

# 新华钻石品质企业股票型证券投资基金 2010 年年度报告（摘要）

2010 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月三十日

---

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司投资托管服务部根据新华钻石品质企业股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）合同规定，于2011年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自2010年2月3日起至2010年12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	新华钻石企业股票
基金主代码	519093
交易代码	519093
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月3日
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	972,290,110.47份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对上市公司基本面的深入研究，结合宏观经济周期和行业景气度分析，力求在有效控制风险并适度保持良好流动性的前提下，精选具有稳定价值性和高质量成长性的钻石品质类的优质上市公司。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过对经济周期、行业特征等宏观层面的信息进行全面分析，调整大类资产配置比例和行业配置比例；在个股个券的选择上采用自下而上的投资策略，核心是从企业价值的稳定性和成长的高质量出发，筛选具有钻石品质的优质企业，并进行重点配置。钻石品质企业股票的配置比例不低于股票资产配置的80%。钻石品质企业是指具有稳定价值性和高质量成长性的上市公司，它们具有安全、透明、稳定、创新与领导气质五大优秀品质。
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、债券型基金和货币型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	尹东
	联系电话	010-88423386	010-67595003
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	010-67595096
传真		010-88423310	010-66275865

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年12月31日
本期已实现收益	52,525,480.85
本期利润	65,396,607.62
加权平均基金份额本期利润	0.0424
本期加权平均净值利润率	4.37%
本期基金份额净值增长率	2.10%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末
期末可供分配利润	20,897,051.36
期末可供分配基金份额利润	0.0215
期末基金资产净值	993,187,161.83
期末基金份额净值	1.021
3.1.3 累计期末指标	2010年末
基金份额累计净值增长率	2.10%

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金于2010年2月3日基金合同生效。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	份额净值	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	------	-------	-------	--------	-----	-----

	增长率①	长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	5.15%	1.53%	5.31%	1.42%	-0.16%	0.11%
过去六个月	23.31%	1.41%	17.68%	1.24%	5.63%	0.17%
自基金成立起至今	2.10%	1.44%	0.57%	1.28%	1.53%	0.16%

注：1、本基金于 2010 年 2 月 3 日基金合同生效。

2、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数收益率，债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数收益率，复合业绩比较基准为 80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

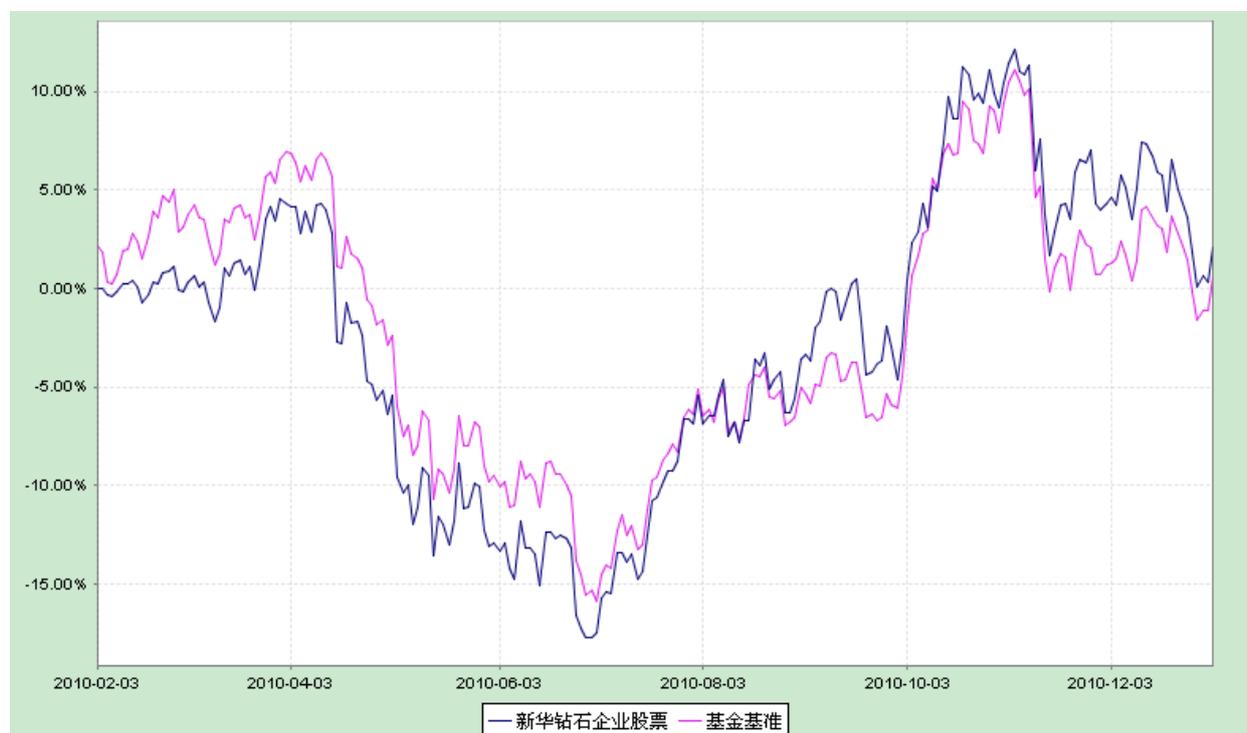
3、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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

