

新世纪优选分红混合型证券投资基金

2009 年半年度报告（摘要）

2009 年 6 月 30 日

基金管理人：新世纪基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇〇九年八月二十六日

1 重要提示及目录

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股份有限公司基金托管部根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 24 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
3	主要财务指标、基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	6
4	管理人报告.....	7
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	9
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5	托管人报告.....	11
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2	托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3	托管人对本报告期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
6	半年度财务报表.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
7	投资组合报告.....	29
7.1	期末基金资产组合情况.....	29
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3	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.....	30
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	30
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.6	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.....	33
7.7	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	33
7.8	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.....	33
7.9	投资组合报告附注.....	33

8	基金份额持有人信息.....	34
8.1	期末基金份额持有人户数及基金份额持有人结构.....	34
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	34
9	开放式基金份额变动.....	35
10	重大事件揭示.....	35
10.1	基金份额持有人大会决议.....	35
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	35
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	35
10.4	基金投资策略的改变.....	35
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	35
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	35
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8	其他重大事件.....	37

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新世纪优选分红混合
交易代码	519087
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	2,044,705,867.88份

2.2 基金产品说明

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。

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	新世纪基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩
	联系电话	010-88423386
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn
客户服务电话	4007108866	95599
传真	010-88423310	010-68424181

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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

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		2009年1月1日 - 2009年6月30日
本期已实现收益		315,491,542.71
本期利润		511,541,437.33
加权平均基金份额本期利润		0.2458
本期基金份额净值增长率		56.08%
3.1.2 期末数据和指标		2009年1月1日 - 2009年6月30日
期末可供分配基金份额利润		-0.0003
期末基金资产净值		1,398,761,022.47
期末基金份额净值		0.6841

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
过去一个月	13.88%	0.88%	8.27%	0.71%	5.61%	0.17%
过去三个月	21.08%	1.16%	14.77%	0.92%	6.31%	0.24%
过去六个月	56.08%	1.36%	39.23%	1.16%	16.85%	0.20%
过去一年	20.04%	1.81%	13.03%	1.52%	7.01%	0.29%
过去三年	108.54%	1.95%	80.45%	1.45%	28.09%	0.50%
自基金成立以来至今	187.84%	1.82%	128.90%	1.34%	58.94%	0.48%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

新世纪优选分红混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005 年 9 月 16 日至 2009 年 6 月 30 日)



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

新世纪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 2009 年 6 月 30 日，新世纪基金管理有限公司旗下管理着两只开放式基金，即新世纪优选分红混合型证券投资基金和新世纪优选成长股票型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曹名长	基金经理， 投资管理 部副总监	2006-7-12	-	12 年	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、新世纪基金管理有限公司策略

					分析师。现任投资管理部副总监。
向朝勇	基金经理， 副总经理	2007-6-19	-	12 年	管理学博士，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； 现任公司副总经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。
 2、证券从业的含义遵从行业协会，《证券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管理人按照《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基金份额持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

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。

4.3.2 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

1、报告期内基金业绩

截至 2009 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.6841 元，本报告期份额净值增长率为 56.08%，同期比较基准的增长率为 39.23%。

2、投资策略和运作分析

上半年 A 股市场在流动性推动、宏观数据持续转好、外围股市回暖以及大宗商品价格上涨等因素刺激下，股指继续震荡向上。受益于经济复苏的强周期性行业如地产、汽车、钢铁、煤炭、工程机械等板块出现了较大的涨幅，周期性较弱的医药、食品饮料、商业零售、TMT、电力设备等也出现补涨。由于经济以及市场走势基本按我们年初估计方向行进，因此在操作上我们一直保持较高的仓位配置，对金融、医药、商业贸易、TMT、食品饮料等行业中的具有长期投资价值且处于估值洼地，可实现业绩持续稳定增长的优质上市公司进行了重点配置；对周期性较强，行业出现景气拐点的地产、工程机械、造纸、钢铁、化工等板块也进行阶段性的参与和布局，使得基金净值表现较好。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断，在未出现经济过热、恶性通胀、资产泡沫过度膨胀的背景下，政府仍然会继续保持积极的财政政策和宽松的货币政策来刺激经济的复苏，货币政策的微调不会改变大的战略方向；宏观经济运行趋势仍然会沿着复苏的路径向前迈进。但随着经济的逐步复苏对资金需求的加剧、央行货币政策的微调、新股发行的加速，市场流动性最充裕的时刻正在过去，市场未来可能会在企业赢利回升和流动性逐步收紧的合力下寻求新的平衡点，震荡将会加剧，如果市场估值在震荡中继续提升，我们的操作将会趋于谨慎。

