新华灵活主题股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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:二〇一三年十月二十五日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月24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
基金主代码	519099
交易代码	519099
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月13日
报告期末基金份额总额	54,274,197份
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,并精选获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投资主题进行动态配置,并精选获益程度最高的主题个股群进行重点投资。
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

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	7,155,378.09
2.本期利润	8,179,791.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.1252
4.期末基金资产净值	61,111,225.09
5.期末基金份额净值	1.126

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

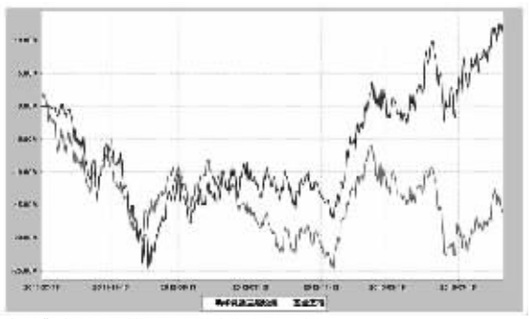
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.49%	1.13%	7.70%	1.15%	4.79%	-0.02%

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

新华灵活主题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

(2011年7月13日至2013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		
李昱	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	2011-7-13	-	16	管理学硕士,历任广发证券股份有限公司环市东营业部大户主管,广发证券股份有限公司资产管理部投资经理。李昱女士于2010年3月加入新华基金管理有限公司,历任专户管理部负责人。现任新华灵活主题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。
贲兴振	本基金基金经理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理	2013-2-1	-	6	经济学硕士,6年证券从业经验。历任北京城市系统工程研究中心研究员。贲兴振先生于2007年9月加入新华基金管理有限公司,先后负责研究煤炭、电力、金融、通信设备、电子和有色金属等行业,担任过策略分析师、债券分析师。现任新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理,新华灵活主题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于方的交易,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,由中央交易室根据投资总监、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运作分析

对经济平稳和改革创新的良好预期下,前期相对收益较少的行业在第三季度借助题材主题炒作盛行。部分成长股和纯题材股估值提升过多,年底流动性偏紧和IPO迟早重启将给市场带来冲击。

第四季度配置重点关注环保、医药和大众消费品等相关行业,从为明年布局的角度考虑中期配置思路,争取今后投资业绩有所进步。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为1.126元,本报告期份额净值增长率为12.49%,同期比较基准的增长率为7.70%。

§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	40,330,601.81	62.47
	其中:股票	40,330,601.81	62.47
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	16,000,000.00	24.78
	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	6,008,008.25	9.31
6	其他各项资产	2,223,339.05	3.44
7	合计	64,561,949.11	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	29,795,163.36	48.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	579,050.00	0.95
F	批发和零售业	-	-
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	2,817,298.70	4.61
J	金融业	2,422,150.00	3.96
K	房地产业	1,020,480.00	1.67
L	租赁和商务服务业	1,370,540.00	2.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,325,919.75	3.81
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	40,330,601.81	66.00

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	600887	伊利股份	55,000	2,457,400.00	4.02
2	000063	中兴通讯	110,000	1,826,000.00	2.99
3	000826	桑德环境	53,625	1,809,843.75	2.96
4	600535	天士力	35,099	1,580,156.98	2.59
5	000525	红 太 阳	88,909	1,498,116.65	2.45
6	002104	恒宝股份	90,000	1,404,000.00	2.30
7	300020	银江股份	53,700	1,282,356.00	2.10
8	300058	蓝色光标	17,800	1,192,600.00	1.95
9	600422	昆明制药	40,000	1,079,200.00	1.77
10	002226	江南化工	77,817	1,071,540.09	1.75

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名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名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名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 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	450,595.28
2	应收证券清算款	1,768,740.71
3	应收股利	-
4	应收利息	2,125.88
5	应收申购款	1,877.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,223,339.05

5.10.4 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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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	74,093,627.93
本报告期基金总申购份额	625,044.48
减:本报告期基金总赎回份额	20,444,475.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	54,274,197

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人于本报告期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

本基金本报告期内未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灵活主题股票型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华灵活主题股票型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华灵活主题股票型证券投资基金托管协议》

(四)《新华灵活主题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《新华灵活主题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

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。

新华基金管理有限公司
二〇一三年十月二十五日

新华优选消费股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十五日

§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2013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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华优选消费股票
基金主代码	519150
交易代码	519150
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月13日
报告期末基金份额总额	154,360,065.12份
投资目标	精选消费行业中具有持续成长潜力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	本基金主要从定性分析和定量分析两个方面进行消费个股的精选。
业绩比较基准	80%×中证内地消费主题指数收益率 +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预期收益品种,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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	8,877,766.86
2.本期利润	15,050,501.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.2076
4.期末基金资产净值	220,514,128.10
5.期末基金份额净值	1.429

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

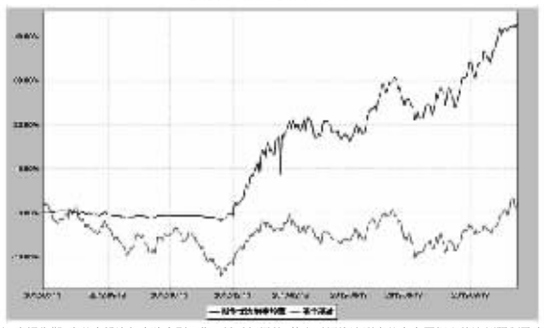
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.52%	0.92%	12.64%	0.98%	4.88%	-0.06%

