、证券日报、公司网站	2013-7-23
25	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2013 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	2013-8-28
26	新华行业周期轮换股票型证券投资基金 2013 年半年度报告（正文）	公司网站	2013-8-28
27	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	2013-9-2
28	新华行业周期轮换股票型证券投资基金招	公司网站	2013-9-2

	募说明书（更新）全文		
29	关于延长中国农业银行金穗卡基金网上交易申购费率优惠活动时间公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-9-16
30	新华行业周期轮换股票型证券投资基金2013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	2013-10-25
31	新华基金管理有限公司股东股权转让及修改公司章程的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013-12-3
32	新华基金管理有限公司关于旗下基金增加和讯信息科技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、证券日报、公司网站	2013-12-25

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2012年，本基金经理由于采取尾市集中下单方式，造成相关股票价格异动，本报告期收到了重庆证监局监管谈话的决定。

§ 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)更新的《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
二〇一四年三月二十八日