

新世纪优选分红混合型证券投资基金

2007 年半年度报告

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

送出日期：2007 年 8 月 24 日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于 2007 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中的财务资料未经审计,本报告期是 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日。

目 录

一、基金简介	4
二、主要财务指标和基金净值表现.....	5
三、管理人报告	7
四、托管人报告	9
五、财务会计报告	10
六、基金投资组合报告	20
七、基金份额持有人户数、持有人结构.....	32
八、基金份额变动	32
九、重大事项揭示	32
十、备查文件目录	38

一、基金简介

(一) 基金名称：新世纪优选分红混合型证券投资基金

基金简称：世纪分红

交易代码：前端 519087，后端 519088

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：1,305,703,423.24 份

基金合同存续期：不定期

(二) 基金投资目标：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。

投资策略：采用战术型资产配置策略；寻找品质优异的高成长型上市公司及分红能力强的价值型上市公司，并辅助以国际竞争力比较，寻找具有市场估值合理的股票，确定最终的投资组合。

业绩比较基准：60%*中信标普 300 指数+40%*中信全债指数

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。

(三) 基金管理人

法定名称：新世纪基金管理有限公司

注册及办公地址：重庆市渝中区邹容路 68 号大都会商厦 32 楼

邮政编码：400010

法定代表人：蒋钢

信息披露负责人：齐岩

联系电话：010-88423386

传真：010-88423310

电子邮箱：qiyang@ncfund.com.cn

(四) 基金托管人

法定名称：中国农业银行

注册及办公地址：北京复兴路甲 23 号

法定代表人：项俊波

信息披露负责人：李芳菲

联系电话：010-68424199

传真：010-68424181

电子邮箱：lifangfei@abchina.com

（五）基金选定的信息披露报纸：中国证券报、上海证券报、证券时报

登载本期报告正文的管理人网址：

<http://www.ncfund.com.cn>

基金本期报告置备地点：基金管理人、基金托管人的办公地

（六）聘请的会计师事务所：重庆天健会计师事务所

办公地址：重庆市渝中区人和街 74 号 11-12 楼 邮编：400015

（七）注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

办公地址：中国北京市西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

邮编：100032

二、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日
1. 基金本期净收益	477,233,792.83
2. 基金份额本期净收益	0.5600
3. 期末可供分配基金收益	332,930,655.36
4. 期末可供分配基金份额收益	0.2550
5. 期末基金资产净值	1,687,134,129.83
6. 期末基金份额净值	1.2921
7. 基金加权平均净值收益率	46.63%
8. 本期基金份额净值增长率	61.01%
9. 基金份额累计净值增长率	237.97%

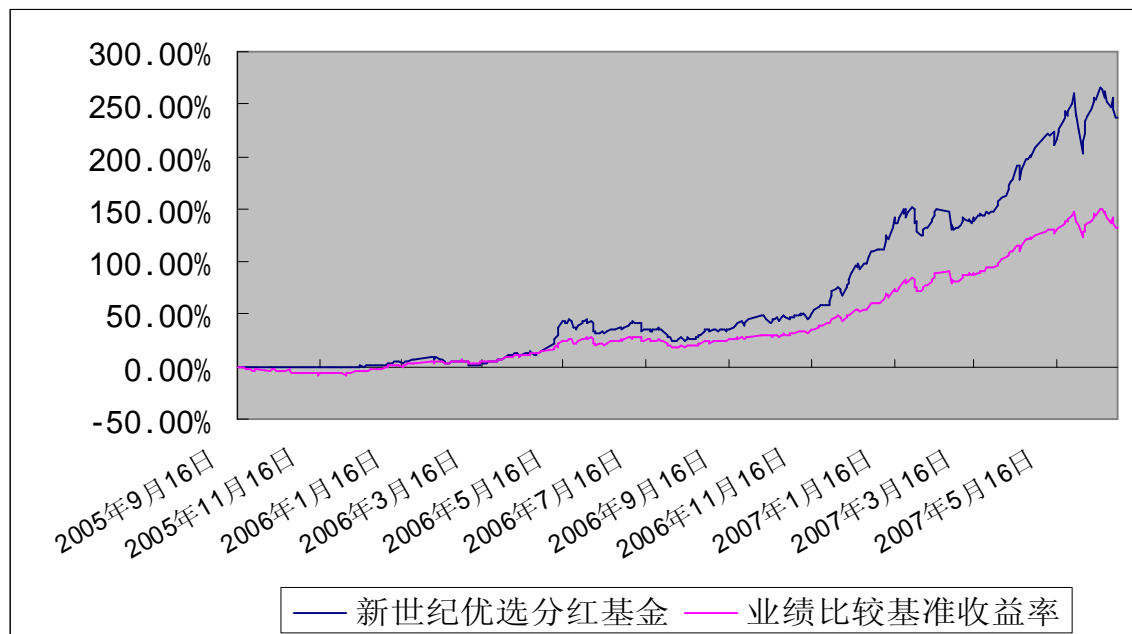
说明：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 基金净值表现

1、净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

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 1 月	-0.91%	2.79%	-2.74%	1.85%	1.83%	0.94%
过去 3 月	36.57%	2.32%	19.62%	1.53%	16.95%	0.79%
过去 6 月	61.01%	2.20%	45.41%	1.51%	15.60%	0.69%
过去 1 年	144.86%	1.86%	83.17%	1.21%	61.69%	0.65%
自基金成立起至今	237.97%	1.60%	132.34%	1.04%	105.63%	0.56%

2、基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较图



业绩比较基准：60%*中信标普 300 指数+40%*中信全债指数

三、管理人报告

一、基金管理人及基金经理简介

1、基金管理人简介

新世纪基金管理有限公司是经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004]197 号文批准设立，于 2004 年 12 月 9 日注册成立，并于 2004 年 12 月 13 日取得中国证券监督管理委员会核发的《基金管理公司法人许可证》。

公司注册资本为 1 亿元人民币，其中主发起人新华信托投资股份有限公司出资 4800 万元人民币，占注册资本 48%，山东海化集团有限公司出资 3000 万元人民币，占注册资本 30%，深圳市泰丰通讯电子有限公司出资 2200 万元人民币，占注册资本 22%。

本基金是基金管理人管理的第一只基金。

2、基金经理简介

曹名长先生：经济学硕士，10 年证券从业经验，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、新世纪基金管理有限公司策略分析师。现任“新世纪优选分红混合型证券投资基金”基金经理。

向朝勇先生，管理学博士，10 年证券从业经验，先后供职于宝钢集团公司；平安证券资产管理事业部及投资管理部；东吴证券投资总部；东吴基金管理公司投资管理部，并于 2005 年 2 月 1 日至 2006 年 7 月 20 日期间担任东吴嘉禾优势精选基金的基金经理；现供职于新世纪基金管理有限公司，任总经理助理兼投资管理部总监。2007 年 6 月 19 日，经新世纪基金管理有限公司临时董事会会议决议增聘为“新世纪优选分红混合型证券投资基金”基金经理。

