# 新世纪优选分红混合型证券投资基金

# 2006 年年度报告摘要

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：2006 年 3 月 28 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

董事宋宏宇因故未能参加董事会，亦未授权给其他董事。独立董事黄林芳因工作安排原因，不能亲自出席董事会会议，全权委托独立董事孙茂竹代表其出席并代为行使表决权。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于 **2007** 年 **3** 月 **20** 日复核了本报告中的财务指标、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。

# 目　　录

一、基金简介 ..... 4
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况 ..... 5
三、管理人报告 ..... 7
四、托管人报告 ..... 11
五、审计报告 ..... 12
六、财务会计报告 ..... 12
附注 1．会计政策 ..... 16
附注 2．本报告期重大会计差错 ..... 16
附注 3．关联方关系及关联方交易 ..... 16
附注 4．报告期末流通转让受到限制的基金资产 ..... 17
附注 5.资产负债表日后事项的非调整事项 ..... 17
附注 6．其他重要事项 ..... 18
附注 7．或有事项 ..... 18
附注 8．承诺事项 ..... 18
七、基金投资组合报告 ..... 18
八、基金份额持有人户数、持有人结构 ..... 22
九、开放式基金份额变动 ..... 22
十、重大事项揭示 ..... 23
十一、备查文件目录 ..... 26

## 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：**83,897,488.99** 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：**010-58873895**

传真：**010-58873895**

电子邮箱：**qiyan@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：杨明生

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

登载年度报告正文的管理人网址：

**http://www.ncfund.com.cn**

基金年度报告置备地点：基金管理人、基金托管人的办公地

## 二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

（一）主要财务指标 单位：人民币元

| 主要财务指标 | 2006 年 | 2005 年 |
|---|---|---|
| 1.基金本期净收益 | 67,819,592.99 | 2,069,296.24 |
| 2.基金份额本期净收益 | 0.4398 | 0.3474 |
| 3.期末可供分配基金收益 | 24,251,560.60 | 1,563,286.93 |
| 4.期末可供分配基金份额收益 | 0.2891 | 0.0035 |
| 5.期末基金资产净值 | 135,092,119.61 | 446,507,624.14 |
| 6.期末基金份额净值 | 1.6102 | 1.0099 |
| 7.基金加权平均净值收益率 | 41.03% | 0.35% |
| 8.本期基金份额净值增长率 | 107.85% | 0.99% |
| 9.基金份额累计净值增长率 | 109.91% | 0.99% |

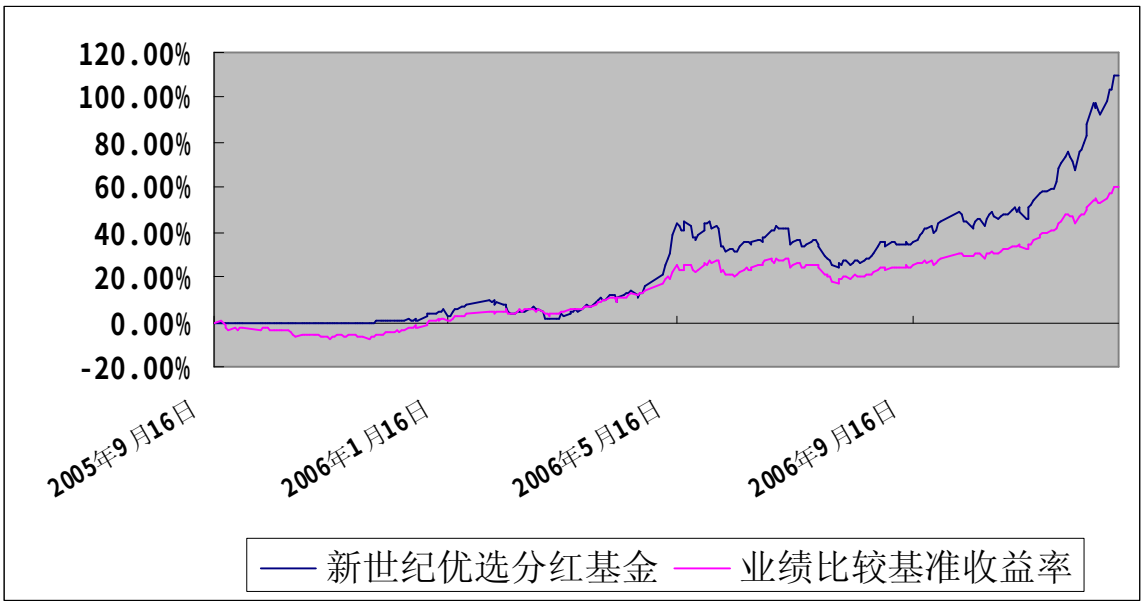
说明：本基金合同生效日为 2005 年 9 月 16 日，2005 年度主要财务指标的计算期间为 2005 年 9 月 16 日至 2005 年 12 月 31 日,无完整会计年度。

