

新华钻石品质企业股票型证券投资基金

2011 第二季度 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十一日

\$1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员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，并对本内容的真实性、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股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年7月20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。投资人投资风险，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。

本公司对本基金的持续监督并定期向基金份额持有人报告。

本报告期自2011年1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
报告期末基金份额总额	793,339,172.07份

本基金采取“在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的前提下获得良好收益”的前提下，精选具有稳定价值特征和成长性的钻石品质类的优质公司。

本基金采取“在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的前提下获得良好收益”的前提下，精选具有稳定价值特征和成长性的钻石品质类的优质公司。

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 中国工商银行股份有限公司

\$3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 2011年4月1日-2011年6月30日
1.本期已实现收益	4,396,426.37
2.本期利润	-34,058,434.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0426
4.期末基金份额净值	788,564,285.74
5.期末基金份额净值	0.994

3.1 主要财务指标

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 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.24% 0.98% -4.28% 0.88% 0.04% 0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率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

2010年2月3日至2011年6月30日

注：报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

曹名长 基金经理(新华钻石品质企业股票型证券投资基金) 2010-2-3 - 14 经济学硕士，历任君安证券有限公司研究员、红塔证券有限公司资产管理部股权投资经理、新华信托分红计划基金管理人、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理、新华基金管理有限公司基金投资部总监。新华信托分红计划基金管理人、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理、新华基金管理有限公司基金投资部总监。

李昱 基金经理 2011-1-27 - 14 管理学硕士，14年证券从业经验。历任广发证券有限公司研究所研究员、广发证券股份有限公司研究所研究员、广发证券股份有限公司研究所研究员、广发证券股份有限公司研究所研究员。李昱女士于2010年3月加入新华基金管理有限公司，任专户管理负责人，负责新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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 基金管理人内部控制制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.3 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.4 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.5 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.6 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.7 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.8 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.9 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.10 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.11 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.12 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.13 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.14 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.15 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.16 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.17 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.18 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.19 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.20 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.21 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.22 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.23 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.24 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.25 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.26 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.27 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.28 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.29 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.30 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.31 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.32 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.33 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.34 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.4.35 公平交易制度执行情况

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，建立健全内部控制制度，严格执行内部管理制度，严格控制基金投资风险，在严格控制风险的基础上为持有人谋取最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

</