

基金管理人: 新世纪基金管理有限公司
基金托管人: 中国农业银行
报告送出日期: 二〇〇九年一月二十一日

§ 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根据本基金合同规定,于2009年1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。

§ 2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 世纪分红; 交易代码, S19087(前端), S19088(后端); 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2005年9月16日; 报告期末基金份额总额, 2,123,257,149.96份

有效地控制风险,实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准并提供稳定的分红。

1、大类资产配置
根据本基金的配置目标、投资理念和投资范围,采用成本型资产配置策略,即不断评估各类资产的风险收益状况,以调整投资组合中的大类资产配置,从变化的市场条件中获利。本基金一方面动态地考察中国宏观经济和制度变革带来的国内金融资产估值水平的变化趋势,根据国内市场“新兴加转轨”的特点对政策等因素进行研究;另一方面,对无风险收益率、股权风险溢价进行分析,在比较收益风险状况的基础上综合确定股票、债券和其他金融工具之间的配置比例。

2、行业配置策略
动态研究行业基本面、景气周期变化形成行业投资价值评价,参考国际竞争力比较因素,形成行业配置。

3、股票优选策略
在财务分析和上市公司调研的基础上,寻找品质优异且有分红潜力的高成长型上市公司及分红能力强的价值型上市公司,构建股票库。并辅助以国际竞争力比较,提高选股的有效性,寻找具有国内竞争优势的股票,增强最终投资组合的盈利能力和抗风险能力。

4、债券投资策略
本基金考察国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势,采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略等积极投资策略,力求获取高于业绩比较基准的回报。

业绩比较基准: 60%\*中信标普300指数+40%\*中信国债指数
风险收益特征: 本基金属于中等风险的混合型基金,其风险收益特征从长期平均来看,介于股票基金与债券基金之间。

基金管理人: 新世纪基金管理有限公司
基金托管人: 中国农业银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2008年10月1日-2008年12月31日); 1.本期已实现收益, -178,602,895.11; 2.本期利润, -22,781,791.70; 3.加权平均基金份额本期利润, -0.0107; 4.期末基金资产净值, 930,532,633.30; 5.期末基金份额净值, 0.4383

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(例如基金申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 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3个月, -2.27%, 2.13%, -9.00%, 1.80%, 6.73%, 0.33%

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
新世纪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

新世纪优选分红混合型证券投资基金

2008 第四季度报告

2008年12月31日

2005年9月16日至2008年12月31日

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 钱基经小组简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 钱基经, 基金经理, 2007-6-19, -, 11年; 曹名长, 基金经理, 2006-7-12, -, 11年

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,新世纪基金管理有限公司作为新世纪优选分红混合型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的规定,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 公平交易制度的执行情况

本报告期,本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

(一)对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释

1. 本基金业绩表现

截至2008年12月31日,本基金份额净值为0.4383元,本报告期份额净值增长率为-2.27%,同期比较基准的增长率为-0.00%。

2. 投资策略和运作分析

持续动荡的金融环境继续困扰着全球经济,季度伊始的全球央行集体降息仍未刺激各国股市整体走强,在此背景下,A股市场未能独善其身,2008年四季度A股市场持续下挫。随后,在政府为刺激经济先后出台4万亿扩大内需、大幅度降息维持金融稳定等一系列政策措施的影响下,A股市场在创下本轮调整的新低后逐步企稳并展开了近30%的反弹。

目前,国际油价、铁矿石、煤炭等大宗商品材料及农产品价格暴跌,需求不振,企业进入去库存化周期,次贷危机对实体经济的蔓延导致对美国经济步入衰退以及全球经济增长放缓的担忧;央行货币政策持续宽松,房地产市场持续低迷,宏观经济增速逐步放缓,分析师对企业盈利水平的不断下降,宏观经济虽然可

能仍面临着下滑的风险,但4万亿扩大内需政策出台的刺激下人们对经济的预期不再过度悲观,估值的吸引力以及流动性的释放,使市场热点板块频出,前期跌幅巨大的周期性行业如钢铁、有色、航运、煤炭板块等出现了超跌反弹,周期性较强的医药、必需消费品、TMT,受益于国家基础设施建设的建筑、水泥、电力设备、工程机械等表现强劲。我们在资产配置加大对金融、医药、商业贸易、机械等设备等行业投资,增加了仓位配置。基金净值在同类型基金中表现较好。

(二)未来展望及操作策略
目前的经济仍面临着下滑的风险,但我们预计在政府的宏观调控下,国内的通胀将会逐步回落,经济实现软着陆的可能性较大。市场的大幅调整导致整体估值水平已经大幅降低,系统性风险已充分释放。我们认为中国经济长期仍将保持较快的增长,不会因短期调整和外部力量的冲击而改变,经济周期的短期波动不会改变优质上市公司的长期投资价值,很多优质上市公司的投资价值已经凸显。

