新华优选消费混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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:二〇一五年十月二十四日

§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2015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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华优选消费混合
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	532,347,808.71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	本基金为混合型基金,基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。
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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	34,883,956.04
2.本期利润	-305,218,514.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5638
4.期末基金资产净值	944,506,764.17
5.期末基金份额净值	1.774

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。

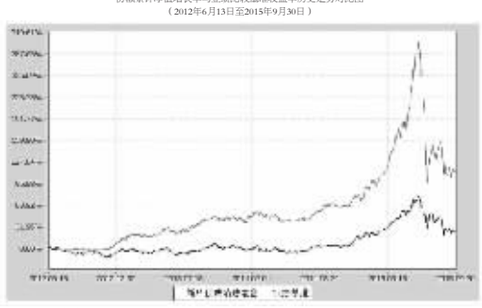
3.2 基金净值表现

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	-24.32%	3.42%	-20.10%	2.68%	-4.22%	0.74%

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

新华优选消费混合型证券投资基金
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2015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		
崔建波	本基金基金经理、新华基金管理股份有限公司总经理助理兼投资总监、基金管理部总监、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、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理、新华优选分红混合型证券投资基金基金经理、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。	2012-06-13	-	20	经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津茂楼营业部投资经理助理、海融资讯系统有限公司研发员、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业务投资经理。现任新华基金管理股份有限公司总经理助理兼投资总监、基金管理部总监、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、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理、新华优选分红混合型证券投资基金基金经理、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。

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优选消费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》、《新华优选消费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,同时包括投权、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、或交确认,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或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 投资管理人在报告期内采取的风险管理措施和运作分析

2015年3季度在市场清理配资和汇率贬值预期的影响下,上证指数从高点最大跌幅达到45%,而创业板指数最大跌幅达到56%,基金维持较低仓位配置,虽然也在下跌,但表现好于同类基金,配置方面,偏防御板块和周期板块为主,重点配置医药生物、计算机、化工、汽车、机械设备、食品饮料、公用事业等板块。9月中旬开始随着清理场外配资逐步进入尾声,人民币贬值预期降低,市场逐步企稳,基金小幅增加仓位配置,目前,整体仓位偏低,未来将根据对市场的提前预判及时调整仓位配置,根据市场热点,成长性以及估值,精选主题和个股。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.774元,本报告期份额净值增长率为-24.32%,同期比较基准的增长率为-20.10%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计4季度经济将底部徘徊,难以出现明显改善。进出口增速低迷,消费平稳,基建和地产投资有望改善。美国9月非农数据大幅低于市场预期,短期加息可能性降低,年内最多加息1次,很可能不会加息,全球流动性仍然保持宽松格局。

4季度指数总体区间震荡行情,波动率将显著降低。4季度我们认为先涨后跌概率更大,看好4季度初的反弹行情,不排除十八届五中全会后指数再次出现回调,但回调难以再创新低,总体市场风险可控。

4季度我们先看好4季度初反弹的主题投资机会,届时最大催化剂就是十三五规划,目前去杠杆接近尾声,人民币贬值预期弱化,前期个股超跌,近期政府稳定股市意愿强,提供了较好的反弹时间窗口。4季度初建议重点关注主题投资和超跌股,建议关注:十三五规划、新材料、互联网+、工业4.0、基因检测、核电、信息安全、电改、油气改革、迪斯尼、东北振兴等。五中全会后,3季报也披露完成,市场会对个股、板块全年业绩有更好的把握,届时有业绩的股票将迎来大分化行情,可甄选真成长公司进行战略配置。五中全会后我们对市场态度偏谨慎,经历前期主题投资,估值修复后,市场催化剂减少,获利盘有回吐可能。年底IMF对中国的SDR表决能否通过很关键,如果通过将会短期刺激市场上涨,但如果没有通过,市场可能迎来较大调整,彼时我们建议配置优质成长股和低估值白马股,包括金融、中字头、食品饮料、医药、餐饮、环保、新能源汽车、离岸产业链等板块龙头个股。12月美联储议息会议很重要,我们将密切关注。