新华钻石品质企业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

(2010 年 2 月 3 日至 2010 年 12 月 31 日)

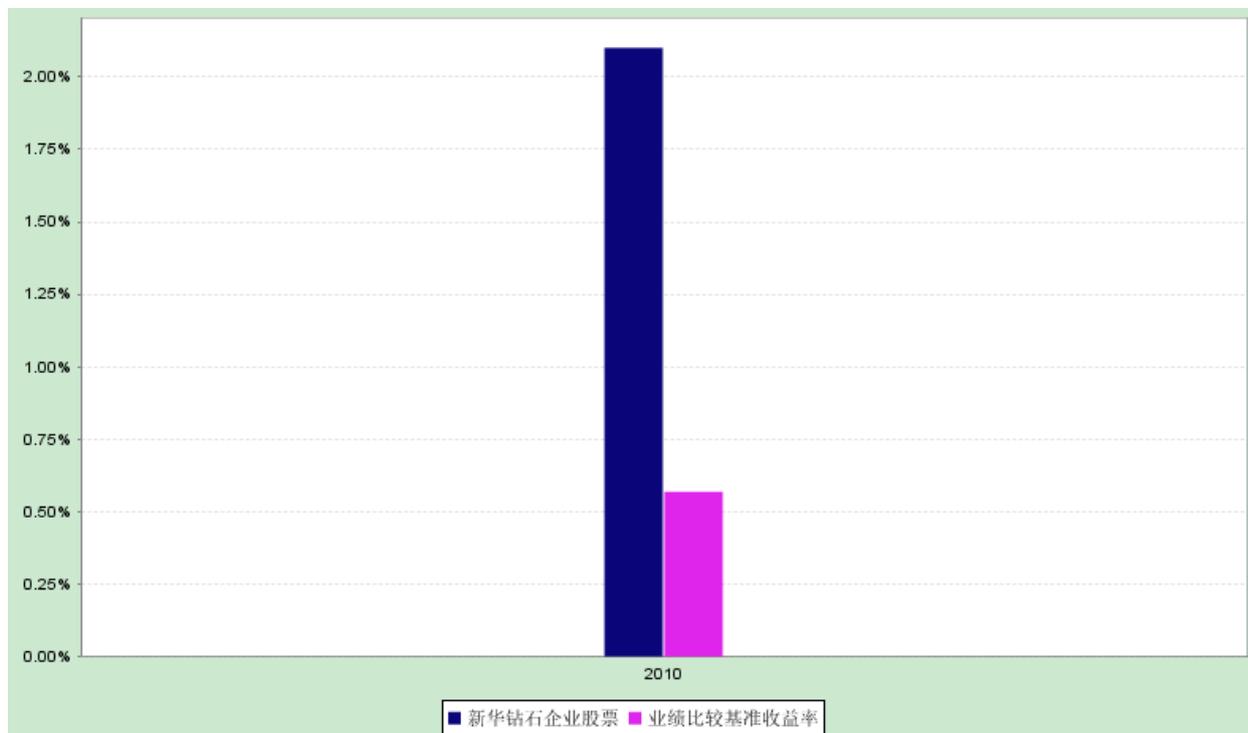


注：本基金于 2010 年 2 月 3 日基金合同生效。按照《新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 2 月 3 日起 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华钻石品质企业股票型证券投资基金

