天治稳健双盈债券型证券投资基金

【2012】第三季度报告

基金管理人：天治基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年十月二十四日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天治稳健双盈债券
基金主代码	350006
交易代码	350006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月5日
报告期末基金份额总额	505,274,099.97份
投资目标	在注重资产安全性和流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金根据宏观经济运行状况、货币政策及利率走势的综合判断，运用自上而下的资产配置与品种选择策略，并充分利用各种套利策略，实现基金的保值增值。此外，本基金可以参与股票一级市场申购和二级市场投资。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于主动管理的债券型基金，为证券投资基金中的较低风险较低收益品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	天治基金管理有限公司
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	9,920,760.34
2.本期利润	-3,514,794.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0065
4.期末基金资产净值	538,072,060.30
5.期末基金份额净值	1.0649

注：1、上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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

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	-0.08%	0.31%	-0.17%	0.07%	0.09%	0.24%

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

天治稳健双盈债券型证券投资基金
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
(2008年11月5日至2012年9月30日)

注：按照本基金合同规定，本基金债券类资产（包括国债、金融债、企业债、可转换债券、资产支持证券、央行票据、债券回购等）的投资比例不低于基金资产的80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金自2008年11月5日基金合同生效日起六个月内，达到了本基金合同第12条规定的投资比例限制。截止本报告期末，本基金符合上述要求。

§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		
秦娟	固定收益部总监、本基金的基金经理、天治稳定收益债券型证券投资基金的基金经理。	2010-4-14	-	8	经济学硕士研究生，具有基金从业资格，证券从业经验8年，历任广东证券股份有限公司债券分析师、东莞银行股份有限公司债券分析师、长信基金管理有限责任公司债券研究员，2010年4月14日至2012年6月29日任天治天得利货币市场基金的基金经理，现任本公司固定收益部总监、本基金的基金经理、天治稳定收益债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、表内的任职日期和离任日期为公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同》、《天治稳健双盈债券型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产，为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》。本基金管理人公平交易体系涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，并通过明确投权限划分、建立统一研究报告管理平台、分层次建立适用全公司及各投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库、应用投资管理系统公平交易相关程序、定期对不同投资组合收益率差异、交易价差、成交量事后量化分析评估等一系列措施切实落实各项公平交易制度。

报告期内，本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人没有所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形。

报告期内，本基金管理人未发现异常交易行为。

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

2012年三季度，通胀指数保持平稳，基本维持在2%左右，由于翘尾因素的逐步消失，四季度继续下行的概率不大。货币政策方面，央行迟迟没有降准，而是不断的用逆回购的方式投放资金，受到外汇占款净流出和季末因素的影响，资金面呈现出紧平衡的状态。由于上半年债券涨幅比较大，所以三季度展开了调整，各类限限的债券轮番下跌，尤其是久期较长的中低评级信用债，所以本基金三季度主要减了债券的杠杆，降低了之前获利较多的城投债的仓位，节奏把握比较准。

另外，三季度由于股市跌幅较大，而本基金参与了一些股票的投资，主要以券商为主，在季度末的时候有较好表现。可转债方面，也进行了适当的调整配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金份额净值为1.0649元，报告期内本基金份额净值增长率为-0.08%，业绩比较基准收益率为-0.17%，超越同期业绩比较基准收益率0.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

第四季度来看，经济有底部企稳的迹象，在此背景下，通胀可能已经过了最低点，随着cpi的上行，对债市构成不太有利的因素，但是由于货币政策的紧平衡，且目前来看，经过三季度的调整，许多债券尤其是低评级信用债，已经回到年初时的水平，调整幅度有限。信用债收益率在四季度将维持区间震荡的走势。中低评级信用债的持有期收益仍然可观。本基金仍然采取哑铃型策略，在持有高票息信用债的同时，增加短久期利率产品的配置，以防年末流动性压力；另外可转债相对于历史估值来说，依然相当具有投资价值，尤其是大盘转债，仍然会持有待涨。权益投资方面，随着经济增速的寻底结束，企业利润也会明显改善，伴随着资金面的宽松，股市的反弹概率较高，所以仍然会适度参与，本基金计划继续参与券商、保险等周期类个股。

§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	99,850,498.92	17.13
	其中：股票	99,850,498.92	17.13
2	固定收益投资	464,471,077.60	79.70
	其中：债券	464,471,077.60	79.70
	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	5,481,415.13	0.94
6	其他各项资产	12,948,496.07	2.22
7	合计	582,751,487.72	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	采掘业	17,611,600.00	3.27
C	制造业	11,229,694.80	2.09
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	4,113,900.00	0.76
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,115,794.80	1.32
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,564,733.50	2.71
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	6,491,716.50	1.21
I	金融、保险业	27,680,078.87	5.14
J	房地产业	16,697,503.75	3.10
K	社会服务业	4,794,526.50	0.89
L	传播与文化产业	780,645.00	0.15
M	综合类	-	-
	合计	99,850,498.92	18.56

