

# 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

**重要提示**  
基金管理人、基金托管人及会计师事务所均不存在虚假记载、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。

董事宋宏伟因未能参加董事会,亦未授权给其他董事,独立董事黄林芳因工作原因,不能亲自出席董事会,全权委托独立董事孙茂川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约定,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预示其未来表现。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。

**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:前缀519067,后缀519088  
基金运作方式:契约型开放式  
基金合同生效日:2006年9月16日  
基金募集金额:83,897,488.99份  
基金存续期限: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:采用技术型资产配置策略;寻找品质优良的高成长上市公司及分红能力强的价值型上市公司,并借助国际竞争力比较,寻找具有市场价值优势的个股,确定最终的投资组合。

业绩比较基准:60%\* 中信标普300指数+40%\* 中信国债指数  
风险控制措施:本基金属于中等风险的混合型基金,其风险控制措施从长期平均来看,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  
注册地址:北京市西城区翠明庄路68号大都会大厦32楼  
邮政编码:400010  
法定代表人:蒋钢  
信息披露负责人:乔岩  
联系电话:010-58873895  
传真:010-58873895  
电子邮箱:qiyuan@fund.com.cn  
(四)基金托管人  
法定名称:中国农业银行  
注册地址: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:010-68424119  
传真:010-68424181  
电子邮箱:lianganglo@abcchina.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互联网网址:  
http://www.fund.com.cn  
基金年度报告备置地: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

主要财务指标	2006年	2005年
1.基金本期净收益	67,819,592.99	2,069,286.24
2.基金本期基金份额净收益	0.438	0.0474
3.期末可供分配基金份额收益	24,251,560.00	1,563,286.03
4.期末可供分配基金份额净收益	0.2891	0.0035
5.期末基金资产净值	136,092,119.61	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.本报告期内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	105.91%	0.99%

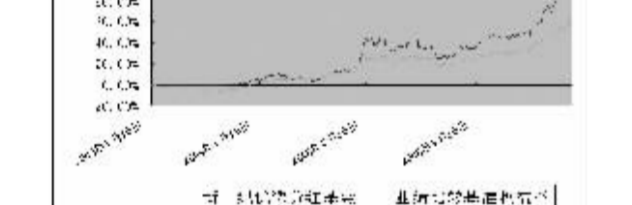
说明:本基金合同生效日为2006年9月16日,2006年度主要财务指标的计算期间为2006年9月16日至2006年12月31日,无完整会计年度。  
(二)基金净值表现  
1.净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

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	44.82%	1.67%	24.53%	0.03%	20.29%	0.64%
过去6个月	52.88%	1.49%	25.96%	0.04%	26.92%	0.65%
过去1年	107.85%	1.49%	63.73%	0.04%	44.12%	0.66%
自基金成立起至今	105.91%	1.21%	59.78%	0.07%	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%\* 中信国债指数  
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:2006年显示的指标计算期间为基金合同生效日2006年9月16日至2006年12月31日。  
(三)自基金合同生效以来每年的基金收益分配表

年度	每10份基金份额的分红次数	备注
2006年6月16日	0.50	
2006年6月07日	0.70	
2006年5月24日	0.80	
2006年5月17日	1.00	
2006年2月14日	0.40	
2006年1月19日	0.20	
合计	3.04	

