

# 新华钻石品质企业股票型证券投资基金

## 2011 年半年度报告

2011 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十六日

## 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3 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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
7.6 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.....	33
7.7 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.....	33
7.8 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.....	33

7.9 投资组合报告附注.....	33
8 基金份额持有人信息.....	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	34
9 开放式基金份额变动.....	34
10 重大事件揭示.....	34
10.1 基金份额持有人大会决议.....	34
10.2 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.....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	35
10.4 基金投资策略的改变.....	35
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	35
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	35
10.8 其他重大事件.....	37
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	38
12 备查文件目录.....	38
12.1 备查文件目录.....	38
12.2 存放地点.....	38
12.3 查阅方式.....	38

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华钻石品质企业股票型证券投资基金
基金简称	新华钻石品质企业股票
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	793,339,172.07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
注册地址		重庆市江北区建新东路85号 附1号1层1-1	北京市西城区金融大街25号
办公地址		重庆市渝中区较场口88号得意商厦A座7-2 北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座	北京市西城区闹市口大街1
邮政编码		400010（重庆） 100089（北京）	100033
法定代表人		陈重	郭树清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

## 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	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	-7,717,473.20
本期利润	-15,801,955.45

加权平均基金份额本期利润	-0.0182
本期加权平均净值利润率	-1.80%
本期基金份额净值增长率	-2.64%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2011年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-4,774,886.33
期末可供分配基金份额利润	-0.0060
期末基金资产净值	788,564,285.74
期末基金份额净值	0.994
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2011年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-0.60%

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）。

## 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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1月	0.91%	1.01%	1.19%	0.95%	-0.28%	0.06%
过去3月	-4.24%	0.98%	-4.28%	0.88%	0.04%	0.10%
过去6月	-2.64%	1.13%	-1.67%	0.99%	-0.97%	0.14%
过去1年	20.05%	1.28%	15.72%	1.12%	4.33%	0.16%
自基金成立起至今	-0.60%	1.34%	-1.11%	1.18%	0.51%	0.16%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数率，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。

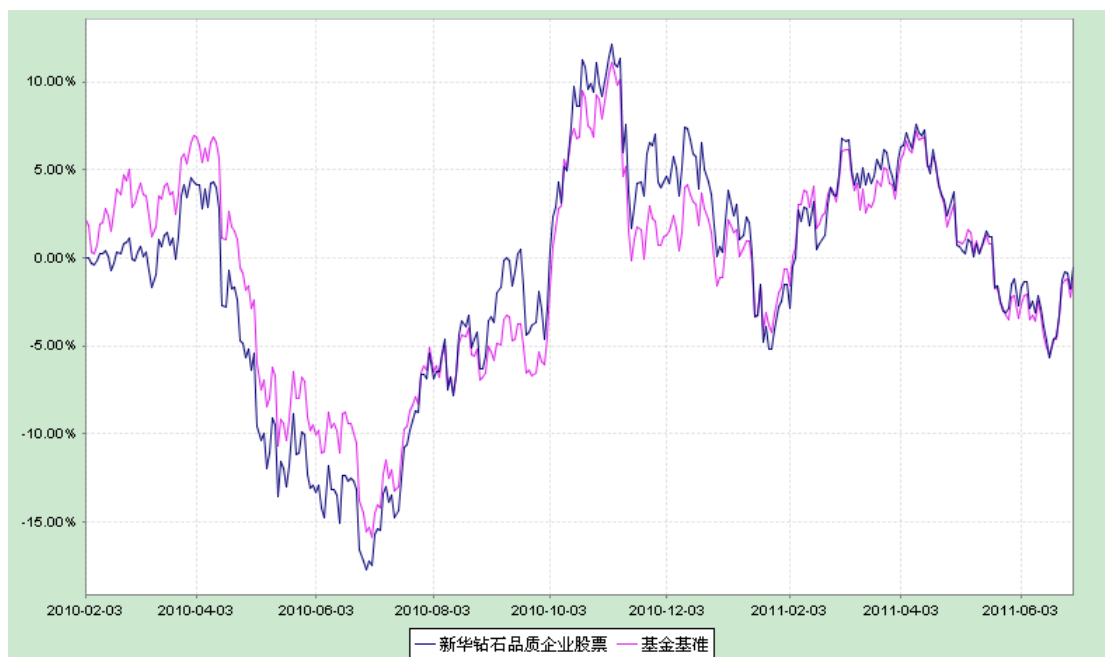
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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2011年6月30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。