自基金合同生效以来每年净值增长率图



注：本基金于 2010 年 2 月 3 日基金合同生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2010 年 2 月 3 日基金合同生效，于 2010 年 12 月 31 日未进行过利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新华基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2010 年 12 月 31 日，新华基金管理有限公司旗下管理着五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金和新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮换股票型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曹名长	本基金基金经理；新华优选分红混合型证券投资基金基金经理；新华基金管理有限公司基金管理部副总监	2010-02-03	-	13	经济学硕士，历任君安证券有限公司研究员、红塔证券股份有限公司资产管理部投资经理、百瑞信托股份有限公司投资经理，现任新华基金管理有限公司基金管理部副总监，新华优选分红混合型证券投资基金基金经理，新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会，《证券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合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理有限公司作为新华钻石品质企业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》、《新华钻石品质企业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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金 2010 年 2 月 3 日成立，从基金成立到年底，上证综合指数从 3004 点下跌到 2808 点，跌幅为 6.5%。分析股指震荡向下的原因，我们认为主要是过于偏紧缩的政策特别是房地产政策导致的对经济的担心以及由此带来的资金偏紧。虽然我们在 2010 年初判断 2010 年股指将会处于震荡之中，但由于相对看好 2010 上半年的行情，因此对上半年市场较大幅度下跌预期不足，导致基金成立初就在股票资产配置上相对激进，加上本基金长期以投资高品质蓝筹股为主，这使得基金从成立之日到年底的业绩表现不理想，在此对投资者表示歉意。今后我们新华投研团队一定加倍努力，争取长时期为投资者赚取满意的回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金成立于 2010 年 2 月 3 日，截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.021 元，本报告期份额净值增长率为 2.1%，同期比较基准的增长率为 0.57%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年，虽然全球以及国内经济出现大幅波动的可能性不大，但通胀则日益显现。物价以及大宗商品的波动，不但对宏观经济和企业盈利有较大影响，而且影响政策走向。当然，就像通胀于经济和企业一样，通胀于股市也并非一定是负面的。通胀之初，流动性宽裕，企业盈利能力逐渐提高，这时通胀可能是有利于股市。而随着通胀压力进一步上升，货币政策会趋向紧缩，此时市场震荡调整的可能性较大。2011 年的市场，很可能将处在以上通胀的正负交替影响中，一会儿左一会儿右，因此，对于 A 股市场来说，2011 年可能是最为复杂的一年。对于复杂的市场，操作最好更为灵活，一旦市场出现大幅波动，应及时采取相应的策略。在通胀中，如果有投资机会的话，其更可能体现在周期相关的行业，因此，比较看好低估值的周期股如金融、煤炭、建材、机械、家电、汽车、钢铁和地产等。而以食品饮料及医药为代表的非周期类行业，则在通胀回落之后，作重点配置。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

### 4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

#### 4.6.1.1 估值工作小组的职责分工

---

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、中央交易室、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

#### 4.6.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

#### 4.6.1.3 投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

---

#### 4.6.1.4 中央交易室的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

#### 4.6.1.5 监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

## § 6 审计报告

本报告期基金财务报告经国富浩华会计师事务所有限公司审计，注册会计师刁云涛、李荣坤签字出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过报告正文查看审计报告正文，

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：新华钻石品质企业股票型证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010年12月31日
<b>资 产：</b>	
银行存款	48,144,782.45
结算备付金	1,103,189.31
存出保证金	1,000,000.00
交易性金融资产	917,565,987.57
其中：股票投资	917,565,987.57
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	29,335,123.66
应收利息	10,485.87
应收股利	-
应收申购款	344,729.95
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	997,504,298.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>

	2010年12月31日
<b>负 债：</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	577,760.39
应付管理人报酬	1,299,145.78
应付托管费	216,524.29
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,091,529.07
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	1,132,177.45
负债合计	4,317,136.98
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	972,290,110.47
未分配利润	20,897,051.36
所有者权益合计	993,187,161.83
负债和所有者权益总计	997,504,298.81

