新华中小市值优选混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十六日

§1 重要提示

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。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2016年3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。

本报告财务材料已经审计。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华中小市值优选混合
基金主代码	519097
交易代码	519097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月28日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	302,085,503.80份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资,力求实现基金净值增长率持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金以合理价格成长选股策略(GARP)为核心,精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证700指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

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		新华基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	田青
	联系电话	010-88423386	010-67595096
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	010-67595096
传真		010-88423310	010-66275865

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	68,178,798.54	51,520,568.18	91,993,132.54
本期利润	68,862,357.67	46,235,911.76	68,245,479.05
加权平均基金份额本期利润	0.9192	0.3662	0.2180
本期基金份额净值增长率	80.87%	34.68%	19.31%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.7337	0.3985	0.0376
期末基金资产净值	534,736,638.18	114,041,223.98	192,881,449.30
期末基金份额净值	1.770	1.398	1.038

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(例如基金申购费赎回费等),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

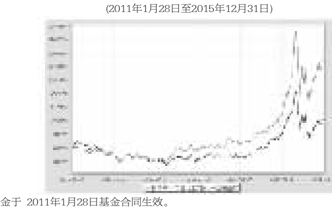
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.30%	1.61%	18.26%	1.61%	8.04%	0.00%
过去六个月	2.70%	2.61%	-11.46%	2.54%	14.16%	0.07%
过去一年	80.87%	2.39%	28.04%	2.23%	52.83%	0.16%
过去三年	190.64%	1.61%	83.15%	1.54%	107.49%	0.07%
自基金合同生效起至今	152.86%	1.44%	45.65%	1.41%	107.21%	0.03%

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再平衡的计算方法。

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较

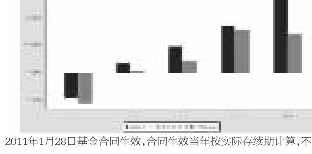
新华中小市值优选混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年1月28日至2015年12月31日)



注:本基金于 2011年1月28日基金合同生效。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华中小市值优选混合型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金于 2011年1月28日基金合同生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	7.620	577,339,603.74	8,576,539.31	585,916,143.05	-
2014年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2013年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
合计	7.620	577,339,603.74	8,576,539.31	585,916,143.05	-

§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

新华基金管理股份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2015年12月31日,新华基金管理股份有限公司旗下管理着三十一只开放式基金,即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华惠鑫分级债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华财富金30天理财债券型证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金和新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金。

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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贲兴振	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司基金管理部副总监、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。	2014-01-02	-	8	经济学硕士,8年证券从业经验。历任北京城市系统工程研究中心研究员。贲兴振先生于2007年9月加入新华基金管理股份有限公司,先后负责研究煤炭、电力、金融、通信设备、电子和有色金属等行业,担任过策略分析师、债券分析师。现任新华基金管理股份有限公司基金管理部副总监、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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,新华基金管理股份有限公司作为新华中小市值优选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》、《新华中小市值优选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持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、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,投资指令统一由交易部下达,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,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令,交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内以及5日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明:债券同向交易频率偏低;股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断,即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大,结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生,本报告期内,未发生有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年全年股票市场受资金面和风险偏好波动影响震荡幅度较大,本基金操作上坚持稳中求进,净值波动在同类基金中相对较小。本基金全年收益率位于晨星分类排名前十分之一。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日,本基金份额净值为1.770元,本报告期份额净值增长率为80.87%,同期比较基准的增长率为28.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2016年全年宏观经济较为平稳,行业领热分化,地产、汽车等传统周期先导性行业景气持续不乐观,中游钢铁、化工、水泥整体上仍然存在较大压力,传统消费的纺织服装和商贸零售数据缺乏亮点,而旅游、传媒等新兴消费领域将继续保持较高的景气度。政策稳增长力度会有所增加。从央行在年初的货币政策报告中,我们判断货币政策面临着汇率硬约束,货币政策在现阶段过于宽松会导致贬值压力,不利于汇率的稳定。降低了市场对宽松货币的预期。

在推动供给侧改革的过程中,实体经济将面临短痛,但也孕育着对中长期预期的边际改善。 我们将重点从新型消费、智能制造、信息技术等领域精选个股,把握供给侧改革、国企改革等主题性的阶段投资机会。

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。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、交易部、监察稽核部人员组成。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。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长,运作保障部负责人在基金会计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 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。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。

基金会计认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。

4.6.1.3 投资管理部的职责分工

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 交易部的职责分工

① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应;
② 通知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 评价并确认基金会计提供的估值报告。

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 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求;
④ 评价现行估值方法是否恰当反映证券公允价值的风险;
⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯;
⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金于2015年12月25日本基金已实现的可分配利润,对权益登记在册的本基金份额持有人进行利润分配。每一基金份额享有同等分配权;投资人可以选择现金分红或红利再投资的方式。对于未选择具体分红方式的投资者,本基金默认的分红方式是现金分红。投资人选择红利再投资方式的,现金红利转换为基金份额净值基准日为2015年12月25日,基金份额登记过户日为2015年12月28日。

