

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:二〇一二年四月二十四日

#### § 1 重要提示

基金管理人的董事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2012年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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。  
本报告自2012年1月1日起至3月31日止。

#### § 2 基金产品概况

基金简称	新华泛资源优势混合
基金代码	519091
交易代码	519091
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月13日
报告期末基金份额总额	724,462,244.32份
投资目标	在有效控制风险的前提下,通过重点精选与集中配置具有社会资源和自然资源(泛资源)优势的股票,实现基金净值增长,以求持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采用“自上而下”结合“自下而上”的投资策略,通过股票选择、行业配置、结合自上而下的技术性大类资产配置策略,进行积极投资管理。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%×上证国债指数
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高等风险品种,预期风险和收益高于债券型、货币型基金,低于股票型基金。
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

主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-13,609,798.29
2.本期利润	4,626,026.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0063
4.期末基金资产净值	662,632,176.49
5.期末基金份额净值	0.915

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

阶段	净值增长 率①	业绩比较 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	0.66%	1.24%	3.27%	0.91%	-2.61%	0.33%

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

新华泛资源优势灵活配置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历史走势对比图  
2009年7月13日至2012年3月31日



注:本报告期,本基金各资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## 新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

## 【2012】第一季度报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
崔建波	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、公司基金管理部副总监	2010-3-24	-	17
桂跃强	本基金基金经理、新华中小市值优选股票型证券投资基金经理	2011-6-27	-	5

4.1 基金经理 或基金经理小组]简介

4.2 管理人对于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泛资源优势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》、《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金合同》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  
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决策、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所对手询价、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  
本报告期内,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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明  
截至2012年3月31日,本基金份额净值增长率为0.915元,本报告期份额净值增长率为0.66%,同期比较基准的增长率为3.27%。

#### § 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	434,927,686.79	64.46
	其中:股票	434,927,686.79	64.46
2	固定收益投资	83,985,523.00	12.43
	其中:债券	83,985,523.00	12.43
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	152,536,470.82	22.61
8	其他各项资产	3,314,661.14	0.49
9	合计	674,764,341.75	100.00

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	1,831,500.00	0.28
B	采掘业	7,583,991.03	1.14
C	制造业	223,485,898.18	33.73
C0	食品、饮料	46,048,406.46	6.95
C1	纺织、服装、皮毛	16,340,920.20	2.47
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	41,035,501.14	6.19
C5	电子	4,751,728.16	0.72
C6	金属、非金属	8,354,400.00	1.26
C7	机械、设备、仪表	80,407,958.22	12.13
C8	医药、生物制品	14,312,834.70	2.16
C99	其他制造业	12,234,149.30	1.85
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	52,933,699.58	7.99
H	批发和零售贸易	2,848,448.40	0.43
I	金融、保险业	77,085,591.29	11.63
J	房地产业	56,552,232.48	8.53
K	社会服务业	6,270,325.83	0.95
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,336,000.00	0.96
9	合计	434,927,686.79	65.64

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	000602	*ST金马	1,241,000	30,528,600.00	4.61
2	300072	三聚环保	1,365,187	24,737,188.44	3.73
3	300222	科大智能	1,250,530	20,783,808.60	3.14
4	600887	伊利股份	897,488	19,780,635.52	2.99
5	600519	贵州茅台	95,100	18,730,896.00	2.83
6	600036	招商银行	1,514,951	18,027,916.90	2.72
7	002485	希格玛	825,299	16,340,920.20	2.47
8	002450	康得新	1,007,205	15,591,533.40	2.35
9	000002	万科A	1,675,000	13,869,000.00	2.09
10	300170	润德股份	738,437	12,590,350.85	1.90