注：本基金于2010年2月3日成立，报告截止日2010年12月31日未满一年，基金份额净值1.021元，基金份额总额972,290,110.47份。

## 7.2 利润表

会计主体：新华钻石品质企业股票型证券投资基金

本报告期：2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期
	2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年12月31日
<b>一、收入</b>	<b>97,430,387.64</b>
1. 利息收入	1,477,874.41
其中：存款利息收入	1,477,874.41
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）	81,029,163.11
其中：股票投资收益	67,524,990.04
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	13,504,173.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	12,871,126.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,052,223.35
<b>减：二、费用</b>	<b>32,033,780.02</b>
1. 管理人报酬	20,474,554.69
2. 托管费	3,412,425.65
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	7,741,967.39
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	404,832.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>65,396,607.62</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>65,396,607.62</b>

注：本基金于2010年2月3日成立，报告截止日2010年12月31日未满一年。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华钻石品质企业股票型证券投资基金

本报告期：2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,937,798,339.14	-	1,937,798,339.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	65,396,607.62	65,396,607.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-965,508,228.67	-44,499,556.26	-1,010,007,784.93
其中：1. 基金申购款	603,199,902.07	28,521,397.78	631,721,299.85
2. 基金赎回款	-1,568,708,130.74	-73,020,954.04	-1,641,729,084.78
四、本期向基金份额持有人分配利润	-	-	-

产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	972,290,110.47	20,897,051.36	993,187,161.83

注：本基金于 2010 年 2 月 3 日成立，报告截止日 2010 年 12 月 31 日未满一年。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：陈重，主管会计工作负责人：孙枝来，会计机构负责人：徐端骞

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

新华钻石品质企业股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]1220 号文件“关于核准新华钻石品质企业股票型证券投资基金募集的批复”,由新华基金管理有限公司作为发起人,于 2010 年 1 月 4 日至 1 月 29 日向社会公开募集,首次募集资金总额 1,937,798,339.14 元,其中募集净认购资金金额 1,936,938,537.27 元,募集资金产生利息 859,801.87 元,并经国富浩华会计师事务所有限公司浩华验字[2010]第 8 号验资报告予以验证。2010 年 2 月 3 日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限,本基金管理人为新华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《新华钻石品质企业股票型证券投资基金招募说明书》及《新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%;其中投资于具有钻石品质企业的股票市值不低于股票投资的 80%。债券、现金类资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%-40%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。

2009 年 9 月 28 日,经中国证券监督管理委员会证监许可(2009)944 号文件批复,新世纪基金管理有限公司将名称变更为新华基金管理有限公司。公司注册地址变更为重庆市渝中区较场口 88 号 A 座 7-2。

2010 年 7 月 12 日,经中国证监会(证监许可[2010]940 号)文件关于核准新华基金管理有限公司变更股权及修改章程的批复,核准山东海化集团有限公司将其持有的公司 30%股权转让给陕西蓝潼电子投资有限公司。核准上海隼基环境产业有限公司更名为上海大众环境产业有限公司。转让完成后,

---

各股东持股比例不变。

2010年8月23日，经中国证监会批准（证监许可[2010]1135号）关于核准新华基金管理有限公司变更住所的批复，新华基金管理有限公司住所由“重庆市渝中区较场口88号A座7-2”变更为“重庆市江北区建新东路85号附1号1层1-1”。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理有限公司于2011年3月19日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本基金2010年年度会计报告的实际编制时间为2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年12月31日。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

人民币

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的

---

金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

#### **7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

(1) 金融资产和金融负债的初始确认和终止确认（证券投资基金成本计价方法）

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

a 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

b 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于交易日按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按 7.4.4.4 (1)、1)、c 所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

c 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资，权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

2) 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

3) 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，

---

其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

## (2) 金融资产和金融负债的后续计量

本基金持有的金融资产和金融负债的后续计量与其分类相关联。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，按照公允价值后续计量，公允价值变动计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，采用实际利率法，按摊余成本计量。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

#### (1) 估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3) 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

#### (2) 主要资产的估值方法

##### 1) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂

---

牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

## 2) 债券投资

交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所上市的收盘价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息后的净价为公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日收盘价确定公允价值。估值日无交易但最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

全国银行间同业市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种采用估值技术确定公允价值。同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别确定公允价值。

## 3) 权证投资

因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

4) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

---

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

---

卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(7) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期内未有其他重要的会计政策和会计估计。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金报告期内未发生会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金报告期内未发生会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金报告期内未发生会计差错更正。

### **7.4.6 税项**

关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字[2005]107 号文《关于利息红利个人所得税政策