二、基金运作的合规守信说明

本报告期，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新世纪优选分红混合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。

三、本报告期内的业绩表现和投资策略的说明与解释

（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 2007 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2921 元，本报告期份额净值增长率为 61.01%，同期比较基准的增长率为 45.41%。

2、投资策略和运作分析

2007 年上半年是不同寻常的半年。一季度，A 股市场投机气氛显现，基于价值投资的方式和理念遭遇挑战，部分绩差低价股在资产重组、业绩虚增故事等题材的光环下涨幅惊人，股价表现大幅超越大盘，蓝筹股则由于遭遇估值天花板而转入休整状态；而进入二季度，题材绩差股由疯狂转入大幅波动，从而加大了市场的波动，而蓝筹绩优股相对稳定，成为稳定市场的中坚力量。

上半年 A 股市场如此特点给基金的操作带来了一定困难，但作为理性的长期价值投资者，我们没有也不会因为市场的这种短期特征而改变一贯的投资风格和理念，因此，上半年的操作我们依然选择成长和价值作为投资主线，但适当增加了灵活性。整个上半年取得了较好的业绩，基金半年度收益大幅超越比较基准，半年每单位份额基金累计分红 **0.887** 元，远远超过银行 1 年期法定存款利率。

（二）未来展望及操作策略

由于当前经济开始由过快转向过热，因此未来宏观经济必将伴随经常性的紧缩政策，这无疑会加大市场的短期波动幅度。加息等货币政策会抑制固定投资增长；调整出口退税对部分上市公司业绩将产生负面影响；扩大 QDII 分流国内资金，会降低 A 股的吸引力，增加估值压力；建行和中石油回归 A 股带来近千亿扩容，以及不断增加的大小非减持；新股民入市意愿减弱，使市场短期面临资金压力。

但另一方面，中国经济的长期强劲增长，却不会因为短期调控和外部力量冲击而改变。上市公司盈利能力不断提高，人民币持续小幅升值，流动性保持充裕，居民对股票基金等金融资产的需求呈爆发性上升，因此构成中国 A 股牛市的坚实基础不可动摇，宏观调控不会改变市场长期上涨趋势。

由此我们判断，下半年市场可能出现结构性趋势，总体上市场将处于反复波

动并缓慢向上突破的态势，结构性风险与机会并存。

投资策略方面，我们仍将坚守“价值+成长”的投资理念，着眼于中国 A 股牛市的长期远景，淡化短期利空与调整波折；在战术上采取防御与进攻相结合的原则，增加稳定增长性行业配置，谨慎对待周期性股票，坚持持有具有竞争优势和高成长性，能穿越短期市场波动并能带来长期超额收益的绩优蓝筹股。

下半年继续看好房地产、金融、消费品和消费服务、机械设备、汽车、钢铁、资源品（煤炭、有色金属）和具有资源属性的机场、港口等行业，超配房地产、银行、保险、证券、高端白酒、零售、造船、机床、汽车、钢铁、石化、煤炭、机场、港口等子行业，有色金属中的稀有品种和化工建材中的优势公司。

四、托管人报告

在托管新世纪优选分红证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《新世纪优选分红证券投资基金基金合同》、《新世纪优选分红证券投资基金托管协议》的约定，对新世纪优选分红证券投资基金管理人-新世纪基金管理有限公司 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为，新世纪基金管理有限公司在新世纪优选分红证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人认为，新世纪基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的新世纪优选分红证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配

情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行托管业务部

二 00 七年八月二十三日

五、财务会计报告

（一）基金会计报表

1、资产负债表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		182,569,555.84	11,825,867.99
清算备付金		26,001,608.05	1,579,233.64
交易保证金		1,387,967.51	550,000.00
应收证券清算款		5,566,016.45	0.00
应收股利		350,784.00	0.00
应收利息	6(1)	355,254.69	18,508.19
应收申购款		2,244,466.35	590,666.53
股票投资市值	6(2)	1,437,951,595.81	121,058,812.70
其中：股票投资成本		1,442,950,569.11	83,340,816.61
债券投资市值		66,177,290.64	5,864,055.30
其中：债券投资成本		70,647,195.83	3,997,131.85
权证投资		0.00	0.00
其中：权证投资成本		0.00	0.00
待摊费用	6(3)	49,316.50	74,246.82

资产合计		1,722,653,855.84	141,561,391.17
负债：			
应付证券清算款		3,158,507.04	3,015,221.65
应付赎回款		20,501,020.04	2,338,275.97
应付赎回费		78,267.73	8,112.88
应付管理人报酬		2,234,093.80	161,258.49
应付托管费		372,348.96	26,876.42
应付佣金	6(4)	8,547,975.98	509,479.37
应付利息			0.00
其他应付款	6(5)	528,159.51	278,540.42
卖出回购证券款			0.00
预提费用	6(6)	99,352.55	131,506.36
负债合计		35,519,726.01	6,469,271.56
持有人权益：			
实收基金	6(7)	1,305,703,423.24	83,897,488.99
未实现利得	6(8)	48,500,051.23	26,943,070.02
未分配收益		332,930,655.36	24,251,560.60
持有人权益合计		1,687,134,129.83	135,092,119.61
负债及持有人权益总计		1,722,653,855.84	141,561,391.17

(所附注释系会计报表的组成部分)

2、经营业绩表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日 -2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日 -2006 年 6 月 30 日
一、收入			
股票差价收入(损失)	6(9)	471,302,742.59	39,000,305.67
债券差价收入(损失)	6(10)	7,302,534.52	(48,305.94)
债券利息收入		132,360.51	72,242.00

存款利息收入		595,260.89	182,674.97
权证差价收入		0.00	774,514.67
股利收入		4,753,578.34	561,207.97
买入返售证券收入		0.00	0.00
其他收入	6(11)	1,915,351.98	536,182.43
收入合计		486,001,828.83	41,078,821.77
二、费用			
基金管理人报酬		7,360,670.56	1,349,095.45
基金托管费		1,226,778.45	224,849.24
卖出回购证券支出		0.00	0.00
其他费用	6(12)	180,586.99	190,187.92
其中:上市年费			0.00
信息披露费		148,765.71	147,554.82
审计费用		24,010.80	29,415.37
汇划手续费		2,710.48	4,217.73
其它		0.00	9,000.00
费用合计		8,768,036.00	1,764,132.61
三、基金净收益		477,233,792.83	39,314,689.16
加:未实现利得		-49,053,798.03	5,722,016.73
四、基金经营业绩		428,179,994.80	45,036,705.89

3、基金收益分配表

单位: 人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日 -2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日 -2006 年 6 月 30 日
本期基金净收益		477,233,792.83	39,314,689.16
加:期初基金净收益		24,251,560.60	1,563,286.93
加:本期损益平准金		51,368,583.77	-2,001,684.50