（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

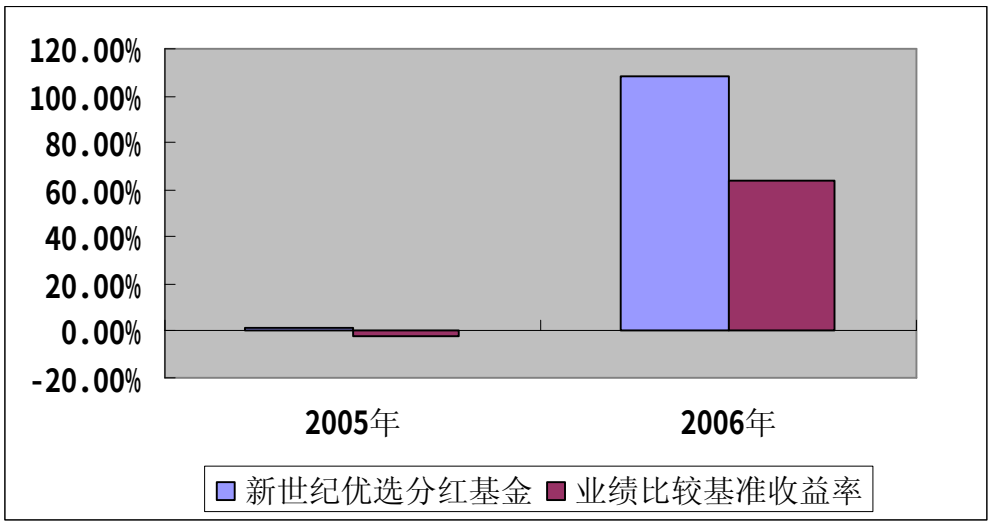
| 阶　段 | 净值增长率（1） | 净值增长率标准差（2） | 业绩比较基准收益率（3） | 业绩比较基准收益率标准差（4） | （1）-（3） | （2）-（4） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去 3 个月 | 44.92% | 1.67% | 24.53% | 0.83% | 20.39% | 0.84% |
| 过去 6 个月 | 52.08% | 1.49% | 25.96% | 0.84% | 26.12% | 0.65% |
| 过去 1 年 | 107.85% | 1.49% | 63.73% | 0.84% | 44.12% | 0.65% |
| 自基金成立起至今 | 109.91% | 1.31% | 59.78% | 0.79% | 50.13% | 0.52% |

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

3、基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率对比图




注：2005 年图示的指标计算期间为基金合同生效日 2005 年 9 月 16 日至 2005 年 12 月 31 日。

（三）自基金合同生效以来每年的基金收益分配情况

单位:元

| 年度 | 每 10 份基金份额分红数 | 备注 |
|---|---|---|
| 2006 年 6 月 16 日 | 0.540 | |
| 2006 年 6 月 07 日 | 0.670 | |
| 2006 年 5 月 24 日 | 0.800 | |
| 2006 年 5 月 17 日 | 0.430 | |
| 2006 年 2 月 14 日 | 0.400 | |
| 2006 年 1 月 19 日 | 0.200 | |
| 合　计 | 3.04 | |

## 三、管理人报告

(一)基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人情况

经中国证券监督管理委员会批复，新世纪基金管理有限公司于 2004 年 12 月

9 日注册成立，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%。

公司下设投资管理部、市场营销部、运作保障部、监察稽核部、综合管理部、机构理财部等部门。良好的治理结构、健全的内部控制、高效的组织架构保证了公司的合法、规范、稳健经营。

公司现有员工 40 人，90%的员工拥有本科及以上学历，其中投资研究团队由 9 名硕士及以上学历人员组成，其主要成员均具有 7 年以上的证券从业经验，公司高管人员的平均金融证券从业年限 12 年，具有丰富的实践操作经验和管理经验。

自成立以来，新世纪基金管理有限公司秉承“以民为本，为民理财”的服务理念，“稳健为本，科学决策”的投资理念，“诚信为本，创新求精”的经营理念，以专业化的运作为基础，以客户满意的服务为宗旨，以优良的业绩表现为追求，努力为基金持有人谋求最大利益。

2、基金经理简介

曹名长先生：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。

（二）基金运作的遵规守信情况

本报告期，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

（三）基金经理报告

1、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 2006 年 12 月 31 日，本基金累计份额净值为 1.6102 元，本报告期份额净值增长率为 107.85%，同期比较基准的增长率为 63.73%。