本报告期共进行一次分红,每10份基金份额分配7.62元,本次分红的权益登记、除权日为2015年12月25日,现金红利发放日为2015年12月29日,分配利润总金额585,916,143.05元。

§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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在新华中小市值优选混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,发现本基金所持有的"齐峰转债"被强制赎回,并通知了基金管理人;基金管理人主动对基金资产的相关损失进行了补偿,未对基金份额持有人利益造成损害。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为585,916,143.05元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师张伟、胡慰签字出具了瑞华审字[2016]01360031号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:新华中小市值优选混合型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:	-	-
银行存款	265,501,522.16	5,054,862.19
结算备付金	1,017,263.33	2,539,545.44
存出保证金	179,521.04	124,224.69
交易性金融资产	334,842,253.13	90,837,341.05
其中:股票投资	334,842,253.13	90,697,427.00
基金投资	-	-
债券投资	-	139,914.05
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	17,600,000.00
应收证券清算款	-	3,422,722.11
应收利息	190,870.92	3,235.33
应收股利	-	-
应收申购款	20,466,153.54	73,837.80
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	622,197,584.12	119,655,768.61
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	49,641,083.10	2,469,730.58
应付赎回款	35,179,105.25	900,907.78
应付管理人报酬	498,637.42	149,103.20
应付托管费	83,106.21	24,850.52
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,546,429.48	1,689,588.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	512,584.48	380,364.55
负债合计	87,460,945.94	5,614,544.63
所有者权益:	-	-
实收基金	302,085,503.80	81,547,473.84
未分配利润	232,651,134.38	32,493,750.14
所有者权益合计	534,736,638.18	114,041,223.98
负债和所有者权益总计	622,197,584.12	119,655,768.61

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.770元,基金份额总额302,085,503.80份。

7.2 利润表

会计主体:新华中小市值优选混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	75,947,411.40	53,711,446.16
1.利息收入	458,840.32	902,269.87
其中:存款利息收入	380,723.37	198,486.89
债券利息收入	187.69	128.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	77,929.26	703,654.68
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	73,462,240.84	58,020,050.40
其中:股票投资收益	72,935,581.22	56,385,055.95
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4.87	0.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	526,654.75	1,634,994.45
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	683,559.13	-5,284,656.42
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,342,771.11	73,782.31
减:二、费用	7,085,053.73	7,475,534.40
1. 管理人报酬	2,325,328.62	2,217,389.10
2. 托管费	387,554.79	369,564.76
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,965,629.29	4,477,415.10
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	406,541.03	411,165.44
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	68,862,357.67	46,235,911.76
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	68,862,357.67	46,235,911.76

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华中小市值优选混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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)	81,547,473.84	32,493,750.14	114,041,223.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,862,357.67	68,862,357.67
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)	220,538,029.96	717,211,169.62	937,749,199.58
其中:1.基金申购款	799,879,248.06	1,203,478,060.27	2,003,357,308.33
2.基金赎回款	-579,341,218.10	-486,266,890.65	-1,065,608,108.75
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)	-	-585,916,143.05	-585,916,143.05
五、期末所有者权益(基金净值)	302,085,503.80	232,651,134.38	534,736,638.18
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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)	185,886,943.81	6,994,505.49	192,881,449.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	46,235,911.76	46,235,911.76
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)	-104,339,469.97	-20,736,667.11	-125,076,137.08
其中:1.基金申购款	58,849,448.61	7,860,458.48	66,709,907.09
2.基金赎回款	-163,188,918.58	-28,597,125.59	-191,786,044.17
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)	81,547,473.84	32,493,750.14	114,041,223.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:陈重,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华中小市值优选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")证监许可[2010]1403号文件"关于核准新华中小市值优选混合型证券投资基金募集的批复",由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于2011年1月4日至1月25日向社会公开募集,首次募集资金总额742,965,884.43元,其中募集净认购资金金额742,773,420.20元,募集资金产生利息192,464.23元,并经国富浩华会计师事务所(特殊普通合伙)浩华验字[2011]第1号验资报告予以验证。2011年1月28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,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书》及《新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%,其中中小市值股票投资占基金股票资产的比例不低于80%,债券投资占基金资产的比例范围为0%-40%,资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为0%-20%,权证投资占基金资产净值的比例范围为0%-3%,现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:80%*中证700指数收益率+20%*上证国债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于2016年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制,根据实际发生的交易和事项,按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的41项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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估计与最近一期年度报告不一致,所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的通知要求,本基金自2015年3月30日起,对交易所市场上市交易或挂牌转让的除实行全价交易的可转换债券和深交所可交换债券、按成本估值的私募债和未上市债券品种以外的固定收益品种估值时,由原来的直接采用交易所收盘价估值变更为采用第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值进行估值。本基金对该会计估计变更采用未来适用法,经测算新估值标准实施日的相关调整对前一估值日基金资产净值的影响未超过0.5%。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

7.4.6 税项

1、印花税

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。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,股权分置改革过程中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号文《关于证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴20%的个人所得税,基金向个人投资者分配股息、红利、利息时,不再代扣个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,股权分置改革过程中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税 [2015] 101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时,对个人持股1年以内(含1年)的,上市公司暂不扣缴个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	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
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东
深圳新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	316,584,331.85	11.07%	-	-