的补充通知》、自 2008 年 4 月 24 日起执行的《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起按 0.1% 的税率缴纳。经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税征收方式，将现行的对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
山东海化集团有限公司	基金管理人股东
上海大众环境产业有限公司	基金管理人股东
陕西蓝潼电子投资有限公司	基金管理人股东

注：2010 年 7 月 12 日经中国证券监督管理委员会证监许可〔2010〕940 号文件批复，山东海化集团有限公司将所持的公司 30% 股权全部转让给陕西蓝潼电子投资有限公司，同时批复股东上海隼基环境产业有限公司更名为上海大众环境产业有限公司。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金于 2010 年 2 月 3 日成立，报告截止日 2010 年 12 月 31 日未满一年，均无通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金于 2010 年 2 月 3 日成立，报告截止日 2010 年 12 月 31 日未满一年，均无通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金于 2010 年 2 月 3 日成立，报告截止日 2010 年 12 月 31 日未满一年，均无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金于 2010 年 2 月 3 日成立，报告截止日 2010 年 12 月 31 日未满一年，均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于 2010 年 2 月 3 日成立，报告截止日 2010 年 12 月 31 日未满一年，均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,474,554.69
其中：支付销售机构的客户维护费	1,694,945.92

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,412,425.65

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期末进行银行债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	48,144,782.45	1,444,382.58

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

#### 7.4.9 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截止报告期期末本基金未持有流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止报告期期末本基金未持有暂时停牌股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末未有银行间市场债券正回购。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未有交易所市场债券正回购。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	917,565,987.57	91.99

	其中：股票	917,565,987.57	91.99
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	-	-
	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	49,247,971.76	4.94
6	其他各项资产	30,690,339.48	3.08
7	合计	997,504,298.81	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	82,487,990.92	8.31
C	制造业	351,257,137.32	35.37
C0	食品、饮料	105,877,702.98	10.66
C1	纺织、服装、皮毛	4,023,877.95	0.41
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	7,464,000.00	0.75
C4	石油、化学、塑胶、塑料	30,865,533.00	3.11
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	14,163,160.32	1.43
C7	机械、设备、仪表	179,571,583.07	18.08
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	9,291,280.00	0.94
D	电力、煤气及水的生产和供应业	9,132,500.00	0.92
E	建筑业	4,883,145.30	0.49
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	67,266,884.40	6.77
H	批发和零售贸易	19,897,713.75	2.00
I	金融、保险业	322,538,289.08	32.48
J	房地产业	7,378,966.00	0.74
K	社会服务业	52,723,360.80	5.31
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	917,565,987.57	92.39

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 期末按公允价值占基金净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,544,642.00	86,747,094.72	8.73
2	002202	金风科技	3,885,235.00	86,640,740.50	8.72
3	600036	招商银行	5,233,817.00	67,045,195.77	6.75
4	601601	中国太保	2,147,925.00	49,187,482.50	4.95
5	600519	贵州茅台	259,244.00	47,680,156.48	4.80
6	002242	九阳股份	2,781,151.00	41,911,945.57	4.22
7	600007	中国国贸	4,025,135.00	40,573,360.80	4.09
8	600600	青岛啤酒	1,027,237.00	35,624,579.16	3.59
9	000550	江铃汽车	1,170,000.00	32,221,800.00	3.24
10	600050	中国联通	5,089,952.00	27,231,243.20	2.74

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于 <http://www.ncfund.com.cn> 网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	002202	金风科技	167,279,760.10	16.84
2	600519	贵州茅台	162,637,579.48	16.38
3	601318	中国平安	151,405,610.01	15.24
4	600036	招商银行	147,006,692.98	14.80
5	000001	深发展A	98,004,511.00	9.87
6	600900	长江电力	96,867,596.06	9.75
7	000712	锦龙股份	95,925,309.65	9.66
8	600000	浦发银行	90,514,602.23	9.11
9	002242	九阳股份	83,211,115.30	8.38
10	600050	中国联通	81,735,574.87	8.23
11	601601	中国太保	79,643,639.78	8.02
12	601169	北京银行	77,837,346.47	7.84
13	600007	中国国贸	70,627,020.71	7.11