可供分配基金净收益		552,853,937.20	38,876,291.59
减：本期已分配基金净收益	6 (13)	219,923,281.84	36,782,675.19
期末基金净收益		332,930,655.36	2,093,616.40

4、基金净值变动表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日 -2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日 -2006 年 6 月 30 日
年初基金净值		135,092,119.61	446,507,624.14
本期经营活动			
基金净收益		477,233,792.83	39,314,689.16
未实现估值增值/（减值）变动数		-49,053,798.03	5,722,016.73
经营活动产生的基金净值变动数		428,179,994.80	45,036,705.89
本期基金份额交易			
基金申购款		2,627,178,515.76	104,158,717.09
基金赎回款		1,283,393,218.50	-428,946,311.66
基金份额交易产生的基金净值变动数		1,343,785,297.26	-324,787,594.57
本期向基金份额持有人分配收益			
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数		-219,923,281.84	-36,782,675.19
期末基金净值		1,687,134,129.83	129,974,060.27

(所附注释系会计报表组成部分)

(二) 会计报表附注

附注 1. 会计政策

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

附注 2. 本报告期重大会计差错:无

附注 3. 主要税项

(1) 印花税

2007 年 5 月 30 日前根据财政部、国家税务总局财税[2005]11 号文《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，本基金管理人运用基金买卖股票按照 1‰的税率征收印花税。

2007 年 5 月 30 日后财政部决定从 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由现行 1‰调整为 3‰。即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据，由立据双方当事人分别按 3‰的税率缴纳证券（股票）交易印花税。

（2）营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围，不征收营业税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入和债券的利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

附注 4. 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

附注 5. 关联方关系及关联方交易

（1）关联方关系：本报告期关联方关系未发生变化

关联方名称	与本基金的关系
中国农业银行	基金托管人
新世纪基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
新华信托投资股份有限公司	基金管理人股东
山东海化集团有限公司	基金管理人股东
深圳市泰丰通讯电子有限公司	基金管理人股东

中国证券登记结算有限责任公司	注册登记机构
----------------	--------

(2)关联方交易

A、基金管理人报酬

支付基金管理人新世纪基金管理有限公司的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提,逐日计提,按月支付,日管理费=前一日基金资产净值 \times 1.5% \div 当年天数。截止至 2007 年 6 月 30 日,本基金 2007 年上半年共需支付基金管理人报酬人民币 7,360,670.56 元(上年同期: 1,349,095.45 元,已全部支付)。其中已支付人民币 5,126,576.76 元,尚余人民币 2,234,093.80 元未支付。

B、基金托管人报酬

支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提,逐日计提,按月支付,日托管费=前一日基金资产净值 \times 0.25% \div 当年天数。截止至 2007 年 6 月 30 日,本基金 2007 年上半年共需支付基金托管人报酬人民币 1,226,778.45 元(上年同期: 224,849.24 元,已全部支付)。其中已支付人民币 854,429.49 元,尚余人民币 372,348.96 元未支付。

C、关联方持有本基金情况

新世纪基金管理有限公司期末持有本基金 20,027,000 份(上年同期: 20,027,000 份),占基金总份额 1.53%(上年同期: 16.31%),系后端收费,费率为:后端 1 年(含 1 年)以内,按认购金额 1.2%收取;后端持有期 1 年(不含 1 年)至 3 年以内(含 3 年),按认购金额 0.8%收取;后端持有期 3 年(不含 3 年)至 5 年以内(含 5 年),按认购金额 0.4%收取;后端持有期 5 年以上不再收取认购费;本报告期基金份额无变动。

D、关联方保管的银行存款余额及当期产生利息收入

1、本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 182,569,555.84 元(上年同期: 23,843,553.02 元)。本会计年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 520,459.99 元(上年同期: 163,929.12 元)。

2、本基金2007年6月30日在中国证券登记结算有限责任公司的清算备付金余额为26,001,608.05元(上年同期: 783,227.89元),交易保证金余额为300,000.00

元（上年同期：300,000.00）。本报告期由注册登记结构保管的备付金及保证金产生的利息收入为74,800.90元（上年同期：18,745.85元）。

附注 6. 会计报表重要项目说明

单位：人民币元

(1) 应收利息

项 目	2007 年 6 月 30 日
应收银行存款利息	32,580.71
应收清算备付金利息	10,652.22
应收可转债利息	312,021.76
合 计	355,254.69

(2) 投资估值增值

项 目	2007 年 6 月 30 日
股票投资估值增值	-4,998,973.30
债券投资估值增值	-4,469,905.19
合 计	-9,468,878.49

(3) 待摊费用

项 目	2007 年 6 月 30 日
中国证券报信息披露费	24,658.25
上海证券报信息披露费	24,658.25
合 计	49,316.50

(4) 应付佣金

项 目	2007 年 6 月 30 日
新时代证券有限责任公司	3,361,869.11
国泰证券股份有限公司	1,352,150.16
东方证券股份有限公司	3,010,726.73

恒泰证券有限责任公司	823,229.98
合 计	8,547,975.98

(5) 其他应付款

项 目	2007 年 6 月 30 日
应付后端申购费	272,759.51
应付券商保证金	250,000.00
应付代扣代缴税金	5,400.00
合 计	528,159.51

(6) 预提费用

项 目	2007 年 6 月 30 日
审计费	24,010.80
证券时报信息披露费	75,341.75
合 计	99,352.55

(7) 实收基金

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
期初数	83,897,488.99
本期申购数	2,280,193,294.25
本期赎回数	1,058,387,360.00
期末数	1,305,703,423.24

(8) 未实现利得

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
期初数	26,943,070.02
加: 未实现估值增值/(减值)变动数	-49,053,798.03
加: 本期申购基金份额的未实现利得平准金	183,371,088.37
减: 本期赎回基金份额的未实现利得平准金	112,760,309.13

期末数	48,500,051.23
-----	---------------

(9) 股票差价收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
卖出股票成交金额(1)	6,083,732,132.12
卖出股票成本总额(2)	5,607,314,614.29
应付佣金(3)	5,114,775.24
股票差价收入(1)－(2)－(3)	471,302,742.59

(10) 债券差价收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
卖出债券成交金额(1)	77,338,834.22
卖出债券成本总额(2)	69,867,569.06
应收利息(3)	168,730.64
债券差价收入(1)－(2)－(3)	7,302,534.52

(11) 其他收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
赎回费收入	1,599,586.44
其它	315,765.54
合计	1,915,351.98

(12) 其他费用

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
信息披露费	148,765.71
审计费用	24,010.80
债券帐户维护费	4,500.00
汇划手续费	2,710.48
其它	600.00

合计	180,586.99
----	------------

(13) 基金收益分配情况

日期	分红金额
2007 年 1 月 09 日	35,253,893.98
2007 年 1 月 16 日	10,993,695.57
2007 年 2 月 05 日	35,071,934.07
2007 年 2 月 13 日	17,543,364.79
2007 年 4 月 24 日	55,815,090.59
2007 年 5 月 11 日	65,245,302.84
累计分配金额	219,923,281.84