投资策略方面,我们将仍将坚守“价值+成长”的投资理念,努力寻找那些具有长期投资价值,能够穿越经济周期的短期波动,即使在整体经济增长减速的背景下,盈利仍能保持稳定快速增长的公司作为配置重点。对于周期性股票,我们将加大对行业周期性的把握,谨慎对待,对于周期已经触底、未来长期投资价值显现并被低估的公司将会战略配置,对于处于景气高点行业将会减少配置。坚持持有具有核心竞争优势和成长性,能穿越短期市场波动并能带来长期超额收益的优质股。

2009年1季度结合自上而下和自下而上的方法,我们将看好医药、食品饮料中的必需消费品,电力设备、信息技术、基础设施建设等行业中的部分优质上市公司,但由于前期涨幅较大,我们会密切关注其估值的水平,将会减持其中的较高估值的板块或者个股,密切关注房地产、农业、钢铁、有色、机械、化工、煤炭等行业中的结构性投资机会,对于其中的超跌、率先复苏的周期性行业将会加大配置力度。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%); 1 权益投资, 743,950,757.12, 79.10; 其中:股票, 743,950,757.12, 79.10; 2 固定收益投资, 138,426,167.91, 14.72; 其中:债券, 138,426,167.91, 14.72; 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, 47,182,790.47, 5.02; 6 其他资产, 10,946,359.26, 1.16; 7 合计, 940,506,074.76, 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 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, 18,133,365.18, 1.95; B 采矿业, 14,131,501.79, 1.52; C 制造业, 282,262,760.05, 30.33; CD 食品饮料, 37,245,334.13, 4.00; CI 纺织服装、皮毛, 5,665,000.00, 0.61; C2 木材、家具, -, -; C3 造纸、印刷, -, -; C4 石油、化学、塑胶、塑料, 49,345,364.12, 5.30; C5 电子, 5,610,150.00, 0.60; C6 金属、非金属, 32,701,489.71, 3.51; C7 机械、设备、仪表, 90,142,659.20, 9.69; H 批发和零售业, 79,324,867.45, 8.52; I 房地产业, 10,135,520.00, 1.09; K 社会服务业, 23,220,552.22, 2.50; L 传播与文化业, 3,107,825.00, 0.33; M 综合类, 29,772,784.16, 3.20; 合计, 743,950,757.12, 79.95

5.3 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股票投资明细

Table with 5 columns: 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 权益投资, 743,950,757.12, 79.10; 其中:股票, 743,950,757.12, 79.10; 2 固定收益投资, 138,426,167.91, 14.72; 其中:债券, 138,426,167.91, 14.72; 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, 47,182,790.47, 5.02; 6 其他资产, 10,946,359.26, 1.16; 7 合计, 940,506,074.76, 100.00

5.4 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

Table with 5 columns: 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 122013 08北债债, 344,160, 36,453,427.20, 3.92; 2 110003 新钢转债, 314,890, 30,197,951.00, 3.25; 3 122009 08新海债, 250,000, 26,307,500.00, 2.83; 4 122011 08安发债, 160,000, 16,512,000.00, 1.77; 5 125709 唐钢转债, 133,073, 13,502,917.31, 1.45

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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 122013 08北债债, 344,160, 36,453,427.20, 3.92; 2 110003 新钢转债, 314,890, 30,197,951.00, 3.25; 3 122009 08新海债, 250,000, 26,307,500.00, 2.83; 4 122011 08安发债, 160,000, 16,512,000.00, 1.77; 5 125709 唐钢转债, 133,073, 13,502,917.31, 1.45

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

本报告期末本基金未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元); 1 存出保证金, 1,300,000.00; 2 应收证券清算款, 6,633,597.39; 3 应收利息, -, -; 4 应收股利, 2,983,611.68; 5 应收申购款, 29,150.19; 6 其他应收款, -, -; 7 其他, -, -; 8 合计, 10,946,359.26

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 125709 唐钢转债, 13,502,917.31, 1.45

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本报告期末前十名股票中没有流通受限情况。

5.8.6 其他需说明的重要事项
无

§ 6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额, 2,153,947,649.23; 报告期间基金总申购份额, 8,615,756.51; 报告期间基金总赎回份额, 39,309,255.78; 报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列), -; 报告期末基金份额总额, 2,123,257,149.96

