新华钻石品质企业股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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:二〇一四年三月二十八日

§1 重要提示

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根据本基金合同规定, 于2014年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。本报告财务材料已经审计。

本报告期自2013年1月1日起至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	637,654,989.19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	田青
	联系电话	010-88423386	010-67595096
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tianqing.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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	94,535,028.64	-65,294,969.12	-8,267,724.60
本期利润	92,594,003.02	70,625,236.20	-115,551,693.22
加权平均基金份额本期利润	0.1409	0.1006	-0.1433
本期基金份额净值增长率	13.84%	12.00%	-15.96%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.0940	-0.0404	-0.1416
期末基金资产净值	697,581,893.75	645,274,122.91	621,564,220.31
期末基金份额净值	1.094	0.961	0.858

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
过去三个月	6.52%	1.27%	-2.45%	0.90%	8.97%	0.37%
过去六个月	22.10%	1.31%	5.06%	1.03%	17.04%	0.28%
过去一年	13.84%	1.39%	-5.30%	1.11%	19.14%	0.28%
过去三年	7.15%	1.26%	-18.57%	1.06%	25.72%	0.20%
自基金合同生效起至今	9.40%	1.30%	-18.11%	1.11%	27.51%	0.19%

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。

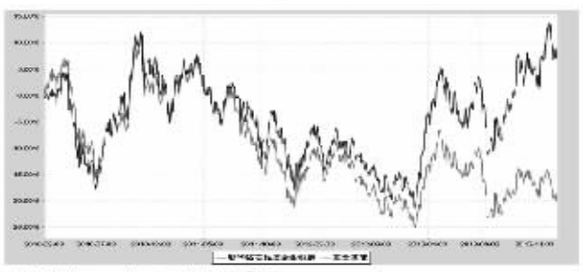
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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2013年12月31日)



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2013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2013年12月31日,新华基金管理有限公司旗下管理着十四只开放式基金,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、新华中小市值优选股票型证券投资基金、新华灵活主题股票型证券投资基金、新华优选消费股票型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航股票型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金和新华信用增益债券型证券投资基金。

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总监	2010-02-03	-	16	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。
孔雪梅	本基金基金经理助理,新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,新华优选消费股票型证券投资基金基金经理,研究部总监	2012-10-25	2013-11-12	5	管理学硕士,于2008年3 月加入新华基金管理有限公司,负责行业研究,历任新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理助理,新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华基金管理有限公司研究部总监、新华优选消费股票型证券投资基金基金经理。
李会忠	本基金基金经理助理	2013-07-20	-	6	清华大学经济学硕士,迪沙药业集团财务副总监、大公国际资信评估有限公司信用分析师,2007年9月加入新华基金管理有限公司,先后负责研究金融、商贸零售、纺织服装、餐饮旅游、煤炭、电力、交通运输、食品饮料、农林牧渔等行业。现任新华基金管理有限公司策略分析师、金融工程部副总监、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理助理。

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《证券业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遵规守信情况的说明

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。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合基金合同规定投资比例的,基金管理人已在10 个交易日内调整完毕。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易,投资指令统一由中央交易室下达,并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,中央交易室根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由中央交易室报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向中央交易室下达投资指令,中央交易室向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《新华基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内以及5日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明:债券同向交易频率偏低;股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断,即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大,结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生,本报告期内,未发生有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

2013年全年A股呈震荡下跌之势,从上证指数和沪深300来看,全年只有三季度上涨,一、二、四季度均下跌。市场震荡下跌的主要原因在于资金面偏紧,而经济处于转型当中,周期性行业公司和其他传统行业公司被投资者抛弃。相反的是,代表新兴产业的创业板指数屡创新高。

由于我们在2012年底对2013年的判断是经济继续走在复苏的道路上,对转型的预期则不足。总体来看,我们全年的股票配置比例保持高仓位,但结构相对均衡,因此,净值虽没有创业板指数表现那么强劲,但取得了一定的正收益,好于中信标普、上证及沪深300等主要指数。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为1.094元,本报告期份额净值增长率为13.84%,同期比较基准的增长率为-5.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于今后的市场判断,我们认为一定时期内可能还将处于底部徘徊整固阶段。中短期的经济增速相对稳定和企业盈利保持一定增速,以及以大盘蓝筹为代表的权重股估值处于历史低位,是A股市场的支撑。当然,由于经济仍处于结构调整等方面的原因,市场要走出持续上涨的行情也较为困难。但我们仍强调,市场震荡徘徊如此长时间以后,其在2014年的某个时期走出底部泥潭的可能性在不断增加,因此,我们有理由保持相对乐观,除了对于2013年大幅上涨的一些行业和个股需保持必要的谨慎以外。