在资产配置方面，我们将沿着经济复苏、通胀预期、年底消费旺季、出口回暖四条主线去寻求各行业的投资机会，对中上游的钢铁、化工、工程机械、有色等强周期性行业，当其估值具有吸引力时将择机配置，同时适当加大对前期涨幅较小的，受益于消费旺季的食品饮料、商业零售行业，年底估值水平会得到提升。

的医药、TMT、基础设施建设等稳定增长行业中的优质公司的配置力度。

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。估值工作小组由运营总监、基金会计室、投资部、集中交易室、监察稽核部部门经理组成。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。

运营总监是估值工作小组的组长，运营总监在基金会计室经理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 基金会计室的职责分工

基金会计室负责日常证券资产估值。该室和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计室定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计室职责：

- 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。

基金会计室经理认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

4.6.1.3 投资部的职责分工

- 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室提供的估值报告；
- 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 集中交易室的职责分工

- ① 对基金会计室的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计室关于证券停牌、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室提供的估值报告。

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

在托管新世纪优选分红混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《新世纪优选分红混合型证券投资基金基金合同》、《新世纪优选分红混合型证券投资基金托管协议》的约定，对新世纪优选分红混合型证券投资基金基金管理人—新世纪基金管理有限公司 2009 年 1 月 1 日至 2009 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。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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混合型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。

5.3 托管人对本报告期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混合型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，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部

2009 年 8 月 24 日

6 半年度财务报表

6.1 资产负债表

会计主体：新世纪优选分红混合型证券投资基金

报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产：			
银行存款		84,441,440.16	45,572,272.19
结算备付金		6,550,937.73	1,610,518.28
存出保证金		1,594,028.12	1,300,000.00
交易性金融资产		1,312,598,459.13	882,376,925.03
其中：股票投资		1,251,520,837.63	743,950,757.12
债券投资		61,077,621.50	138,426,167.91
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		-	6,633,597.39
应收利息		3,482,084.30	2,983,611.68
应收股利		-	-
应收申购款		828,404.27	29,150.19
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,409,495,353.71	940,506,074.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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		2,613,496.12	5,493,993.59
应付赎回款		2,356,422.58	221,514.92
应付管理人报酬		1,642,867.50	1,199,277.59
应付托管费		273,811.23	199,879.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,253,317.55	1,195,846.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,594,416.26	1,662,929.71
负债合计		10,734,331.24	9,973,441.46
所有者权益：			
实收基金		1,271,105,630.10	1,319,939,226.06
未分配利润		127,655,392.37	-389,406,592.76

所有者权益合计		1,398,761,022.47	930,532,633.30
负债和所有者权益总计		1,409,495,353.71	940,506,074.76

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6841 元，基金份额总额 2,044,705,867.88 份