**三、管理人报告**  
(一)基金管理人及基金经理情况  
1.基金管理人简介  
经中国证券监督管理委员会批准,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《基金管理人资格证书》。  
公司注册资本1.1亿元人民币,其中发起人新华信托投资股份有限公司出资4000万元人民币,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36%,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,具有丰富的实操经验和风险管理经验。  
自成立以来,新世纪基金管理有限公司秉承“以民为本,为理财师”的服务理念,“稳健为本,科学决策”的经营理念,“诚信为本,不断创新”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。  
(二)基金运作的遵规守信情况  
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》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)基金业绩表现  
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%,同期业绩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持续提高。加上人民币升值、外资资源不断流入等因素,将构成下一阶段中国股市的主要动力。因此,从目前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——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速增长投资机会。  
在行业配置上,则重点看好直接受到价值重估推动的地产、金融、受益于消费升级带来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环境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型证券投资基金,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,避免误导性陈述;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,严禁篡改打印销售基金。  
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員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约定,具体到日常监察工作主要有:  
(1)监督公司投资管理人員日常工作流程是否符合《规程》的规定;  
(2)通过公司投资管理人員向监察稽核部备案的材料监督投资管理人員对“世纪分红”基金设立的股票池的投资选股的个人判断是否符合公司《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》的规定;  
(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)每通过交易系统系统监督基金投资比例,对于主动投资造成的超比例现象定期并督促基金经理当日必须进行调整,对于由于份额净值变动造成的超比例现象,在10个交易日及时对基金经理进行调整。  
3.内部控制制度的完善与执行  
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,完善了公司治理结构,提高了公司决策效率,同时对公司内部的各项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部控制体系建设,更强调对内部控制制度的贯彻执行,公司监察稽核稽核部着力加强了内部控制或专项的监督,有计划地对公司市场营销部门、运作保障部门、投资管理部門的有关业务进行了多次全面或专项的监察,确保了公司内部控制制度的有效执行,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,公司各项披露工作均按照《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违法违规问题。  
5.基金投资系统的监督  
为了加强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“进行系统检查,检查内容包括:数据备份情况、信息系统的运行稳定性、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年度经营运作合规稳健,内部控制健全并执行良好,未出现重大风险以及违法违规问题。  
**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,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日的基金投资运作,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前赴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、基金费用开支等项上,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总账账务符合《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,未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。  
**五、审计会计师事务所**  
本基金2006年年度财务会计报告经重庆天健会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了重庆天健审[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

资产项目	附注	2006年12月31日	2006年12月31日
资产:			
银行存款		11,825,867.99	241,854,415.59
清算备付金		1,579,232.64	8,907,547.16
交易保证金		560,000.00	300,000.00
应收证券清算款		0.00	2,254.38
应收利息	(61)	18,508.19	71,542.79
应收申购款		590,665.63	0.00
股票投资	(62)	121,058,812.20	205,079,465.20
其中:股票投资成本		83,340,816.61	201,946,352.34
债券投资		5,864,056.30	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	(64)	74,248.82	141,847.64
合计		141,561,391.17	456,357,062.77
负债:			
应付证券清算款		3,015,221.65	2,323,347.00
应付赎回款		2,338,275.97	6,275,347.00
应付管理费		8,112.88	23,892.46
应付托管费		161,268.49	699,297.23
应付投资费		26,876.42	116,546.65
应付佣金	(65)	509,479.37	317,876.72
应付利息		0.00	0.00
其他应付款	(66)	278,540.42	64,051.90
卖出回购证券款		0.00	0.00
预提费用	(67)	131,506.36	29,078.18
负债合计		6,469,271.56	9,849,438.63
持有人权益:			
实收基金	(68)	83,897,488.99	442,150,483.29
未实现利得	(69)	26,943,070.02	2,793,853.82
未分配收益		24,251,560.00	1,563,286.03
持有人权益合计		136,092,119.61	446,507,624.14
负债及持有人权益总计		141,561,391.17	456,357,062.77