7.4.8.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	231,183.07	9.94%	231,183.07	14.95%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,325,328.62	2,217,389.10
其中:支付销售机构的客户维护费	854,416.80	1,049,727.97

注:基金管理费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。

本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	387,554.79	369,564.76

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。

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间,本基金未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末,除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	265,501,522.16	353,297.37	5,054,862.19	147,451.73

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600960	渤海活塞	2015-10-30	筹划重大资产重组	10.90	2016-03-04	9.81	45,500.00	535,946.26	495,950.00	-
300043	互动娱乐	2015-12-17	重要事项未公告	15.80	-	-	48,021.00	878,979.16	758,731.80	-
002228	合兴包装	2015-08-04	筹划发行股份购买资产	16.88	2016-02-02	17.31	20,000.00	586,400.00	337,600.00	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	拟披露重大事项	56.68	-	-	14,286.00	713,183.70	809,730.48	-
300036	超图软件	2015-10-30	筹划重大事项	39.01	2016-01-15	31.28	38,126.00	959,268.88	1,487,295.26	-
002678	珠江钢琴	2015-12-21	筹划非公开发行股票	17.21	2016-01-19	13.44	60,400.00	1,000,830.33	1,039,484.00	-
300011	鼎汉技术	2015-12-31	筹划非公开发行股票	29.80	2016-01-22	26.82	187,000.00	5,500,891.86	5,572,600.00	-
300104	乐视网	2015-12-07	筹划重大资产重组	58.80	-	-	53,813.00	2,825,351.69	3,164,204.40	-

7.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券7.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末未有银行间市场债券正回购。

7.4.9.2.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未有交易所市场债券正回购。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	334,842,253.13	53.82
	其中:股票	334,842,253.13	53.82
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	266,518,785.49	42.84
7	其他各项资产	20,836,545.50	3.35
8	合计	622,197,584.12	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	202,429,497.84	37.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,747,582.80	1.45
E	建筑业	18,685.00	0.00
F	批发和零售业	22,501,727.45	4.21
G	交通运输、仓储和邮政业	7,521,024.64	1.41
H	住宿和餐饮业	4,766,279.00	0.89
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,059,785.68	5.81
J	金融业	27,211,084.98	5.09
K	房地产业	14,086,202.62	2.63
L	租赁和商务服务业	1,443,495.06	0.27
M	科学研究和技术服务业	7,353,162.40	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	2,097,172.00	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,606,553.66	1.24
S	综合	-	-
	合计	334,842,253.13	62.62

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

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	600741	华域汽车	676,235	11,401,322.10	2.13
2	002009	天奇股份	535,200	11,105,400.00	2.08
3	000523	广州浪奇	697,349	10,516,022.92	1.97
4	601688	华泰证券	524,822	10,349,489.84	1.94
5	603766	隆鑫通用	423,400	10,047,282.00	1.88
6	600588	用友网络	263,700	8,388,297.00	1.57
7	000938	紫光股份	83,100	8,175,378.00	1.53
8	601211	国泰君安	341,100	8,152,290.00	1.52
9	600826	兰生股份	220,000	7,576,800.00	1.42
10	000601	韶能股份	626,300	6,895,563.00	1.29