§ 7 备查文件目录

- 1 中国证监会批准新世纪优选成长股票型证券投资基金募集的文件(《中国证监会批准新世纪优选成长股票型证券投资基金募集文件》)
(二)《新世纪优选成长股票型证券投资基金基金合同》
(三)《新世纪优选成长股票型证券投资基金托管协议》
(四)《新世纪基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(五)更新的《新世纪优选成长股票型证券投资基金招募说明书》
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
(七)基金托管人业务资格批件及营业执照
7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人住所。
7.3 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。

新世纪基金管理有限公司
二〇〇九年一月二十一日

基金管理人: 新世纪基金管理有限公司
基金托管人: 中国农业银行
报告送出日期: 二〇〇九年一月二十一日

§ 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根据本基金合同规定,于2009年1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。

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,因此主要采取自上而下的主动投资管理策略。当然仅应用自上而下的策略可能导致某行业投资策略集中度过高,行业配置不够分散,造成组合非系统风险高。再考虑到国内资产配置风险高,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。

1、大类资产配置
本基金重点考虑以下四个基本因素:一是宏观经济周期因素;二是估值因素;三是制度和政策的变化因素;四是市场情绪因素。通过这四个方面的分析,利用打分卡模型(MVPS,即:宏观因素A;估值因素B;政策因素C;情绪因素D)综合四个方面的结果,调整股票投资比例。其中宏观经济因素主要考虑GDP、固定资产投资增速、消费品零售总额、进出口额、CPI、原材料价格、利率和汇率等;估值因素主要考虑整体市场的市盈率 and 隐含股权风险溢价等;政策因素主要考虑政策周期、制度创新等;情绪因素主要考虑新增开户数等指标。

2、行业配置策略
本基金对初级股票池中个股所处行业的动态评价是在“新世纪行业评价系统”的辅助下完成,通过把握宏观经济所处的阶段,估计行业所处的景气周期阶段,结合对行业竞争优势的评价和对行业估值水平的研究,综合形成对行业的总体投资价值评价。景气周期主要参考国家统计局的“中国行业企业景气指数”;行业估值水平采用PEG估值,行业竞争优势主要参考政策扶持、市场需求、行业组织、行业集中度、生产要素配置、国际化水平六方面综合评价。本基金重点考虑投资价值高的行业,增加(和行业自然权重相比较)其行业权重,减少或不投资价值低(和行业自然权重相比较)的行业权重。

3、股票选择策略
采用以选择具有成长性兼具品质保障的上市公司的“优选成长”选股策略。首先通过财务指标从中选择出财务风险低上市公司,并选择具有成长性公司,即预期未来2年主营业务收入增长率高于GDP增长率1.5倍,股票,辅助以预期主营业务收入利润增长率指标,以及参考企业成长因子分析进行选择,形成初选股票池;进而选择估值低、具备盈利能力、偿债能力,以及公司业绩质量(即真实、稳定)的公司,主要采用现金流分析、估值模型(PEG)和其他定量定性分析(主要是净资产收益率ROE和资产负债率)筛选上市公司的品质,形成备选股票池;最后,通过调研,并根据行业配置策略确定最终的投资组合。

4、债券投资策略
本基金考察国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势,采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略等积极投资策略,力求获取高于业绩比较基准的回报。

5、权证投资策略
在控制风险的前提下,本基金将采用以下策略:普通策略:根据权证定价模型,选择低估的权证进行投资,并选择保护策略;股票型基金持有股票的必要(最低60%),却有股价下跌带来损失的可能。利用权证法,就可以实现对手中持股的保护。套利策略:当权证价格和正股价格和低于行权价格时,并且收益率超过市场无风险收益率时,可以进行无风险套利。

6、资产支持证券投资策略
在控制风险的前提下,本基金对资产支持证券从五个方面综合评价,选择低估的品种进行投资。五个方面包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。其中信用因素是目前最重要的因素,本基金采用信用矩阵方法来选择。

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: 新世纪基金管理有限公司
基金托管人: 中国农业银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2008年10月1日-2008年12月31日); 1.本期已实现收益, 1,810,882.45; 2.本期利润, 1,291,498.18; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0100; 4.期末基金资产净值, 88,323,250.41; 5.期末基金份额净值, 0.9933

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(例如基金申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

Table with 6 columns: 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3个月, 0.01%, 0.82%, -14.38%, 2.43%, 14.39%, -1.61%

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
新世纪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2008年12月31日

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 钱基经小组简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 曹名长, 基金经理, 2008-7-25, -, 11; 王卫东, 基金经理, 2008-7-25, -, 15

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,新世纪基金管理有限公司作为新世纪优选成长股票型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的规定,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 公平交易制度的执行情况