4.7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	567,852,330.67	59.76
	其中:股票	567,852,330.67	59.76
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	381,304,370.65	40.12
7	其他资产	1,136,430.57	0.12
8	合计	950,293,131.89	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	1,972,000.00	0.21
B	采矿业	9,180,170.00	0.97
C	制造业	341,997,583.98	36.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,046,922.51	3.39
E	建筑业	2,541,921.30	0.27
F	批发和零售业	29,444,372.73	3.12
G	交通运输、仓储和邮政业	9,931,420.00	1.05
H	住宿和餐饮业	3,663,236.50	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,392,527.61	5.34
J	金融业	-	-
K	房地产业	65,937,384.05	6.98
L	租赁和商务服务业	745,400.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	487,160.00	0.05
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	2,705,164.00	0.29
S	综合	16,807,067.99	1.78
	合计	567,852,330.67	60.12

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	000002	万 科A	1,850,800	23,560,684.00	2.49
2	600129	太极集团	1,200,204	18,987,227.28	2.01
3	600422	昆药集团	562,700	16,858,492.00	1.78
4	600455	博通股份	351,027	15,575,067.99	1.65
5	002481	双塔食品	350,000	12,148,500.00	1.29
6	600476	湘邮科技	480,670	12,011,943.30	1.27
7	002215	诺 普 信	977,361	11,786,973.66	1.25
8	002599	盛通股份	500,472	11,295,653.04	1.20
9	002708	光洋股份	538,260	11,201,190.60	1.19
10	600315	上海家化	275,877	9,506,721.42	1.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本期末未持有债券。

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

本基金本期末无权证。

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

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

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	450,925.30
2	应收证券清算款	603,721.89
3	应收股利	-
4	应收利息	69,084.74
5	应收申购款	12,698.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,136,430.57

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	600315	上海家化	9,506,721.42	1.01	筹划重大事项停牌
2	002481	双塔食品	12,148,500.00	1.29	筹划重大事项停牌

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	548,379,964.97
本报告期基金总申购份额	57,246,191.09
减:本报告期基金总赎回份额	73,278,347.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	532,347,808.71

§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

本基金管理人本报告期未持有本基金。

7.2 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

1、 经新华基金管理有限公司董事会、股东会审议决议,重庆市工商行政管理局核准,报中国证监会备案,新华基金管理有限公司法定名称变更为"新华基金管理股份有限公司",住所变更为"重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层",公司股权结构等事项未发生变化。

2、 为符合2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定,根据《中国人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规的规定以及《新华中小市值优选股票型证券投资基金基金合同》的约定,新华中小市值优选股票型证券投资基金自2015年8月4日起基金类别变更为混合型基金,基金合同部分条款相应修订,变更基金类别并修订基金合同的事项不损害基金份额持有人的利益,亦不涉及基金合同当事人权利义务变化,依据法律法规和基金合同约定,无需召开基金份额持有人大会。变更修订事项已报中国证监会备案。

§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混合型证券投资基金募集的文件

(二)《新华优选消费混合型证券投资基金基金合同》

(三)《新华优选消费混合型证券投资基金托管协议》

(四)更新的《新华优选消费混合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
二〇一五年十月二十四日

新华中小市值优选混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十四日

§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2015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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华中小市值优选混合
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	65,824,170.55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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-25,124,872.89
2.本期利润	-28,962,111.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4962
4.期末基金资产净值	131,751,237.14
5.期末基金份额净值	2.002

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。

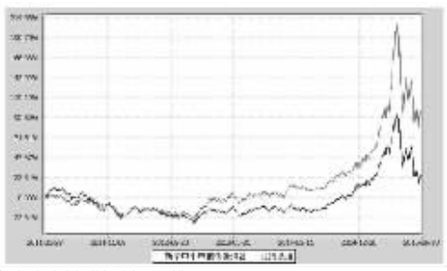
3.2 基金净值表现

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	-18.68%	3.28%	-25.13%	3.17%	6.45%	0.11%

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

新华中小市值优选混合型证券投资基金
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2015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		
贾兴振	本基金基金经理、新华鹏诺宝货币市场基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华财富金30天理财债券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、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。	2014-01-02	-	8	经济学硕士,8年证券从业经验。历任北京城市系统工程研究中心研究员。贾兴振先生于2007年9月加入新华基金管理股份有限公司,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。现任新华鹏诺宝货币市场基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华财富金30天理财债券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》、《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》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,同时包括投权、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、或交确认,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或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 投资管理人在报告期内采取的风险管理措施和运作分析