## 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 2011 年 6 月 30 日，新华基金管理有限公司旗下管理着六只开放式基金，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、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和新华中小市值优选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	2010-02-03	-	14	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



	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				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。
李昱	本基金基金经理	2011-01-27	-	14	管理学硕士，14 年证券从业经验。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。李昱女士于 2010 年 3 月加入新华基金管理有限公司，任专户管理部负责人，现任新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理。

注：

- 1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。
- 2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。
- 3、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说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年 A 股市场以震荡调整为主，1 季度小幅上涨，2 季度则下跌，我们认为市场的震荡调整主要基于物价上涨超预期以及由此导致的紧缩政策持续时间及力度超预期。由于对通胀超预期及其对市场的影响估计不足，本基金上半年的股票配置比例保持高水平，因此净值亦随市场指数出现了小幅度下跌。本基金今后将加强对宏观特别是通胀及其对市场影响的研究，争取今后的操作尽量避免类似的失误。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.994 元，本报告期份额净值增长率为 -2.64%，同期比较基准的增长率为 -1.67%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2011 年下半年，我们认为由于通胀将在 7 月以后逐步下行，由此政策最紧的时期正在过去，这使得导致前期市场下跌的主要因素将逐渐削弱，因此，我们对下半年特别是 3 季度的市场相对乐观，配置也将以股票资产为主。当然，由于今年经济的复杂性，我们也并不对通胀的大幅回落抱很大的期望，逐步下行的通胀如果仍处于较高水平，这仍将是制约市场持续上涨的主要因素，由此，具体投资中保持适当的结构性防御是有必要的。在通胀见顶到其逐步回落的过程中，我们比较看好金融、食品饮料、家电、汽车、地产、旅游、通信以及公用事业等行业。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

一、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、基金管理部、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。

## 二、 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司基金管理部相互独立。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。

## 三、 基金管理部的职责分工

- 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。

#### 四、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。

#### 五、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投资运作遵规守信、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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	40,951,519.69	48,144,782.45
结算备付金		956,116.44	1,103,189.31
存出保证金		1,072,656.25	1,000,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	742,893,653.74	917,565,987.57
其中：股票投资		742,893,653.74	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		5,471,992.25	29,335,123.66
应收利息	6.4.7.4	8,805.60	10,485.87
应收股利		315,000.00	-
应收申购款		194,088.66	344,729.95
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		791,863,832.63	997,504,298.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
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		472,062.30	577,760.39
应付管理人报酬		950,891.58	1,299,145.78
应付托管费		158,481.93	216,524.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.5	478,027.95	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	6.4.7.6	1,240,083.13	1,132,177.45
负债合计		3,299,546.89	4,317,136.98
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.7	793,339,172.07	972,290,110.47
未分配利润	6.4.7.8	-4,774,886.33	20,897,051.36
所有者权益合计		788,564,285.74	993,187,161.83
负债和所有者权益总计		791,863,832.63	997,504,298.81

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.994 元，基金份额总额 793,339,172.07 份。

## 6.2 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 2 月 3 日（基金合 同生效日）至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-5,975,165.61</b>	<b>-260,384,447.04</b>
1.利息收入		180,281.83	1,170,886.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	180,281.83	1,170,886.34
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）		1,529,142.44	-39,276,509.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,493,628.82	-44,195,090.06
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	6.4.7.11	7,022,771.26	4,918,580.13
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.12	-8,084,482.25	-222,793,165.33
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.13	399,892.37	514,341.88
<b>减：二、费用</b>		<b>9,826,789.84</b>	<b>16,234,566.38</b>
1. 管理人报酬		6,570,590.48	10,365,957.98
2. 托管费		1,095,098.42	1,727,659.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.14	1,958,626.94	3,962,587.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.15	202,474.00	178,360.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）</b>		<b>-15,801,955.45</b>	<b>-276,619,013.42</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		<b>-15,801,955.45</b>	<b>-276,619,013.42</b>