（2）投资策略和运作分析

基于 06 年初对 A 股市场相对国际其它市场以及相对债券市场具有吸引力的判断，整个 06 年我们把重点放在了 A 股市场，加大了股票配置比例。

而在 A 股的具体投资策略上，我们坚持选取具有行业比较优势、企业核心竞争力以及具有相对估值优势的公司为重点对象进行投资。整个 06 年都围绕人民币升值、消费升级、技术与创新以及股指期货、股权激励、整体上市等主题，进行相关行业、板块及重点公司的配置和投资。

由于市场环境判断正确以及投资策略恰当，使本基金在 06 年取得了较为优异的成绩。

2、未来展望及操作策略

展望未来，由于 2007 年中国经济仍将保持两位数的增长，这将带动上市公司盈利水平继续提高。加上人民币升值、外资源源不断流入等因素，将构成下一阶段中国股市的主要动力。当然，由于目前 A 股市场估值处于相对较高水平，因此，出现短期的波动在所难免。

对于 2007 年初的投资策略，我们将继续坚持一个起点——持续成长性，紧抓两条主线——人民币升值背景下的价值重估和以消费升级为主要内容的产业结构升级。同时，深入挖掘中国经济高速增长带来的投资机会，并适当关注三大主题投资——3G、奥运和数字电视所带来的高增长的投资机会。

在行业配置上，则重点看好直接受到价值重估推动的房地产、金融业，受益于消费需求长期增长的消费品行业（食品饮料、品牌服饰、旅游、零售、通讯）和在市场竞争和出口升级中不断壮大的制造业（机械设备、汽车、钢铁）。

（四）基金内部监察报告

本报告期内，本基金管理人监察稽核主要工作如下：

1、对开放式基金的营销工作的监察稽核

2006 年，公司管理的开放式基金——新世纪优选分红混合式证券投资基金，分别在券商渠道及银行渠道进行了持续营销，并新增一家券商为代销机构。在持续营销过程中，公司监察稽核部首先从宣传资料的内容上进行严格审核，确保资

料内容合法合规、通俗易懂，避免误导投资者；其次，督促公司市场部认真地遵守法律法规及证监会的有关规定，严禁向投资者进行基金投资风险和投资收益的虚假陈述，严禁以不正当的方式诱导投资者买卖基金，严禁变相打折销售基金。

2、对基金投资运作的监察稽核

监察稽核部对于基金投资运作的监察重点是公司投资管理人员是否按照法律法规及公司《投资管理规程》（以下简称《规程》）的要求履行职责，基金投资范围及投资比例是否符合法律法规和基金合同的规定，具体到日常监察工作主要有：

①监督公司投资管理人员的日常工作流程是否符合《规程》的规定；

②通过公司投资管理部向监察稽核部备案的材料监督投资管理部针对“世纪分红”基金设立的股票池的投资备选股票的调入调出是否符合公司《规程》的规定；

③根据备案的投委会会议纪要监督投委会的职责是否按照公司《投资管理委员会工作细则》的规定履行，特别关注基金重仓股的投资是否符合公司《规程》的规定；

④通过交易系统的实时监控监督投资比例和投资权限是否严格按照基金合同及《规程》的要求履行、是否严格执行《规程》规定的投资禁止及投资限制制度、投资交易流程是否执行《规程》规定；

⑤根据备案的授权书结合交易系统的实时监控监督重大授权是否以书面方式确定。

⑥每日通过交易系统监督基金投资比例，对于主动投资造成的超比例现象提醒并督促基金经理当日必须进行调整，对于由于份额或净值变动造成的超比例现象，在 10 个交易日内及时对基金经理进行提示。

在本年度的基金投资运作中，本基金的投资目标、投资决策依据和投资程序符合现行有效的法律法规及基金合同、招募说明书、公司投资管理相关制度的规定；投资交易行为合法合规，基金各项投资比例符合法律法规及基金合同的规定；基金的席位租用和交易量分配也能按照有关法规及公司制度规定的原则和程序办理，未出现席位交易量超标的现象。

3、内控制度的完善和执行

本年度，根据最新修订出台的《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国

证券法》，公司对公司章程进行了修订，完善了公司法人治理结构，提高了公司决策效率。同时对公司内部的制度流程重新进行了修订，重点是对投资管理流程进行了补充完善，目前公司制度体系完善。