6.2 利润表

会计主体：新世纪优选分红混合型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日 - 2008 年 6 月 30 日
一、收入		528,416,327.90	-914,549,338.74
1.利息收入		3,228,993.59	1,854,122.50
其中：存款利息收入		288,696.84	1,568,099.83
债券利息收入		2,940,296.75	286,022.67
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）		329,065,225.27	-375,298,833.11
其中：股票投资收益		322,030,747.82	-380,582,114.79
债券投资收益		-174,600.18	-33,056.56
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	11,145.74
股利收益		7,209,077.63	5,305,192.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		196,049,894.62	-541,332,429.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		72,214.42	227,801.39
二、费用（以“-”号填列）		16,874,890.57	52,317,224.04
1. 管理人报酬		8,623,275.08	12,385,778.64
2. 托管费		1,437,212.48	2,064,296.49
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		6,616,365.72	37,625,489.23
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 其他费用		198,037.29	241,659.68
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		511,541,437.33	-966,866,562.78
所得税费用（以“-”号填 列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		511,541,437.33	-966,866,562.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新世纪优选分红混合型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日	实收基金	未分配利润
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,319,939,226.06	-389,406,592.76	930,532,633.30
二、本期经营活动产生的 的基金净值变动数(本期 利润)	-	511,541,437.33	511,541,437.33
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)	-48,833,595.96	5,520,547.80	-43,313,048.16
其中：1. 基金申购款	47,500,755.68	-2,048,034.48	45,452,721.20
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-96,334,351.64	7,568,582.28	-88,765,769.36
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)	1,271,105,630.10	127,655,392.37	1,398,761,022.47
项目	上年度可比期间		
	2008 年 1 月 1 日 - 2008 年 6 月 30 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)	520,723,573.70	312,824,815.12	833,548,388.82

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-966,866,562.78	-966,866,562.78
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）	855,342,930.60	539,465,032.89	1,394,807,963.49
其中：1. 基金申购款	1,012,085,276.36	579,949,271.67	1,592,034,548.03
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-156,742,345.76	-40,484,238.78	-197,226,584.54
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)	1,376,066,504.30	-114,576,714.77	1,261,489,789.53

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新世纪优选分红混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]115号文件“关于同意新世纪优选分红证券投资基金管理的批复”批准,由新世纪基金管理有限公司作为发起人,于2005年7月28日至9月9日向社会公开募集,首次募集资金总额618,416,866.55元,募集资金产生利息:401,318.43元,并经重庆天健会计师事务所重天健验[2005]26号验资报告予以验证。2005年9月16日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新世纪基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新世纪优选分混合型证券投资基金招募说明书》及《新世纪优选分混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是:股票投资比例为基金资产净值的20%—90%;债券及短期金融工具的投资比例为基金资产净值10%—80%。其中本基金实时持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的合计比例不低于基金资

产净值的 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人新世纪基金管理有限公司于 2009 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2009]4 号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新世纪优选分红混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 6 月 30 日的财务状况、2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日的经营成果和 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日的基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

2009 年 01 月 01 日至 2009 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

人民币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

基金持有的金融资产和承担的金融负债，通常分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，应当采用公允价值进行初始和后续计量，公允价值的变动以及取得时发生的相关交易费用计入当期损益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括交易性金融资产。将购入目的是为了在近期内出售的金融资产确认为交易性金融资产。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以公允价值进行后续计量，公允价值按照取得日或发行日的市场情况和当前市场情况，或其他类似债务

工具（即有类似的剩余期限、现金流量模式、标价币种、信用风险、担保和利率基础等）的当前市场利率确定。债务人的信用风险和适用的信用风险贴水在债务工具发行后没有改变的，可使用基准利率估计当前市场利率确定债务工具的公允价值。债务人的信用风险和相应的信用风险贴水在债务工具发行后发生改变的，参考类似债务工具的当前价格或利率，并考虑金融工具之间的差异调整，确定债务工具的公允价值。公允价值变动形成的收益或损失计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

金融资产和金融负债估值原则如下。

（1）上市股票

以估值日证券交易所挂牌的市场收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日收盘价估值；

（2）未上市的股票投资

①首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

⑤在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

⑥国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（3）权证

①基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近

交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

②首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

③因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

④在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（3）项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（3）项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

⑤国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（4）债券

①在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

②在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

③首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

④交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

⑤在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

⑥同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

⑦在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

⑧国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（5）分离交易可转债

分离交易可转债上市前债券与权证成本分摊与增值估值：

①成本分摊：上市前权证成本按照理论价格确定为权证成本，分离交易可转债投资成本扣除对应数量权证成本为债券投资成本；

②增值估值：上市前债券按其面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内逐日计提利息；上市前权证采用 B-S 模型（布莱克——斯柯尔斯模型）计算其公允价值。