### 6.3 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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）	972,290,110.47	20,897,051.36	993,187,161.83
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数（本期利 润）	-	-15,801,955.45	-15,801,955.45

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）	-178,950,938.40	-9,869,982.24	-188,820,920.64
其中：1. 基金申购款	193,450,811.79	6,766,453.72	200,217,265.51
2. 基金赎回款	-372,401,750.19	-16,636,435.96	-389,038,186.15
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）	793,339,172.07	-4,774,886.33	788,564,285.74
项目	上年度可比期间		
	2010 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 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）	-	-276,619,013.42	-276,619,013.42
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）	-311,288,384.07	-3,916,624.04	-315,205,008.11
其中：1. 基金申购款	97,822,238.17	-1,585,441.17	96,236,797.00
2. 基金赎回款	-409,110,622.24	-2,331,182.87	-411,441,805.11
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）	1,626,509,955.07	-280,535,637.46	1,345,974,317.61

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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，存续期不限定，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上市的股票、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%。

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 8 月 26 日批准报出。

#### **6.4.2 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。

#### **6.4.3 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。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 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。

##### **6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	40,951,519.69
定期存款	-
其他存款	-
合计	40,951,519.69

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		738,107,009.22	742,893,653.74	4,786,644.52
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		738,107,009.22	742,893,653.74	4,786,644.52

## 6.4.7.3 买入返售金融资产

## 6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

## 6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	8,418.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	387.18
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	8,805.60

## 6.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	478,027.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	478,027.95

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	1,645.84
预提费用	488,437.29
合计	1,240,083.13

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	972,290,110.47	972,290,110.47
本期申购	193,450,811.79	193,450,811.79
本期赎回（以“-”号填列）	-372,401,750.19	-372,401,750.19
本期末	793,339,172.07	793,339,172.07

**6.4.7.8 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	59,493,250.42	-38,596,199.06	20,897,051.36
本期利润	-7,717,473.20	-8,084,482.25	-15,801,955.45
本期基金份额交易产生的变动数	-8,533,225.49	-1,336,756.75	-9,869,982.24
其中：基金申购款	9,254,490.67	-2,488,036.95	6,766,453.72
基金赎回款	-17,787,716.16	1,151,280.20	-16,636,435.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,242,551.73	-48,017,438.06	-4,774,886.33

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	172,876.72

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,405.11
其他	-
合计	180,281.83

## 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	720,861,154.15
减：卖出股票成本总额	726,354,782.97
买卖股票差价收入	-5,493,628.82

## 6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,022,771.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,022,771.26

## 6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,084,482.25
——股票投资	-8,084,482.25
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-8,084,482.25

## 6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	399,660.96
转换费收入	231.41
其他	-

合计	399,892.37
----	------------

**6.4.7.14 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	1,958,626.94
银行间市场交易费用	-
合计	1,958,626.94

**6.4.7.15 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
汇划手续费	5,036.71
债券帐户维护费	9,000.00
合计	202,474.00

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的重大资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本报告期及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,570,590.48	10,365,957.98
其中：支付销售机构的客户维护费	2,608,297.96	5,328,179.15

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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,095,098.42	1,727,659.57

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。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未进行银行债券(含回购)交易。

##### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

###### 6.4.10.4.1 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。

###### 6.4.10.4.2 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

报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年2月3日（基金合同生效日）至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	40,951,519.69	172,876.72	69,792,183.77	1,144,809.22

**6.4.10.6 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。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期间无收益分配事项。

**6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600461	洪城水业	2011-01-07	2012-01-05	非公开发行锁定期	14.50	10.06	1,700,000	24,650,000.00	17,102,000.00	注1
600461	洪城水业	2011-06-02	2012-01-05	非公开发行锁定期转增	-	10.06	850,000	-	8,551,000.00	注1
600187	国中水务	2011-02-16	2012-02-14	非公开发行锁定期	7.50	9.66	6,000,000	45,000,000.00	57,960,000.00	-

注：本基金持有的非公开发行股票洪城水业，于2011年6月2日实施了2010年度利润分配方案，向全体股东每10股派发现金股利1.00元（含税）的同时向股东以每10股转增5股。本基金新增850,000股。