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	600123	兰花科创	580,000	11,437,600.00	2.13
2	601318	中国平安	235,000	9,855,900.00	1.83
3	600837	海通证券	940,000	9,005,200.00	1.67
4	000783	长江证券	955,469	8,818,978.87	1.64
5	002620	瑞和股份	483,065	7,680,733.50	1.43
6	603001	奥康国际	308,310	7,115,794.80	1.32
7	002482	广田股份	400,000	6,884,000.00	1.28
8	600739	辽宁成大	429,915	6,491,716.50	1.21
9	000926	福星股份	872,875	6,468,003.75	1.20
10	002353	杰瑞股份	140,000	6,174,000.00	1.15

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	2,926,550.00	0.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,055,000.00	9.30
	其中：政策性金融债	50,055,000.00	9.30
4	企业债券	287,593,825.00	53.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	123,895,702.60	23.03
8	其他	-	-
9	合计	464,471,077.60	86.32

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	120405	12农发05	500,000	50,055,000.00	9.30
2	113002	工行转债	495,000	49,995,000.00	9.29
3	110015	石化转债	437,390	42,558,047.00	7.91
4	1280109	12安阳投资债	300,000	31,395,000.00	5.83
5	1280234	12松江债	300,000	30,030,000.00	5.58

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 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	4,220,987.98
3	应收股利	31,725.00
4	应收利息	7,811,942.11
5	应收申购款	633,840.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,948,496.07

5.8.4 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	49,995,000.00	9.29
2	110015	石化转债	42,558,047.00	7.91
3	113001	中行转债	27,009,420.80	5.02
4	125887	中鼎转债	2,497,453.00	0.46
5	110011	歌华转债	1,835,781.80	0.34

5.8.5 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情况。

5.8.6 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	218,915,817.09
本报告期基金总申购份额	661,827,872.23
减：本报告期基金总赎回份额	375,469,589.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	505,274,099.97

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、天治稳健双盈债券型证券投资基金设立等相关批准文件

2、天治稳健双盈债券型证券投资基金基金合同

3、天治稳健双盈债券型证券投资基金招募说明书

4、天治稳健双盈债券型证券投资基金托管协议

5、本报告期内按照规定披露的各项公告

7.2 存放地点

天治基金管理有限公司办公地点—上海市复兴西路159号。

7.3 查阅方式

网址：www.chinanature.com.cn

天治基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

【2012】第三季度报告

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2012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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华泛资源优势混合
基金主代码	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	694,421,980.77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“自下而上”结合“自上而下”的投资策略，通过股票选择、行业配置，结合自上而下的战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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-17,891,817.48
2.本期利润	-19,686,202.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0281
4.期末基金资产净值	631,064,082.91
5.期末基金份额净值	0.909

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。

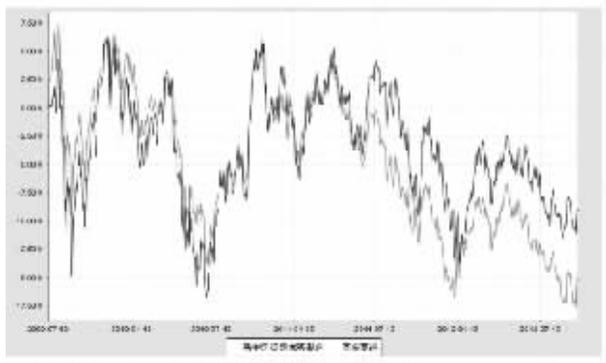
3.2 基金净值表现

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	-2.99%	0.76%	-3.75%	0.71%	0.76%	0.05%

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的历史走势对比图
(2009年7月13日至2012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		
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，新华优选消费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	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、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，新华优选成长股票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。
桂跃强	本基金基金经理，新华中小市值优选股票型基金基金经理	2011-6-27	-	5	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，没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

2012年第三季度，大盘以单边下跌为主，中间夹有较短的超跌反弹行情。我们在之前对经济形势和市场博弈进行了充分分析，认识到当前经济面临较长的困难，市场存在明显的场内资金博弈行为，故整个三季度本基金选择了较低仓位运作，并适度进行行业轮换，个股选择上更是精益求精、优中选优，导致基金表现较好。

展望2012年四季度，我们预计四季度经济将底部企稳、政策偏积极。物价水平已经触底，经济增速也有望逐步企稳，佐证就是基建投资持续反弹对冲了制造业投资的下滑风险、房地产投资和社会消费品总额初现企稳迹象，出口也有望在全球制造业触底的带动下逐步企稳。国内经济底部徘徊，国际经济不确定性因素较多，政策支持经济平稳发展的必要性毋庸置疑。政府本次给经济开的“药方”偏向标本兼治的“中医疗药”，更利于经济的长远发展。市场行情看，当前估值水平处于历史低位，大盘点位也连创新低，市场情绪被过度压制，这种情况下大盘随时会酝酿反弹行情。同时当前板块间估值差异较大，结构性行情也将会此起彼伏。而在泥沙俱下的下跌后，也正是真正的“金子”涌现的时候，此阶段是价值投资者最应该“千淘万漉”，布局长期看好的成长个股和行业的时候。行业上看好券商、建材、地产、汽车、信息设备、家电、商业贸易等。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。故本基金仍然坚持价值与成长的思路，2012年四季度在成长股方面精选个股，同时兼顾行业优选配置策略，力争取得较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年9月30日，本基金份额净值为0.909元，本报告期份额净值增长率为-2.99%，同期比较基准的增长率为-3.75%。