附注 7. 报告期末流通转让受到限制的基金资产

股票名称	数量 (股)	总成本(元)	总市值 (元)	估值 方法	转让受限 原因	受限期限
扬农化工	200,000	4,269,787.91	4,120,000.00	收盘价	开股东 大会	2007 年 7 月 2 日 复盘

除上述股票外，截止 2007 年 6 月 30 日，本基金无流通受限、不能自由转让的股票、债券、配股等资产。

附注 8. 资产负债表日后事项的非调整事项

除上述事项外，截止 2007 年 8 月 20 日，本基金没有其他需要披露的重大资产负债表日后事项中的非调整事项。

六、基金投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

项目名称	金额（人民币元）	占基金资产总值比例
股票投资	1,437,951,595.81	83.47%
债券投资	66,177,290.64	3.84%
权证投资	0.00	0.00
银行存款和清算备付金	208,571,163.89	12.11%
其它资产	9,953,805.50	0.58%
合计	1,722,653,855.84	100%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	数量（股）	市值（人民币元）	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	792,381	41,214,135.74	2.44%
B 采掘业		0.00	0.00%
C 制造业	21,788,361	735,674,018.01	43.60%
C0 食品、饮料	4,978,120	225,202,014.32	13.35%
C1 纺织、服装、皮毛	198,600	7,981,734.00	0.47%
C2 木材、家具		0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	150,000	3,901,500.00	0.23%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	4,409,463	153,878,327.80	9.12%
C5 电子	1,162,600	17,594,696.00	1.04%
C6 金属、非金属	5,972,324	156,012,680.94	9.25%
C7 机械、设备、仪表	4,525,274	158,374,144.95	9.39%
C8 医药、生物制品	192,000	8,329,360.00	0.49%
C99 其他制造业	199,980	4,399,560.00	0.26%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		0.00	0.00%
E 建筑业		0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业		0.00	0.00%
G 信息技术业	2,512,656	63,147,036.71	3.74%
H 批发和零售贸易	1,592,207	81,284,577.85	4.82%
I 金融、保险业	10,099,920	314,588,879.20	18.65%

J 房地产业	5,516,705	124,606,645.10	7.39%
K 社会服务业	1,069,679	42,573,224.20	2.52%
L 传播与文化产业		0.00	0.00%
M 综合类	345,179	34,863,079.00	2.07%
合计	43,717,088	1,437,951,595.81	85.23%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	期末市值 (人民币元)	占基金资产 净值比
1	600519	贵州茅台	828,206	99,119,694.08	5.88%
2	600036	招商银行	3,500,000	86,030,000.00	5.10%
3	000002	万科A	4,250,000	81,260,000.00	4.82%
4	601318	中国平安	1,099,920	78,655,279.20	4.66%
5	600031	三一重工	1,549,912	68,552,607.76	4.06%
6	000792	盐湖钾肥	1,384,936	61,463,459.68	3.64%
7	600585	海螺水泥	950,000	56,012,000.00	3.32%
8	601628	中国人寿	1,330,000	54,676,300.00	3.24%
9	600660	福耀玻璃	1,763,792	53,830,931.84	3.19%
10	002024	苏宁电器	1,145,700	53,802,072.00	3.19%
11	600383	金地集团	1,266,705	43,346,645.10	2.57%
12	000069	华侨城A	1,069,679	42,573,224.20	2.52%
13	600887	伊利股份	1,299,914	40,505,320.24	2.40%
14	000858	五粮液	1,250,000	39,325,000.00	2.33%
15	002069	獐子岛	499,999	37,959,924.08	2.25%
16	600415	小商品城	345,179	34,863,079.00	2.07%
17	600529	山东药玻	2,691,550	33,994,276.50	2.01%
18	600809	山西汾酒	1,000,000	33,580,000.00	1.99%
19	600096	云天化	1,363,000	33,379,870.00	1.98%
20	000063	中兴通讯	580,089	31,556,841.60	1.87%
21	002028	思源电气	471,969	29,677,410.72	1.76%
22	600016	民生银行	2,500,000	28,575,000.00	1.69%
23	600761	安徽合力	1,000,000	28,500,000.00	1.69%
24	600312	平高电气	1,218,393	27,767,176.47	1.65%
25	600694	大商股份	446,507	27,482,505.85	1.63%
26	600309	烟台万华	499,919	26,775,661.64	1.59%
27	600143	金发科技	620,896	23,929,331.84	1.42%
28	601166	兴业银行	670,000	23,510,300.00	1.39%
29	600000	浦发银行	600,000	21,954,000.00	1.30%
30	600030	中信证券	400,000	21,188,000.00	1.26%
31	600271	航天信息	382,567	16,959,195.11	1.01%
32	600195	中牧股份	600,000	12,672,000.00	0.75%

33	600439	瑞贝卡	198,600	7,981,734.00	0.47%
34	600050	中国联通	1,300,000	7,631,000.00	0.45%
35	000839	中信国安	250,000	7,000,000.00	0.41%
36	600563	法拉电子	237,600	4,445,496.00	0.26%
37	002003	伟星股份	199,980	4,399,560.00	0.26%
38	600276	恒瑞医药	94,000	4,252,560.00	0.25%
39	002076	雪 莱 特	230,000	4,188,300.00	0.25%
40	000401	冀东水泥	300,000	4,128,000.00	0.24%
41	600486	扬农化工	200,000	4,120,000.00	0.24%
42	002007	华兰生物	98,000	4,076,800.00	0.24%
43	002084	海鸥卫浴	130,000	4,033,900.00	0.24%
44	000060	中金岭南	136,982	4,013,572.60	0.24%
45	002078	太阳纸业	150,000	3,901,500.00	0.23%
46	600584	长电科技	330,000	3,864,300.00	0.23%
47	600183	生益科技	275,000	3,374,250.00	0.20%
48	600438	通威股份	292,382	3,254,211.66	0.19%
49	000698	沈阳化工	280,000	3,158,400.00	0.19%
50	002045	广州国光	265,000	3,084,600.00	0.18%
51	600360	华微电子	100,000	2,012,000.00	0.12%
52	600740	山西焦化	50,000	872,500.00	0.05%
53	600685	广船国际	10,000	502,700.00	0.03%
54	000731	四川美丰	10,712	179,104.64	0.01%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、本报告期内累计买入金额及累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

