新华趋势领航混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十六日

§1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华趋势领航混合
基金主代码	519158
交易代码	519158
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月11日
报告期末基金份额总额	925,449,192.00份
投资目标	把握整体市场和行业中的趋势机会,精选具有盈利增长趋势以及股票价格趋势的优质上市公司进行投资,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	本基金采用自上而下与自下而上相结合的主动投资策略,深入分析并积极跟踪驱动股票市场、债券市场、行业板块、公司股价形成上升趋势的根本性因素,通过前瞻性地把握市场中存在的趋势机会,完成本基金的大类资产配置、行业配置、债券类属品种配置以及投资组合的最终构建。
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	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	51,652,069.22
2.本期利润	135,226,363.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.1096
4.期末基金资产净值	1,787,147,722.78
5.期末基金份额净值	1.931

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。

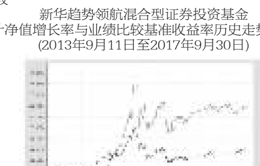
3.2 基金净值表现

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

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.92%	0.63%	3.74%	0.47%	2.18%	0.16%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

新华趋势领航混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年9月11日至2017年9月30日)



注:报告期内本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔建波	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监,权益投资部总监,新华优选消费混合型证券投资基金基金经理,新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理,新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华华荣灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理,新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2013-09-11	-	22	经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员、中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经理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、权益投资部总监、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华荣灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
蔡春红	本基金基金经理,新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理,新华行业周期轮换混合型证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。	2016-07-13	-	6	国际金融硕士,6年证券从业经验。2010年7月加入新华基金管理股份有限公司,历任新华优选分红混合型证券投资基金基金经理助理、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,现任新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、新华行业周期轮换混合型证券投资基金基金经理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。

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,新华基金管理股份有限公司作为新华趋势领航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》、《新华趋势领航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,无损害基金持有人利益的行为。

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《新华基金管理股份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,投资指令统一由交易部下达,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,交易部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,由交易部报投资总监、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会议,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交易部下达投资指令,交易部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 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,市场整体呈现震荡上行。期内,仓位较上季度有所提升,适当增加银行、通讯、食品等强势板块个股配置。整体来说,个股配置仍较为均衡。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.931元,本报告期份额净值增长率为5.92%,同期比较基准的增长率为3.74%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

数据显示,国内经济运行平稳,韧性较强。同时,央行的定向降准预期流动性的边际改善。海外方面,美减税计划落地概率大增,英国、法国、印度等国家的减税战争也悄然开启,这将提升全球范围的风险偏好。因此,整体并不悲观。

未来仍将以均衡配置为基础,更加注重个股的精选。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,650,009,910.38	91.84
	其中:股票	1,650,009,910.38	91.84
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	139,076,803.47	7.74
7	其他各项资产	7,440,159.38	0.41
8	合计	1,796,526,873.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	453,176.00	0.03
B	采矿业	3,070,154.70	0.17
C	制造业	871,713,970.15	48.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,401,558.35	0.08
E	建筑业	73,399,484.72	4.11
F	批发和零售业	66,464,194.60	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	23,526,845.76	1.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,102,280.53	1.52
J	金融业	424,221,449.62	23.74
K	房地产业	146,428,226.42	8.19
L	租赁和商务服务业	168,297.37	0.01
M	科学研究和技术服务业	343,375.05	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	264,612.72	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,424,952.45	0.42
R	文化、体育和娱乐业	381,331.94	0.02
S	综合	3,646,000.00	0.20
	合计	1,650,009,910.38	92.33

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000666	经纬纺机	3,150,801	63,961,260.30	3.58
2	600801	华新水泥	3,355,589	48,421,149.27	2.71
3	601988	中国银行	10,000,000	41,200,000.00	2.31
4	600498	烽火通信	1,215,389	39,621,681.40	2.22
5	601818	光大银行	9,330,000	37,786,500.00	2.11
6	601601	中国太保	973,309	35,944,301.37	2.01
7	600036	招商银行	1,402,887	35,843,762.85	2.01
8	600519	贵州茅台	65,500	33,905,420.00	1.90
9	600581	威孚高科	1,351,186	32,968,938.40	1.84
10	601328	交通银行	5,171,790	32,685,712.80	1.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无股指期货投资。