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600741	华域汽车	17,675,037.54	15.50
2	601318	中国平安	17,153,016.00	15.04
3	600048	保利地产	16,515,994.01	14.48
4	000523	广州浪奇	16,171,009.31	14.18
5	002609	捷顺科技	16,127,032.51	14.14
6	601688	华泰证券	15,538,295.47	13.63
7	600038	中直股份	15,317,044.84	13.43
8	002009	天奇股份	14,078,963.52	12.35
9	601166	兴业银行	13,351,461.18	11.71
10	600588	用友网络	12,369,848.16	10.85
11	300024	机器人	11,714,269.14	10.27
12	603019	中科曙光	11,344,667.00	9.95
13	000555	神州信息	11,219,553.28	9.84
14	300369	绿盟科技	10,803,778.26	9.47
15	600176	中国巨石	10,524,534.20	9.23
16	002594	比亚迪	10,444,243.98	9.16
17	000001	平安银行	10,284,298.02	9.02
18	600570	恒生电子	10,194,119.48	8.94
19	603766	隆鑫通用	10,187,040.00	8.93
20	300075	数字政通	10,093,678.54	8.85
21	601169	北京银行	10,056,055.76	8.82
22	002439	启明星辰	9,872,529.00	8.66
23	002271	东方雨虹	9,824,637.41	8.61
24	000938	紫光股份	9,776,383.46	8.57
25	002675	东诚药业	9,723,082.22	8.53
26	300168	万达信息	8,763,953.12	7.68
27	600302	标准股份	8,687,089.83	7.62
28	601211	国泰君安	8,600,527.28	7.54
29	600992	贵绳股份	8,504,565.25	7.46
30	000002	万 科A	8,421,930.93	7.38
31	601398	工商银行	8,190,092.00	7.18
32	002217	合力泰	8,054,413.97	7.06
33	000678	襄阳轴承	7,878,969.45	6.91
34	600963	岳阳林纸	7,796,532.20	6.84
35	000090	天健集团	7,752,069.83	6.80
36	600835	上海机电	7,701,348.55	6.75
37	300450	先导智能	7,409,419.74	6.50
38	600826	兰生股份	7,396,374.00	6.49
39	603001	奥康国际	7,237,398.00	6.35
40	002152	广电运通	7,097,988.99	6.22
41	000601	韶能股份	7,016,409.41	6.15
42	300295	三六五网	6,923,182.94	6.07
43	300011	鼎汉技术	6,905,453.30	6.06
44	000732	泰禾集团	6,871,806.96	6.03
45	600735	新华锦	6,815,576.00	5.98
46	002347	泰尔重工	6,723,375.00	5.90
47	002304	洋河股份	6,656,706.60	5.84
48	600079	人福医药	6,618,103.67	5.80
49	000776	广发证券	6,587,662.06	5.78
50	300379	东方通	6,579,107.14	5.77
51	601857	中国石油	6,412,582.00	5.62
52	601588	北辰实业	6,339,144.62	5.56
53	600422	昆药集团	6,323,445.82	5.54
54	601601	中国太保	6,323,395.20	5.54
55	000976	*ST春晖	6,305,709.42	5.53
56	000519	江南红箭	6,276,487.16	5.50
57	300072	三聚环保	6,227,211.00	5.46
58	300384	三联虹普	6,152,890.00	5.40
59	300104	乐视网	6,145,274.40	5.39
60	002053	云南盐化	6,137,791.99	5.38
61	300400	劲拓股份	6,023,968.30	5.28
62	300367	东方网力	5,934,625.43	5.20
63	002410	广联达	5,890,424.00	5.17
64	603883	老百姓	5,806,893.65	5.09
65	300167	迪威视讯	5,800,100.88	5.09
66	000428	华天酒店	5,721,216.71	5.02
67	002081	金 螳 螂	5,572,570.43	4.89
68	002690	美亚光电	5,528,817.20	4.85
69	300166	东方国信	5,523,174.00	4.84
70	600476	湘邮科技	5,424,352.50	4.76
71	600446	金证股份	5,411,221.61	4.74
72	002245	澳洋顺昌	5,362,962.50	4.70
73	300274	阳光电源	5,280,029.99	4.63
74	603111	康尼机电	5,255,715.78	4.61
75	603678	火炬电子	5,243,676.00	4.60
76	002593	日上集团	5,126,735.00	4.50
77	002156	通富微电	5,108,080.99	4.48
78	000651	格力电器	5,106,935.70	4.48
79	600298	安琪酵母	4,987,974.70	4.37
80	002236	大华股份	4,972,583.16	4.36
81	000681	视觉中国	4,951,087.00	4.34
82	600660	福耀玻璃	4,941,012.50	4.33
83	600703	三安光电	4,876,215.32	4.28
84	300220	金运激光	4,791,017.11	4.20
85	600400	红豆股份	4,769,452.40	4.18
86	002456	欧菲光	4,761,372.00	4.18
87	600804	鹏博士	4,756,357.00	4.17
88	600028	中国石化	4,650,100.00	4.08
89	002444	巨星科技	4,622,157.22	4.05
90	600587	新华医疗	4,612,730.00	4.04
91	002241	歌尔声学	4,564,511.13	4.00
92	600184	光电股份	4,506,832.20	3.95
93	000547	航天发展	4,455,661.40	3.91
94	300113	顺网科技	4,401,589.88	3.86
95	601009	南京银行	4,351,233.00	3.82
96	600723	首商股份	4,293,238.99	3.76
97	300210	森远股份	4,276,688.18	3.75
98	000596	古井贡酒	4,270,734.14	3.74
99	600198	大唐电信	4,188,417.00	3.67
100	600129	太极集团	4,174,746.20	3.66
101	300332	天壕环境	4,152,493.73	3.64
102	002250	联化科技	4,134,010.30	3.63
103	002171	楚江新材	4,129,449.00	3.62
104	002612	朗姿股份	4,109,418.00	3.60