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

新华优选消费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

(2012年6月13日至2013年9月30日)



注:本报告期,本基金投资组合除个别工作日被动超标外,其余时间均达到本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§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、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理;新华趋势领航股票型证券投资基金基金经理;公司基金管理部副总监	2012-6-13	-	18	经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津伟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。现任新华基金管理有限公司基金管理部副总监、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理和新华优选消费股票型证券投资基金基金经理、新华趋势领航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

本报告期内,新华基金管理有限公司作为新华优选消费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》、《新华优选消费股票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于方的交易,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,由中央交易室根据投资总监、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运作分析

2013年第三季度,市场震荡上扬、表现强势。其中新兴成长板块、大众消费板块和十八届三中全会密切相关的主题投资板块均表现强劲,而绩优蓝筹和传统周期板块则表现一般。

三季度之所以股市表现较好,原因是多方面的。首先,6月底的资金紧张导致股市大幅下跌,释放了很大一部分市场风险,使得三季度开始时股市整体位于较低位置;其次,七八月份的经济表现相对强劲,流动性紧张的局面得到较大缓解,市场面临的系统性风险很小,大盘基本没有调整压力,为题材股的"兴风作浪"提供了良好的市场平台;最后,三中全会临近,主题投资不断涌现,很多消费股进入补涨主升浪,新兴成长也借势继续表现。

展望四季度,我们认为市场短期可能有较大回调压力,十八届三中全会附近将是行情分水岭。首先,经济内生动力低于预期,呈现旺季不旺特征;其次,三中全会之后市场短期面临利好兑现的尴尬局面;再次,IPO在三中全会之后可能重启,将会对市场尤其是创业板造成冲击;最后,基金年底调仓风险对新兴成长股的短期表现也不利。综合看,我们四季度相对看好低位的消费股、具有防御价值的绩优蓝筹,以及部分新主题投资,如地方国资国企改制主题等。

四季度本基金将以防御为主,在较低仓位的基础上,侧重配置我们看好的行业或板块。

长期看,我们更强调自下而上的选股策略,选出能够穿越经济波动、长期保持快速增长的细分行业个股龙头,将更能带来超额收益。故本基金仍然坚持精选个股并兼顾行业优选配置策略,力争取得较好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为1.429元,本报告期份额净值增长率为17.52%,同期比较基准的增长率为12.64%。

§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	120,846,584.92	51.82
	其中:股票	120,846,584.92	51.82
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	34,536,303.52	14.81
6	其他各项资产	77,810,441.63	33.37
7	合计	233,193,330.07	100.00

注:本报告期末(2013年9月30日)本基金股票投资占基金资产比例低于60%,系大额申购造成被动超标。

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	8,355,650.00	3.79
C	制造业	79,574,967.56	36.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,879,000.00	0.85
E	建筑业	157,584.00	0.07
F	批发和零售业	1,278,000.00	0.58
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	3,525,850.00	1.60
J	金融业	14,358,015.36	6.51
K	房地产业	8,027,058.00	3.64
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,586,300.00	1.17
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	65,460.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,038,700.00	0.47
	合计	120,846,584.92	54.80

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	002557	洽洽食品	416,551	9,297,418.32	4.22
2	000848	承德露露	221,566	6,427,629.66	2.91
3	000525	红 太 阳	372,701	6,280,011.85	2.85
4	300164	通源石油	365,000	6,135,650.00	2.78
5	600104	上汽集团	380,000	5,141,400.00	2.33
6	002226	江南化工	346,100	4,765,797.00	2.16
7	002104	恒宝股份	300,000	4,680,000.00	2.12
8	002496	辉丰股份	307,617	4,088,229.93	1.85
9	002010	传化股份	416,720	3,946,338.40	1.79
10	000876	新 希 望	320,000	3,705,600.00	1.68

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名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名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名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 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

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	185,046.28
2	应收证券清算款	65,063,749.30
3	应收股利	-
4	应收利息	13,659.26
5	应收申购款	12,547,986.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,810,441.63

5.10.4 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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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	82,286,490.21
本报告期基金总申购份额	192,724,485.04
减:本报告期基金总赎回份额	120,650,910.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	154,360,065.12

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人于本报告期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

本基金本报告期内未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优选消费股票型证券投资基金募集的文件

(二)《新华优选消费股票型证券投资基金基金合同》

(三)《新华优选消费股票型证券投资基金托管协议》

(四)更新的《新华优选消费股票型证券投资基金招募说明书》

(五)关于申请募集新华优选消费股票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

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。

新华基金管理有限公司
二〇一三年十月二十五日

新华中小市值优选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十五日

§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10月24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7月1日起至9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	233,378,594.36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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	16,127,517.99
2.本期利润	24,905,182.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0907
4.期末基金资产净值	239,826,607.95
5.期末基金份额净值	1.028

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	8.67%	1.05%	13.12%	1.11%	-4.45%	-0.06%

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

新华中小市值优选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

(2011年1月28日至2013年9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于方的交易,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,由中央交易室根据投资总监、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运作分析

在三季度,与"新经济"沾边的品种继续高歌猛进。由于短期无法证伪,只要有一点想象空间的品种都被投资者无限憧憬。传媒、计算机等行业涨幅惊人。本基金相对谨慎,缺席了这场盛宴,表现不尽如人意。

由于市场上大部分的概念都得到了相当充分的挖掘,而权重股又缺乏向上所需的基本面支撑。因此,我们预计四季度投资机会有限。我们相对看好必须消费品、国企改革预期、环保力度加大等带来的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为1.028