

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

2010 年第 2 季度报告

2010 年 6 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：二〇一〇年七月十九日

§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根据本基金合同规定，于 2010 年 7 月 16 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 2010 年 4 月 1 日起至 6 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	1,625,263,356.24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(2010年4月1日-2010年6月30日)
1.本期已实现收益	-33,630,977.11
2.本期利润	-293,779,968.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1806
4.期末基金资产净值	1,363,932,103.74
5.期末基金份额净值	0.839

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	-17.91%	1.60%	-14.19%	1.09%	-3.72%	0.51%

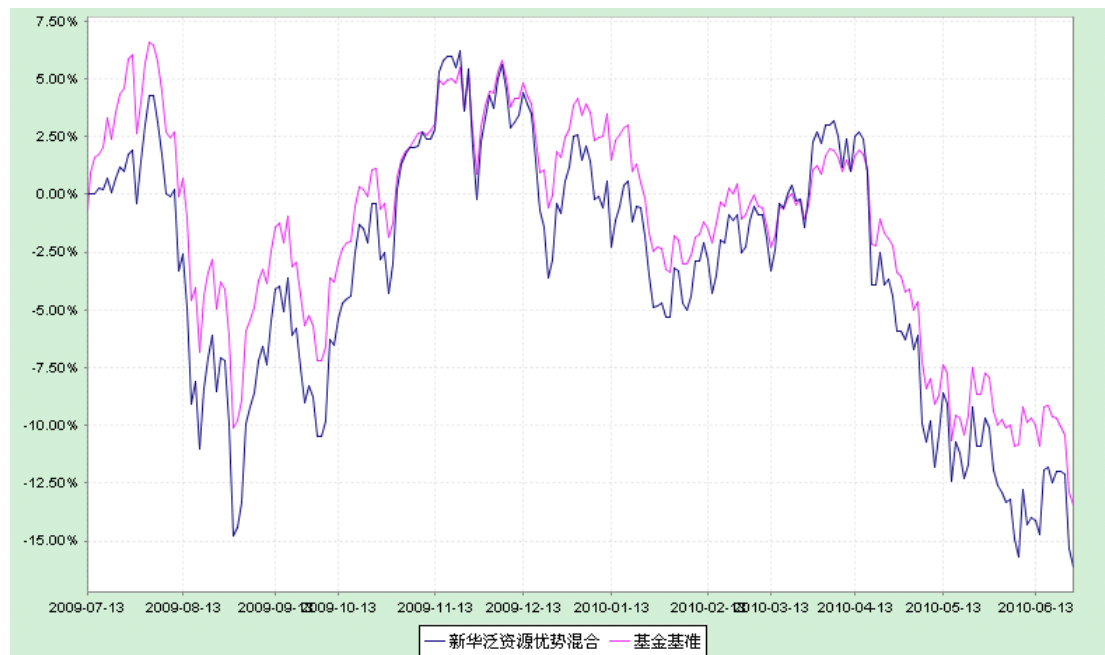
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基

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 2010 年 6 月 30 日)



1、本基金自 2009 年 7 月 13 日成立，至 2010 年 6 月 30 日披露日未满一年； 2、本基金建仓期为 6 个月，本报告期，本基金各资产配置比例符合本基金合同约定。

§ 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，新华优选成长股	2009-7-13	-	17	硕士，先后供职于广东发展银行海南证券业务部，任经理；广发证券公司海口海甸岛营业部，负责营业部管理并从事投资银行工作；广发证券公司投资理财部和自营部，任经理；华龙证券有限责任公司投

	票型 证券 投资 基金 基金 经理； 投资 总监； 副总 经理				资理财总部，任总经理；青岛 海东清置业有限公司，任总经 理。现任新华基金管理有限公司投资总监，副总经理，新华 优选成长股票型证券投资基金基金经理，新华泛资源优势 灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
崔建 波	本基 基金 基金 经理	2009-3-24	-	15	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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，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

本报告期内，基金管理人一直坚持公平交易原则，在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，基金管理人未管理与本基金风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