分离交易可转债上市后债券与权证成本分摊调整与增值估值：

①分离交易可转债的债券与权证上市日，按以下方法对债券和权证进行对成本分摊进行调整：

权证成本=分离交易可转债初始投资成本*[持有权证上市日公允价值/（持有权证上市日公允价值+持有债券上市日公允价值）]

债券成本=分离交易可转债初始投资成本-权证成本

按调整后的成本相应调整债券和权证投资成本。

②增值估值

上市后债券估值：估值日为交易日时，债券按当日证券交易所挂牌的市场收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日市场收盘价估值，并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内逐日

计提利息；上市后权证估值：估值日为交易日时，以当日证券交易所挂牌的市场收盘价估值；估值日无交易时，采用 B-S 模型（布莱克——斯柯尔斯模型）计算其公允价值。

（6）银行间市场交易和未上市流通的债券

按成本估值，并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

6、证券投资的计价方法

股票投资成本按成交日应支付的价款全部（包括成本总额和相关的费用）入账。

权证投资成本按成交日应支付的价款全部（包括成本总额和相关的费用）入账；因股权分置获得的权证成本计价为 0 元。

买入证券交易所的债券于成交日确认为债券投资，按应支付的全部价款入账；如果应支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入银行间同业市场交易和非上市流通的债券于实际支付价款时确认为债券投资，按实际支付的全部价款入账；如果实际支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入；卖出银行间同业市场交易和非上市流通的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

通过证券交易所进行融券业务，按成交日扣除手续费后的应付金额确认买入返售证券投资；通过银行间市场进行融券业务，按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

7、长期停牌股票的估值原则

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允

价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金核算对外发行基金份额所募集的总金额在扣除平准金分摊部分后的余额。每份基金份额的面值为 1.00 元。由于申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于相关活动的确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益/（累计基金净损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益/（累计基金净损失）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票的成交总额与其成本和相关费用的差额计算确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证的成交总额与其成本和相关费用的差额计算确认。

卖出交易所上市债券--于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；卖出银行间市场交易债券--于实际收到价款时确认债券差价收入，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券实际持有期内逐日计提确认。

存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率在证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账。

6.4.4.10 费用的确认和计量

基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提确认。

基金托管费按前一日的基金资产净值 2.5‰ 的年费率逐日计提确认。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金收益分配方式：

投资人可以选择现金分红或红利再投资的方式。投资人不选择时，本基金默认的收益分配方式是现金分红。投资人选择红利再投资时，分配的基金收益以红利发放日的基金份额净值为基准自动转换为基金份额进行再投资。

3、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

4、基金当期收益应先弥补前期亏损后，才可进行当期收益分配；

5、基金收益分配后基金份额资产净值不能低于面值；

6、当基金已实现收益比例超过分红点的 10 个交易日内必须实施分红。分红点定义如下：

分红点 = 中国人民银行一年期定期存款利率的两倍

对分红点进行公告的具体规定请参见招募说明书或更新后的招募说明书。

7、每年分红次数最多不超过 6 次，每次分红的比例不低于可分配收益的 80%。但如果基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

8、年度分红次数 6 次后，如果再次达到分红条件，可分配收益滚存到下一年度实施；

9、满足收益分配的其他原则，但基金已实现收益未达到分红点时，本基金也可能实施分红。

10、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本报告期本基金无外币交易。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期不存在会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字[2005]107 号文《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、自 2008 年 4 月 24 日起执行的《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的

股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日前按照 0.3%的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起按 0.1%的税率缴纳。经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税征收方式，将现行的对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1%的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1%的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国农业银行股份有限公司	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
上海隽基环境产业有限公司	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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本报告期本基金未通过关联方进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本报告期本基金未通过关联方进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本报告期本基金未通过关联方进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本报告期本基金未通过关联方进行债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期本基金无应支付关联方的佣金

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 – 2009年 6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日 – 2008年6月30 日
当期应支付的管理费	8,623,275.08	12,385,778.64
其中：当期已支付	6,980,407.58	10,684,337.19
期末未支付	1,642,867.50	1,701,441.45