公司不仅十分重视内控制度体系建设，更强调对内控制度的贯彻执行，公司委派监察稽核部着力加强了内控制度执行的监控力度，有计划地对公司市场营销部门、运作保障部门、投资管理部门的有关业务进行了多次全面或专项的监察，确保了公司内控制度的有效执行，本年度公司未出现重大风险和违法违规问题。

4、信息披露的专项工作

本年度，公司的信息披露工作均按照《基金法》及《证券投资基金信息披露管理办法》的要求进行，监察稽核部对公司各项信息披露内容都进行了严格的合法合规性审核，确保了信息披露的及时、准确、完整，并未发生任何重大的法律风险。

5、基金运营系统的监督

为了保障基金投资的正常进行，监察稽核部对基金运营系统给与了高度关注，定期对公司的信息技术部门进行现场检查，检查内容包括：数据备份情况、信息系统的运营稳定性、是否定期进行灾备演练等等，本年度基金后台运营系统正常，未出现影响经营运作的突发事件。

综上所述，公司在 2006 年度中经营运作合规稳健，内控制度健全并执行良好，未出现重大风险以及违法违规的现象。

## 四、托管人报告

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《新世纪优选分红混合型证券投资基金合同》、《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管理人—新世纪基金管理有限公司 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 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混合型证券投资基金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

2007 年 3 月 20 日

## 五、审计报告

本基金 **2006** 年年度财务会计报告经重庆天键会计师事务所有限责任公司审计，注册会计师签字出具了重天键审**[2007]**第 **188** 号“无保留意见的审计报告”。

## 六、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 | 2006 年 12 月 31 日 | 2005 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 资产**:** | | | |
| 银行存款 | | **11,825,867.99** | **241,854,415.59** |
| 清算备付金 | | **1,579,233.64** | **8,907,547.16** |
| 交易保证金 | | **550,000.00** | **300,000.00** |
| 应收证券清算款 | | **0.00** | **2,254.39** |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应收利息 | 6(1) | 18,508.19 | 71,542.79 |
| 应收申购款 | | 590,666.53 | 0.00 |
| 股票投资市值 | 6(2) | 121,058,812.70 | 205,079,455.20 |
| 其中:股票投资成本 | | 83,340,816.61 | 201,946,352.34 |
| 债券投资市值 | 6(3) | 5,864,055.30 | 0.00 |
| 其中:债券投资成本 | | 3,997,131.85 | 0.00 |
| 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(4) | 74,246.82 | 141,847.64 |
| 资产合计 | | 141,561,391.17 | 456,357,062.77 |
| 负债: | | | |
| 应付证券清算款 | | 3,015,221.65 | 2,323,347.59 |
| 应付赎回款 | | 2,338,275.97 | 6,275,347.00 |
| 应付赎回费 | | 8,112.88 | 23,892.46 |
| 应付管理人报酬 | | 161,258.49 | 699,297.23 |
| 应付托管费 | | 26,876.42 | 116,549.55 |
| 应付佣金 | 6(5) | 509,479.37 | 317,876.72 |
| 应付利息 | | 0.00 | 0.00 |
| 其他应付款 | 6(6) | 278,540.42 | 64,051.90 |
| 卖出回购证券款 | | 0.00 | 0.00 |
| 预提费用 | 6(7) | 131,506.36 | 29,076.18 |
| 负债合计 | | 6,469,271.56 | 9,849,438.63 |
| 持有人权益: | | | |
| 实收基金 | 6(8) | 83,897,488.99 | 442,150,483.39 |
| 未实现利得 | 6(9) | 26,943,070.02 | 2,793,853.82 |
| 未分配收益 | | 24,251,560.60 | 1,563,286.93 |
| 持有人权益合计 | | 135,092,119.61 | 446,507,624.14 |
| 负债及持有人权益总计 | | 141,561,391.17 | 456,357,062.77 |

(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 | 2006 年 | 2005 年 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | | |
| 股票差价收入 | 6(10) | 67,738,981.33 | 2,287,436.29 |
| 债券差价收入 | 6(11) | 115,751.15 | 48.47 |
| 债券利息收入 | | 110,781.76 | 21.11 |
| 存款利息收入 | | 259,009.94 | 430,586.43 |
| 股利收入 | | 997,417.12 | 0.00 |
| 权证差价收入 | 6(12) | 1,224,220.70 | 465,285.05 |
| 买入返售证券收入 | | 0.00 | 1,826,048.00 |
| 其他收入 | 6(13) | 730,979.33 | 222,545.19 |
| 收入合计 | | 71,177,141.33 | 5,231,970.54 |
| 二、费用 | | | |
| 基金管理人报酬 | | 2,542,685.99 | 2,602,937.68 |
| 基金托管费 | | 423,780.96 | 433,822.93 |
| 卖出回购证券支出 | | 0.00 | 0.00 |
| 其他费用 | 6(14) | 391,081.39 | 125,913.69 |
| 其中:上市年费 | | | 0.00 |
| 信息披露费 | | 290,031.00 | 87,228.54 |
| 审计费用 | | 80,000.00 | 0.00 |
| 汇划手续费 | | 7,550.39 | 1,663.50 |
| 回购交易费用 | | 0.00 | 36,121.65 |
| 其它 | | 0.00 | 900.00 |
| 费用合计 | | 3,357,548.34 | 3,162,674.30 |
| 三、基金净收益 | | 67,819,592.99 | 2,069,296.24 |
| 加:未实现利得 | | 36,451,816.68 | 3,133,102.86 |
| 四、基金经营业绩 | | 104,271,409.67 | 5,202,399.10 |