单位：人民币元

累计买入金额超出期初基金资产净值 2%股票明细				
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额 (人民币元)	占期初基金资产 净值比
1	000002	万 科 A	262,601,064.89	194.39%
2	600016	民生银行	260,536,300.51	192.86%
3	600036	招商银行	258,846,598.02	191.61%
4	600519	贵州茅台	193,286,857.69	143.08%
5	600030	中信证券	181,018,911.02	134.00%
6	600000	浦发银行	150,038,065.69	111.06%
7	002024	苏宁电器	149,634,255.59	110.76%
8	600015	华夏银行	147,338,687.57	109.07%
9	600585	海螺水泥	127,459,331.09	94.35%
10	600031	三一重工	127,177,527.73	94.14%
11	600808	马钢股份	118,449,621.66	87.68%

12	600739	辽宁成大	109,896,473.29	81.35%
13	600143	金发科技	107,006,971.56	79.21%
14	000858	五 粮 液	106,361,493.52	78.73%
15	601628	中国人寿	99,192,984.82	73.43%
16	600005	武钢股份	94,357,376.03	69.85%
17	600383	金地集团	87,631,566.68	64.87%
18	601318	中国平安	85,825,029.13	63.53%
19	000629	攀钢钢钒	76,863,714.61	56.90%
20	600009	上海机场	75,842,913.42	56.14%
21	600649	原水股份	75,189,726.80	55.66%
22	600309	烟台万华	75,017,662.08	55.53%
23	600008	首创股份	70,761,519.70	52.38%
24	600177	雅戈尔	67,044,810.52	49.63%
25	600660	福耀玻璃	66,844,739.35	49.48%
26	600196	复星医药	66,459,974.12	49.20%
27	000792	盐湖钾肥	65,269,686.13	48.31%
28	000069	华侨城 A	62,885,300.54	46.55%
29	000623	吉林敖东	61,496,369.77	45.52%
30	600269	赣粤高速	61,267,475.04	45.35%
31	600331	宏达股份	59,855,890.25	44.31%
32	600415	小商品城	59,086,178.12	43.74%
33	600895	张江高科	58,199,226.75	43.08%
34	000537	广宇发展	56,396,718.37	41.75%
35	600408	安泰集团	54,285,815.66	40.18%
36	600740	山西焦化	53,015,304.64	39.24%
37	600887	伊利股份	52,911,106.33	39.17%
38	600685	广船国际	52,570,385.33	38.91%
39	000063	中兴通讯	52,544,117.80	38.90%
40	600072	江南重工	50,757,763.39	37.57%
41	600050	中国联通	50,082,184.61	37.07%
42	600694	大商股份	49,934,463.25	36.96%
43	600809	山西汾酒	48,665,186.67	36.02%
44	000839	中信国安	48,639,970.48	36.01%
45	600675	中华企业	46,038,327.43	34.08%
46	600531	豫光金铅	45,974,612.29	34.03%
47	600704	中大股份	45,709,114.95	33.84%
48	002069	獐 子 岛	45,656,437.68	33.80%
49	600123	兰花科创	44,501,103.47	32.94%
50	600717	天津港	44,260,678.80	32.76%
51	000060	中金岭南	44,133,627.58	32.67%
52	000919	金陵药业	44,021,423.30	32.59%
53	600028	中国石化	43,789,017.03	32.41%
54	600428	中远航运	43,475,645.55	32.18%

55	600863	内蒙华电	41,884,946.19	31.00%
56	600529	山东药玻	41,210,162.38	30.51%
57	600884	杉杉股份	40,864,023.80	30.25%
58	000001	深发展 A	40,072,420.21	29.66%
59	600963	岳阳纸业	39,983,350.53	29.60%
60	000898	鞍钢股份	38,727,173.05	28.67%
61	600096	云天化	38,057,647.70	28.17%
62	000876	新希望	37,404,287.50	27.69%
63	600642	申能股份	36,846,454.76	27.28%
64	000878	云南铜业	36,531,897.25	27.04%
65	000698	沈阳化工	35,873,383.18	26.55%
66	600312	平高电气	34,508,424.48	25.54%
67	000401	冀东水泥	34,478,534.62	25.52%
68	002041	登海种业	33,265,746.65	24.62%
69	000927	一汽夏利	33,145,483.13	24.54%
70	600518	康美药业	33,040,798.92	24.46%
71	600067	冠城大通	32,949,807.08	24.39%
72	600352	浙江龙盛	32,758,625.95	24.25%
73	600688	S 上石化	32,551,917.61	24.10%
74	600761	安徽合力	32,133,810.91	23.79%
75	600362	江西铜业	32,108,436.61	23.77%
76	600271	航天信息	31,869,352.27	23.59%
77	600001	邯郸钢铁	31,778,081.99	23.52%
78	600107	美尔雅	31,670,001.06	23.44%
79	600219	南山铝业	31,188,508.89	23.09%
80	600348	国阳新能	31,015,643.41	22.96%
81	000731	四川美丰	30,631,836.08	22.67%
82	600900	长江电力	30,617,496.27	22.66%
83	000869	张裕 A	30,327,173.86	22.45%
84	002028	思源电气	30,245,915.69	22.39%
85	000562	宏源证券	29,595,080.18	21.91%
86	601166	兴业银行	28,823,699.93	21.34%
87	600795	国电电力	28,702,059.73	21.25%
88	000568	泸州老窖	28,482,887.41	21.08%
89	000758	中色股份	27,756,514.51	20.55%
90	000829	天音控股	27,446,560.34	20.32%
91	600019	宝钢股份	27,143,860.35	20.09%
92	000510	金路集团	27,072,454.23	20.04%
93	000031	中粮地产	27,040,000.62	20.02%
94	000748	长城信息	26,897,852.10	19.91%
95	600755	厦门国贸	26,858,599.43	19.88%
96	000522	白云山 A	26,132,080.36	19.34%
97	000598	蓝星清洗	24,964,857.39	18.48%

98	600598	北大荒	24,078,492.42	17.82%
99	600236	桂冠电力	23,256,953.94	17.22%
100	600104	上海汽车	23,009,401.92	17.03%
101	000960	锡业股份	22,440,840.50	16.61%
102	600004	白云机场	21,662,421.98	16.04%
103	600488	天药股份	21,547,642.24	15.95%
104	600832	东方明珠	21,391,121.73	15.83%
105	600677	航天通信	20,772,230.18	15.38%
106	000009	S 深宝安 A	20,733,877.57	15.35%
107	600960	滨州活塞	19,793,134.27	14.65%
108	600978	宜华木业	19,434,409.57	14.39%
109	000428	华天酒店	19,197,384.96	14.21%
110	600390	金瑞科技	18,928,884.58	14.01%
111	600166	福田汽车	18,706,857.60	13.85%
112	000983	西山煤电	17,410,344.43	12.89%
113	000006	深振业 A	17,385,125.79	12.87%
114	000024	招商地产	17,175,592.24	12.71%
115	600087	南京水运	16,945,519.23	12.54%
116	000951	中国重汽	16,918,359.48	12.52%
117	000680	山推股份	16,810,478.02	12.44%
118	600161	天坛生物	16,681,842.42	12.35%
119	600176	中国玻纤	16,279,049.03	12.05%
120	000625	长安汽车	16,024,492.03	11.86%
121	600357	承德钒钛	15,660,318.33	11.59%
122	600583	海油工程	15,635,745.13	11.57%
123	600109	成都建投	14,854,362.91	11.00%
124	601398	工商银行	14,417,124.16	10.67%
125	000539	粤电力 A	14,044,443.10	10.40%
126	600663	陆家嘴	13,790,088.75	10.21%
127	600621	上海金陵	13,737,920.02	10.17%
128	000900	现代投资	13,355,061.26	9.89%
129	600859	王府井	12,977,039.04	9.61%
130	600195	中牧股份	12,245,932.37	9.06%
131	600115	东方航空	11,670,868.75	8.64%
132	600210	紫江企业	10,947,709.55	8.10%
133	000157	中联重科	10,414,950.96	7.71%
134	600563	法拉电子	9,856,619.35	7.30%
135	000612	焦作万方	9,745,249.46	7.21%
136	600066	宇通客车	9,655,276.40	7.15%
137	600867	通化东宝	9,431,222.68	6.98%
138	600497	驰宏锌锗	9,184,868.21	6.80%
139	000976	春晖股份	8,997,904.97	6.66%
140	600037	歌华有线	8,949,019.66	6.62%