**6.4.12.2 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等流通受限的股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。



### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2011年6月30日					
资产					
银行存款	40,951,519.69	-	-	-	40,951,519.69
结算备付金	956,116.44	-	-	-	956,116.44
存出保证金	-	-	-	1,072,656.25	1,072,656.25
交易性金融资产	-	-	-	742,893,653.74	742,893,653.74
应收证券清算款	-	-	-	5,471,992.25	5,471,992.25
应收利息	-	-	-	8,805.60	8,805.60
应收股利	-	-	-	315,000.00	315,000.00
应收申购款	-	-	-	194,088.66	194,088.66
资产总计	41,907,636.13	-	-	749,956,196.50	791,863,832.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	472,062.30	472,062.30
应付管理人报酬	-	-	-	950,891.58	950,891.58
应付托管费	-	-	-	158,481.93	158,481.93
应付交易费用	-	-	-	478,027.95	478,027.95
其他负债	-	-	-	1,240,083.13	1,240,083.13
负债总计	-	-	-	3,299,546.89	3,299,546.89
利率敏感度缺口	41,907,636.13	-	-	746,656,649.61	788,564,285.74
上年度末 2010年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	48,144,782.45	-	-	-	48,144,782.45
结算备付金	1,103,189.31	-	-	-	1,103,189.31
存出保证金	-	-	-	1,000,000.00	1,000,000.00
交易性金融资产	-	-	-	917,565,987.57	917,565,987.57

应收证券清算款	-	-	-	29,335,123.66	29,335,123.66
应收利息	-	-	-	10,485.87	10,485.87
应收申购款	-	-	-	344,729.95	344,729.95
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	49,247,971.76	-	-	948,256,327.05	997,504,298.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	577,760.39	577,760.39
应付管理人报酬	-	-	-	1,299,145.78	1,299,145.78
应付托管费	-	-	-	216,524.29	216,524.29
应付交易费用	-	-	-	1,091,529.07	1,091,529.07
其他负债	-	-	-	1,132,177.45	1,132,177.45
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	4,317,136.98	4,317,136.98
利率敏感度缺口	49,247,971.76	-	-	943,939,190.07	993,187,161.83

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 其他市场变量不变，市场利率上升25个基点		
	1. 其他市场变量不变，市场利率下降25个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	市场利率上升25.00 bp	增加10.48万元	增加12.56万元
	市场利率下降25.00 bp	减少10.48万元	减少12.56万元

注：本基金管理人运用 XRisk Suite 风险控制系统对本基金投资组合中的银行存款、结算备付金、债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是

指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	742,893,653.74	94.21	917,565,987.57	92.39
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	742,893,653.74	94.21	917,565,987.57	92.39

注：本基金投资组合中股票投资比例范围占基金资产净值的[60%-95%]；其中投资于具有钻石品质上市公司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%]；持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的合计比例为[在5%以上]，权证投资比例不高于基金资产净值的3%。于2011年6月30日，本基金面临的整体市场风险价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 其他市场变量不变，本基金的业绩比较基准上升1%		
	1. 其他市场变量不变，本基金的业绩比较基准下降1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	本基金业绩比较基准上升1%	增加638.19万元	增加919.50万元
	本基金业绩比较基准下降1%	减少638.19万元	减少919.50万元

注：1. 本基金的整体业绩比较基准为沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

2. 本基金管理人运用XRISK SUITE风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以

上其他价格风险的敏感性分析。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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	742,893,653.74	93.82
	其中：股票	742,893,653.74	93.82
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	41,907,636.13	5.29
6	其他各项资产	7,062,542.76	0.89
7	合计	791,863,832.63	100.00

### 7.2 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	22,626,851.50	2.87
C	制造业	265,825,963.72	33.71
C0	食品、饮料	88,187,532.20	11.18
C1	纺织、服装、皮毛	22,812,008.00	2.89
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	14,301,934.32	1.81
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	133,130,089.20	16.88
C8	医药、生物制品	7,394,400.00	0.94

C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	109,402,795.08	13.87
E	建筑业	3,224,000.00	0.41
F	交通运输、仓储业	8,190,000.00	1.04
G	信息技术业	50,717,413.01	6.43
H	批发和零售贸易	33,621,707.81	4.26
I	金融、保险业	202,814,835.06	25.72
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	46,470,087.56	5.89
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	742,893,653.74	94.21