§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	275,535,174.35	42.92
	其中：股票	275,535,174.35	42.92
2	固定收益投资	64,469,504.00	10.04
	其中：债券	64,469,504.00	10.04
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,000.00	15.58
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	100,000,000.00	15.58
5	银行存款和结算备付金合计	124,791,253.92	19.44
6	其他各项资产	77,200,044.22	12.03
7	合计	641,995,976.49	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	1,721,475.60	0.27
B	采掘业	14,698,694.40	2.33
C	制造业	123,486,693.32	19.57
C0	食品、饮料	26,329,652.89	4.17
C1	纺织、服装、皮毛	4,358,172.50	0.69
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	24,495,548.13	3.88
C5	电子	2,475,722.00	0.39
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	64,715,711.15	10.26
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	1,111,886.65	0.18
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	6,113,489.50	0.97
G	信息技术业	17,820,222.60	2.82
H	批发和零售贸易	12,667,192.04	2.01
I	金融、保险业	43,537,106.40	6.90
J	房地产业	45,800,663.69	7.26
K	社会服务业	7,592,636.80	1.20
L	传播与文化产业	892,000.00	0.14
M	综合类	1,205,000.00	0.19
	合计	275,535,174.35	43.66

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	300072	三聚环保	1,813,949	20,370,647.27	3.23
2	600104	上汽集团	1,435,299	19,433,948.46	3.08
3	600519	贵州茅台	70,020	17,210,916.00	2.73
4	600028	中国石化	1,966,560	11,779,694.40	1.87
5	300222	科大智能	832,210	11,392,954.90	1.81
6	000001	平安银行	843,446	11,074,445.98	1.75
7	600741	华域汽车	1,102,162	10,448,495.76	1.66
8	002535	林州重机	1,236,609	9,188,004.87	1.46
9	600048	保利地产	797,135	8,577,172.60	1.36
10	000783	长江证券	849,919	7,844,752.37	1.24

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	64,469,504.00	10.22
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	64,469,504.00	10.22

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	122014	09豫园债	332,710	34,069,504.00	5.40
2	123001	09爱使债	200,000	20,000,000.00	3.17
3	122931	09临海债	100,000	10,400,000.00	1.65

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名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 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	583,494.45
2	应收证券清算款	74,431,686.35
3	应收股利	161,236.98
4	应收利息	2,009,699.25
5	应收申购款	13,927.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,200,044.22

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 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	706,626,593.23
本报告期基金总申购份额	2,765,258.31
减：本报告期基金总赎回份额	14,969,870.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	694,421,980.77

§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泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新世纪泛资源优势灵活配置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)《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(五)《新华泛资源优势灵活配置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《新华泛资源优势灵活配置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，或通过基金管理人网站查阅。

新华基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

新华优选成长股票型证券投资基金

【2012】第三季度报告

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：二〇一二年十月二十四日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华优选成长股票
基金主代码	519089
交易代码	519089
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2008年7月25日
报告期末基金份额总额	3,317,189,657.31份
投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，优选具有成长性兼具品质保障的上市公司为主要投资对象，力争持续地超越业绩比较基准，为投资者实现超额收益。
投资策略	本基金是股票型基金，选择具有成长性兼具品质保障的股票，因此主要采取自下而上的主动投资管理策略。当然仅应用自下而上的策略可能导致某行业股票集中度过高，行业配置不够分散，造成组合非系统风险高。再考虑到国内系统风险高，因此有必要辅助以适当的资产配置和行业配置策略进行调整。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	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
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-178,677,153.72
2.本期利润	-164,453,981.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0492
4.期末基金资产净值	3,797,140,744.09
5.期末基金份额净值	1.1447

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。

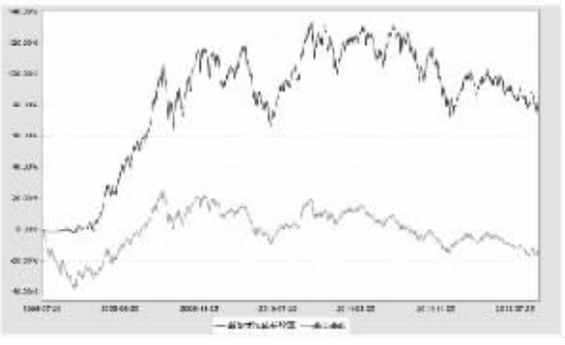
3.2 基金净值表现

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	-4.11%	1.14%	-5.29%	0.95%	1.18%	0.19%

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

新华优选成长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
(2008年7月25日至2012年9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		
王卫东	本基金基金经理；投资总监；副总经理	2008-7-25	-	19	硕士，先后供职于广