新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31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:二〇一四年一月二十一日

§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2014年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华纯债添利债券发起	
基金主代码	519152	
基金运作方式	契约型开放式基金	
基金合同生效日	2012年12月21日	
报告期末基金份额总额	292,313,184.85份	
投资目标	本基金通过对债券组合的久期、期限结构、类属品种以及单个债券进行积极主动的配置,力争在严格控制投资组合风险的同时,提高基金资产的流行性及收益率水平,为投资者提供长期稳定的投资回报。	
投资策略	基金的投资策略主要包括:利率预期策略、类属品种配置策略以及证券选择策略。采用定量与定性相结合的研究方法,深入分析市场利率发展方向、期限结构变化趋势、信用主体评级水平以及单个债券的投资价值,积极主动进行类属品种配置及个券选择,谋求基金资产的长期稳定增值。	
业绩比较基准	中债新综合指数(总价)。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均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	新华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
下属两级基金的交易代码	519152	519153
报告期末下属两级基金的份额总额	59,818,654.50份	232,494,530.35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(2013年10月1日-2013年12月31日)	
	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
1.本期已实现收益	1,641,833.10	6,582,104.43
2.本期利润	-1,752,710.73	-7,518,838.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0197	-0.0201
4.期末基金资产净值	60,935,286.84	235,639,068.06
5.期末基金份额净值	1.019	1.014

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

1.新华纯债添利债券发起A类:

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	-1.92%	0.12%	-2.60%	0.09%	0.68%	0.03%

2.新华纯债添利债券发起C类:

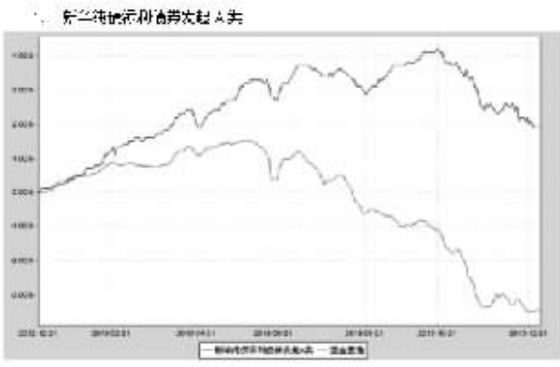
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.03%	0.12%	-2.60%	0.09%	0.57%	0.03%

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

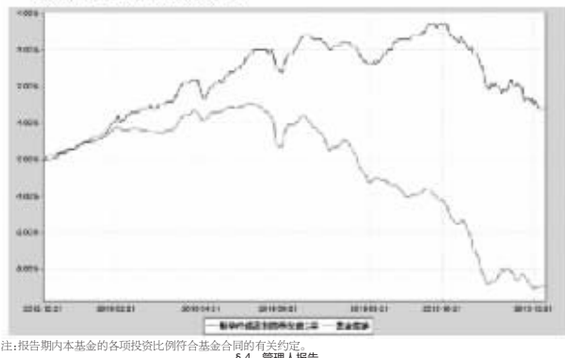
新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年12月21日至2013年12月31日)



2.新华纯债添利债券发起C类



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		
于泽雨	本基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理	2012-12-21	-	5	经济学博士,5年证券从业经验。历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理,于2012年10月加入新华基金管理有限公司,现任新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理。
贲兴振	本基金基金经理、新华兴盛主题股票型证券投资基金基金经理、新华童诺宝货币市场基金基金经理	2012-12-21	-	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、新华童诺宝货币市场基金基金经理。

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纯债添利债券型发起式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》、《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金合同》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

四季度债市继续调整,一、二级利率大幅攀升,市场需求弱,很多一级发行人选择推迟融资或分期发行,新增供给大幅下滑。目前来看,市场出现超预期调整的主要原因在于:利率市场化的背后是理财机构、产品的多元化,在央行采取紧缩之后,理财机构、产品的多元化加剧了短期资金的紧张程度,这种变化可能是央行和市场没有充分估计到的。本基金在四季度受到市场下跌和基金赎回的双重挤压,操作上主要是不断减仓以应对赎回,同时仓位也不断上升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金A类份额净值为1.019元,本报告期份额净值增长率为-1.92%,同期比较基准的增长率为-2.60%;本基金C类份额净值为1.014元,本报告期份额净值增长率为-2.03%,同期比较基准的增长率为-2.60%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	595,222,186.70	95.31
	其中:债券	595,222,186.70	95.31
	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	16,373,505.13	2.62
6	其他资产	12,948,108.72	2.07
7	合计	624,543,800.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

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

报告期末,本基金未持有股票。

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	19,998,000.00	6.74
	其中:政策性金融债	19,998,000.00	6.74
4	企业债券	556,056,186.70	187.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,168,000.00	6.46
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	595,222,186.70	200.70

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	1280159	12朝阳建投债	300,000	29,496,000.00	9.95
2	1280305	12合力债	300,000	29,373,000.00	9.90
3	1280437	12立业债	300,000	29,208,000.00	9.85
4	1280415	12经投债	300,000	28,914,000.00	9.75
5	122522	12兴城建	293,630	28,758,122.20	9.70

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

本基金合同约定本基金不能投资股指期货。

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

本基金合同约定本基金不能投资国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金合同约定本基金不能投资国债期货。

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证券没有超出基金合同约定。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	105,977.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,842,130.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,948,108.72

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金合同约定本基金不能投资股票。

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

项目	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
本报告期期初基金份额总额	106,918,985.27	531,184,340.07
本报告期基金总申购份额	342,862.51	10,926,789.71
减:本报告期基金总赎回份额	47,443,193.28	309,616,599.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	59,818,654.50	232,494,530.35

§7 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,900.00	3.42%	9,999,900.00	3.42%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	9,999,900.00	3.42%	9,999,900.00	3.42%	