**3**、基金收益分配表 单位：人民币元

| 项　　目 | 附注 | 2006 年 | 2005 年 |
|---|---|---|---|
| 基金净收益 | | 67,819,592.99 | 2,069,296.24 |
| 加：年初基金净收益 | | 1,563,286.93 | 0.00 |
| 加:本期损益平准金 | | -8,348,644.13 | -506,009.31 |
| 可供分配基金净收益 | | 61,034,235.79 | 1,563,286.93 |
| 减：本年已分配基金净收益 | | 36,782,675.19 | 0.00 |
| 期末未分配基金净收益 | | 24,251,560.60 | 1,563,286.93 |

**4**、基金净值变动表 单位：人民币元

| 项　　目 | 附注 | 2006 年 | 2005 年 |
|---|---|---|---|
| 一、期初基金净值 | | 446,507,624.14 | 618,818,129.03 |
| 二、本年度经营活动 | | | |
| 基金净收益 | | 67,819,592.99 | 2,069,296.24 |
| 未实现利得 | | 36,451,816.68 | 3,133,102.86 |
| 经营活动产生的基金净值变动数 | | 104,271,409.67 | 5,202,399.10 |
| 三、本年度基金份额交易 | | | |
| 基金申购款 | | 208,565,523.61 | 478,500.46 |
| 基金赎回款 | | -587,469,762.62 | -177,991,404.45 |
| 基金份额交易产生的基金净值变动数 | | -378,904,239.01 | -177,512,903.99 |
| 四、本年向基金份额持有人分配收益 | | | 0.00 |
| 向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数 | | -36,782,675.19 | 0.00 |
| 五、期末基金净值 | | 135,092,119.61 | 446,507,624.14 |

备注：2005 年度主要财务指标的计算期间为 2005 年 9 月 16 日至 2005 年 12 月 31 日,无完整会计年度。

(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**

本报告期无重大会计差错

**附注 3．关联方关系及关联方交易**

**(1) 关联方关系：**

| 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×1.5%÷当年天数。截止至 2006 年 12 月 31 日，本基金 2006 年度共需支付基金管理人报酬人民币 2,542,685.99 元。其中已支付人民币 2,381,427.50 元，尚余人民币 161,258.49 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×0.25%÷当年天数。截止至 2006 年 12 月 31 日，本基金 2006 年度共需支付基金托管人报酬

人民币 423,780.96 元。其中已支付人民币 396,904.54,尚余人民币 26,876.42 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，占基金总份额 23.87%，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 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 11,825,867.99 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 227,584.28 元。

2、本基金2006年12月31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1,579,233.64元，交易保证金余额为550,000.00元。本会计年度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31,425.66元。

E、本年度本基金未向各关联方支付销售服务费。

**附注 4．报告期末流通转让受到限制的基金资产**

截止 2006 年 12 月 31 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 5.资产负债表日后事项的非调整事项**

1、2007年1月9日，本基金以2007年1月4日已实现的可分配收益为基准，对基金持有人分配的红利为每10份基金份额4.00元。

2、2007年1月16日，本基金以2007年1月 10 日已实现的可分配收益为基准，对基金持有人分配的红利为每10份基金份额0.86 元。

3、2007年2月5日，本基金以2007年1月31 日已实现的可分配收益为基准，对基金持有人分配的红利为每10份基金份额2.10元。

4、2007年2月13日，本基金以2007年2月 8 日已实现的可分配收益为基准，对基金持有人分配的红利为每10份基金份额0.65 元。

**附注 6．其他重要事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的其他重要事项。

**附注 7．或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**附注 8．承诺事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的承诺事项。