### 7.3 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

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	1,518,861	73,315,420.47	9.30
2	600187	国中水务	6,000,000	57,960,000.00	7.35
3	601601	中国太保	2,252,580	50,435,266.20	6.40
4	600007	中国国贸	5,002,807	45,425,487.56	5.76
5	002242	九阳股份	3,589,329	44,866,612.50	5.69
6	600036	招商银行	3,269,955	42,574,814.10	5.40
7	000550	江铃汽车	1,608,806	42,263,333.62	5.36
8	600519	贵州茅台	188,868	40,159,002.84	5.09
9	600600	青岛啤酒	1,150,874	39,290,838.36	4.98
10	600050	中国联通	6,179,439	32,442,054.75	4.11
11	600900	长江电力	3,576,948	25,789,795.08	3.27
12	600461	洪城水业	2,550,000	25,653,000.00	3.25
13	601088	中国神华	750,725	22,626,851.50	2.87
14	601009	南京银行	1,995,607	17,900,594.79	2.27
15	600875	东方电气	650,000	16,575,000.00	2.10
16	002045	广州国光	1,922,303	14,301,934.32	1.81
17	000602	*ST 金马	449,546	14,300,058.26	1.81
18	601566	九牧王	619,500	13,387,395.00	1.70
19	600631	百联股份	858,610	12,776,116.80	1.62
20	002048	宁波华翔	944,676	11,307,771.72	1.43
21	600827	友谊股份	586,736	9,933,440.48	1.26
22	601628	中国人寿	511,300	9,586,875.00	1.22

23	600233	大杨创世	548,900	9,424,613.00	1.20
24	600741	华域汽车	833,072	9,272,091.36	1.18
25	000001	深发展 A	527,350	9,001,864.50	1.14
26	600104	上海汽车	472,000	8,845,280.00	1.12
27	601006	大秦铁路	1,000,000	8,190,000.00	1.04
28	002563	森马服饰	157,600	7,594,744.00	0.96
29	000623	吉林敖东	240,000	7,394,400.00	0.94
30	000869	张裕 A	73,890	7,300,332.00	0.93
31	002063	远光软件	210,000	3,975,300.00	0.50
32	000987	广州友谊	158,047	3,317,406.53	0.42
33	601668	中国建筑	800,000	3,224,000.00	0.41
34	000729	燕京啤酒	84,700	1,437,359.00	0.18
35	600754	锦江股份	60,000	1,044,600.00	0.13

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600187	国中水务	45,000,000.00	4.53
2	600900	长江电力	28,732,297.89	2.89
3	601088	中国神华	26,455,475.52	2.66
4	600461	洪城水业	24,650,000.00	2.48
5	600271	航天信息	20,274,364.80	2.04
6	600007	中国国贸	18,426,456.92	1.86
7	002242	九阳股份	17,519,607.52	1.76
8	600875	东方电气	17,195,489.53	1.73
9	600529	山东药玻	17,142,870.35	1.73
10	000550	江铃汽车	17,032,250.54	1.71
11	002045	广州国光	15,278,357.02	1.54
12	600104	上海汽车	14,393,175.45	1.45
13	000069	华侨城 A	14,107,356.70	1.42
14	601566	九牧王	12,757,969.87	1.28
15	002048	宁波华翔	12,443,478.26	1.25
16	601318	中国平安	12,264,101.39	1.23
17	600157	永泰能源	12,081,934.20	1.22
18	000602	*ST 金马	11,770,737.76	1.19
19	002202	金风科技	9,928,836.16	1.00
20	601628	中国人寿	9,582,855.00	0.96