5.9.2 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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	842,161.02
2	应收证券清算款	6,344,077.34
3	应收股利	-
4	应收利息	13,267.53
5	应收申购款	240,653.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,440,159.38

5.11.4报告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债。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,442,269,043.82
报告期基金总申购份额	11,265,224.71
减:报告期基金总赎回份额	528,085,076.53
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	925,449,192.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170703-20170828	411,919,828.30	0.00	316,684,931.10	95,234,897.20	10.29%
产品特有风险							

1.赎回申请延期办理的风险

机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,中小投资者可能面临小额赎回,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险;

2.基金净值大幅波动的风险

机构投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;

3.提前终止基金合同的风险

机构投资者赎回后,可能出现基金资产净值低于5000万元的情形,若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人可能提前终止基金合同,基金财产将进行清算;

4.基金规模过小导致的风险

机构投资者赎回后,可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华趋势领航混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华趋势领航混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华趋势领航混合型证券投资基金托管协议》

(四)《新华趋势领航混合型证券投资基金基金合同》

(五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华趋势领航混合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

(九) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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,或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司
二〇一七年十月二十六日

新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

§1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华行业灵活配置混合	
基金主代码	519156	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月5日	
报告期末基金份额总额	1,686,183,669.75份	
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,并且在此基础上通过进行积极的大类资产配置,力求实现基金资产长期稳定地持续增长。	
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(MVO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	本基金的业绩比较基准:50%×沪深300指数收益率+50%×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等风险中等预期收益品种,预期风险和收益低于股票型基金,高于债券型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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新华行业灵活配置混合A	新华行业灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	519156	519157
报告期末下属分级基金的份额总额	1,664,666,834.05份	21,516,835.70份

§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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	新华行业灵活配置混合A	新华行业灵活配置混合C
1.本期已实现收益	-15,460,266.53	-365,405.39
2.本期利润	81,553,829.79	1,124,498.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0439	0.0383
4.期末基金资产净值	2,660,150,127.21	30,451,031.57
5.期末基金份额净值	1.598	1.415

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

1、新华行业灵活配置混合A:

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.10%	0.88%	2.41%	0.30%	0.69%	0.58%

2、新华行业灵活配置混合C:

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.98%	0.89%	2.41%	0.30%	0.57%	0.59%

3.2.2 自基金转型以来基金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

新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年6月5日至2017年9月30日)

1. 新华行业灵活配置混合A:

2. 新华行业灵活配置混合C:

注:本报告期本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

本基金报告期无其他指标需要披露。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
栾江伟	本基金基金经理、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-07-07	-	8	硕士研究生,8年证券从业经验。2008年7月加入新华基金管理股份有限公司,历任新华基金管理股份有限公司研究部行业分析师、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
李会忠	本基金基金经理、新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫锐混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-06-11	2017-07-06	10	经济学硕士,10年证券从业经验。2007年9月加入新华基金管理股份有限公司,历任新华基金管理股份有限公司行业研究员、策略分析师、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫锐混合型证券投资基金基金经理。

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,新华基金管理股份有限公司作为新华行业轮换灵活配置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》、《新华行业轮换灵活配置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,无损害基金持有人利益的行为。