141	600439	瑞贝卡	8,493,717.64	6.29%
142	600500	中化国际	8,492,194.89	6.29%
143	600874	创业环保	8,010,664.04	5.93%
144	000959	首钢股份	7,947,777.06	5.88%
145	000933	神火股份	7,571,870.64	5.60%
146	600217	*ST 秦岭	7,239,699.49	5.36%
147	000755	山西三维	7,009,075.17	5.19%
148	600432	吉恩镍业	6,531,085.94	4.83%
149	600470	六国化工	6,369,407.41	4.71%
150	601111	中国国航	6,321,593.70	4.68%
151	600064	南京高科	5,855,452.75	4.33%
152	600100	同方股份	5,716,394.63	4.23%
153	600594	益佰制药	5,654,594.91	4.19%
154	600230	沧州大化	5,433,573.24	4.02%
155	600600	青岛啤酒	5,354,272.13	3.96%
156	002071	江苏宏宝	5,209,375.57	3.86%
157	600547	山东黄金	5,206,663.96	3.85%
158	600299	星新材料	5,067,607.93	3.75%
159	600549	厦门钨业	5,009,632.06	3.71%
160	002003	伟星股份	4,892,325.65	3.62%
161	600360	华微电子	4,811,583.28	3.56%
162	002076	雪 莱 特	4,685,603.17	3.47%
163	002098	浔兴股份	4,385,399.96	3.25%
164	600486	扬农化工	4,269,787.91	3.16%
165	600276	恒瑞医药	4,240,898.64	3.14%
166	002084	海鸥卫浴	4,230,460.60	3.13%
167	002078	太阳纸业	4,208,033.30	3.11%
168	600416	湘电股份	4,110,056.09	3.04%
169	600546	中油化建	4,108,400.00	3.04%
170	600584	长电科技	4,042,270.96	2.99%
171	002007	华兰生物	3,874,160.44	2.87%
172	600085	同仁堂	3,870,333.55	2.86%
173	600438	通威股份	3,842,326.53	2.84%
174	600183	生益科技	3,635,825.34	2.69%
175	002045	广州国光	3,579,112.65	2.65%
176	600033	福建高速	2,710,002.05	2.01%

累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细				
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额 (人民币元)	占期初基金资产 净值比(%)
1	600016	民生银行	235,384,718.93	174.24%
2	000002	万 科 A	233,299,015.07	172.70%

3	600036	招商银行	218,578,342.54	161.80%
4	600030	中信证券	170,308,657.44	126.07%
5	600015	华夏银行	157,752,581.89	116.77%
6	600000	浦发银行	149,400,314.09	110.59%
7	002024	苏宁电器	119,361,892.65	88.36%
8	600808	马钢股份	117,339,771.17	86.86%
9	600739	辽宁成大	108,212,748.08	80.10%
10	600005	武钢股份	100,099,537.37	74.10%
11	600031	三一重工	95,855,403.45	70.96%
12	600143	金发科技	94,873,895.63	70.23%
13	000629	攀钢钢钒	93,237,260.26	69.02%
14	600519	贵州茅台	91,850,544.43	67.99%
15	600585	海螺水泥	90,586,334.86	67.06%
16	600009	上海机场	84,253,641.57	62.37%
17	000623	吉林敖东	81,257,031.35	60.15%
18	000858	五 粮 液	81,150,440.09	60.07%
19	600649	原水股份	79,231,444.93	58.65%
20	600008	首创股份	78,053,167.53	57.78%
21	600177	雅戈尔	76,969,668.15	56.98%
22	600331	宏达股份	75,214,382.84	55.68%
23	600383	金地集团	73,004,595.14	54.04%
24	600196	复星医药	72,468,716.67	53.64%
25	600309	烟台万华	65,060,919.28	48.16%
26	600269	赣粤高速	62,407,676.99	46.20%
27	600685	广船国际	62,231,399.19	46.07%
28	600895	张江高科	60,043,690.25	44.45%
29	600740	山西焦化	59,364,963.37	43.94%
30	000001	深发展 A	57,528,037.39	42.58%
31	600072	江南重工	57,275,220.43	42.40%
32	600531	豫光金铅	55,017,913.16	40.73%
33	000537	广宇发展	54,464,740.92	40.32%
34	000758	中色股份	51,998,321.99	38.49%
35	600675	中华企业	50,317,537.63	37.25%
36	600408	安泰集团	49,780,999.14	36.85%
37	000878	云南铜业	48,819,910.78	36.14%
38	601628	中国人寿	48,153,874.93	35.65%
39	600123	兰花科创	47,690,357.13	35.30%
40	600642	申能股份	46,421,200.84	34.36%
41	600963	岳阳纸业	44,291,382.18	32.79%
42	600428	中远航运	44,141,719.73	32.68%
43	600028	中国石化	44,029,414.12	32.59%
44	600717	天津港	43,273,894.25	32.03%
45	600688	S 上石化	43,080,989.24	31.89%