基于上述判断,对2014年全年的操作,我们仍将保持原有的较高股票仓位风格,以精选个股为主,兼顾配置的多样性。

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讯;

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方法符合现行法律、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瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师李荣坤、张吉范签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	41,162,486.62	36,155,242.93
结算备付金	448,358.00	1,245,194.14
存出保证金	131,338.29	1,500,000.00
交易性金融资产	656,158,513.60	606,580,453.67
其中:股票投资	656,158,513.60	606,580,453.67
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	3,026,438.82	3,704,875.35
应收利息	8,687.72	7,682.47
应收股利	-	-
应收申购款	284,146.65	689,137.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	701,219,969.70	649,882,586.41
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	-	1,163,260.97
应付赎回款	826,157.34	506,758.73
应付管理人报酬	934,204.32	748,680.12
应付托管费	155,700.72	124,780.00
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,091,389.38	434,297.35
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	630,624.19	1,630,686.33
负债合计	3,638,075.95	4,608,463.50
所有者权益:		
实收基金	637,654,989.19	671,374,011.85
未分配利润	59,926,904.56	-26,099,888.94
所有者权益合计	697,581,893.75	645,274,122.91
负债和所有者权益总计	701,219,969.70	649,882,586.41

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.094元,基金份额总额637,654,989.19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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	108,037,945.62	83,973,808.03
1.利息收入	312,106.28	270,838.83
其中:存款利息收入	308,987.47	270,838.83
债券利息收入	3,118.81	-
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)	109,390,067.48	-52,358,061.90
其中:股票投资收益	95,866,808.02	-62,939,898.53
基金投资收益	-	-
债券投资收益	394,447.29	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13,128,812.17	10,581,836.63
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,941,025.62	135,920,205.32
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	276,797.48	140,825.78
减:二、费用	15,443,942.60	13,348,571.83
1.管理人报酬	9,913,348.67	9,184,894.15
2.托管费	1,652,224.77	1,530,815.67
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,472,418.40	2,229,482.55
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	405,950.76	403,379.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	92,594,003.02	70,625,236.20
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列	92,594,003.02	70,625,236.20

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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	671,374,011.85	-26,099,888.94	645,274,122.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	92,594,003.02	92,594,003.02
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)	-33,719,022.66	-6,567,209.52	-40,286,232.18
其中:1.基金申购款	413,046,142.40	11,308,234.15	424,354,376.55
2.基金赎回款	-446,765,165.06	-17,875,443.67	-464,640,608.73
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)	637,654,989.19	59,926,904.56	697,581,893.75
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	724,108,083.11	-102,543,862.80	621,564,220.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	70,625,236.20	70,625,236.20
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)	-52,734,071.26	5,818,737.66	-46,915,333.60
其中:1.基金申购款	115,239,132.23	-12,085,413.39	103,153,718.84
2.基金赎回款	-167,973,203.49	17,904,151.05	-150,069,052.44
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)	671,374,011.85	-26,099,888.94	645,274,122.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人公司负责人:陈重,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1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相一致。

7.4.2差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

7.4.3关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东

注:本报告期内,本公司原有股东陕西蓝潼投资有限公司将其持有的30%股权、上海大众环境产业有限公司将其持有的13.75%股权转让给恒泰证券股份有限公司,并已完成证监会审批和工商变更登记手续。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1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。

7.4.4.1.2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。

7.4.4.1.3债券交易

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债券交易。

7.4.4.1.4债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.4.1.5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。

7.4.4.2关联方报酬

7.4.4.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,913,348.67	9,184,894.15
其中:支付销售机构的客户维护费	3,300,723.33	3,636,770.76

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。

7.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,652,224.77	1,530,815.67

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。

7.4.4.3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。

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.4.4.2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