## 七、基金投资组合报告

（一）本报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目名称 | 金额（人民币元） | 占基金资产总值比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 股票投资 | 121,058,812.70 | 85.52% |
| 2 | 债券投资 | 5,864,055.30 | 4.14% |
| 3 | 权证投资 | 0.00 | 0.00% |
| 4 | 银行存款和清算备付金 | 13,405,101.63 | 9.47% |
| 5 | 其它资产 | 1,233,421.54 | 0.87% |
| 6 | 合计 | 141,561,391.17 | 100% |

(二)本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 | | 0.00 | 0.00% |
| B 采掘业 | | 0.00 | 0.00% |
| C 制造业 | 2,557,673 | 50,052,625.26 | 37.05% |
| C0 食品、饮料 | 335,883 | 14,152,141.06 | 10.48% |
| C1 纺织、服装、皮毛 | | 0.00 | 0.00% |
| C2 木材、家具 | | 0.00 | 0.00% |
| C3 造纸、印刷 | | 0.00 | 0.00% |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 243,653 | 5,903,712.19 | 4.37% |
| C5 电子 | | 0.00 | 0.00% |
| C6 金属、非金属 | 1,010,550 | 11,549,300.00 | 8.55% |
| C7 机械、设备、仪表 | 783,887 | 12,367,002.01 | 9.15% |
| C8 医药、生物制品 | 183,700 | 6,080,470.00 | 4.50% |
| C99 其他制造业 | | 0.00 | 0.00% |
| D 电力、煤气及水的生产和供 | | 0.00 | 0.00% |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应业 | | | |
| E 建筑业 | | 0.00 | 0.00% |
| F 交通运输、仓储业 | 100,000 | 1,891,000.00 | 1.40% |
| G 信息技术业 | 25,000 | 977,500.00 | 0.72% |
| H 批发和零售贸易 | 396,888 | 14,721,080.60 | 10.90% |
| I 金融、保险业 | 2,693,049 | 32,465,552.84 | 24.03% |
| J 房地产业 | 1,006,925 | 18,750,054.00 | 13.88% |
| K 社会服务业 | 100,000 | 2,201,000.00 | 1.63% |
| L 传播与文化产业 | | 0.00 | 0.00% |
| M 综合类 | | 0.00 | 0.00% |
| | | | |
| 合计 | 6,879,535 | 121,058,812.70 | 89.61% |

(三)本报告期末基金投资股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数 量（股） | 期末市值（人民币元） | 市值占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002024 | 苏宁电器 | 240,602 | 10,923,330.80 | 8.09% |
| 2 | 000002 | 万 科Ａ | 705,000 | 10,885,200.00 | 8.06% |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 619,969 | 10,142,692.84 | 7.51% |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 1,056,404 | 6,549,704.80 | 4.85% |
| 5 | 600016 | 民生银行 | 616,676 | 6,290,095.20 | 4.66% |
| 6 | 000623 | 吉林敖东 | 183,700 | 6,080,470.00 | 4.50% |
| 7 | 600309 | 烟台万华 | 243,653 | 5,903,712.19 | 4.37% |
| 8 | 600000 | 浦发银行 | 242,000 | 5,157,020.00 | 3.82% |
| 9 | 000869 | 张 裕Ａ | 100,883 | 5,025,991.06 | 3.72% |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 55,000 | 4,830,650.00 | 3.58% |