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	000602	*ST金马	1,241,000	30,528,600.00	4.61
2	300072	三聚环保	1,365,187	24,737,188.44	3.73
3	300222	科大智能	1,250,530	20,783,808.60	3.14
4	600887	伊利股份	897,488	19,780,635.52	2.99
5	600519	贵州茅台	95,100	18,730,896.00	2.83
6	600036	招商银行	1,514,951	18,027,916.90	2.72
7	002485	希格玛	825,299	16,340,920.20	2.47
8	002450	康得新	1,007,205	15,591,533.40	2.35
9	000002	万科A	1,675,000	13,869,000.00	2.09
10	300170	润德股份	738,437	12,590,350.85	1.90

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	120,743,613.91	61.89
2	其中:股票	120,743,613.91	61.89
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	74,069,792.76	37.96
10	其他各项资产	294,687.29	0.15
11	合计	195,108,093.96	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	2,809,200.00	1.52
B	采掘业	3,739,150.00	2.03
C	制造业	64,042,243.16	34.76
C0	食品、饮料	5,899,400.00	3.20
C1	纺织、服装、皮毛	4,886,393.00	2.65
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	19,995,751.60	10.85
C5	电子	10,238,136.56	5.56
C6	金属、非金属	4,072,360.00	2.21
C7	机械、设备、仪表	14,476,432.00	7.80
C8	医药、生物制品	2,822,000.00	1.53
C99	其他制造业	1,751,770.00	0.95
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,525,800.00	1.91
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	10,041,829.75	5.45
H	批发和零售贸易	2,968,200.00	1.61
I	金融、保险业	27,371,600.00	14.85
J	房地产业	3,193,500.00	1.73
K	社会服务业	1,861,091.00	1.01
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,191,000.00	0.65
合计	合计	120,743,613.91	65.53

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	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	74,906,144.10	61.13
2	其中:股票	74,906,144.10	61.13
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	15,237,998.65	12.44
10	其他各项资产	32,381,950.96	26.43
11	合计	122,526,093.71	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	4,915,646.79	4.06
B	采掘业	517,122.10	0.43
C0	食品、饮料	6,347,566.00	5.24
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	240,216.80	0.20
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,283,100.68	10.97
C5	电子	2,007,561.50	1.66
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	4,346,373.16	3.59
C8	医药、生物制品	3,325,461.39	2.75
C99	其他制造业	2,267,559.42	1.87
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	207,400.00	0.17
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,541,724.32	3.75
H	批发和零售贸易	1,694,018.80	1.40
I	金融、保险业	19,755,612.64	16.32
J	房地产业	3,631,590.50	3.00
K	社会服务业	5,425,990.00	4.48
L	传播与文化产业	2,399,200.00	1.98
M	综合类	-	-
合计	合计	74,906,144.10	61.88

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	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	74,906,144.10	61.13
2	其中:股票	74,906,144.10	61.13
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	15,237,998.65	12.44
10	其他各项资产	32,381,950.96	26.43
11	合计	122,526,093.71	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	4,915,646.79	4.06
B	采掘业	517,122.10	0.43
C0	食品、饮料	6,347,566.00	5.24
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	240,216.80	0.20
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,283,100.68	10.97
C5	电子	2,007,561.50	1.66
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	4,346,373.16	3.59
C8	医药、生物制品	3,325,461.39	2.75
C99	其他制造业	2,267,559.42	1.87
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	207,400.00	0.17
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,541,724.32	3.75
H	批发和零售贸易	1,694,018.80	1.40
I	金融、保险业	19,755,612.64	16.32
J	房地产业	3,631,590.50	3.00
K	社会服务业	5,425,990.00	4.48
L	传播与文化产业	2,399,200.00	1.98
M	综合类	-	-
合计	合计	74,906,144.10	61.88

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	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	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	83,985,523.00	12.67
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债	-	-
9	其他	-	-
10	合计	83,985,523.00	12.67

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十名债券投资明细

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	122014	09豫园债	332,710	33,703,523.00	5.09
2	0908130	09伊城投债	200,000	20,062,000.00	3.03
3	123001	09农发债	200,000	20,000,000.00	3.02
4	122931	09临海债	100,000	10,220,000.00	1.54

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  
本报告期末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权证投资明细  
本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注  
5.8.1 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。  
5.8.2