

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:二〇一四年三月二十八日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。本年度报告已经全部独立审计,并由会计师事务所出具审计报告。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月27日复核了本年度报告中的财务指标、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预示其未来表现,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。本报告期内基金管理人于2014年1月1日起至12月31日止。

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.1 基金基本情况, 2.2 基金产品说明) and Content.

Table with 2 columns: Item (e.g., 名称, 基金管理人) and Value.

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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

Table with 5 columns: Item, 2013年, 2012年, 2011年, 2010年.

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交易基金的各项费用(例如基金申购赎回费等等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数,为期末余额,不是当期发生数。

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

Table with 5 columns: Period, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④.

注:1. 本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证700指数收益率,债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数收益率,复合业绩比较基准为80%×中证700指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

2. 本基金对业绩比较基准采用每日复平衡的计算方法。
3. 2.2 自基金合同生效后以来基金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

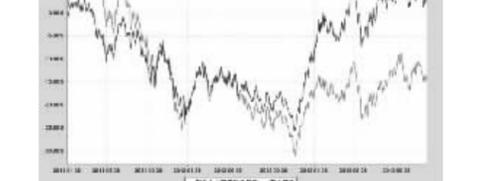


图1:自基金合同生效后以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 自基金合同生效后以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



图2:自基金合同生效后以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

3.3 自基金合同生效后以来基金的利润分配情况
本基金于2011年12月31日,新华基金管理有限公司旗下管理着十四只开放式基金,即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、新华资源优选灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮动股票型证券投资基金、新华中小市值优选股票型证券投资基金、新华灵活主题股票型证券投资基金、新华优选消费股票型证券投资基金、新华纯债债券型证券投资基金、新华行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航股票型证券投资基金、新华安享惠金定期开放灵活配置证券投资基金、新华优选回报混合型证券投资基金、新华信用增利债券型证券投资基金。

4.1.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的职责分工

Table with 4 columns: Name, Position, Term, Description.

注:1. 此处的任职日期和离任日期均指公告作出决定之日为始。

2. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

3. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

4. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

5. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

6. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

7. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

8. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

9. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

10. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

11. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

12. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

13. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

14. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

15. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

16. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

17. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

18. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

19. 基金经理的离任日期指公告作出决定之日为始。

新华中小市值优选股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

下降,但是增长的质量将优化,股票市场不存在整体性大幅上涨的行情,但结构性行情、阶段性行情仍有挖掘空间。

2014年一季度,由于2月份IPO暂停,银行年初有信贷冲动,市场会出现阶段性反弹。市场机会主要来自三个方面,一是大众消费品,如医药、食品饮料等行业的优质公司;二是传统产业公司和“新经济”模式结合后带来的估值提升机会;三是临近两会,一些受益于相关新政策出台的公司可能有投资机会。

4.6 管理人对于估值流程等有关事项的说明
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

1. 接受监管机构对于所投资证券价格异常波动的问询;
2. 对拟定价证券价格异常波动证券,退市证券提供估值建议;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.4 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.5 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.6 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.7 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.8 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.9 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.10 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.11 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.12 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.13 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.14 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.15 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.16 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.17 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.18 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.19 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.20 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.21 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.22 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.23 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.24 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.25 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.26 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.27 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.28 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.29 监察稽核部的职责分工
① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

3. 评估并确认基金会计提供的估值报告;
4. 向估值工作小组提供任何其他认为可能的估值信息。

4.6.1.30 中央交易室的职责分工
① 对基金会计的证券价格信息需求做出及时响应;
② 确保基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

报告附注为财务报表的组成部分
本报告页码以1至74,财务报表由下列负责人签署:
基金管理人:基金管理人:陈重,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐瑞峰
7.4.1 报表附注
7.4.1.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。
7.4.2 差错更正的说明
本基金报告期内未发生会计差错更正。
7.4.3 关联方关系

Table with 2 columns: Party Name, Relationship with the Fund.

注:本报告期内,本公司原有股东陕西西潼投资有限公司将其持有的30%股权、上海大众环境产业有限公司将其持有的13.75%股权转让给恒泰证券股份有限公司,并已完成证监会审批和工商变更登记手续。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.4.1.1 股票交易
本报告期及上年度可比期间,本基金均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.1.2 权证交易
本报告期及上年度可比期间,本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 债券交易
本报告期及上年度可比期间,本基金均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.4.1.4 债券回购交易
本报告期及上年度可比期间,本基金均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.4.1.5 支付关联方款项
本报告期及上年度可比期间,本基金均未支付关联方的款项。

7.4.4.2 关联方佣金
7.4.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日, 上年度可比期间2012年1月1日至2012年12月31日.

