新华优选分红混合型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十七日

§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2013年7月12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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华优选分红混合	
基金主代码	519087	
交易代码	519087	519088
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年9月16日	
报告期末基金份额总额	1,853,233,235.99份	
投资目标	有效地控制风险,实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准并提供稳定的分红。	
投资策略	采用战术型资产配置策略;寻找品质优异的高成长型上市公司及分红能力强的价值型上市公司,并辅助以国际竞争力比较,寻找具有市场估值合理的股票,确定最终的投资组合。	
业绩比较基准	60%×中信标普300指数+40%×中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金属于中等风险的混合型基金,其风险收益特征从长期平均来看,介于股票基金与债券基金之间。	
基金管理人	新华基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	

§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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	2,943,382.58
2.本期利润	-111,477,971.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0578
4.期末基金资产净值	1,380,879,237.22
5.期末基金份额净值	0.7451

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	-7.31%	1.37%	-6.42%	0.86%	-0.89%	0.51%

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

新华优选分红混合型证券投资基金
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
(2005年9月16日至2013年6月30日)

注:本报告期末本基金的各项投资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		
曹名长	本基金基金经理;新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理;公司基金管理部总监	2006-7-12	-	16年	经济学硕士,历任君安证券有限公司研究员、红塔证券股份有限公司资产管理部投资经理、百瑞信托股份有限公司投资经理,现任新华基金管理有限公司基金管理部总监,新华优选分红混合型证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业股票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,新华基金管理有限公司作为新华优选分红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》、《新华优选分红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,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 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

2013年二季度A股市场经历了2011年9月以来的最大单季跌幅,上证综指和沪深300指数下跌幅度均超过11%,深成指下跌幅度更是超过13%,而与市场这三个主要指数形成强烈对比的是,创业板指数整个季度上涨超过16%,市场分化剧烈。

本基金二季度的股票仍保持较高仓位,配置比例相对前期未出现明显变化。由于长期配置了一些医药消费类股票,因此季度的净值表现稍强于大盘。本基金投资主要基于对长期因素的考虑,因此一直在长期业绩较为稳定的金融、消费、机械等行业的配置较高。

A股市场自2009年以来已经经历了四年持续下跌,现在看来2012年底的上涨并没有给市场带来信心,加上当前宏观以经济结构调整为目标,使得部分投资者更显悲观。与市场大部分投资者看法不同的是,我们曾认为A股去年底的上涨有可能(大概率)是牛市的开始,目前来看这种看法可能有失偏颇。追究我们判断失误的原因,主要在于我们忽视了本轮经济周期调整的复杂性。在结构性调整的大环境下,本轮经济周期调整的时间可能更为漫长。但即使如此,我们仍认为市场当前处于底部区域,进一步下跌的空间有限,未来一段时间的A股市场可能以在此底部区间震荡为主。

基于以上判断,我们在2013年三季度及以后的操作将以精选个股为主,同时坚持估值的安全性和组合配置的多样性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.7451元,本报告期份额净值增长率为-7.31%,同期比较基准的增长率为-6.42%。

§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	1,194,499,305.28	85.37
	其中:股票	1,194,499,305.28	85.37
2	固定收益投资	119,929,679.40	8.57
	其中,债券	119,929,679.40	8.57
	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	69,729,479.77	4.98
6	其他各项资产	15,071,216.01	1.08
7	合计	1,399,229,680.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	428,887,618.30	31.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,427,751.64	1.33
E	建筑业	46,513,536.24	3.37
F	批发和零售业	52,299,741.15	3.79
G	交通运输、仓储和邮政业	23,122,988.16	1.67
H	住宿和餐饮业	69,164,174.97	5.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	921,304.56	0.07
J	金融业	315,957,010.27	22.88
K	房地产业	168,573,154.69	12.21
L	租赁和商务服务业	30,053,032.80	2.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	40,578,992.50	2.94
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	1,194,499,305.28	86.50

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	601318	中国平安	2,580,937	89,713,370.12	6.50
2	600036	招商银行	7,478,520	86,750,832.00	6.28
3	600007	中国国贸	9,321,770	86,039,937.10	6.23
4	601588	北辰实业	30,449,870	82,519,147.70	5.98
5	000550	江铃汽车	5,354,483	81,977,134.73	5.94
6	300255	常山药业	4,242,475	79,588,831.00	5.76
7	600754	锦江股份	5,502,321	69,164,174.97	5.01
8	601166	兴业银行	3,916,412	57,845,405.24	4.19
9	600016	民生银行	6,696,363	57,387,830.91	4.16
10	601668	中国建筑	11,800,000	38,586,000.00	2.79

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	119,929,679.40	8.69
8	其他	-	-
9	合计	119,929,679.40	8.69

