

基金管理人：新华基金管理股份有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一六年一月二十二日

§ 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及其他从事基金销售、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

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2016年1月18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，确认本报告不存在虚假记载、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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金名称	新华行业周期轮换混合型证券投资基金
基金代码	519005
交易代码	519006
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2010年7月20日
报告期末基金份额总额	136,101,891.16份
投资目标	在有效控制风险的前提下，通过把行业周期轮换操作，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超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采用自下而上与自上而下相结合的投资策略，即通过深入分析宏观经济、周报、政策导向、行业及市场情况等以判断各行业类资产配置比例的策略的基础上，借助公司自行研发的“新华行业周期轮换模型（MVO模型）”，寻找预期能够获得超额收益的行业，并重点配置其优质上市公司的股票。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益类基金和货币市场基金。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

## § 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

报告期

(2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益

25,598,911.69

2.本期利润

46,021,470.74

3.加权平均基金份额本期利润

0.3185

4.期末基金资产净值

288,048,447.76

5.期末基金份额净值

2.120

注：1.本期已实现收益指本期利息收入、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.以上所列各项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将低于所列数字。

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变动的比较

阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

收益率差④

①-③

②-④

过去三个月

16.47%

1.43%

13.07%

1.34%

1.90%

0.05%

3.2.2 本基金成立以来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

阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

收益率差④

①-③

②-④

过去三个月

16.47%

1.43%

13.07%

1.34%

1.90%

0.05%

3.2.3 本报告期基金份额净值增长率历史走势对比如图

(2010年7月21日至2015年12月31日)



注：本报告期，本基金各项资产配置比例符合基金合同规定的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名

职务

任职日期

离任日期

证券从业年限

说明

本基金基金经理，新华行业周期轮换混合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》、《新华优选成长混合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，不存在损害持有人利益的行为。

本基金基金经理，新华行业周期轮换混合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》、《新华行业周期轮换混合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，不存在损害持有人利益的行为。

本基金基金经理，新华行业周期轮换混合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》、