本报告期末及上年度末,除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.4.5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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	41,162,486.62	290,564.56	36,155,242.93	261,274.38

7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.4.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.5利润分配情况

本基金本报告期及上年度可比期间无收益分配事项。

7.4.6期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1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。

7.4.6.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000558	莱茵置业	2013-12-26	筹划资产收购事宜	3.44	2014-01-02	3.63	242,898	783,073.58	835,569.12	-

7.4.6.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.6.3.1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。

7.4.6.3.2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	656,158,513.60	93.57
	其中:股票	656,158,513.60	93.57
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	41,610,844.62	5.93
6	其他各项资产	3,450,611.48	0.49
7	合计	701,219,969.70	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	采矿业	-	-
C	制造业	337,177,480.82	48.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,563,178.28	4.67
E	建筑业	23,800,826.34	3.41
F	批发和零售业	28,214,186.96	4.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	47,852,060.40	6.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	78,150,569.16	11.20
K	房地产业	101,610,412.47	14.57
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,789,799.17	0.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	656,158,513.60	94.06

8.3 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

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	000550	江铃汽车	2,271,190	57,710,937.90	8.27
2	600754	锦江股份	2,987,020	47,852,060.40	6.86
3	600007	中国国贸	4,429,317	46,995,053.37	6.74
4	601588	北辰实业	15,700,242	42,233,650.98	6.05
5	601318	中国平安	894,346	37,321,058.58	5.35
6	002226	江南化工	2,601,996	36,870,283.32	5.29
7	600886	国投电力	8,285,796	32,563,178.28	4.67
8	002284	亚太股份	3,474,626	30,576,708.80	4.38
9	601166	兴业银行	2,845,597	28,854,353.58	4.14
10	000786	北新建材	1,407,308	24,627,890.00	3.53

注: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	002226	江南化工	37,824,891.73	5.86
2	600886	国投电力	34,652,701.16	5.37
3	600036	招商银行	34,338,173.99	5.32
4	601166	兴业银行	32,813,437.34	5.09
5	600754	锦江股份	32,334,708.22	5.01
6	601588	北辰实业	31,417,724.50	4.87
7	002284	亚太股份	29,670,983.93	4.60
8	002007	华兰生物	25,585,756.60	3.97
9	300196	长海股份	25,460,782.40	3.95
10	600000	浦发银行	17,664,166.22	2.74
11	600016	民生银行	16,987,990.13	2.63
12	002398	建研集团	16,732,496.06	2.59
13	600761	安徽合力	16,526,018.82	2.56
14	002431	棕榈园林	16,234,388.46	2.52
15	000860	顺鑫农业	16,046,087.73	2.49
16	002674	兴业科技	15,875,907.61	2.46
17	600697	欧亚集团	15,614,929.30	2.42
18	000893	东凌粮油	15,184,756.62	2.35
19	002496	辉丰股份	14,737,133.21	2.28
20	000786	北新建材	14,103,120.57	2.19
21	000069	华侨城A	14,054,828.36	2.18
22	601006	大秦铁路	13,877,500.00	2.15
23	000001	平安银行	13,322,980.34	2.06
24	000525	红 太 阳	13,308,156.29	2.06
25	300066	三川股份	13,042,102.37	2.02
26	002032	苏 泊 尔	12,909,416.19	2.00

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	300255	常山药业	48,809,537.23	7.56
2	600036	招商银行	45,600,542.14	7.07
3	600016	民生银行	40,690,770.18	6.31
4	600104	上汽集团	30,734,720.59	4.76
5	000001	平安银行	29,600,813.14	4.59
6	002393	力生制药	27,628,717.69	4.28
7	601601	中国太保	26,164,749.83	4.05
8	002327	富安娜	24,545,033.05	3.80
9	002570	贝因美	24,463,665.92	3.79
10	300178	腾邦国际	23,148,609.63	3.59
11	600000	浦发银行	22,467,360.19	3.48
12	600761	安徽合力	21,345,509.38	3.31
13	002674	兴业科技	19,168,554.40	2.97
14	600741	华域汽车	17,427,690.77	2.70
15	002521	齐峰新材	17,137,408.14	2.66
16	000893	东凌粮油	17,051,898.72	2.64
17	002431	棕榈园林	16,677,251.30