5.5 报告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

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	113002	工行转债	657,130	71,876,879.40	5.21
2	113001	中行转债	480,000	48,052,800.00	3.48

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本报告期末本基金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名的前五名权证投资明细
本报告期末本基金未持有权证。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 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。
5.8.2 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。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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。
5.9.2 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。
5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	572,420.28
2	应收证券清算款	12,856,392.01
3	应收股利	975,606.73
4	应收利息	447,299.36
5	应收申购款	219,497.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,071,216.01

5.9.4 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	113002	工行转债	71,876,879.40	5.21
2	113001	中行转债	48,052,800.00	3.48

5.9.5 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没有流通受限情况。
5.9.6 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	1,950,820,689.71
本报告期基金总申购份额	116,739,994.35
减:本报告期基金总赎回份额	214,327,448.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,853,233,235.99

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未有影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准新世纪优选分红混合型证券投资基金募集的文件
(二)关于申请募集新世纪优选分红混合型证券投资基金之法律意见书
(三)中国证监会关于核准新世纪基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
(四)《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》
(五)《新华优选分红混合型证券投资基金托管协议》
(六)《新华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(七)更新的《新华优选分红混合型证券投资基金招募说明书》
(八)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
(九)基金托管人业务资格批件及营业执照
8.2 存放地点
基金管理人、基金托管人住所。
8.3 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。

新华基金管理有限公司
二〇一三年七月十七日

新华钻石品质企业股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十七日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月16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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华钻石品质企业股票
基金主代码	519093
交易代码	519093
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月3日
报告期末基金份额总额	653,715,841.95份
投资目标	本基金通过对上市公司基本面的深入研究,结合宏观经济周期和行业景气度分析,力求在有效控制风险并适度保持良好流动性的前提下,精选具有稳定价值性和高质量成长性的钻石品质类的优质上市公司。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略,通过对经济周期、行业特征等宏观层面的信息进行全面分析,调整大类资产配置比例和行业配置比例;在个股个券的选择上采用自下而上的投资策略,核心是从企业价值的稳定性和成长的高质量出发,筛选具有钻石品质的优质企业,并进行重点配置。钻石品质企业股票的配置比例不低于股票资产配置的80%。钻石品质企业是指具有稳定价值性和高质量成长性的上市公司,它们具有安全、透明、稳定、创新与领导气质五大优秀品质。
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、债券型基金和货币型基金。
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	5,914,245.68
2.本期利润	-45,076,880.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0671
4.期末基金资产净值	585,795,506.30
5.期末基金份额净值	0.896

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。

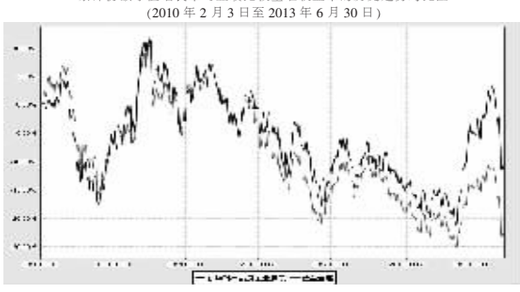
3.2 基金净值表现

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	-7.44%	1.42%	-9.32%	1.16%	1.88%	0.26%

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

新华钻石品质企业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
(2010年2月3日至2013年6月30日)



注:报告期内本基金的各项投资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		
曹名长	本基金基金经理;新华优选分红混合型证券投资基金基金经理;公司基金管理部总监	2010-2-3	-	16	经济学硕士,历任君安证券有限公司研究员、红塔证券股份有限公司资产管理部投资经理、百瑞信托股份有限公司投资经理,现任新华基金管理有限公司基金管理部总监,新华优选分红混合型证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业股票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,新华基金管理有限公司作为新华钻石品质企业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》、《新华钻石品质企业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 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 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

2013年二季度A股市场经历了2011年9月以来的最大单季跌幅,上证综指和沪深300指数下跌幅度均超过11%,深成指下跌幅度更是超过13%,而与市场这三个主要指数形成强烈对比的是,创业板指数整个季度上涨超过16%,市场分化剧烈。

本基金二季度的股票仍保持较高仓位,配置比例相对前期未出现明显变化。由于长期配置了一些医药消费类股票,因此季度的净值表现稍强于大盘。本基金投资主要基于对长期因素的考虑,因此一直在长期业绩较为稳定的金融、消费、机械等行业的配置较高。

A股市场自2009年以来已经经历了四年持续下跌,现在看来2012年底的上涨并没有给市场带来信心,加上当前宏观以经济结构调整为目标,使得部分投资者更显悲观。与市场大部分投资者看法不同的是,我们曾认为A股去年底的上涨有可能(大概率)是牛市的开始,目前来看这种看法可能有失偏颇。追究我们判断失误的原因,主要在于我们忽视了本轮经济周期调整的复杂性。在结构性调整的大环境下,本轮经济周期调整的时间可能更为漫长。但即使如此,我们仍认为市场当前处于底部区域,进一步下跌的空间有限,未来一段时间的A股市场可能以在此底部区间震荡为主。