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《新华基金管理股份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,投资指令统一由交易部下达,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,交易部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,由交易部报投资总监、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会议,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交易部下达投资指令,交易部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 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年3季度,市场震荡上扬,上证主板走势好于创业板,有色金属、钢铁、煤炭、银行、食品饮料、通信、建材等板块走势较好,传媒、电力及公用事业、纺织服装等板块走势最差。3季度上证综指上涨4.9%,创业板指上涨2.69%,沪市300上涨4.63%,新华行业轮换配置基金上涨3.37%,表现一般,基金3季度减持了部分中小创个股,加仓了部分低估值周期股,地产白马、化工、农业增持较多,仓位中性,基金持股集中度仍然较高,板块配置方面,重点配置了农林牧渔、化工、房地产、建筑装饰、国防军工等板块。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金A级份额净值为1.598元,本基金C级份额净值为1.415元;本报告期A级份额净值增长率为3.10%,业绩比较基准的增长率为2.41%,本报告期C级份额净值增长率为2.98%,业绩比较基准的增长率为2.41%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2017年4季度指数震荡整理。目前市场情绪比较稳定,主题持续炒作,轮动较快,不易把握,4季度是政策主题高峰期,重点关注12月中央经济工作会议和农村工作会议的定调。4季度基金换手预计会比较低,坚守低估值个股,同时配置部分基本面较好的成长股。主题投资重点关注农业,对涨价题材板块谨慎,预计4季度保持中性仓位。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内未出现持有人少于二百人或连续20个工作日基金净值低于伍仟万的情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,173,190,524.01	79.70
	其中:股票	2,173,190,524.01	79.70
2	固定收益投资	504,938.10	0.02
	其中:债券	504,938.10	0.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	100,000,000.00	3.67
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	196,494,637.73	7.21
7	其他各项资产	256,381,456.24	9.40
8	合计	2,726,571,556.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	144,315,123.21	5.36
B	采矿业	46,840,264.60	1.74
C	制造业	1,208,682,447.88	44.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	227,879,233.58	8.47
F	批发和零售业	57,668,596.75	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	100,189,889.77	3.72
J	金融业	34,610,523.22	1.29
K	房地产业	283,236,332.11	10.53
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	25,108,509.69	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	44,487,637.86	1.65
S	综合	-	-
	合计	2,173,190,524.01	80.77

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600760	中航黑豹	4,483,837	150,881,115.05	5.61
2	601952	苏垦农发	10,043,169	147,935,879.37	5.50
3	600691	阳煤化工	37,829,155	146,777,121.40	5.46
4	600383	金地集团	12,104,481	138,838,397.07	5.16
5	600873	梅花生物	21,406,913	137,004,243.20	5.09
6	000666	经纬纺机	5,582,301	113,320,710.30	4.21
7	002146	荣盛发展	11,793,059	112,741,644.04	4.19
8	002368	太极股份	3,568,476	98,811,100.44	3.67
9	600598	北大荒	7,909,097	94,355,527.21	3.51
10	002036	联创电子	3,058,447	63,432,190.78	2.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	504,938.10	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	504,938.10	0.02

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128013	洪涛转债	4,990	504,938.10	0.02

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

本基金本报告期无资产支持证券投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期无权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期末无国债投资。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,765,030.19
2	应收证券清算款	252,498,596.18
3	应收股利	-
4	应收利息	-268,040.87
5	应收申购款	2,385,870.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	256,381,456.24

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128013	洪涛转债	504,938.10	0.02

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6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,分项之和与合计之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	新华行业灵活配置混合A	新华行业灵活配置混合C
本报告期期初基金份额总额	2,050,933,963.00	37,550,432.04
报告期基金总申购份额	155,777,272.46	5,909,184.03
减:报告期基金总赎回份额	542,044,401.41	21,942,780.37
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,664,666,834.05	21,516,835.70

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

(一)中国证监会核准新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)《新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)更新的《新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(五)关于申请募集新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

(八)中国证监会要求的其他文件

(九) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

9.2存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3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。

新华基金管理股份有限公司
二〇一七年十月二十六日

新华行业周期轮换混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十六日

§1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华行业周期轮换混合
基金主代码	519095
交易代码	519095
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月21日
报告期末基金份额总额	66,739,906.51份
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(MVO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	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	9,167,211.26
2.本期利润	10,732,317.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.1448
4.期末基金资产净值	127,549,812.99
5.期末基金份额净值	1.911

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。

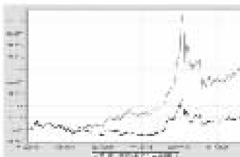
3.2 基金净值表现

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

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.15%	1.10%	3.74%	0.48%	4.41%	0.62%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