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002202	金风科技	79,690,530.27	8.02
2	600036	招商银行	32,462,282.88	3.27
3	000069	华侨城 A	29,841,154.95	3.00
4	601628	中国人寿	23,878,953.72	2.40
5	600309	烟台万华	23,049,231.48	2.32
6	600271	航天信息	20,318,786.86	2.05
7	000983	西山煤电	20,092,047.20	2.02
8	000937	冀中能源	17,928,351.48	1.81
9	000729	燕京啤酒	17,177,555.52	1.73
10	000655	金岭矿业	16,905,339.42	1.70
11	600529	山东药玻	16,501,986.92	1.66
12	601318	中国平安	14,477,993.08	1.46
13	600519	贵州茅台	13,902,590.75	1.40
14	601088	中国神华	13,898,545.34	1.40
15	000063	中兴通讯	13,888,465.95	1.40
16	600066	宇通客车	13,730,393.45	1.38
17	000602	*ST 金马	13,525,390.85	1.36
18	601166	兴业银行	13,349,134.15	1.34
19	600157	永泰能源	12,667,986.26	1.28
20	000001	深发展 A	12,291,566.09	1.24

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。

#### 7.4.3 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	559,766,931.39
卖出股票的收入(成交)总额	720,861,154.15

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。

#### 7.5 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。



**7.6 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**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 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。

**7.8 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**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.9 投资组合报告附注**

7.9.1 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。

7.9.2 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。

**7.9.3 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	1,072,656.25
2	应收证券清算款	5,471,992.25
3	应收股利	315,000.00
4	应收利息	8,805.60
5	应收申购款	194,088.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,062,542.76

**7.9.4 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券。

**7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600187	国中水务	57,960,000.00	7.35	非公开发行锁定期

**7.9.6 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
15,129	52,438.31	15,815,983.14	1.99%	777,523,188.93	98.01%

### 8.2 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	569,888.69	0.07%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年2月3日)基金份额总额	1,937,798,339.14
本报告期初基金份额总额	972,290,110.47
本报告期基金总申购份额	193,450,811.79
减：本报告期基金总赎回份额	372,401,750.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	793,339,172.07

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 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

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。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未有基金投资策略的改变。

## 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
申银万国	1	326,523,765.77	26.96%	277,543.84	27.43%	-
新时代证券	1	286,078,692.08	23.62%	243,166.31	24.03%	-

国金证券	1	265,683,498.02	21.94%	215,869.21	21.34%	-
银河证券	1	178,730,470.35	14.76%	145,219.54	14.35%	-
国信证券	1	129,005,672.01	10.65%	109,654.41	10.84%	-
中投证券	1	24,955,987.31	2.06%	20,277.04	2.00%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

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，本基金报告期内共租用7个交易席位，报告期内无席位增减。

(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。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

本报告期内本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华基金管理有限公司关于旗下基金2010年年度资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-1-4
2	新华基金管理有限公司关于旗下基金投资洪城水业（600461）非公开发行的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-1-11
3	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的费率调整公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-1-19
4	新华钻石品质企业股票型证券投资基金2010年第4季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-1-22
5	新华基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-1-27
6	新华基金管理有限公司关于旗下基金投资国中水务（600187）非公开发行的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-2-18
7	新华基金管理有限公司关于因系统升级需暂停网站及客服系统服务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-2-25
8	新华基金管理有限公司关于旗下基金增加重庆银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-3-3
9	新华钻石品质企业股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-3-19
10	新华钻石品质企业股票型证券投资基金招募说明书（更新）全文	公司网站	2011-3-19
11	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]	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-3-30
12	新华钻石品质企业股票型证券投资基金2010年年度报告[正文]	公司网站	2011-3-30
13	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-4-1
14	新华基金管理有限公司关于旗下基金参加“华夏银行·盈基金2011”网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-4-9
15	新华钻石品质企业股票型证券投资基金2011年第1季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-4-20
16	新华基金管理有限公司旗下基金在重庆银行股份有限公司开通基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-4-28
17	新华基金管理有限公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上直销优惠费率的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-4-30
18	新华基金管理有限公司旗下基金在中信证	中国证券报、证券	2011-5-6

	券股份有限公司开通基金定期定额投资业务的公告	时报、上海证券报	
19	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-5-19
20	新华基金管理有限公司关于系统升级维护的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-5-27
21	新华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2011-6-24

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华钻石品质企业股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华钻石品质企业股票型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华钻石品质企业股票型证券投资基金托管协议
- (四) 新华钻石品质企业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) 《新华钻石品质企业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
- (九) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 12.3 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  
二〇一一年八月二十六日