基于以上判断,我们在2013年三季度及以后的操作将以精选个股为主,同时坚持估值的安全性和组合配置的多样性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.896元,本报告期份额净值增长率为-7.44%,同期比较基准的增长率为-9.32%。

§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	553,390,383.13	93.88
	其中:股票	553,390,383.13	93.88
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	34,273,813.56	5.81
6	其他各项资产	1,781,677.47	0.30
7	合计	589,445,874.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	224,395,352.44	38.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	756,800.00	0.13
E	建筑业	18,988,587.37	3.24
F	批发和零售业	16,146,675.23	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	7,867,200.00	1.34
H	住宿和餐饮业	31,299,677.10	5.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,952,501.00	0.33
J	金融业	156,390,194.99	26.70
K	房地产业	79,273,299.41	13.53
L	租赁和商务服务业	9,298,900.80	1.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,170,529.66	1.05
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	850,665.13	0.15
S	综合	-	-
	合计	553,390,383.13	94.47

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	600007	中国国贸	4,643,275	42,857,428.25	7.32
2	601318	中国平安	1,210,346	42,071,626.96	7.18
3	000550	江铃汽车	2,456,890	37,614,985.90	6.42
4	600036	招商银行	3,201,252	37,134,523.20	6.34
5	601588	北辰实业	13,143,746	35,619,551.66	6.08
6	300255	常山药业	1,843,442	34,582,971.92	5.90
7	600754	锦江股份	2,490,030	31,299,677.10	5.34
8	600016	民生银行	3,059,352	26,218,646.64	4.48
9	601166	兴业银行	1,597,065	23,588,650.05	4.03
10	002393	力生制药	527,265	16,492,849.20	2.82

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末,本基金未持有债券。
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。
5.7 报告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
报告期末,本基金未持有权证。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 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。
5.8.2 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。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1 本报告期内,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。
5.9.2 本报告期内,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之外的股票。
5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	133,232.64
2	应收证券清算款	1,094,156.18
3	应收股利	435,957.66
4	应收利息	6,625.20
5	应收申购款	111,705.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,781,677.47

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5.9.5 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,本基金持有前十名股票中不存在流通受限情况。
5.9.6 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。

§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	666,825,987.54
本报告期基金总申购份额	43,976,896.59
减:本报告期基金总赎回份额	57,087,042.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	653,715,841.95

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内未有影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准新华钻石品质企业股票型证券投资基金募集的文件
(二)关于申请募集新华钻石品质企业股票型证券投资基金之法律意见书
(三)《新华钻石品质企业股票型证券投资基金托管协议》
(四)《新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金合同》
(五)《新华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(六)更新的《新华钻石品质企业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
8.2 存放地点
基金管理人、基金托管人住所。
8.3 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。

新华基金管理有限公司
二〇一三年七月十七日

新华中小市值优选股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十七日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月16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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华中小市值优选股票
基金主代码	519097
交易代码	519097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月28日
报告期末基金份额总额	302,865,076.88份
投资目标	在有效控制风险的前提下,精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资,力求实现基金净值增长率持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金以合理价格成长选股策略(GARP)为核心,精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证700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。
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	23,520,567.27
2.本期利润	6,914,506.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0191
4.期末基金资产净值	286,408,900.81
5.期末基金份额净值	0.946

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。

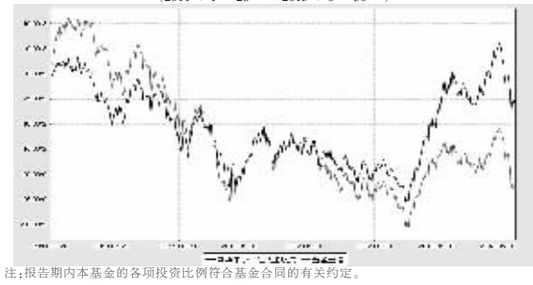
3.2 基金净值表现

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	-0.42%	1.17%	-5.85%	1.21%	5.43%	-0.04%

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

新华中小市值优选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1月28日至2013年6月30日)



注:报告期内本基金的各项投资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		
桂跃强	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	2011-7-12	-	6	工学、金融学双硕士,历任中国石化石油化工科学研究院工程师。于2007年加入新华基金管理有限公司,历任化工、有色、轻工、建材等行业分析师,策略分析师,新华优选成长股票型证券投资基金基金经理助理,投资经理。现任新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华中小市值优选股票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,新华基金管理有限公司作为新华中小市值优选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》、《新华中小市值优选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 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 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