(附注详见财务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			
股票投资收益	(70)	67,738,981.33	2,287,436.29
债券投资收益	(71)	115,761.15	46.47
公允价值变动收益		110,781.76	2,111
存款利息收入		209,009.94	430,586.43
股利收入		997,417.12	0.00
权证投资收益	(72)	1,224,220.70	465,286.05
买入返售证券收入		0.00	1,826,040.00
其他收入	(73)	739,579.33	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		2,542,688.99	2,602,377.88
基金托管费		423,789.96	483,822.09
卖出回购证券支出		0.00	0.00
其他费用	(74)	391,081.29	126,919.69
其中:上市费用		0.00	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		7,560.39	1,663.50
回购交易费用		0.00	36,121.65
其它		0.00	9000.00
费用合计		3,367,548.34	3,162,674.30
三、基金净收益		67,819,592.99	2,069,286.24
加:未实现利得		36,461,816.68	3,133,102.96
加:未分配收益		104,271,409.67	5,202,390.10
四、基金净值变动表 单位:人民币元			
项目	附注	2006年	2005年
一、期初基金份额净值		446,507,624.14	618,818,120.03
二、本年度经营活动			
基金净收益		67,819,592.99	2,069,286.24
基金份额变动		36,461,816.68	3,133,102.96
经营活动产生的基金净值变动数		104,271,409.67	5,202,390.10
三、本年度基金份额变动			
基金申购款		208,565,523.61	478,500.46
基金赎回款		-587,469,762.82	-177,891,404.46
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、年末基金份额净值		1.6102	1.0099
五、期末基金份额净值		136,092,119.61	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。  
(附注详见财务会计报表组成部分)  
(二)资产负债表附注  
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.本报告期末大会计差错  
本报告期末大会计差错  
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
深圳泰丰通讯电子有限公司	基金管理人股东
中国银河证券股份有限公司	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2,542,688.99元,其中已支付人民币2,391,427.50元,尚余人民币161,268.49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423,789.96元,其中已支付人民币396,904.54元,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,占基金总额23.87%,系后收费费,费率:后满1年(含1年)以内,按认购金额1.2%收取;后满持有期1年(不含1年)至3年(含3年)以内,按认购金额0.8%收取;后满持有期3年(不含3年)至5年(含5年)以内,按认购金额0.4%收取;后满持有期5年以上不再收取认购费。本报告期基金均无变动。  
D.关联方持有的银行有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1,579,232.64元,交易保证金余额为560,000.00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.本基金本基金向各关联方支付销售服务费  
附注4.报告期内未通过转让受到限制的基金资产  
截止2006年12月31日,本基金无流通股受限、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说明事项  
1.2007年1月9日,本基金以2007年1月4日已实现的可供分配收益为基础,对基金持有人分配的股利为每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日已实现的可供分配收益为基础,对基金持有人分配的股利为每10份基金份额0.96元。  
3.2007年2月5日,本基金以2007年1月31日已实现的可供分配收益为基础,对基金持有人分配的股利为每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日已实现的可供分配收益为基础,对基金持有人分配的股利为每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)	占基金资产总额比例
1	股票投资	121,058,812.20	88.52%
2	债券投资	5,864,056.30	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	1,232,424.58	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	50,082,626.26	37.96%
C1食品饮料	338,883	14,182,141.06	10.48%
C2纺织服装		0.00	0.00%
C3医药生物		0.00	0.00%
C4化学原料		0.00	0.00%
C5电子		0.00	0.00%
C6电力、煤气及水生产和供应业	243,653	5,903,712.19	4.37%
C7有色金属		0.00	0.00%
C8金属非金属	1,010,550	11,549,300.00	8.55%
C9机械、设备、仪器	783,887	12,397,020.21	9.15%
C10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	100,000	1,891,000.00	1.40%
G信息技术业	25,000	977,500.00	0.72%
H批发和零售业	398,888	14,721,080.00	10.90%
I金融、保险业	2,692,490	42,465,552.84	24.03%
J房地产业	1,006,926	18,790,064.00	13.88%
K社会服务业	100,000	2,301,000.00	1.65%
L传播与文化业		0.00	0.00%
M综合类		0.00	0.00%
合计	6,879,536	121,058,812.20	88.61%

(三)本报告期末基金投资组合明细

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	240,002	10,323,200.00	8.09%
2	000				