

新华灵活主题股票型证券投资基金

2012 第三季度报告

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年十月二十四日

重要提示
基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。

本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况
基金简称:新华灵活主题股票
基金代码:519099

投资目标
以主题投资为核心,前瞻性挖掘市场的长期主题趋势,动态把握市场阶段性的主题转换,并精选收益程度高的主题个股进行投资,在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。

投资策略
本基金以战略性与战术性资产配置策略为指导,围绕市场的长期性和阶段性主题进行动态配置,并精选收益程度高的主题个股进行重点投资。

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较高预期风险收益品种,预期风险和收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

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(例如基金申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率基准差④, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

新华灵活主题股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年7月13日至2012年9月30日)



注:本报告期,本基金各项资产配置比例符合本基金合同的有关规定。

§ 4 基金经理报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明

4.2 管理人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灵活主题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》、《新华灵活主题股票型证券投资基金合同》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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,根据公司产品制度,严格控制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合理申购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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
同期:中国股市基本面,可以预期经济低速复苏但悲观情绪持续,中国的消费、投资和出口的“三驾马车”全面放缓的状态中,包括一些先行指标的“先行”也普遍转差,国内工业生产的整体增速和盈利能力仍在下降,相应地大盘也出现了盘跌的走势,在2000点关口出现了反弹行情。本报告期内,本基金持有一些前期涨幅较大的个股,降低了仓位。

对于近期的市场,总体看法是:对于四季度整体看法是经济难以有明显的起色,同时创业板解禁时点延后到12月份,与年末基金赎回时点叠加,因此对于指数的上涨没有大的期望。在后续的操作中,十八大的政策导向是值得关注的重点。在配置上,鉴于以上的分析,还是以业绩确定性强的公司为首要的考虑目标。

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年9月30日,本基金份额净值为0.869元,本报告期份额净值增长率为-2.58%,同期比较基准的增长率为-5.29%。

§ 5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本报告期,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现在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。

5.8.2 本报告期,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9 合计 6,487,713.32

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息
7.1 重要提示

4.2 管理人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灵活主题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》、《新华灵活主题股票型证券投资基金合同》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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,根据公司产品制度,严格控制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合理申购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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
同期:中国股市基本面,可以预期经济低速复苏但悲观情绪持续,中国的消费、投资和出口的“三驾马车”全面放缓的状态中,包括一些先行指标的“先行”也普遍转差,国内工业生产的整体增速和盈利能力仍在下降,相应地大盘也出现了盘跌的走势,在2000点关口出现了反弹行情。本报告期内,本基金持有一些前期涨幅较大的个股,降低了仓位。

对于近期的市场,总体看法是:对于四季度整体看法是经济难以有明显的起色,同时创业板解禁时点延后到12月份,与年末基金赎回时点叠加,因此对于指数的上涨没有大的期望。在后续的操作中,十八大的政策导向是值得关注的重点。在配置上,鉴于以上的分析,还是以业绩确定性强的公司为首要的考虑目标。

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年9月30日,本基金份额净值为0.7034元,本报告期份额净值增长率为-6.21%,同期比较基准的增长率为-3.90%。

§ 5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本报告期,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现在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。

5.8.2 本报告期,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9 合计 1,150,038,879.38

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息
7.1 重要提示

4.2 管理人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灵活主题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》、《新华灵活主题股票型证券投资基金合同》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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,根据公司产品制度,严格控制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合理申购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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
同期:中国股市基本面,可以预期经济低速复苏但悲观情绪持续,中国的消费、投资和出口的“三驾马车”全面放缓的状态中,包括一些先行指标的“先行”也普遍转差,国内工业生产的整体增速和盈利能力仍在下降,相应地大盘也出现了盘跌的走势,在2000点关口出现了反弹行情。本报告期内,本基金持有一些前期涨幅较大的个股,降低了仓位。

对于近期的市场,总体看法是:对于四季度整体看法是经济难以有明显的起色,同时创业板解禁时点延后到12月份,与年末基金赎回时点叠加,因此对于指数的上涨没有大的期望。在后续的操作中,十八大的政策导向是值得关注的重点。在配置上,鉴于以上的分析,还是以业绩确定性强的公司为首要的考虑目标。

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年9月30日,本基金份额净值为1.124元,本报告期份额净值增长率为2.65%,同期比较基准的增长率为-5.29%。

§ 5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本报告期,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现在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。

5.8.2 本报告期,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9 合计 2,407,443,403.91