105	300027	华谊兄弟	4,074,560.00	3.57
106	600266	北京城建	4,035,966.53	3.54
107	600728	佳都科技	4,015,810.28	3.52
108	300253	卫宁健康	3,977,323.00	3.49
109	002294	信立泰	3,976,103.80	3.49
110	300036	超图软件	3,966,704.96	3.48
111	002179	中航光电	3,924,968.82	3.44
112	000488	晨鸣纸业	3,916,338.20	3.43
113	300086	康芝药业	3,910,244.50	3.43
114	000926	福星股份	3,904,165.00	3.42
115	002121	科陆电子	3,894,288.00	3.41
116	002358	森源电气	3,861,761.76	3.39
117	002049	同方国芯	3,818,273.14	3.35
118	600138	中青旅	3,794,674.00	3.33
119	300468	四方精创	3,788,459.00	3.32
120	300155	安居宝	3,785,802.00	3.32
121	600560	金自天正	3,781,401.00	3.32
122	601258	庞大集团	3,718,357.00	3.26
123	002678	珠江钢琴	3,636,947.65	3.19
124	600007	中国国贸	3,632,725.35	3.19
125	600643	爱建集团	3,605,856.96	3.16
126	002751	易尚展示	3,561,439.84	3.12
127	002280	联络互动	3,557,489.00	3.12
128	300439	美康生物	3,540,394.80	3.10
129	002111	威海广泰	3,536,529.60	3.10
130	601988	中国银行	3,532,300.00	3.10
131	600850	华东电脑	3,528,432.00	3.09
132	000400	许继电气	3,523,327.00	3.09
133	601088	中国神华	3,515,828.00	3.08
134	002625	龙生股份	3,498,687.72	3.07
135	002134	天津普林	3,452,421.96	3.03
136	600150	中国船舶	3,436,260.00	3.01
137	601313	江南嘉捷	3,434,160.25	3.01
138	000503	海虹控股	3,400,255.00	2.98
139	300392	腾信股份	3,399,245.00	2.98
140	002153	石基信息	3,395,775.52	2.98
141	600661	新南洋	3,354,715.00	2.94
142	603588	高能环境	3,339,769.80	2.93
143	002104	恒宝股份	3,303,520.60	2.90
144	002686	亿利达	3,272,186.00	2.87
145	600837	海通证券	3,267,440.00	2.87
146	300404	博济医药	3,259,966.63	2.86
147	002312	三泰控股	3,228,603.20	2.83
148	601021	春秋航空	3,227,623.00	2.83
149	600513	联环药业	3,216,478.00	2.82
150	300359	全通教育	3,197,891.20	2.80
151	002465	海格通信	3,168,930.00	2.78
152	002273	水晶光电	3,152,088.00	2.76
153	300065	海兰信	3,151,289.67	2.76
154	600685	中船防务	3,132,589.00	2.75
155	601998	中信银行	3,111,431.00	2.73
156	600881	亚泰集团	3,084,804.00	2.70
157	000671	阳 光 城	3,040,595.81	2.67
158	601933	永辉超市	3,039,896.00	2.67
159	600278	东方创业	3,037,592.00	2.66
160	002396	星网锐捷	3,027,633.00	2.65
161	600894	广日股份	3,023,759.00	2.65
162	002573	清新环境	2,981,712.33	2.61
163	600376	首开股份	2,957,486.00	2.59
164	000333	美的集团	2,956,764.15	2.59
165	600309	万华化学	2,951,336.91	2.59
166	600767	运盛医疗	2,948,880.87	2.59
167	002431	棕榈园林	2,947,705.75	2.58
168	600015	华夏银行	2,935,778.00	2.57
169	002063	远光软件	2,935,621.41	2.57
170	300005	探路者	2,909,570.85	2.55
171	300255	常山药业	2,909,550.00	2.55
172	600654	中安消	2,894,796.92	2.54
173	600222	太龙药业	2,891,353.90	2.54
174	300273	和佳股份	2,883,183.00	2.53
175	000920	南方汇通	2,872,927.00	2.52
176	300045	华力创通	2,862,917.26	2.51
177	002574	明牌珠宝	2,806,788.40	2.46
178	000567	海德股份	2,762,326.00	2.42
179	300133	华策影视	2,761,988.16	2.42
180	600105	永鼎股份	2,758,290.00	2.42
181	601668	中国建筑	2,756,867.00	2.42
182	002665	首航节能	2,751,091.07	2.41
183	300146	汤臣倍健	2,743,394.18	2.41
184	000802	北京文化	2,740,013.99	2.40
185	300059	东方财富	2,733,500.21	2.40
186	600271	航天信息	2,733,177.80	2.40
187	601006	大秦铁路	2,731,206.84	2.39
188	600378	天科股份	2,716,305.69	2.38
189	600280	中央商场	2,709,657.70	2.38
190	600230	沧州大化	2,695,837.00	2.36
191	600343	航天动力	2,666,631.44	2.34
192	000739	普洛药业	2,656,947.00	2.33
193	000155	*ST川化	2,653,603.78	2.33
194	600694	大商股份	2,616,902.60	2.29
195	002022	科华生物	2,585,496.24	2.27
196	002739	万达院线	2,568,067.79	2.25
197	000559	万向钱潮	2,542,484.00	2.23
198	000912	*ST天化	2,522,535.49	2.21
199	000786	北新建材	2,474,292.00	2.17
200	600064	南京高科	2,460,347.50	2.16
201	600036	招商银行	2,439,501.40	2.14
202	300263	隆华节能	2,432,682.61	2.13
203	002504	弘高创意	2,422,969.50	2.12
204	600511	国药股份	2,422,789.36	2.12
205	002112	三变科技	2,413,529.47	2.12
206	300043	互动娱乐	2,413,101.32	2.12
207	300160	秀强股份	2,410,470.26	2.11
208	300041	回天新材	2,398,905.60	2.10