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 – 2009年 6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日 – 2008年6月30 日
当期应支付的托管费	1,437,212.48	2,064,296.49
其中：当期已支付	1,163,401.25	1,780,722.91
期末未支付	273,811.23	283,573.58

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，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

6.4.8.2.3 销售服务费

本报告期内本基金无销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期本基金未进行银行间同业市场债券（含回购）交易

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期	上年度可比期间

	2009年1月1日 - 2009年 6月30日	2008年1月1日 - 2008年6月30 日
期初持有的基金份额	-	20,027,000.00
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	12,188,298.88
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	32,215,298.88
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	2.34%

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本报告期内，无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2009年1月1日 - 2009年6月30日	期末余额	2008年1月1日 - 2008年6月30日	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	84,441,440.16	261,286.55	83,942,120.48	1,471,178.94
中国证券登记结算有限责任公司	8,144,965.85	27,410.29	6,531,734.54	96,920.89

注：中国证券登记结算有限责任公司备付金余额系本基金委托托管银行转存于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的资金。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.9 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.10 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 股))	期末成本总额	期末估值总额
000887	中鼎	2009-2-12	2010-2-12	定向增	6.16	6.89	1,200,00	6,160,000.00	8,268,000.00

	股份			发			0		
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 股)	期末成本总额	期末估值总额
6.4.12.1.3 受限证券类别：									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 股)	期末成本总额	期末估值总额

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000063	中兴通讯	2009-6-30	临时股东大会	28.10	2009-7-1	28.97	929,000	25,534,281.51	26,104,900.00

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

报告期内本基金无银行间市场债券正回购。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

报告期内本基金无交易所市场债券正回购。

7 投资组合报告

7.1 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	1,251,520,837.63	88.79
	其中：股票	1,251,520,837.63	88.79

2	固定收益投资	61,077,621.50	4.33
	其中：债券	61,077,621.50	4.33
	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	90,992,377.89	6.46
6	其他资产	5,904,516.69	0.42
7	合计	1,409,495,353.71	100.00

7.2 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 (%)
1	农、林、牧、渔业	15,941,723.20	1.14
2	采掘业	41,439,811.78	2.96
3	制造业	482,117,617.18	34.47
4	食品、饮料	129,646,927.00	9.27
5	纺织、服装、皮毛	-	-
6	木材、家具	-	-
7	造纸、印刷	-	-
8	石油、化学、塑胶、塑料	48,495,052.80	3.47
9	电子	17,054,048.88	1.22
10	金属、非金属	33,174,400.00	2.37
11	机械、设备、仪表	116,228,674.16	8.31
12	医药、生物制品	137,518,514.34	9.83
13	其他制造业	-	-
14	电力、煤气及水的生产和供应业	16,811,600.00	1.20
15	建筑业	2,337,600.00	0.17
16	交通运输、仓储业	-	-
17	信息技术业	148,209,830.64	10.60
18	批发和零售贸易	162,657,409.02	11.63
19	金融、保险业	309,071,063.61	22.10
20	房地产业	46,715,796.00	3.34
21	社会服务业	18,328,023.20	1.31
22	传播与文化产业	-	-
23	综合类	7,890,363.00	0.56

24	合计	1,251,520,837.63	89.47
----	----	------------------	-------

7.3 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	601009	南京银行	4,319,829	77,713,723.71	5.56
2	601318	中国平安	1,080,000	53,416,800.00	3.82
3	600519	贵州茅台	357,110	52,855,851.10	3.78
4	600600	青岛啤酒	1,859,010	49,431,075.90	3.53
5	002001	新和成	1,393,536	48,495,052.80	3.47
6	600036	招商银行	2,150,322	48,188,716.02	3.45
7	002187	广百股份	1,778,894	47,336,369.34	3.38
8	002038	双鹭药业	1,449,564	46,893,395.40	3.35
9	000667	名流置业	6,869,970	46,715,796.00	3.34
10	002242	九阳股份	1,737,343	45,344,652.30	3.24