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息
7.1 重要提示

4.2 管理人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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,根据公司产品制度,严格控制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合理申购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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
同期:中国股市基本面,可以预期经济低速复苏但悲观情绪持续,中国的消费、投资和出口的“三驾马车”全面放缓的状态中,包括一些先行指标的“先行”也普遍转差,国内工业生产的整体增速和盈利能力仍在下降,相应地大盘也出现了盘跌的走势,在2000点关口出现了反弹行情。本报告期内,本基金持有一些前期涨幅较大的个股,降低了仓位。

对于近期的市场,总体看法是:对于四季度整体看法是经济难以有明显的起色,同时创业板解禁时点延后到12月份,与年末基金赎回时点叠加,因此对于指数的上涨没有大的期望。在后续的操作中,十八大的政策导向是值得关注的重点。在配置上,鉴于以上的分析,还是以业绩确定性强的公司为首要的考虑目标。

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年9月30日,本基金份额净值为1.124元,本报告期份额净值增长率为2.65%,同期比较基准的增长率为-5.29%。

§ 5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本报告期,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现在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。

5.8.2 本报告期,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9 合计 2,407,443,403.91

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息
7.1 重要提示

4.2 管理人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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,根据公司产品制度,严格控制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合理申购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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
同期:中国股市基本面,可以预期经济低速复苏但悲观情绪持续,中国的消费、投资和出口的“三驾马车”全面放缓的状态中,包括一些先行指标的“先行”也普遍转差,国内工业生产的整体增速和盈利能力仍在下降,相应地大盘也出现了盘跌的走势,在2000点关口出现了反弹行情。本报告期内,本基金持有一些前期涨幅较大的个股,降低了仓位。

对于近期的市场,总体看法是:对于四季度整体看法是经济难以有明显的起色,同时创业板解禁时点延后到12月份,与年末基金赎回时点叠加,因此对于指数的上涨没有大的期望。在后续的操作中,十八大的政策导向是值得关注的重点。在配置上,鉴于以上的分析,还是以业绩确定性强的公司为首要的考虑目标。

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年9月30日,本基金份额净值为1.124元,本报告期份额净值增长率为2.65%,同期比较基准的增长率为-5.29%。

§ 5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本报告期,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现在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。

5.8.2 本报告期,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9 合计 2,407,443,403.91

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息
7.1 重要提示

4.2 管理人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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,根据公司产品制度,严格控制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合理申购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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
同期:中国股市基本面,可以预期经济低速复苏但悲观情绪持续,中国的消费、投资和出口的“三驾马车”全面放缓的状态中,包括一些先行指标的“先行”也普遍转差,国内工业生产的整体增速和盈利能力仍在下降,相应地大盘也出现了盘跌的走势,在2000点关口出现了反弹行情。本报告期内,本基金持有一些前期涨幅较大的个股,降低了仓位。

对于近期的市场,总体看法是:对于四季度整体看法是经济难以有明显的起色,同时创业板解禁时点延后到12月份,与年末基金赎回时点叠加,因此对于指数的上涨没有大的期望。在后续的操作中,十八大的政策导向是值得关注的重点。在配置上,鉴于以上的分析,还是以业绩确定性强的公司为首要的考虑目标。

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年9月30日,本基金份额净值为1.124元,本报告期份额净值增长率为2.65%,同期比较基准的增长率为-5.29%。

§ 5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本报告期,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现在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。

5.8.2 本报告期,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.9 合计 2,407,443,403.91

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息
7.1 重要提示

4.2 管理人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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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,根据公司产品制度,严格控制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合理申购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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
同期:中国股市基本面,可以预期经济低速复苏但悲观情绪持续,中国的消费、投资和出口的“三驾马车”全面放缓的状态中,包括一些先行指标的“先行”也普遍转差,国内工业生产的整体增速和盈利能力仍在下降,相应地大盘也出现了盘跌的走势,在2000点关口出现了反弹行情。本报告期内,本基金持有一些前期涨幅较大的个股,降低了仓位。

对于近期的市场,总体看法是:对于四季度整体看法是经济难以有明显的起色,同时创业板解禁时点延后到12月份,与年末基金赎回时点叠加,因此对于指数的上涨没有大的期望。在后续的操作中,十八大的政策导向是值得关注的重点。在配置上,鉴于以上的分析,还是以业绩确定性强的公司为首要的考虑目标。

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2012年9月30日,本基金份额净值为1.124元,本报告期份额净值增长率为2.65%,同期比较基准的增长率为-5.29%。

§ 5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)