46	600050	中国联通	42,652,148.86	31.57%
47	600704	中大股份	42,235,004.26	31.26%
48	000919	金陵药业	42,133,586.99	31.19%
49	000060	中金岭南	40,566,362.95	30.03%
50	000839	中信国安	40,507,951.51	29.99%
51	000898	鞍钢股份	39,653,366.72	29.35%
52	600884	杉杉股份	38,515,264.43	28.51%
53	600067	冠城大通	38,146,175.06	28.24%
54	000869	张裕A	38,040,791.79	28.16%
55	600362	江西铜业	35,776,141.18	26.48%
56	000876	新希望	34,743,883.11	25.72%
57	002041	登海种业	34,451,354.03	25.50%
58	000698	沈阳化工	33,904,537.56	25.10%
59	600863	内蒙华电	33,808,869.47	25.03%
60	000927	一汽夏利	33,773,551.60	25.00%
61	000031	中粮地产	33,274,353.11	24.63%
62	000069	华侨城A	32,991,096.99	24.42%
63	600352	浙江龙盛	32,323,074.16	23.93%
64	600900	长江电力	31,986,740.09	23.68%
65	600348	国阳新能	31,970,966.39	23.67%
66	600755	厦门国贸	31,562,451.89	23.36%
67	600107	美尔雅	31,339,712.94	23.20%
68	600795	国电电力	31,000,192.80	22.95%
69	000748	长城信息	30,980,787.35	22.93%
70	600219	南山铝业	30,785,996.48	22.79%
71	600518	康美药业	30,689,583.80	22.72%
72	600236	桂冠电力	30,467,077.22	22.55%
73	000568	泸州老窖	30,446,618.84	22.54%
74	600001	邯郸钢铁	30,340,496.18	22.46%
75	000401	冀东水泥	30,062,396.22	22.25%
76	000562	宏源证券	29,655,171.37	21.95%
77	600978	宜华木业	27,853,074.49	20.62%
78	000829	天音控股	27,050,509.17	20.02%
79	600104	上海汽车	26,971,241.17	19.97%
80	600019	宝钢股份	26,948,845.59	19.95%
81	600390	金瑞科技	25,958,168.51	19.22%
82	000731	四川美丰	25,793,456.16	19.09%
83	600415	小商品城	25,152,294.31	18.62%
84	000598	蓝星清洗	24,157,866.79	17.88%
85	000960	锡业股份	24,086,645.21	17.83%
86	000522	白云山A	23,497,496.17	17.39%
87	600004	白云机场	23,174,322.76	17.15%
88	000009	S深宝安A	22,979,973.93	17.01%

89	600598	北大荒	22,922,638.59	16.97%
90	600488	天药股份	22,532,084.43	16.68%
91	000006	深振业 A	22,229,277.44	16.45%
92	000510	金路集团	21,010,525.49	15.55%
93	600694	大商股份	20,702,175.67	15.32%
94	600166	福田汽车	20,616,347.42	15.26%
95	600357	承德钒钛	20,287,828.24	15.02%
96	600832	东方明珠	19,756,419.94	14.62%
97	601398	工商银行	19,645,741.07	14.54%
98	000951	中国重汽	19,263,796.49	14.26%
99	600960	滨州活塞	19,080,927.57	14.12%
100	000680	山推股份	18,828,011.10	13.94%
101	600677	航天通信	18,405,808.98	13.62%
102	000428	华天酒店	18,318,048.61	13.56%
103	000063	中兴通讯	18,261,216.40	13.52%
104	600859	王府井	18,209,406.16	13.48%
105	600087	南京水运	18,049,188.77	13.36%
106	000983	西山煤电	17,946,785.11	13.28%
107	000024	招商地产	17,409,537.48	12.89%
108	000625	长安汽车	16,337,935.90	12.09%
109	600583	海油工程	15,972,399.63	11.82%
110	000157	中联重科	15,714,983.85	11.63%
111	600874	创业环保	15,534,224.94	11.50%
112	600176	中国玻纤	15,494,901.05	11.47%
113	000900	现代投资	15,026,490.65	11.12%
114	600660	福耀玻璃	14,882,959.79	11.02%
115	600161	天坛生物	14,371,962.71	10.64%
116	600663	陆家嘴	13,967,082.63	10.34%
117	000539	粤电力 A	13,867,164.58	10.26%
118	600271	航天信息	13,679,773.23	10.13%
119	600621	上海金陵	13,679,718.01	10.13%
120	600109	成都建投	13,035,089.23	9.65%
121	600210	紫江企业	12,843,868.92	9.51%
122	600115	东方航空	11,061,258.77	8.19%
123	600497	驰宏锌锗	10,253,607.67	7.59%
124	600867	通化东宝	9,706,407.62	7.19%
125	600037	歌华有线	9,553,413.38	7.07%
126	601318	中国平安	9,503,957.68	7.04%
127	000612	焦作万方	9,454,330.20	7.00%
128	600066	宇通客车	8,489,710.32	6.28%
129	000959	首钢股份	8,452,757.02	6.26%
130	600809	山西汾酒	8,360,575.20	6.19%
131	000976	春晖股份	8,328,850.65	6.17%

132	600500	中化国际	8,025,839.90	5.94%
133	600887	伊利股份	7,961,093.65	5.89%
134	601111	中国国航	7,944,200.92	5.88%
135	000933	神火股份	7,679,379.05	5.68%
136	000755	山西三维	7,550,803.19	5.59%
137	600217	*ST 秦岭	6,948,386.43	5.14%
138	600432	吉恩镍业	6,901,593.14	5.11%
139	600064	南京高科	6,782,071.12	5.02%
140	600470	六国化工	6,686,179.44	4.95%
141	600230	沧州大化	6,199,903.92	4.59%
142	600594	益佰制药	5,743,595.20	4.25%
143	600100	同方股份	5,559,908.92	4.12%
144	600600	青岛啤酒	5,251,888.14	3.89%
145	002071	江苏宏宝	5,173,335.80	3.83%
146	600299	星新材料	5,120,052.03	3.79%
147	600563	法拉电子	5,085,574.43	3.76%
148	600312	平高电气	4,967,202.64	3.68%
149	600546	中油化建	4,894,187.03	3.62%
150	601166	兴业银行	4,734,733.80	3.50%
151	600549	厦门钨业	4,360,329.72	3.23%
152	600547	山东黄金	4,315,816.00	3.19%
153	600048	保利地产	4,172,928.60	3.09%
154	002098	浔兴股份	3,960,044.85	2.93%
155	600416	湘电股份	3,692,674.88	2.73%
156	600085	同仁堂	3,581,620.31	2.65%
157	000807	云铝股份	3,485,732.18	2.58%
158	600033	福建高速	2,869,375.74	2.12%

2、本报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本总额	6,966,924,953.84
卖出股票的收入总额	6,083,732,132.12

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	期末市值 (人民币元)	市值占基金资产 净值比例
国债投资	0.00	0.00%
企业债券投资	0.00	0.00%
金融债券投资	0.00	0.00%

可转换债投资	66,177,290.64	3.92%
债券投资合计	66,177,290.64	3.92%

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	期末市值 (人民币元)	市值占基金资产 净值比例
1	125717	韶钢转债	44,503,435.30	2.64%
2	126003	07 云化债	6,427,282.40	0.38%
3	126001	06 马钢债	6,092,230.80	0.36%
4	128031	巨轮转债	5,867,419.14	0.35%
5	126002	06 中化债	3,286,923.00	0.19%