2010 年第二季度，国务院出台了严厉的控制房地产投资需求的政策，成为 A 股大幅下挫的导火索，加之欧洲国家的债务危机，国内 A 股市场出现大幅调整，其中周期性行业如房地产、金融、煤炭、钢铁、有色下跌幅度较大，非周期行业的商业、食品饮料相对抗跌，而非周期的医药行业由于受到相关政策影响出现大幅补跌行情，另外，中小板和创业板股票也在二季度后期出现较大幅度的补跌。之前虽然对国家房地产调控、信贷控制有心理准备，但对股市的反应估计不足，导致地产、煤炭、金融配置较重，短期没有取得较高的投资回报，但我们坚持认为这些行业估值较低、有长期竞争优势，从长远考虑这几个板块能够取得较好的投资收益。在以后的投资中，我们将积极总结经验教训，力求更精益求精的把握好行业介入时点，给投资者带来好的回报。第三季度，首先我们认为股市有望见底回升，因为世界经济仍处在复苏过程中，即使增速回落，但中国经济内在增长动力依然强劲。以全球视野来看，A 股市场具有相当大吸引力。三季度我们将利用市场回升机会进行结构调整，我们会相应加大有长期增长潜力的大消费类行业和服务业股票的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.839 元，本报告期份额净值增长率为-17.91%，同期比较基准的增长率为-14.19%。

§ 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	1,073,729,390.80	78.47
	其中：股票	1,073,729,390.80	78.47

2	固定收益投资	187,466,578.40	13.70
	其中：债券	187,466,578.40	13.70
	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	95,849,705.92	7.01
6	其他各项资产	11,209,987.10	0.82
7	合计	1,368,255,662.22	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	41,962,907.93	3.08
C	制造业	182,531,915.87	13.38
C0	食品、饮料	15,922,300.00	1.17
C1	纺织、服装、皮毛	51,043,737.81	3.74
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	335,775.00	0.02
C5	电子	19,409,348.00	1.42
C6	金属、非金属	33,258,637.70	2.44
C7	机械、设备、仪	61,539,170.88	4.51

	表		
C8	医药、生物制品	1,022,946.48	0.07
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	29,646,100.63	2.17
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	57,866,450.84	4.24
H	批发和零售贸易	2,560,885.60	0.19
I	金融、保险业	740,303,456.21	54.28
J	房地产业	1,534,500.00	0.11
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	17,323,173.72	1.27
	合计	1,073,729,390.80	78.72

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	600000	浦发银行	9,282,023	126,235,512.80	9.26
2	601318	中国平安	2,723,000	121,309,650.00	8.89
3	600036	招商银行	8,348,545	108,614,570.45	7.96
4	000001	深发展 A	6,072,848	106,335,568.48	7.80
5	601166	兴业银行	3,777,720	87,000,891.60	6.38
6	601169	北京银行	5,495,206	66,656,848.78	4.89
7	601601	中国太保	2,252,451	51,288,309.27	3.76

8	000712	锦龙股份	3,043,753	51,043,737.81	3.74
9	000338	潍柴动力	671,000	41,266,500.00	3.03
10	600016	民生银行	4,728,389	28,606,753.45	2.10

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	177,190,495.40	12.99
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	10,276,083.00	0.75
7	其他	-	-
8	合计	187,466,578.40	13.74

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	800,000	83,992,000.00	6.16
2	122009	08新湖债	226,780	24,979,817.00	1.83
3	122931	09临海债	200,000	21,660,000.00	1.59
4	0980130	09伊城投债	200,000	20,896,000.00	1.53
5	111301	09爱使债	200,000	20,000,000.00	1.47

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	1,182,038.80
2	应收证券清算款	1,752,850.02
3	应收股利	4,437.09
4	应收利息	8,030,501.99
5	应收申购款	236,871.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	3,287.87
8	其他	-
9	合计	11,209,987.10

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	110008	王府转债	4,475,761.20	0.33
2	110007	博汇转债	1,919,580.00	0.14

5.8.5 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	601318	中国平安	121,309,650.00	8.89	筹划平安银行与深发展整合的重组事项。
2	000001	深发展	106,335,568.48	7.80	筹划深发展与平安银行整合的重组事项。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,715,571,876.09
报告期期间基金总申购份额	56,315,786.50
报告期期间基金总赎回份额	146,624,306.35
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,625,263,356.24

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末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)《新华管理有限公司开放式基金业务规则》

(七)《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

二〇一〇年七月十九日