209	600438	通威股份	2,372,436.00	2.08
210	300018	中元华电	2,363,894.40	2.07
211	002400	省广股份	2,353,702.17	2.06
212	000758	中色股份	2,351,132.60	2.06
213	601628	中国人寿	2,348,466.00	2.06
214	300329	海伦钢琴	2,347,414.40	2.06
215	300135	宝利国际	2,346,855.00	2.06
216	600584	长电科技	2,327,547.00	2.04
217	000950	建峰化工	2,309,809.99	2.03
218	000056	皇庭国际	2,293,128.14	2.01
219	002367	康力电梯	2,287,079.11	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。8.4.2 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	601318	中国平安	20,875,258.91	18.31
2	002609	捷顺科技	17,890,937.19	15.69
3	000002	万 科A	15,063,160.88	13.21
4	000001	平安银行	14,712,233.66	12.90
5	600048	保利地产	14,112,607.50	12.38
6	601166	兴业银行	13,053,906.92	11.45
7	002675	东诚药业	12,287,070.47	10.77
8	600038	中直股份	12,029,582.92	10.55
9	300369	绿盟科技	11,709,805.11	10.27
10	300075	数字政通	11,474,341.75	10.06
11	000555	神州信息	11,175,385.90	9.80
12	002271	东方雨虹	10,921,458.12	9.58
13	300024	机器人	10,809,766.66	9.48
14	600570	恒生电子	10,193,388.00	8.94
15	600176	中国巨石	10,123,749.38	8.88
16	600302	标准股份	9,548,264.79	8.37
17	002594	比亚迪	9,403,525.17	8.25
18	300168	万达信息	9,242,556.74	8.10
19	600992	贵绳股份	9,194,861.00	8.06
20	600741	华域汽车	8,779,360.53	7.70
21	603001	奥康国际	8,661,952.19	7.60
22	601169	北京银行	8,288,533.68	7.27
23	603019	中科曙光	8,275,054.49	7.26
24	600079	人福医药	8,127,956.66	7.13
25	601398	工商银行	8,013,631.00	7.03
26	600400	红豆股份	8,010,741.57	7.02
27	002465	海格通信	7,623,548.49	6.68
28	000090	天健集团	7,535,749.42	6.61
29	002439	启明星辰	7,534,214.56	6.61
30	300295	三六五网	7,317,501.00	6.42
31	000651	格力电器	7,313,116.53	6.41
32	600963	岳阳林纸	7,248,809.90	6.36
33	000732	泰禾集团	7,161,538.00	6.28
34	300379	东方通	7,069,581.70	6.20
35	600835	上海机电	6,884,787.19	6.04
36	000976	*ST春晖	6,880,659.26	6.03
37	002081	金 螳 螂	6,634,102.15	5.82
38	601857	中国石油	6,629,879.26	5.81
39	600476	湘邮科技	6,607,590.55	5.79
40	601601	中国太保	6,438,101.00	5.65
41	601588	北辰实业	6,429,483.30	5.64
42	600129	太极集团	6,333,196.29	5.55
43	000776	广发证券	6,292,615.40	5.52
44	600660	福耀玻璃	6,156,400.74	5.40
45	002612	朗姿股份	6,087,616.33	5.34
46	002053	云南盐化	6,060,014.48	5.31
47	002304	洋河股份	6,024,122.58	5.28
48	300072	三聚环保	6,017,309.00	5.28
49	300367	东方网力	5,928,884.76	5.20
50	000678	襄阳轴承	5,800,110.48	5.09
51	000523	广州浪奇	5,755,148.88	5.05
52	002410	广联达	5,735,331.48	5.03
53	002152	广电运通	5,719,345.14	5.02
54	600588	用友网络	5,654,912.23	4.96
55	600587	新华医疗	5,521,413.99	4.84
56	300166	东方国信	5,512,577.86	4.83
57	002156	通富微电	5,301,072.37	4.65
58	600028	中国石化	5,124,606.33	4.49
59	000605	渤海股份	5,043,471.00	4.42
60	300274	阳光电源	5,003,639.76	4.39
61	601688	华泰证券	4,979,708.43	4.37
62	600728	佳都科技	4,913,592.46	4.31
63	600446	金证股份	4,911,348.69	4.31
64	000547	航天发展	4,843,581.22	4.25
65	002111	威海广泰	4,786,888.98	4.20
66	601088	中国神华	4,748,807.13	4.16
67	002112	三变科技	4,630,087.84	4.06
68	000950	建峰化工	4,537,536.24	3.98
69	300220	金运激光	4,453,095.00	3.90
70	002241	歌尔声学	4,433,759.33	3.89
71	000926	福星股份	4,350,089.30	3.81
72	002294	信立泰	4,339,805.72	3.81
73	600422	昆药集团	4,314,462.79	3.78
74	300155	安居宝	4,294,152.00	3.77
75	002121	科陆电子	4,270,419.48	3.74
76	600804	鹏博士	4,241,997.04	3.72
77	300210	森远股份	4,232,000.70	3.71
78	002456	欧菲光	4,227,198.58	3.71
79	300027	华谊兄弟	4,212,862.20	3.69
80	300253	卫宁健康	4,168,237.00	3.66
81	600703	三安光电	4,156,530.25	3.64
82	600560	金自天正	4,138,539.00	3.63
83	300113	顺网科技	4,040,590.80	3.54
84	601258	庞大集团	3,930,277.78	3.45
85	601313	江南嘉捷	3,925,088.75	3.44
86	600222	太龙药业	3,899,386.43	3.42
87	601009	南京银行	3,854,337.40	3.38
88	300400	劲拓股份	3,848,339.36	3.37
89	000596	古井贡酒	3,825,039.91	3.35
90	600184	光电股份	3,824,033.00	3.35
91	600511	国药股份	3,806,189.64	3.34