14	601006	大秦铁路	68,724,192.12	6.92
15	000338	潍柴动力	65,674,981.34	6.61
16	601009	南京银行	60,008,003.70	6.04
17	000602	金马集团	59,303,910.33	5.97
18	601628	中国人寿	59,187,498.81	5.96
19	601166	兴业银行	56,846,396.66	5.72
20	600016	民生银行	51,524,000.00	5.19
21	601088	中国神华	50,779,870.55	5.11
22	000858	五 粮 液	45,535,314.78	4.58
23	000413	宝 石 A	35,825,615.35	3.61
24	600600	青岛啤酒	35,762,025.25	3.60
25	600583	海油工程	34,973,643.40	3.52
26	000063	中兴通讯	33,929,238.13	3.42
27	600169	太原重工	28,450,690.13	2.86
28	000550	江铃汽车	28,324,785.53	2.85
29	000623	吉林敖东	28,107,001.32	2.83
30	000983	西山煤电	27,777,839.35	2.80
31	601666	平煤股份	27,246,065.16	2.74
32	002001	新 和 成	25,432,574.60	2.56
33	600682	南京新百	25,237,782.96	2.54
34	601390	中国中铁	24,227,767.68	2.44
35	002045	广州国光	22,812,013.88	2.30
36	000069	华侨城 A	22,785,668.11	2.29
37	601001	大同煤业	22,666,637.00	2.28
38	000937	冀中能源	22,454,620.99	2.26
39	600875	东方电气	22,423,941.24	2.26
40	002098	浔兴股份	21,350,576.55	2.15
41	601988	中国银行	20,750,030.24	2.09
42	000869	张 裕 A	20,617,339.36	2.08

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	121,690,718.06	12.25
2	002202	金风科技	96,879,235.69	9.75
3	600900	长江电力	96,263,805.14	9.69
4	000338	潍柴动力	95,618,502.06	9.63
5	601318	中国平安	93,917,642.74	9.46
6	000712	锦龙股份	90,682,893.52	9.13

7	600000	浦发银行	79,925,813.53	8.05
8	600036	招商银行	67,433,219.98	6.79
9	000602	金马集团	66,333,230.72	6.68
10	601006	大秦铁路	66,185,286.96	6.66
11	601169	北京银行	62,007,225.38	6.24
12	000001	深发展A	57,615,041.14	5.80
13	600050	中国联通	49,991,671.89	5.03
14	601088	中国神华	46,964,379.54	4.73
15	000858	五 粮 液	46,856,950.84	4.72
16	000413	宝 石 A	41,421,140.10	4.17
17	002242	九阳股份	40,451,446.50	4.07
18	600016	民生银行	35,283,734.94	3.55
19	600169	太原重工	34,475,023.36	3.47
20	601166	兴业银行	32,361,183.46	3.26
21	601601	中国太保	31,615,380.38	3.18
22	601009	南京银行	31,597,090.40	3.18
23	601628	中国人寿	31,418,608.44	3.16
24	000869	张 裕 A	29,608,367.43	2.98
25	600007	中国国贸	29,308,415.84	2.95
26	600583	海油工程	27,400,484.36	2.76
27	002152	广电运通	26,462,410.86	2.66
28	600682	南京新百	26,394,336.62	2.66
29	002001	新 和 成	25,904,097.28	2.61
30	002045	广州国光	25,720,901.17	2.59
31	000623	吉林敖东	25,235,750.07	2.54
32	601390	中国中铁	24,246,854.82	2.44
33	000063	中兴通讯	23,867,671.23	2.40
34	600875	东方电气	22,058,150.20	2.22
35	600761	安徽合力	22,057,934.04	2.22
36	002098	浔兴股份	21,969,467.88	2.21
37	601666	平煤股份	21,495,584.37	2.16
38	601988	中国银行	20,205,779.92	2.03

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,106,823,837.97
卖出股票的收入（成交）总额	2,269,653,967.21

注：本项“买入股票的成本(成交)总额”与“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以数量)填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金无债券投资。

## 8.6 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

本报告期末本基金无债券投资。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

## 8.8 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

本报告期末本基金未持有权证。

## 8.9 投资组合报告附注

**8.9.1** 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。

**8.9.2** 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	29,335,123.66
3	应收股利	-
4	应收利息	10,485.87
5	应收申购款	344,729.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,690,339.48

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金没有处于可转股期的可转债。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
15,597	62,338.28	20,692,609.49	2.13%	951,597,500.98	97.87%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	615,391.48	0.06%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	1,937,798,339.14
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	603,199,902.07
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,568,708,130.74
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	972,290,110.47