(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、卖出净值前 20 名的股票明细

| 累计买入金额前 20 名 | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 累计买入金额(元) | 占期末资产净值的比例(%) |
| 1 | 600028 | 中国石化 | 47,835,921.37 | 10.71% |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 29,656,346.10 | 6.64% |
| 3 | 002024 | 苏宁电器 | 27,229,215.84 | 6.10% |
| 4 | 600795 | 国电电力 | 26,061,444.06 | 5.84% |
| 5 | 600088 | 中视传媒 | 23,577,001.21 | 5.28% |
| 6 | 000858 | 五 粮 液 | 22,316,316.63 | 5.00% |
| 7 | 600037 | 歌华有线 | 19,955,445.25 | 4.47% |
| 8 | 000060 | 中金岭南 | 19,926,478.03 | 4.46% |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 9 | 600036 | 招商银行 | 19,413,040.35 | 4.35% |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 17,356,042.55 | 3.89% |
| 11 | 600598 | 北大荒 | 15,860,341.80 | 3.55% |
| 12 | 600831 | 广电网络 | 15,821,331.76 | 3.54% |
| 13 | 600887 | 伊利股份 | 15,312,706.18 | 3.43% |
| 14 | 000617 | S 济 柴 | 14,942,788.90 | 3.35% |
| 15 | 600029 | S 南航 | 14,257,098.73 | 3.19% |
| 16 | 000002 | 万 科Ａ | 13,859,248.45 | 3.10% |
| 17 | 600005 | 武钢股份 | 13,465,747.88 | 3.02% |
| 18 | 600900 | 长江电力 | 13,341,269.68 | 2.99% |
| 19 | 600595 | 中孚实业 | 13,111,250.76 | 2.94% |
| 20 | 000063 | 中兴通讯 | 12,455,687.39 | 2.79% |
| 累计卖出金额前 20 名 | | | | |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 累计卖出金额 | 占期末资产净值的比例(%) |
| 1 | 600016 | 民生银行 | 55,821,452.29 | 12.50% |
| 2 | 600028 | 中国石化 | 48,455,347.27 | 10.85% |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 33,825,784.50 | 7.58% |
| 4 | 600050 | 中国联通 | 31,593,230.81 | 7.08% |
| 5 | 000002 | 万 科Ａ | 31,511,396.53 | 7.06% |
| 6 | 600088 | 中视传媒 | 29,330,459.93 | 6.57% |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 29,129,746.42 | 6.52% |
| 8 | 000898 | 鞍钢股份 | 26,605,015.58 | 5.96% |
| 9 | 600795 | 国电电力 | 24,783,582.47 | 5.55% |
| 10 | 600005 | 武钢股份 | 24,204,475.07 | 5.42% |
| 11 | 002024 | 苏宁电器 | 24,109,209.26 | 5.40% |
| 12 | 600037 | 歌华有线 | 21,019,085.85 | 4.71% |
| 13 | 000858 | 五 粮 液 | 20,746,260.65 | 4.65% |
| 14 | 000060 | 中金岭南 | 19,746,005.80 | 4.42% |
| 15 | 600831 | 广电网络 | 19,425,009.95 | 4.35% |
| 16 | 600875 | 东方电机 | 18,704,991.95 | 4.19% |
| 17 | 600030 | 中信证券 | 16,906,049.94 | 3.79% |
| 18 | 600598 | 北大荒 | 16,619,952.39 | 3.72% |
| 19 | 000617 | S 济 柴 | 15,801,193.67 | 3.54% |
| 20 | 000089 | 深圳机场 | 14,383,943.73 | 3.22% |

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 | 1,113,734,357.81 |
| 卖出股票的收入总额 | 1,300,739,124.58 |

(五)本报告期末债券投资组合

| 债券类别 | 期末市值（人民币元） | 市值占基金资产净值比例 |
|---|---|---|
| 交易所国债投资 | 0.00 | 0.00% |
| 银行间国债投资 | 0.00 | 0.00% |
| 央行票据投资 | 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 | 5,864,055.30 | 4.34% |
| 国家政策金融债券 | 0.00 | 0.00% |
| 其他债券 | 0.00 | 0.00% |
| 债券投资合计 | 5,864,055.30 | 4.34% |

(六)、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的债券明细

| 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 | 125024 | 招商转债 | 4,214,841.70 | 3.12% |
| 2 | 110317 | 营港转债 | 840,766.40 | 0.62% |
| 3 | 110325 | 华发转债 | 808,447.20 | 0.60% |
| 合　　计 | | | 5,864,055.30 | 4.34% |

(六)投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。

2、报告期内投资权证明细如下：

| 权证代码 | 权证名称 | 配售数量（份） | 成本（元） | 获得途径 |
|---|---|---|---|---|
| 031002 | 钢钒 GMC1 | 218750 | 0.00 | 债券分离获得 |
| 580997 | 招行 CMP1 | 1409954 | 0.00 | 股权分置被动持有 |

本报告期内无主动投资的权证。

3、报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4、其他资产构成

| 资产 | 金额(人民币元) |
|---|---|
| 交易保证金 | 550,000.00 |

| | |
|---|---|
| 应收利息 | **18,508.19** |
| 应收申购款 | **590,666.53** |
| 待摊费用 | **74,246.82** |
| 合　计 | **1,233,421.54** |

**5**、基金持有处于转股期的可转换债券明细

| **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** | **110317** | 营港转债 | **840,766.40** | **0.62%** |

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**http://www.ncfund.com.cn**网站的年度报告正文。

## 八、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（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| **4701** | **17,846.73** | **21,090,294.13** | **25.14** | **62,807,194.86** | **74.86%** |

## 九、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 | **442,150,483.39** |
| 本报告期期末基金份额总额 | **83,897,488.99** |
| 本报告期间基金总申购份额 | **192,597,661.97** |
| 本报告期间基金总赎回份额 | **550,850,656.37** |

