

新华钻石品质企业股票型证券投资基金

2012第一季度报告

2012年3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:二〇一二年四月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金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、完整性承担责任,否则承担法律责任。

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2012年4月23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,确认报告的内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金经理承诺:采用勤勉尽责的管理方式和运用基金资产,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2012年1月1日起至3月31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1日

报告期末基金总资产:720,709,852.37份

投资目标:本基金通过对于上市公司基本面的研究,结合宏观经济周期行业景气分析,在综合考虑风险、收益、流动性、稳定性的基础上,精选具有稳定收益性和高成长性的行业品种类的股票进行投资。

投资策略:本基金将采取自下而上的投资组合策略,通过宏观经济周期、行业特征等宏观方面的信息进行综合分析,调整大类资产配置比例和行业配置比例,在个股选择上,采用自下而上的研究方法,精选具有稳定性和成长性的行业品种类的股票进行投资。本基金将重点投资于具有稳定收益性和高成长性的上市公司,它们具有安全、透明、稳定、创新与领导气质五大优秀特质。

业绩比较基准:80%×沪深300指数+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,预期风险和收益水平均高于货币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(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -5,620,972.15

2.本期利润 2,210,366.16

3.加权平均基金份额本期利润 0.0031

4.期末基金份额净值 620,291,160.89

5.期末基金份额净值 0.861

注:1.本期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,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

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

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1月3日至2012年3月31日)

注:报告期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 证券从业年限 说明

曹名长 本基金基金经理,新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业股票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

2010-2-3 15 经济学硕士,历任君安证券有限公司研究员,君拓证券股份有限公司资产管理部投资经理,华泰联合证券有限公司投资经理,现担任新华基金管理有限公司基金经理,新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理,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守信情况的说明

本基金期间,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《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合同》及其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运用基金资产,在严格控制风险的基础上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 公平交易制度执行情况

根据《中国证监会颁布的<关于证券投资基金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,并且由交易系统自动执行交易,中央交易室根据各投资组合经理申报的满足公平交易的条件,严格控制不同投资组合在同日同一时间的买卖。

场外交易,对于部分债券一级市场申购,非公开发行股票申购,交易所大宗交易,债券回购等,由基金经理和交易部,再次执行审慎并确定最终分配结果,如果基金经理认为有必要,可以召开风险管理委员会,对公平交易的事项进行评估和审议,对公平交易的市场交易、固定收益交易、交易大宗交易、投资组合管理的公平性向风险管理委员会进行报告,中央交易室向银行间市场交易对手方或交易对手方,并根据《公平交易制度》的规定执行。

4.3.2 公平交易执行情况

本基金期间,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《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合同》及其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运用基金资产,在严格控制风险的基础上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。

4.4 报告期内基金的证券投资情况说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年1季度的股票仍保持仓位不变,配置比例相对前期未出现明显变化,但由于在有色、煤炭以及房地产等强周期行业表现较好,因此持有的股票表现相对大盘,本基金主要基于对长期因素的考虑,因此一直在长期业绩较为稳定的基金-食品饮料等行业进行配置。

对于市场的判断,我们认为现在是底部区域,而且很可能正处于长期趋势向好的转化过程中。判断的依据是估

4.4.2 报告期内基金的业绩表现说明

4.4.3 报告期内基金的净值表现

2012年1季度的股票仍保持仓位不变,配置比例相对前期未出现明显变化,但由于在有色、煤炭以及房地产等强周期行业表现较好,因此持有的股票表现相对大盘,本基金主要基于对长期因素的考虑,因此一直在长期业绩较为稳定的基金-食品饮料等行业进行配置。

本基金的净值表现相对大盘,2.以上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,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

4.5 基金的净值表现

4.5.1 报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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1月28日至2012年3月31日)

注:报告期本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期初基金份额总额 724,108,083.11

本报告期基金份额申购 43,736,071.18

本报告期基金份额赎回 47,134,301.92

本报告期基金份额变动 46,570,752.19

本报告期末基金份额总额 720,709,852.37

注:本基金的申购赎回费用率为0.80%。

6.1 报告期内基金的利润分配情况

6.1.1 本报告期本基金未进行利润分配。

6.2 报告期内基金的分红情况

6.2.1 本报告期本基金未进行分红。

6.2.2 本报告期本基金未进行分红。

6.2.3 本报告期本基金未进行分红。

6.2.4 本报告期本基金未进行分红。

6.2.5 本报告期本基金未进行分红。

6.2.6 本报告期本基金未进行分红。

6.2.7 本报告期本基金未进行分红。

6.2.8 本报告期本基金未进行分红。

6.2.9 本报告期本基金未进行分红。

6.2.10 本报告期本基金未进行分红。

6.2.11 本报告期本基金未进行分红。

6.2.12 本报告期本基金未进行分红。

6.2.13 本报告期本基金未进行分红。

6.2.14 本报告期本基金未进行分红。

6.2.15 本报告期本基金未进行分红。

6.2.16 本报告期本基金未进行分红。

6.2.17 本报告期本基金未进行分红。

6.2.18 本报告期本基金未进行分红。

6.2.19 本报告期本基金未进行分红。

6.2.20 本报告期本基金未进行分红。

6.2.21 本报告期本基金未进行分红。

6.2.22 本报告期本基金未进行分红。

6.2.23 本报告期本基金未进行分红。

6.2.24 本报告期本基金未进行分红。

6.2.25 本报告期本基金未进行分红。

6.2.26 本报告期本基金未进行分红。

6.2.27 本报告期本基金未进行分红。

6.2.28 本报告期本基金未进行分红。

6.2.29 本报告期本基金未进行分红。

6.2.30 本报告期本基金未进行分红。

6.2.31 本报告期本基金未进行分红。

6.2.32 本报告期本基金未进行分红。

6.2.33 本报告期本基金未进行分红。

6.2.34 本报告期本基金未进行分红。

6.2.35 本报告期本基金未进行分红。

6.2.36 本报告期本基金未进行分红。

6.2.37 本报告期本基金未进行分红。

6.2.38 本报告期本基金未进行分红。

6.2.39 本报告期本基金未进行分红。

6.2.40 本报告期本基金未进行分红。

6.2.41 本报告期本基金未进行分红。

6.2.42 本报告期本基金未进行分红。

6.2.43 本报告期本基金未进行分红。

6.2.44 本报告期本基金未进行分红。

6.2.45 本报告期本基金未进行分红。

6.2.46 本报告期本基金未进行分红。

6.2.47 本报告期本基金未进行分红。

6.2.48 本报告期本基金未进行分红。

6.2.49 本报告期本基金未进行分红。

6.2.50 本报告期本基金未进行分红。

6.2.51 本报告期本基金未进行分红。

6.2.52 本报告期本基金未进行分红。

6.2.53 本报告期本基金未进行分红。

6.2.54 本报告期本基金未进行分红。

6.2.55 本报告期本基金未进行分红。

6.2.56 本报告期本基金未进行分红。

6.2.57 本报告期本基金未进行分红。

6.2.58 本报告期本基金未进行分红。

6.2.59 本报告期本基金未进行分红。

6.2.60 本报告期本基金未进行分红。

6.2.61 本报告期本基金未进行分红。

6.2.62 本报告期本基金未进行分红。

6.2.63 本报告期本基金未进行分红。

6.2.64 本报告期本基金未进行分红。

6.2.65 本报告期本基金未进行分红。

6.2.66 本报告期本基金未进行分红。