92	002358	森源电气	3,780,087.40	3.31
93	600661	新南洋	3,733,054.00	3.27
94	002153	石基信息	3,725,438.00	3.27
95	000400	许继电气	3,725,020.28	3.27
96	002049	同方国芯	3,711,905.32	3.25
97	601988	中国银行	3,658,500.00	3.21
98	000488	晨鸣纸业	3,653,743.00	3.20
99	600513	联环药业	3,647,276.86	3.20
100	600643	爱建集团	3,631,024.70	3.18
101	002573	清新环境	3,587,311.36	3.15
102	300104	乐视网	3,567,650.62	3.13
103	300332	天壕环境	3,560,654.99	3.12
104	002009	天奇股份	3,557,738.29	3.12
105	002431	棕榈园林	3,530,502.35	3.10
106	002751	易尚展示	3,512,907.00	3.08
107	600850	华东电脑	3,491,926.00	3.06
108	002236	大华股份	3,487,840.20	3.06
109	300065	海兰信	3,455,266.93	3.03
110	600881	亚泰集团	3,445,603.54	3.02
111	603588	高能环境	3,410,094.52	2.99
112	600584	长电科技	3,404,850.51	2.99
113	601006	大秦铁路	3,389,639.69	2.97
114	002396	星网锐捷	3,377,968.66	2.96
115	002250	联化科技	3,368,876.30	2.95
116	600007	中国国贸	3,358,756.74	2.95
117	002280	联络互动	3,278,968.68	2.88
118	002312	三泰控股	3,250,869.65	2.85
119	002179	中航光电	3,218,903.01	2.82
120	300005	探路者	3,211,439.59	2.82
121	300263	隆华节能	3,201,318.24	2.81
122	600150	中国船舶	3,200,442.35	2.81
123	000920	南方汇通	3,198,252.59	2.80
124	300255	常山药业	3,192,493.50	2.80
125	000786	北新建材	3,168,464.75	2.78
126	002073	软控股份	3,163,721.75	2.77
127	600894	广日股份	3,154,555.70	2.77
128	300439	美康生物	3,134,278.00	2.75
129	000503	海虹控股	3,126,853.78	2.74
130	600654	中安消	3,117,830.29	2.73
131	300059	东方财富	3,102,278.87	2.72
132	000333	美的集团	3,094,609.69	2.71
133	002007	华兰生物	3,069,174.39	2.69
134	600685	中船防务	3,061,441.47	2.68
135	000671	阳 光 城	3,036,212.00	2.66
136	300036	超图软件	3,033,529.79	2.66
137	300273	和佳股份	3,031,050.24	2.66
138	601989	中国重工	3,029,260.00	2.66
139	002301	齐心集团	3,021,784.00	2.65
140	600309	万华化学	3,018,150.10	2.65
141	600767	运盛医疗	3,012,834.62	2.64
142	002104	恒宝股份	2,961,512.45	2.60
143	300045	华力创通	2,950,474.53	2.59
144	002022	科华生物	2,943,558.00	2.58
145	600266	北京城建	2,938,006.58	2.58
146	601998	中信银行	2,928,608.00	2.57
147	300404	博济医药	2,907,498.25	2.55
148	002504	弘高创意	2,872,019.10	2.52
149	002665	首航节能	2,865,004.92	2.51
150	002657	中科金财	2,857,196.00	2.51
151	002556	辉隆股份	2,845,335.48	2.50
152	002355	兴民钢圈	2,841,955.00	2.49
153	000155	*ST川化	2,802,872.24	2.46
154	000628	高新发展	2,782,826.00	2.44
155	300028	金亚科技	2,771,652.00	2.43
156	002656	卡奴迪路	2,765,055.00	2.42
157	300339	润和软件	2,753,407.50	2.41
158	002625	龙生股份	2,736,249.98	2.40
159	300182	捷成股份	2,709,442.24	2.38
160	600378	天科股份	2,703,031.43	2.37
161	600519	贵州茅台	2,702,480.52	2.37
162	002739	万达院线	2,697,948.00	2.37
163	600271	航天信息	2,683,568.00	2.35
164	002707	众信旅游	2,677,187.00	2.35
165	002400	省广股份	2,670,124.00	2.34
166	600486	扬农化工	2,666,695.40	2.34
167	601668	中国建筑	2,665,608.04	2.34
168	000758	中色股份	2,660,697.00	2.33
169	000912	*ST天化	2,653,023.84	2.33
170	600203	福日电子	2,648,336.00	2.32
171	000338	潍柴动力	2,641,511.65	2.32
172	600837	海通证券	2,638,395.94	2.31
173	300329	海伦钢琴	2,622,011.56	2.30
174	002063	远光软件	2,613,329.93	2.29
175	600064	南京高科	2,597,762.51	2.28
176	000971	高升控股	2,590,693.04	2.27
177	600280	中央商场	2,581,749.95	2.26
178	300041	回天新材	2,541,828.00	2.23
179	300135	宝利国际	2,510,564.00	2.20
180	600249	两面针	2,498,333.42	2.19
181	600138	中青旅	2,484,907.63	2.18
182	002344	海宁皮城	2,478,288.20	2.17
183	002385	大北农	2,461,710.00	2.16
184	600105	永鼎股份	2,460,264.80	2.16
185	300018	中元华电	2,458,797.00	2.16
186	002367	康力电梯	2,449,277.10	2.15
187	300160	秀强股份	2,381,956.39	2.09
188	600230	沧州大化	2,365,365.93	2.07
189	600036	招商银行	2,349,799.00	2.06
190	300291	华录百纳	2,327,881.20	2.04
191	600128	弘业股份	2,313,489.66	2.03
192	600784	鲁银投资	2,304,929.81	2.02
193	000988	华工科技	2,296,055.23	2.01
194	002576	通达动力	2,286,632.00	2.01
195	000801	四川九洲	2,281,862.59	2.00