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于新世纪基金 <http://www.ncfund.com.cn> 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600005	武钢股份	89,549,965.48	9.62
2	600036	招商银行	74,863,677.79	8.05
3	600050	中国联通	74,508,455.19	8.01
4	600030	中信证券	66,173,837.74	7.11
5	601390	中国中铁	61,759,142.81	6.64
6	600016	民生银行	58,094,180.19	6.24
7	000063	中兴通讯	56,575,446.81	6.08
8	601186	中国铁建	51,193,604.00	5.50
9	600600	青岛啤酒	44,203,271.90	4.75
10	000667	名流置业	43,359,116.37	4.66
11	002001	新和成	41,507,496.40	4.46
12	002187	广百股份	41,070,281.14	4.41

13	600487	亨通光电	40,759,683.66	4.38
14	600900	长江电力	40,471,386.23	4.35
15	600410	华胜天成	40,069,532.74	4.31
16	000597	东北制药	39,897,084.48	4.29
17	600007	中国国贸	39,338,211.54	4.23
18	600000	浦发银行	38,067,223.60	4.09
19	002038	双鹭药业	36,362,050.06	3.91
20	002242	九阳股份	34,007,452.67	3.65
21	600594	益佰制药	33,591,939.82	3.61
22	600271	航天信息	30,851,276.43	3.32
23	600439	瑞贝卡	30,034,988.22	3.23
24	600216	浙江医药	29,889,436.38	3.21
25	000157	中联重科	29,613,935.28	3.18
26	000338	潍柴动力	27,412,816.08	2.95
27	600361	华联综超	25,449,340.02	2.73
28	601808	中海油服	23,223,979.98	2.50
29	000001	深发展 A	23,085,421.79	2.48
30	601088	中国神华	22,965,880.68	2.47
31	000895	双汇发展	22,426,883.86	2.41
32	000401	冀东水泥	22,169,110.36	2.38
33	600859	王府井	22,009,794.08	2.37
34	601328	交通银行	21,677,962.53	2.33
35	000919	金陵药业	21,606,186.70	2.32
36	600519	贵州茅台	20,494,311.54	2.20
37	601009	南京银行	20,179,994.75	2.17
38	601318	中国平安	20,095,578.40	2.16
39	600276	恒瑞医药	20,093,492.56	2.16
40	600528	中铁二局	19,646,536.80	2.11
41	000876	新希望	18,720,769.49	2.01

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。

7.4.2 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	600030	中信证券	129,756,542.62	13.94
2	600005	武钢股份	100,255,060.65	10.77
3	600050	中国联通	78,655,744.24	8.45
4	600016	民生银行	70,898,441.88	7.62
5	601390	中国中铁	67,595,822.70	7.26

6	002202	金风科技	63,399,531.14	6.81
7	600036	招商银行	57,302,788.32	6.16
8	600007	中国国贸	49,172,018.06	5.28
9	601186	中国铁建	47,904,310.61	5.15
10	600415	小商品城	43,286,306.86	4.65
11	600845	宝信软件	41,430,637.20	4.45
12	600529	山东药玻	39,364,539.18	4.23
13	601009	南京银行	38,349,296.82	4.12
14	000063	中兴通讯	37,773,818.10	4.06
15	000597	东北制药	35,593,905.74	3.83
16	600351	亚宝药业	34,079,047.38	3.66
17	600000	浦发银行	31,672,173.90	3.40
18	601601	中国太保	31,653,259.56	3.40
19	600439	瑞贝卡	31,093,604.95	3.34
20	601328	交通银行	26,934,055.13	2.89
21	002024	苏宁电器	26,778,713.80	2.88
22	601318	中国平安	25,349,486.00	2.72
23	600588	用友软件	24,497,136.49	2.63
24	002088	鲁阳股份	23,989,400.33	2.58
25	600900	长江电力	23,325,782.25	2.51
26	601088	中国神华	21,609,378.65	2.32
27	000869	张 裕 A	21,566,014.20	2.32
28	600970	中材国际	19,643,167.89	2.11
29	002001	新 和 成	19,490,062.94	2.09
30	600528	中铁二局	18,921,893.11	2.03

注：本项“卖出金额”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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,155,666,504.87
卖出股票的收入（成交）总额	2,164,390,615.00

