

# 新华钻石品质企业股票型证券投资基金

## 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司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
报告期末基金份额总额	1,626,509,955.07份
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	$80\% \times \text{沪深300指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$
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。
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

### §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	-50,920,405.95
2.本期利润	-343,163,036.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2027
4.期末基金资产净值	1,345,974,317.61
5.期末基金份额净值	0.828

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

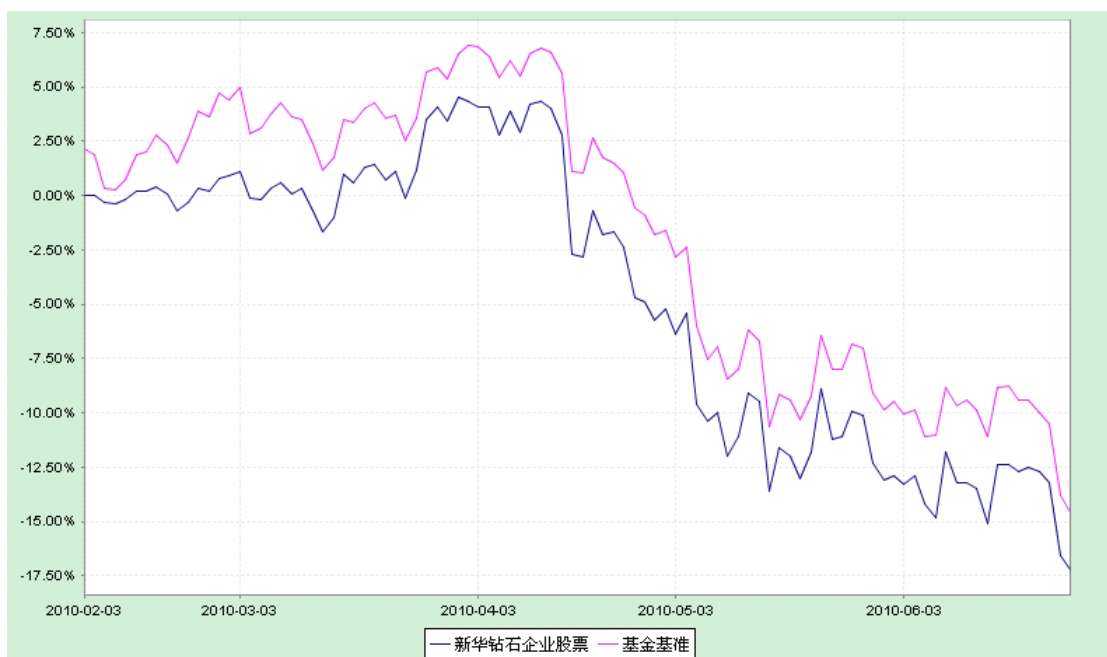
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-19.92%	1.75%	-18.88%	1.45%	-1.04%	0.30%

### 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

新华钻石品质企业股票型证券投资基金

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

(2010 年 2 月 3 日至 2010 年 6 月 30 日)



1、本基金自 2010 年 2 月 3 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		
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	2006-7-12	-	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。

### 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 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

上半年 A 股市场呈现震荡向下格局，上证综合指数从年初的 3290 点下跌到年中的 2398 点，跌幅为 27%。上半年影响股指震荡向下的原因主要是政策紧缩导致的对经济二次探底的预期。我们在去年年底判断今年股指将会处于震荡之中，而相对看好年初及上半年的行情，现在来看，这种判断对政策退出的心理预期不足，因此导致整个上半年操作在大类资产配置上过于激进，虽然在结构和品种上对风险进行了防范，但业绩表现不如人意。

#### 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 0.828 元，本报告期份额净值增长率为-19.92%，同期比较基准的增长率为-18.88%。

## § 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	1,272,742,778.54	93.60
	其中：股票	1,272,742,778.54	93.60
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	71,455,748.34	5.26
6	其他各项资产	15,506,404.17	1.14
7	合计	1,359,704,931.05	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	40,754,338.38	3.03
C	制造业	551,962,480.92	41.01
C0	食品、饮料	182,014,400.05	13.52
C1	纺织、服装、皮毛	73,250,081.47	5.44
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,827,000.00	0.14
C4	石油、化学、塑胶、塑料	385,023.00	0.03
C5	电子	18,105,533.88	1.35
C6	金属、非金属	8,319,090.15	0.62
C7	机械、设备、仪表	267,433,143.37	19.87

C8	医药、生物制品	180,009.00	0.01
C99	其他制造业	448,200.00	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	13,425,200.00	1.00
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	2,958,933.00	0.22
G	信息技术业	47,570,833.28	3.53
H	批发和零售贸易	1,064,000.00	0.08
I	金融、保险业	537,394,977.66	39.93
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	77,612,015.30	5.77
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,272,742,778.54	94.56

### 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	601318	中国平安	2,698,525	120,219,288.75	8.93
2	600519	贵州茅台	864,206	110,065,276.16	8.18
3	600036	招商银行	7,016,356	91,282,791.56	6.78
4	002202	金风科技	4,937,859	76,783,707.45	5.70
5	000001	深发展 A	3,935,078	68,903,215.78	5.12
6	000712	锦龙股份	3,782,411	63,431,032.47	4.71
7	600007	中国国贸	6,266,735	62,542,015.30	4.65
8	000338	潍柴动力	973,142	59,848,233.00	4.45



9	002242	九阳股份	4,604,566	52,906,463.34	3.93
10	600000	浦发银行	3,592,941	48,863,997.60	3.63

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未持有债券。

#### 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

本基金本报告期内未持有债券。

#### 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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未持有权证。

#### 5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本报告期内，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 本报告期内，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之外的股票。

##### 5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,232,558.08
2	应收证券清算款	13,159,274.28
3	应收股利	929,646.27
4	应收利息	13,496.97
5	应收申购款	171,428.57

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,506,404.17

## 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

## 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	120,219,288.75	8.93	筹划平安银行与深发展整合的重组事项
2	000001	深发展A	68,903,215.78	5.12	筹划深发展与平安银行整合的重组事项

## 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,937,798,339.14
-------------	------------------

报告期期间基金总申购份额	97,822,238.17
报告期期间基金总赎回份额	409,110,622.24
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	1,626,509,955.07

## § 7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内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

### 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，或通过本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