4.4.1 市场回顾

6月中旬开始随着清理场外配资力度加强,上证综指和创业板指数连续暴跌,上证指数最大跌幅46%,创业板最大跌幅56%,跌幅大,且跌速快。9月中下旬市场情绪有好转,指数温和反弹。本基金在市场下跌过程中控制仓位和增加有安全边际标的,相对跌幅不大。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为2.002元,本报告期份额净值增长率为-18.68%,同期比较基准的增长率为-25.13%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计第4季度指数宽幅震荡概率较大,看好第4季度的阶段性反弹机会。重点关注十三五规划、国企改革、新材料、新能源汽车、互联网+、工业4.0、信息安全等。在震荡市中,波段操作博弈市场预期差收益,同时配置攻守兼备的标的获取绝对收益。

4.7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	93,963,333.48	69.58
	其中:股票	93,963,333.48	69.58
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	40,567,982.14	30.04
7	其他资产	514,297.21	0.38
8	合计	135,045,612.83	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	391,685.00	0.30
B	采矿业	47,400.00	0.04
C	制造业	62,456,593.81	47.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	792,900.00	0.60
E	建筑业	1,430,884.85	1.09
F	批发和零售业	3,777,408.00	2.87
G	交通运输、仓储和邮政业	798,000.00	0.61
H	住宿和餐饮业	349,632.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,008,750.57	7.60
J	金融业	7,767,365.38	5.90
K	房地产业	2,956,319.17	2.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	527,800.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	1,635,670.70	1.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	388,024.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	634,900.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	93,963,333.48	71.32

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	002271	东方雨虹	157,808	2,785,311.20	2.11
2	300024	机器人	44,291	2,511,299.70	1.91
3	601318	中国平安	77,450	2,312,657.00	1.76
4	600703	三安光电	107,000	2,111,110.00	1.60
5	600422	昆药集团	64,540	1,933,618.40	1.47
6	002675	东诚药业	47,040	1,859,491.20	1.41
7	600963	岳阳林纸	267,635	1,795,830.85	1.36
8	002304	洋河股份	32,561	1,774,248.89	1.35
9	600079	人福医药	115,300	1,739,877.00	1.32
10	002236	大华股份	51,363	1,736,583.03	1.32

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属。

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

报告期末,本基金未持有权证。

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

报告期末,本基金未持有债券。

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

5.11.12014年12月8日,中国平安(601318.SH)子公司平安证券因出具的保荐书存在虚假记载被证监会给予警告,并没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2867万元,并处以440万元罚款。

除此之外,基金投资前十名证券没有被监管部门立案调查或公开谴责、处罚。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	170,633.24
2	应收证券清算款	273,076.38
3	应收股利	-
4	应收利息	7,553.20
5	应收申购款	63,034.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	514,297.21

5.11.4 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。

5.11.5 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的情况。

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	58,456,068.24
本报告期基金总申购份额	29,201,539.67
减:本报告期基金总赎回份额	21,833,437.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	65,824,170.55

§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

本基金管理人本报告期未持有本基金。

7.2 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

经新华基金管理有限公司董事会、股东会审议决议,重庆市工商行政管理局核准,报中国证监会备案,新华基金管理有限公司法定名称变更为"新华基金管理股份有限公司",住所变更为"重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层",公司股权结构等事项未发生变化。"新华基金管理有限公司"对外签订的金邮合同、协议及金邮债权、债务关系将由"新华基金管理股份有限公司"承继。

为符合2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定,根据《中国人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规的规定以及《新华中小市值优选股票型证券投资基金基金合同》的约定,新华中小市值优选股票型证券投资基金自2015年8月4日起基金类别变更为混合型基金,基金合同部分条款相应修订。

§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中小市值优选混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华中小市值优选混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华中小市值优选混合型证券投资基金托管协议》

(四)《新华中小市值优选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《新华中小市值优选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
二〇一五年十月二十四日

新华增盈回报债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十四日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华增盈回报债券
基金主代码	000973
交易代码	000973
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月16日
报告期末基金份额总额	500,928,963.85份
投资目标	本基金在有效控制风险、追求本金安全的基础上,力争通过积极主动的投资管理,为基金份额持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括:大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先,本基金管理人将采用战略性与战术性相结合的大类资产配置策略,在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例。在此基础之上,一方面综合运用久期策略、收益率曲线策略以及信用策略进行固定收益类资产投资组合的构建;另一方面采用以下四大的个股精选策略,精选具有持续成长性且估值相对合理,同时投价具有趋势向上的股票构建权益类资产投资组合,以提高基金的整体收益水平。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债企业债总全价指数收益率×60%+中债国债总全价指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§3