§8 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纯债添利债券型发起式证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华纯债添利债券型发起式证券投资基金之法律意见书

(三)《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金托管协议》

(四)《新华纯债添利债券型发起式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《新华纯债添利债券型发起式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
二〇一四年一月二十一日

新华灵活主题股票型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31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:二〇一四年一月二十一日

§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2014年1月20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10月1日起至12月31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	45,465,478.11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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-147,497.53
2.本期利润	-1,187,799.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0241
4.期末基金资产净值	50,024,215.81
5.期末基金份额净值	1.100

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

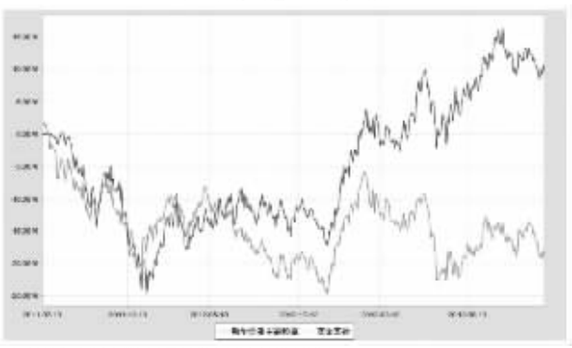
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3月	-2.31%	0.81%	-2.45%	0.90%	0.14%	-0.09%

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12月31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		
李晟	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。李晟女士于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、新华童诺宝货币市场基金基金经理	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、新华童诺宝货币市场基金基金经理。

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

第四季度,市场总体在十八届四中全会的改革憧憬和经济增速下滑的预期下保持震荡态势。上证综指和沪深300指数跌幅分别为-4.71%和-4.47%;代表新兴产业的创业板综合指数先扬后抑,跌幅-3.7%。整体看市场在第四季度处于调整状态,结构性机会也不明显。

展望2014年,我们认为经济在上半年至少仍会保持疲弱状态,资金利率高企的现状很难根本性改变,改革仍会持续进行,产能调整难以完全结束。经历此轮的充分调整后,配合着改革红利,我们认为新一轮的经济周期正在酝酿。

从股票市场看,新股密集上市、资金利率较高、流动性偏紧的现状难以改变。但由于市场经历第四季度的调整后,估值逐步接近合理水平,仍会为我们提供一些长期性机会。

综上,我们认为明年上半年市场的机会主要是从下跌中寻觅到的机会,以及一些细分行业的复苏性机会。同时,作为主题类基金,也将主动配置消费升级、节能环保、科技改变生活、改革转型等的长期主题机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为1.100元,本报告期份额净值增长率为-2.31%,同期比较基准的增长率为-2.45%。

§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	35,970,505.30	69.60
	其中:股票	35,970,505.30	69.60
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	7,900,000.00	15.29
	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	7,049,569.26	13.64
6	其他资产	761,777.62	1.47
7	合计	51,681,852.18	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	21,925,809.55	43.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,299,451.06	4.60
F	批发和零售业	2,970,440.81	5.94
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	2,241,100.00	4.48
J	金融业	2,929,965.00	5.86
K	房地产业	1,563,150.00	3.12
L	租赁和商务服务业	90,632.88	0.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,187,880.00	2.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	762,076.00	1.52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	35,970,505.30	71.91

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	600803	威远生化	154,335	1,915,297.35	3.83
2	002157	正邦科技	237,852	1,850,488.56	3.70
3	002594	比亚迪	48,500	1,827,480.00	3.65
4	600887	伊利股份	42,000	1,641,360.00	3.28
5	603008	喜临门	130,800	1,394,328.00	2.79
6	002251	步步高	80,000	1,102,400.00	2.20
7	002387	黑牛食品	138,000	1,088,820.00	2.18
8	600759	正和股份	135,000	1,075,950.00	2.15
9	000776	广发证券	85,100	1,062,048.00	2.12
10	600104	上汽集团	71,474	1,010,642.36	2.02

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	332,400.91
2	应收证券清算款	423,274.55
3	应收股利	-
4	应收利息	2,349.58
5	应收申购款	3,752.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	761,777.62

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	54,274,197
本报告期基金总申购份额	1,305,213.11
减:本报告期基金总赎回份额	10,113,932
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,465,478.11

§7 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

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
二〇一四年一月二十一日

新华优选消费股票型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31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:二〇一四年一月二十一日

§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2014年1月17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10月1日起至12月31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	165,058,151.52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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	7,322,142.25
2.本期利润	4,372,652.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0313
4.期末基金资产净值	238,727,535.90
5.期末基金份额净值	1.446

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

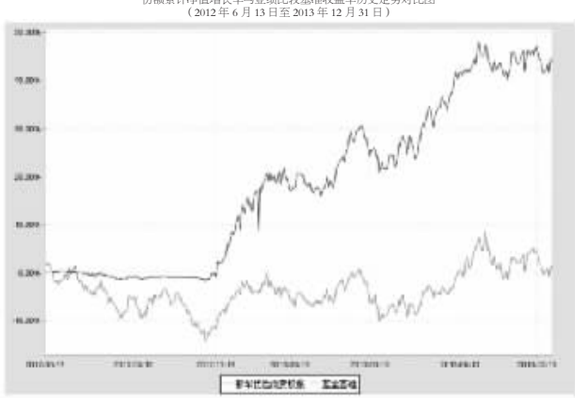
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.19%	0.96%	-1.16%	1.17%	2.35%	-0.21%

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12月31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、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、瑞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。
孔雪梅	本基金基金经理、研究部总监	2013-11-12	-	5	管理学硕士,于2008年3月加入新华基金管理有限公司,负责行业研究。现任新华基金管理有限公司研究部总监、新华优选消费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