

信息披露 Disclosure

新华钻石品质企业股票型证券投资基金

[2014] 第一季度报告

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:二〇一四年四月十八日

§ 1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2014年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。投资人风险，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014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 |
| 基金主代码 | 519103 |
| 交易代码 | 519103 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年2月15日 |
| 报告期末基金份额总额 | 634,678,145.24份 |

基金是通过深入研究公司基本面的深入研究，结合宏观经济和行业景气度分析，力图在有效制胜并把握具有良好流动性的股票上，精选具有稳定的股价和较高成长性的钻石品质企业的股票。

投资目标 本基金采自下而上相结合的投策策略，通过在经济周期、行业特征等宏观面的综合分析，调整大类资产配置比例，从而达到降低风险、提高收益的目的。

投资策略 本基金将主要投资于具有稳定价值性和高成长性的上市企业，并进行行业配置。钻石品质企业股票的配置比例不低于股票资产的80%。

业绩比较基准 80%×中证内地消费主题指数+20%×恒生综合指数。

风险收益特征 本基金为股票型基金，具有较高的风险收益品种，预期风险收益较高。

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

| 主要财务指标 | | 报告期(2014年1月1日-2014年3月31日) |
|----------------|--|---------------------------|
| 1.本期已实现收益 | | 21,441,947.63 |
| 2.本期利润 | | -11,637,674.36 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | | -0.0205 |
| 4.期末基金资产净值 | | 678,790,565.18 |
| 5.期末基金份额净值 | | 1.070 |

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申购基金的各项费用(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示的数字。

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

| 阶段 | 净值增长率为① | 净值增长率为② | 业绩比较基准收益率③ | ①-③ | ②-④ |
|-------|---------|---------|------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -2.19% | 1.3% | -6.16% | 0.95% | 3.97% |

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

比率

新华钻石品质企业股票型证券投资基金净值

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2014年3月31日)



注:报告期内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(或基金经理小组)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 |
|-----|--------------------------------|-------------|--------|----|
| 曹晋长 | 基金经理 新华钻石品质企业股票型证券投资基金的基金经理 | 2010-2-3 | - | 17 |

本基金经理曹晋长先生,经济学硕士,历任安信证券有限公司研究员、红塔证券股份有限公司资产管理部研究员、新华基金管理有限公司基金经理助理、新华钻石品质企业股票型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内,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基金管理人按照《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》以及其他有关规定,严格遵守基金合同,忠实履行管理职责,勤勉尽责的履行基金职责,并不存在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 公平交易制度的执行情况

本报告期内,中国证监会颁布的《证券投资基金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”。制度的范围内包括境内上市股票、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,投资操作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,严格执行公平交易制度。

场外交易中,对于不同债券一级市场申购、非公开发行股票购买交易等,中央交易室根据公平交易制度,启动公平交易机制,定期对不同投资组合的交易行为进行公平性评估。

对于大宗交易的公平性判断,我们定期对大宗交易的情况,不论在报告期内是否有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格是否优于市场价格,以及在报告期内是否有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格是否优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.4 报告期内基金的负债情况

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.5 报告期内基金的盈亏情况

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.6 市场展望和投资策略

对于一季度的市场判断,我们认为一定时期内可能还将处于底部徘徊整理阶段,但短期反弹概率较大。理由在于:一是大盘蓝筹为代表的权重股依然位于历史低位;二是经济的超预期下滑将对政策导向形成一定的支撑,从而带动权重股的反弹;三是由于经济较长时期处于结构均衡等方面的原因,市场将持续大幅度上涨也较为困难。但我们仍坚信,市场震荡徘徊很长时间以后,其在2014或2015年的某个时期走出底部泥潭的可能性在不断增加,因此,我们有理由继续保持乐观,除了对于2013年大幅上涨的一些行业和个人以外。

基于上述判断,对2014年一季度以后的操作,我们仍将保持原有较高仓位风格,同时精选个股,兼顾配置的多样性。

4.7 报告期内基金的利润分配情况

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.8 报告期内基金的费用情况

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.9 报告期内基金的税收情况

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.10 报告期内基金的关联交易情况

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.11 报告期内基金的未完成的基金转换情况

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.12 报告期内基金的其他重大事件

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.13 报告期内基金的会计政策、会计估计和会计差错

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.14 报告期内基金的停牌与未停牌情况

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.15 报告期内基金的估值政策和程序

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.16 报告期内基金的代理投票权

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.17 报告期内基金的融资融券交易

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.18 报告期内基金的资产支持证券

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.19 报告期内基金的资产支持证券

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.20 报告期内基金的资产支持证券

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.21 报告期内基金的资产支持证券

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.22 报告期内基金的资产支持证券

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.23 报告期内基金的资产支持证券

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内有投资组合参与的交易所公开竞价的成交价格优于市场价格,“价格优先”原则保证投资组合得到公平的交易机会。

4.24 报告期内基金的资产支持证券

经核查,本报告期内,公司对不同组合不同时间的交易价格和交易量进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入卖出金额及利差剔除金额等多个层面来判断不同投资组合之间是否存在违反公平交易的原则和异常情况,未