注：本表格中“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	61,077,621.50	4.37
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	61,077,621.50	4.37

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	122013	08 北辰债	553,490	61,077,621.50	4.37

7.7 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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,594,028.12
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	3,482,084.30
5	应收申购款	828,404.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,904,516.69

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期无处于转股期的可转换债券。

7.9.5 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不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及基金份额持有人结构

份额单位：份

基金份 额持有 人户数 (户)	户均持有的 基金份额	基金份额持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
73,358	27,872.98	8,599,762.71	0.42%	2,036,106,105.17	99.58%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持 有本开放式基金	531,392.43	0.03%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	618,818,129.03
报告期期初基金份额总额	2,123,257,149.96
报告期内基金总申购份额	76,410,287.83
报告期内基金总赎回份额	154,961,569.91

报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,044,705,867.88

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金报告期内无基金管理人、基金托管人的专门基金托管人部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金报告期内无改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本基金报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	债券交易
------	------	------	------

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国金证券	1	384,064,080.71	8.89%	81,536,943.45	20.78%
国泰君安	1	607,953,209.24	14.07%	29,078,379.61	7.41%
恒泰证券	1	504,229,053.38	11.67%	18,611,047.26	4.74%
平安证券	1	163,972,734.45	3.80%	2,231,000.00	0.57%
申银万国	1	605,818,652.71	14.02%	92,880,597.10	23.67%
新时代证券	2	465,672,225.27	10.78%	15,713,408.53	4.00%
兴业证券	1	186,998,343.03	4.33%	13,781,116.22	3.51%
招商证券	1	419,717,386.57	9.72%	1,233,880.00	0.31%
中金公司	1	404,785,957.48	9.37%	3,103,407.28	0.79%
中信证券	2	576,845,477.03	13.35%	134,263,659.65	34.21%
合计	12	4,320,057,119.87	100.00%	392,433,439.10	100.00%

	回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
券商名称	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
国金证券	-	-	-	-	326,453.56	9.03%
国泰君安	-	-	-	-	516,760.66	14.30%
恒泰证券	-	-	-	-	428,592.14	11.86%
平安证券	-	-	-	-	133,229.32	3.69%
申银万国	-	-	-	-	514,940.51	14.25%
新时代证券	-	-	-	-	383,249.95	10.60%
兴业证券	-	-	-	-	151,938.13	4.20%
招商证券	-	-	-	-	341,022.61	9.43%
中金公司	-	-	-	-	344,066.40	9.52%
中信证券	-	-	-	-	474,393.76	13.12%
合计	-	-	-	-	3,614,647.04	100.00%

注：报告期内本基金符合中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）的有关规定。报告期内本基金租用证券公司交易单元无变动。

（1）、租用专用席位选择证券经营机构的标准

- ①公司实力雄厚，资信状况良好。公司净资产超过人民币三亿元，并且最近三年没有重大违规行为；
- ②公司财务状况和经营状况良好，各项财务指标显示公司运行稳定；
- ③公司具有较强的研究能力。有固定的研究机构或人员，能及时为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- ④公司内部管理规范、严格。内部运行高效，内部控制严格，能满足基金操作的高

度保密要求。

⑤公司信息服务周全。能提供基金运作的高效通讯条件，并有能力为基金提供全面的信息服务。

(2) 席位租用期限及更换方式

①席位租用期限暂定为半年，半年之后我公司将根据各证券经营机构在半年中向我公司提供的研究报告和信息服务的质量、通讯及信息保密等情况，按照根据上述选择标准细化的评价体系，进行评比排名。对不能及时有效提供信息服务的有关证券经营机构将予以淘汰，重新选择研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

若有关证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合我公司管理基金投资工作的要求，我公司有权中止租用其交易席位。

(3) 基金专用交易席位的选择程序如下：

- ①本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- ②基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	刊登《中国农业银行股份有限公司成立公告》，披露经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司。股份公司于 2009 年 1 月 15 日依法成立。	《金融时报》、《上海证券报》、www.abchina.com	2009-1-16

新世纪基金管理有限公司
二〇〇九年八月二十六日