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

---

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经新华基金管理有限公司 2010 年第二届董事会第十四次会议审议通过，并经中国证监会证监基金字（2010）722 号文核准，公司于 2010 年 6 月 3 日对外披露，聘任王卫东、徐端骞先生担任本公司副总经理。

本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

公司原副总经理姚西（已离职）因离职前劳动报酬及终止劳动合同与公司发生争议，向重庆市渝中区劳动仲裁委员会申请劳动仲裁，2009 年 5 月 13 日重庆市渝中区劳动仲裁委员会开庭进行了审理。2009 年 6 月 30 日公司接到重庆市渝中区劳动仲裁委员会渝中劳仲案字（2008）第 530 号仲裁裁决书，驳回了姚西的全部仲裁申请。姚西不服劳动仲裁机构的仲裁结果于 2009 年 7 月 9 日向重庆市渝中区法院递交了诉讼申请，经重庆市渝中区法院审理，于 2010 年 1 月 5 日宣判：驳回姚西的所有诉讼请求。姚西对判决不服向重庆市第五中级人民法院上诉，重庆市第五中级人民法院于 2010 年 6 月 7 日宣判，驳回姚西的上诉，该判决为终审判决。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

公司于 2010 年 1 月 21 日第二届董事会第十二次会议中通过决议，为本基金提供审计的会计师事务所变更为国富浩华会计师事务所有限公司。公司已于 2010 年 1 月 25 日编制临时公告，披露于中国证券报、上海证券报和证券时报。报告年度应支付给其报酬情况是 80000 元人民币。审计年限为 1 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	1,595,832,741.29	29.79%	1,356,452.15	30.32%	-
申银万国	1	1,162,582,981.10	21.70%	988,193.01	22.09%	-
国金证券	1	858,224,171.77	16.02%	697,310.61	15.59%	-
银河证券	1	682,859,928.57	12.75%	554,826.82	12.40%	-
新时代证券	1	485,136,440.83	9.06%	412,365.77	9.22%	-
太平洋证券	1	384,982,598.10	7.19%	312,801.34	6.99%	-
中投证券	1	187,337,097.85	3.50%	152,212.49	3.40%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金为报告期内新成立的基金，共租用七个交易席位，其中包括：申银万国证券上海席位，国金证券深圳席位，新时代证券上海席位，银河证券深圳席位，国信证券上海席位，中投证券深圳席位，太平洋证券深圳席位。

#### (1) 租用专用席位选择证券经营机构的标准

- ①公司实力雄厚,资信状况良好。公司净资产超过人民币三亿元,并且最近三年没有重大违规行为;
- ②公司财务状况和经营状况良好,各项财务指标显示公司运行稳定;
- ③公司具有较强的研究能力。有固定的研究机构或人员,能及时为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;
- ④公司内部管理规范、严格。内部运行高效,内部控制严格,能满足基金操作的高度保密要求
- ⑤公司信息服务周全。能提供基金运作的高效通讯条件,并有能力为基金提供全面的信息服务。

#### (2) 席位租用期限及更换方式

①席位租用期限暂定为一年,一年之后我公司将根据各证券经营机构在一年中向我公司提供的研究报告和信息服务的质量、通讯及信息保密等情况,按照根据上述选择标准细化的评价体系,进行评比排

---

名。对不能及时有效提供信息服务的有关证券经营机构将予以淘汰,重新选择研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构,租用其交易席位。

若有关证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合我公司管理基金投资工作的要求,我公司有权中止租用其交易席位。

(3) 基金专用交易席位的选择程序如下:

①本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

②基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

#### **11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

本报告期本基金未租用证券公司交易单元进行其它证券的投资。

### **§ 12影响投资者决策的其他重要信息**

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

2010年1月29日,托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告,决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告,范一飞先生已提出辞呈,辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010年7月1日,托管人中国建设银行股份有限公司发布2009年度A股分红派息实施公告,每10股派发现金股息人民币2.02元(含税)。

2010年9月15日,托管人中国建设银行股份有限公司发布公告,张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长,谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010年11月2日,托管人中国建设银行股份有限公司发布2010年度A股配股发行公告。

新华基金管理有限公司

二〇一一年三月三十日