(七) 投资组合报告附注

1、 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

2、 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、 期末其它资产构成：

单位：人民币元

资产	期末数
交易保证金	1,387,967.51
应收股利	350,784.00
应收利息	355,254.69
应收证券清算款	5,566,016.45
应收申购款	2,244,466.35
待摊费用	49,316.50
合计	9,953,805.50

4、期末持有的处于转股期的可转换债券明细表：

本报告期没有处于转股期的可转换债券

5、本报告期内无权证投资。

七、基金份额持有人户数、持有人结构

本报告期末基金份额持有人信息

基金份额持有人户数 (户)	平均每户持有基金份额 (份)	机构投资者持有基金份额 (份)	占总份额比例 (%)	个人投资者持有基金份额 (份)	占总份额比例 (%)
66,611	19601.92	28769731.01	2.20%	1276933692.23	97.80%

八、开放式基金份额变动

项 目	单位 (份)
合同生效日基金份额总额	618,818,129.03
本报告期期初基金份额总额	83,897,488.99
本报告期期末基金份额总额	1,305,703,423.24
本报告期间基金总申购份额	2,280,193,294.25
本报告期间基金总赎回份额	1,058,387,360.00

九、重大事项揭示

1、本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项；

2、本报告期内本基金管理人的人事变动：

(1) 新世纪基金管理有限公司副总经理徐子兵由于个人原因向公司提出辞职，经公司二零零七年第一次董事会会议表决通过，同意徐子兵同志辞去本公司副总经理一职。上述事项已按规定报告中国证监会、重庆证监局并通过审查，并已于 2007 年 4 月 26 日，在指定报刊和网站对外披露。

(2) 新世纪基金管理有限公司原董事宋宏宇先生因个人原因提出辞职，经公司股东会二零零七年第一次会议表决通过，同意宋宏宇先生辞去新世纪基金管理有限公司董事职务，增补翁先定先生为新世纪基金管理有限公司董事。上述事项

已按规定报告中国证监会、重庆证监局并通过审查，并已于 2007 年 4 月 26 日，在指定报刊和网站对外披露。

(3) 因工作需要，经新世纪基金管理有限公司临时董事会审议通过，增聘向朝勇先生为“新世纪优选分红基金”的基金经理。上述事项已按规定报告中国证监会、重庆证监局并通过审查，并已于 2007 年 6 月 19 日，在指定报刊和网站对外披露。

3、本报告期内基金托管人的人事变动：

依据国务院文件，2007 年 6 月 16 日国务院决定任命项俊波同志为中国农业银行行长。依据相关法律规定，中国农业银行法定代表人变更为项俊波先生。

4、本报告期内本基金的投资策略未有改变；

5、本基金自基金合同生效以来聘请重庆天健会计师事务所提供审计服务。

6、基金收益分配事项。

日 期	每 10 份基金份额
(权益登记除息日)	收益分配金额(元)
2007 年 1 月 09 日	4.00
2007 年 1 月 16 日	0.86
2007 年 2 月 05 日	2.10
2007 年 2 月 13 日	0.65
2007 年 4 月 24 日	0.60
2007 年 5 月 11 日	0.66
每 10 份基金份额累计分配金额	8.87

7、本报告期内，本基金租用证券公司席位的有关情况：

(单位：元)

券商名称	租用席位数量	2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日						
		国债交易量	国债交易量比例	国债回购交易量	股票交易量	股票交易量比例	佣金	佣金比例
新时代证券	2	0.00	0.00%	0.00	5,498,605,755.82	42.31%	4,368,286.46	41.54%
东方证券	1	0.00	0.00%	0.00	3,728,578,589.87	28.69%	3,057,416.92	29.07%
恒泰证券	1	0.00	0.00%	0.00	2,119,791,020.27	16.31%	1,738,219.10	16.53%
国泰证券	1	0.00	0.00%	0.00	1,648,976,995.65	12.69%	1,352,150.16	12.86%
总计	5	0.00	0.00%	0.00	12,995,952,361.61	100.00%	10,516,072.64	100%

8、本报告期内其他重大事项：

1、截止到2007年6月30日，新世纪基金管理有限公司基金从业人员持有“新世纪优选分红混合型证券投资基金”基金份额的总量为622027.95份，占该只基金总份额的比例为0.476%。

2、

公告事项	信息披露报纸名称	披露时间
新世纪优选分红基金第七次分红公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 1 月 5 日
新世纪优选分红基金第八次分红公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 1 月 12 日
新世纪优选分红基金 2006 年第 4 季度报告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 1 月 22 日
新世纪优选分红基金第九次分红预告	中国证券报	2007 年 2 月 1 日

	上海证券报 证券时报	
新世纪优选分红基金第九次分红公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 2 月 6 日
新世纪优选分红基金第十次分红 预告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 2 月 9 日
新世纪优选分红基金调整第十次收益 分配方案及分红公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 2 月 14 日
新世纪优选分红基金关于第二次调整 分红点的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 3 月 21 日
新世纪优选分红基金 2006 年报摘要	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 3 月 28 日
新世纪优选分红基金 2007 年 第 1 季度报告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 4 月 19 日

关于新世纪优选分红混合型证券投资基金申购费用及申购份额的计算采用外扣法的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 4 月 20 日
新世纪优选分红基金第十一次分红公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 4 月 20 日
新世纪基金管理有限公司关于高级管理人员离任的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 4 月 26 日
新世纪基金管理有限公司关于更换董事的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 4 月 26 日
新世纪基金管理有限公司关于客服电话变更的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 4 月 26 日
新世纪基金管理有限公司关于客服电话变更和公司网站暂停使用的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 4 月 27 日
新世纪优选分红混合型证券投资基金招募说明书更新（摘要）	中国证券报 上海证券报	2007 年 4 月 30 日

	证券时报	
新世纪优选分红基金第十二次分红公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 5 月 9 日
新世纪基金管理有限公司关于北京分公司住所变更的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 5 月 10 日
新世纪优选分红基金关于第三次调整分红点的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 5 月 22 日
关于新世纪优选分红混合型证券投资基金在中国农业银行增加前端申购费收取模式的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 5 月 29 日
关于新世纪优选分红混合型证券投资基金在中国农业银行增加前端申购费收取模式的提示性公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 5 月 30 日
新世纪基金管理有限公司关于暂停旗下新世纪优选分红混合型证券投资基金后端收费模式申购业务的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 5 月 31 日
新世纪基金管理有限公司关于增聘	中国证券报	2007 年 6 月 12 日

基金经理的公告	上海证券报 证券时报	
新世纪基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 6 月 19 日
新世纪基金管理有限公司关于增加东北证券为新世纪优选分红基金代销机构的公告	中国证券报 上海证券报 证券时报	2007 年 6 月 29 日

十、备查文件目录

- （一）中国证监会批准新世纪优选分红证券投资基金募集的文件
- （二）《新世纪优选分红混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《新世纪优选分红混合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《新世纪优选分红混合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

存放地点：基金管理人或基金托管人住所

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

2007 年 8 月 24 日