注:本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日支付。

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。

7.4.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日, 上年度可比期间2012年1月1日至2012年12月31日.

注:本基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本报告期及上年度可比期间,本基金未进行银行间债券(含回购)交易。

7.4.4.4 关联方投资本基金的情况
7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期及上年度可比期间,本基金管理人未运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.4.4.2 报告期末基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期及上年度末,除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.4.5 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

Table with 4 columns: Party Name, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日, 上年度可比期间2012年1月1日至2012年12月31日.

7.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
本基金在本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.4.7 其他关联方交易事项的说明
本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联方交易事项。

7.4.5 利润分配情况
本基金本报告期及上年度可比期间无收益分配事项。

7.4.6 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
截至报告期末本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

7.4.6.2 期末持有的回购质押等流通受限证券
本基金本报告期末未持有回购质押等流通受限证券。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末未有交易所市场债券正回购。

§8 投资组合报告
8.1 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

Table with 3 columns: Category, Amount, Percentage of Net Assets.

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

Table with 3 columns: Industry, Amount, Percentage of Net Assets.

8.3 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

Table with 4 columns: Stock Code, Stock Name, Quantity, Fair Value.

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于http://cnfund.com.cn网站的年度报告正文。

8.4 报告期末股指期货投资的重大变动
8.4.1 买入股指期货投资情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Stock Code, Stock Name, Amount, Percentage of Net Assets.

注:本项“买入金额”均按买入成交金额(成交均价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 卖出股指期货投资情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Stock Code, Stock Name, Amount, Percentage of Net Assets.

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交均价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2.1 买入股指期货投资情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Stock Code, Stock Name, Amount, Percentage of Net Assets.

注:本项“买入金额”均按买入成交金额(成交均价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2.2 卖出股指期货投资情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: Stock Code, Stock Name, Amount, Percentage of Net Assets.

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交均价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

Table with 4 columns: Stock Code, Stock Name, Amount, Percentage of Net Assets.

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交均价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 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

Table with 2 columns: Item, Amount.

注:本项“买入股票的成本(成交)总额”与“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额(成交均价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
本报告期末本基金无债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本报告期末本基金无债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持投资。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本报告期末本基金无权证投资。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本报告期末本基金无股指期货投资。

8.9.2 本基金投资的股指期货的投资政策
本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
8.10.1 本基金投资的国债期货的投资政策
本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本报告期末本基金无国债期货投资。

8.10.3 本基金投资的国债期货的投资政策
本报告期末本基金无国债期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的期权投资情况
本报告期末本基金无期权投资。

8.11.1 报告期末本基金投资的期权前十名证券没有中国证监会立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.11.2 报告期末本基金投资的期权前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

8.11.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with 3 columns: Item, Amount, Percentage of Net Assets.

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本报告期末本基金持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

Table with 4 columns: Item, Amount, Percentage of Net Assets.

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况
单位:份

Table with 3 columns: Item, Amount, Percentage of Net Assets.

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有该只基金(市值)份额总量的数量区间为10-50万份;该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0万份。

§10 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: Item, Amount.

减:本报告期间基金总申购份额
本报告期间基金赎回份额

§11 重大事件揭示
11.1 基金份额持有人大会决议
本报告期末未召开基金份额持有人大会。

11.2 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
基金管理人专门基金托管部门的重大人事变动:2013年1月18日,因工作调动,孙枝来先生辞去新华基金管理有限公司总经理一职,2013年3月22日,因工作调动,张宗友先生担任新华基金管理有限公司总经理一职。

基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动:本基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀萍为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变
本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
本报告期,本基金未发生改聘会计师事务所情况。2013年7月,国富浩华会计师事务所更名为瑞华会计师事务所(特殊普通合伙),报告年度支付给该报酬80000元/年,审计年限为1年,自2011年至2013年,瑞华会计师事务所为本基金连续提供3年审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
本报告期末基金管理人及其副总经理、督察长由于旗下部分基金采取尾市集中下单方式,致使相关投资价格异动,收到重庆证监局监管谈话的决定。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
11.7.1 基金租用证券公司交易