新华行业周期轮换混合型证券投资基金
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2017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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡春红	本基金基金经理,新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。	2015-08-03	-	6	国际金融硕士,6年证券从业经验。2010年7月加入新华基金管理股份有限公司,历任新华优选分红混合型证券投资基金基金经理助理、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,现任新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、新华行业周期轮换混合型证券投资基金基金经理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。
路文韬	本基金基金经理,新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-09-15	-	10	金融与投资硕士,10年证券从业经验。历任北京兴创投资有限公司项目经理,华夏基金管理有限公司策略分析师,先后负责通讯、电子、传媒、计算机、家电等多个行业的研究,信达证券股份有限公司投资经理。2015年7月加入新华基金管理股份有限公司。现任新华行业周期轮换混合型证券投资基金基金经理、新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,新华基金管理股份有限公司作为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》以及其他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 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《新华基金管理股份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,投资指令统一由交易部下达,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,交易部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,由交易部报投资总监、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会议,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交易部下达投资指令,交易部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 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度由于宏观数据超预期的好,叠加供给侧改革的刺激,周期股表现优异。基金组合在前半段重点配置了周期股,整体表现较好,在后半段逐渐调整结构,仓位加重对成长股的配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.911元,本报告期份额净值增长率为8.15%,同期比较基准的增长率为3.74%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,经济在环保的影响下目前阶段继续向上的可能性大幅降低,同时货币政策稳中趋紧,大幅上涨缺少支撑因素,但是四季度也缺少大幅下跌的因素,经济下行在市场的预期之内,且不是快速的下行,更多可能是小幅下行,货币政策趋紧但也不会出现信号性的紧缩政策。因此市场表现为窄幅震荡的可能性更大,从结构上看自下而上依然能选出投资机会。

四季度,组合配置策略可能倾向于自下而上的在电子行业内选择结构性的机会,虽然苹果出货速度可能节奏较慢,但是IPX所带来的创新给整个电子行业带来了很多新的技术革新,带来了新的增量,在相关产业链上挖掘,能发现有被低估可以实现绝对收益的标的;关注军工行业的机会,因为军队反腐,导致军工订单年内减少,但随着十九大之后军改的落地、部队反腐的告一段落,未来军工订单可能得以恢复,再加上亚洲地缘政治不稳定,加强军队装备投入可能是下一阶段重要工作,因此军工行业在十九大前后可能出现机会。

总体上四季度偏谨慎,但也不过度悲观,仓位上保持中性,结构上尽量积极。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	113,155,467.14	86.54
	其中:股票	113,155,467.14	86.54
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,162,239.27	10.83
7	其他各项资产	3,444,120.41	2.63
8	合计	130,761,826.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,908,800.00	1.50
B	采矿业	1,895,793.60	1.49
C	制造业	92,586,736.02	72.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,528,493.44	9.04
E	建筑业	2,990,000.00	2.34
F	批发和零售业	566,000.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,649,400.00	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	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	12,776.05	0.01
S	综合	-	-
	合计	113,155,467.14	88.71

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000050	深天马A	532,950	11,996,704.50	9.41
2	600760	中航黑豹	302,796	10,189,085.40	7.99
3	002045	国光电器	570,000	9,826,800.00	7.70
4	300398	飞凯材料	399,950	8,654,918.00	6.79
5	000725	京东方A	1,640,000	7,216,000.00	5.66
6	600703	三安光电	300,000	6,942,000.00	5.44
7	601991	大唐发电	1,300,000	5,876,000.00	4.61
8	600011	华能国际	810,000	5,621,400.00	4.41
9	002075	沙钢股份	199,960	4,611,077.60	3.62
10	000768	中航飞机	200,000	3,846,000.00	3.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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贵金属投资明细

本报告期末本基金无贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金无权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无股指期货投资。

5.9.2 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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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遣责、处罚的情形。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	139,457.70
2	应收证券清算款	3,261,612.16
3	应收股利	-
4	应收利息	3,238.76
5	应收申购款	39,811.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,444,120.41

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002075	沙钢股份	4,611,077.60	3.62	重大资产重组

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	76,796,691.41
报告期基金总申购份额	3,454,880.08
减:报告期基金总赎回份额	13,511,664.98
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	66,739,906.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,962,282.88
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	4,962,282.88
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
-	赎回	2017-09-27	4,962,282.88	9,359,421.29	0.10%
合计			4,962,282.88	9,359,421.29	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华行业周期轮换混合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混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华行业周期轮换混合型证券投资基金基金合同》

(四)《新华行业周期轮换混合型证券投资基金托管协议》

(五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(六) 更新的《新华行业周期轮换混合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

(九)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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。

新华基金管理股份有限公司
二〇一七年十月二十六日