本报告期,本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

(一)对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释

1. 本基金业绩表现

截至2008年12月31日,本基金份额净值为0.9933元,本报告期份额净值增长率为0.01%,同期比较基准的增长率为-14.38%。

2. 投资策略和运作分析

08年4季度A股市场继续下跌,其中上证综指下跌20.62%、深成指下跌14.21%、沪深300下跌19%。本基金贯彻了“以防为主、防守反击”的投资策略,季度内净值上涨0.01%,较好地规避了市场的下跌风险。

(二)未来展望及操作策略
A股市场经过2008年全年65%幅度的下跌,市场系统性风险得到释放。目前的绝对估值水平处于历史较低的位置,长期投资价值逐渐显现。

总体上看,09年我国经济将面临内外需同时放缓的严峻考验,但政府为刺激经济先后出台的4万亿亿基建、各种降低税费、扩大内需、大幅降息以及维护金融稳定等一系列的政策措施预计也将发挥作用。因此,在政府全力保障经济增长,并期待效果逐渐显现的环境下,市场信心有望修复,A股市场将改变08年全年单边下跌的走势,存在结构性机会。

本基金认为一季度的可能存在两类投资机会,一类是需求稳定的行业板块,如新能源、农业、医药等行业。另一类是处在周期底部,库存下降,有望率先复苏的行业,如各类制造业。

新世纪优选成长股票型证券投资基金

2008 第四季度报告

2008年12月31日

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 钱基经小组简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 曹名长, 基金经理, 2008-7-25, -, 11; 王卫东, 基金经理, 2008-7-25, -, 15

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,新世纪基金管理有限公司作为新世纪优选成长股票型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的规定,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 公平交易制度的执行情况

本报告期,本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

(一)对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明与解释

1. 本基金业绩表现

截至2008年12月31日,本基金份额净值为0.9933元,本报告期份额净值增长率为0.01%,同期比较基准的增长率为-14.38%。

2. 投资策略和运作分析

08年4季度A股市场继续下跌,其中上证综指下跌20.62%、深成指下跌14.21%、沪深300下跌19%。本基金贯彻了“以防为主、防守反击”的投资策略,季度内净值上涨0.01%,较好地规避了市场的下跌风险。

(二)未来展望及操作策略
A股市场经过2008年全年65%幅度的下跌,市场系统性风险得到释放。目前的绝对估值水平处于历史较低的位置,长期投资价值逐渐显现。

总体上看,09年我国经济将面临内外需同时放缓的严峻考验,但政府为刺激经济先后出台的4万亿亿基建、各种降低税费、扩大内需、大幅降息以及维护金融稳定等一系列的政策措施预计也将发挥作用。因此,在政府全力保障经济增长,并期待效果逐渐显现的环境下,市场信心有望修复,A股市场将改变08年全年单边下跌的走势,存在结构性机会。

本基金认为一季度的可能存在两类投资机会,一类是需求稳定的行业板块,如新能源、农业、医药等行业。另一类是处在周期底部,库存下降,有望率先复苏的行业,如各类制造业。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%); 1 权益投资, 65,429,682.60, 72.29; 其中:股票, 65,429,682.60, 72.29; 2 固定收益投资, 18,466,332.80, 20.40; 其中:债券, 18,466,332.80, 20.40; 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, 4,954,306.67, 5.47; 6 其他资产, 1,662,100.33, 1.84; 7 合计, 90,512,422.40, 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 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, 0.00, 0.00; B 采矿业, 486,500.00, 0.55; C 制造业, 31,336,630.00, 35.48; CD 食品饮料, 1,653,414.00, 1.87; CI 纺织服装、皮毛, 0.00, 0.00; C2 木材、家具, 0.00, 0.00; C3 造纸、印刷, 1,430,000.00, 1.62; C4 石油、化学、塑胶、塑料, 5,211,076.00, 5.90; C5 电子, 790,800.00, 0.90; C6 金属、非金属, 1,543,400.00, 1.75; C7 机械、设备、仪表, 8,993,040.00, 10.18; C8 医药、生物制品, 11,197,900.00, 12.68; C9 其他制造业, 517,000.00, 0.59; D 电力、煤气及水的生产和供应业, 1,396,500.00, 1.58; E 建筑业, 805,000.00, 0.91; F 交通运输、仓储业, 2,296,500.00, 2.60; G 信息技术业, 5,162,390.60, 5.84; H 批发和零售业, 4,810,400.00, 5.45; I 金融业, 10,325,400.00, 11.69; J 房地产业, 4,522,600.00, 5.12; K 社会服务业, 2,123,000.00, 2.40; L 传播与文化业, 927,500.00, 1.05; M 综合类, 1,237,262.00, 1.40; 合计, 65,429,682.60, 74.08

5.3 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股票投资明细