# 十、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、本报告期内基金管理人发生重大人事变动：

（1）基金经理更换。由于本公司内部人员的工作调整，经新世纪基金管理有限公司临时董事会决议（新基董[2006]3 号文件），免去蒋畅“新世纪优选分红混合型投资基金”基金经理一职。依据中国证监会关于基金管理公司基金经理资格管理的有关规定，聘任曹名长为“新世纪优选分红混合型基金”基金经理。并于 2006 年 7 月 12 日，在指定网站及报刊公开披露。

（2）高级管理人员离任。经新世纪基金管理有限公司二零零六年第四次临时董事会会议通讯表决通过，同意朱灿同志辞去本公司副总经理一职。并于 2006 年 12 月 13 日，在指定网站及报刊公开披露。

本报告期内基金托管人的专门托管部门未发生重大人事变动；

3、本报告期内本基金的投资策略未有改变；

4、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。

**5**、本基金根据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,决定租用国泰君安证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、联合证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、东海证券有限责任公司各一个交易席位。本报告期内新租用新时代证券有限责任公司上海交易所交易席位一个。

本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其席位作为本基金的专用交易席位。基金专用交易席位的选择标准如下：

1） 经营行为稳健规范，内控制度健全；

2） 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3） 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定

要求，提供专门研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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。

**6**、本基金 **2006** 年度通过各证券经营机构的席位买卖证券的交易量及支付的佣金如下：

| 序号 | 券商名称 | **2006** 年度 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 国债交易量(元) | 国债交易量比例(%) | 国债回购交易量(元) | 国债回购交量比例 | 股票交易量(元) | 股票交易量比例(%) | 佣金(元) | 佣金比例(%) |
| **1** | 新时代证券 | **0.00** | **0.00** | **0.00** | **0.00** | **630,651,871.97** | **26.14%** | **495,436.14** | **25.40%** |
| **2** | 东海证券 | **48,760,723.40** | **76%** | **0.00** | **0.00** | **627,844,892.03** | **26.02%** | **514,338.90** | **26.36%** |
| **3** | 东方证券 | **0.00** | **0.00** | **0.00** | **0.00** | **423,637,536.86** | **17.56%** | **347,378.41** | **17.81%** |
| **4** | 国泰君安 | **6,709,682.00** | **11%** | **0.00** | **0.00** | **295,227,832.08** | **12.24%** | **242,016.28** | **12.41%** |
| **5** | 中信证券 | **8,483,087.10** | **13%** | **0.00** | **0.00** | **231,956,450.18** | **9.61%** | **190,115.11** | **9.75%** |
| **6** | 联合证券 | **0.00** | **0.00** | **0.00** | **0.00** | **137,562,258.38** | **5.70%** | **107,643.26** | **5.52%** |
| **7** | 恒泰证券 | **0.00** | **0.00** | **0.00** | **0.00** | **65,767,228.00** | **2.73%** | **53,928.18** | **2.76%** |
| 总计 | | **63,953,492.50** | **100%** | **0.00** | **0.00** | **2,412,648,069.50** | **100%** | **1,950,856.28** | **100%** |

**7**、本报告期内其他重大事项：

| 公告事项 | 信息批露报纸名称 | 披露时间 |
|---|---|---|
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金关于赎回业务的更正公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **1** 月 **13** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金分红公告（第一次） | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **1** 月 **18** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金 **2005** 年第四季度报告 | 中国证券报<br>上海证券报 | **20006** 年 **1** 月 **20** 日 |

| | | |
|---|---|---|
| | 证券时报 | |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金第二次分红公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **2** 月 **10** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金 **2005** 年年度报告摘要 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **3** 月 **30** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金 **2006** 年第一季度报告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **4** 月 **21** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金第三次分红公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **5** 月 **12** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金第四次分红公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **5** 月 **22** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金第五次分红公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **6** 月 **2** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金第六次分红公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **6** 月 **14** 日 |
| 新世纪基金管理有限公司关于增加民生证券为新世纪优选分红基金代销机构的公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **6** 月 **30** 日 |
| 新世纪基金管理有限公司关于更换基金经理的公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **7** 月 **12** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金 | 中国证券报 | **2006** 年 **8** 月 **26** 日 |

| | | |
|---|---|---|
| **2006** 年半年度报告摘要 | 上海证券报<br>证券时报 | |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金关于分红点调整的公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **8** 月 **31** 日 |
| 新世纪优选分红混合型证券投资基金 **2006** 年第三季度报告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **10** 月 **25** 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<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **10** 月 **30** 日 |
| 新世纪基金管理有限公司<br>关于高级管理人员离任的公告 | 中国证券报<br>上海证券报<br>证券时报 | **2006** 年 **12** 月 **13** 日 |

## 十一、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 **3** 月 **28** 日