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。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

买入股票的成本(成交)总额	1,514,942,442.51
卖出股票的收入(成交)总额	1,344,448,270.78

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(成交单价乘以数量)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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末无权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资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。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.12015年9月10日,华泰证券(601688)收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》,华泰证券客户中有516个使用homs系统和同花顺系统接入的主账户。对上述客户华泰证券未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息,违反《证券公司监督管理条例》获利18235275元,证监会决定对华泰证券责令改正,给予警告没收违法所得并处以54705825元罚款;对胡智给予警告并处以10万元罚款;对陈栋给予警告并处于10万元罚款。此事项并不影响本基金的投资决策且本基金投资前十名其他标的并不存在类似被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	179,521.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	190,870.92
5	应收申购款	20,466,153.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,836,545.50

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	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
4,349	69,460.91	248,840,319.90	82.37%	53,245,183.90	17.63%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

注:本公司普通从业人员持有本基金份额总量为0份(不包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人)。

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0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份。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年1月28日)基金份额总额	742,965,884.43
本报告期期初基金份额总额	81,547,473.84
本报告期基金总申购份额	799,879,248.06
减:本报告期基金总赎回份额	579,341,218.10
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	302,085,503.80

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内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

2015年2月11日,王卫东先生因个人原因不再担任基金管理人副总经理。

2015年11月30日,沈健先生、林艳芳女士担任基金管理人副总经理。

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知,聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

本基金托管人2015年9月18日发布任免通知,解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

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

本报告期内,本基金未发生改聘会计师事务所情况。报告年度应支付给其报酬80000元人民币。审计年限为1年。自2011年至2015年,瑞华会计师事务所为本基金连续提供5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

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

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单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	530,287,117.32	18.55%	380,535.02	16.36%	-
银河证券	1	365,272,276.82	12.77%	334,074.42	14.36%	-
恒泰证券	2	316,584,331.85	11.07%	231,183.07	9.94%	-
国金证券	1	290,388,859.84	10.16%	265,169.78	11.40%	-
中信建投证券	1	275,622,869.94	9.64%	195,875.00	8.42%	-
中投证券	1	243,164,337.78	8.50%	224,888.35	9.67%	-
申银万国	1	204,860,360.29	7.16%	188,052.08	8.08%	-
国信证券	1	163,875,941.25	5.73%	149,885.41	6.44%	-
安信证券	1	122,582,744.52	4.29%	87,798.17	3.77%	-
方正证券	1	113,386,250.82	3.97%	82,441.03	3.54%	-
新时代证券	1	92,744,632.93	3.24%	84,434.72	3.63%	-
广发证券	1	88,516,587.99	3.10%	64,630.97	2.78%	-
东北证券	1	52,093,956.94	1.82%	37,591.10	1.62%	-

注: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)以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本基金报告期内共租用 16个交易席位,其中 报告期内新增 6个交易席位。新增席位为:恒泰证券上海交易所席位、方正证券上海交易所席位、广发证券上海交易所席位、东北证券上海交易所席位、恒泰证券深圳交易所席位及安信证券深圳交易所席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础,主要考察点包括:

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。

二、交易席位的选择流程

1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。

2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配 交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础,主要考察点包括:

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务,包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等,用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核,由基金经理、研究员和交易员分别打分,根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据,交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
中信建投证券	-	-	283,400,000.00	53.79%	-	-
申银万国	-	-	123,000,000.00	23.34%	-	-
国信证券	-	-	62,500,000.00	11.86%	-	-
新时代证券	-	-	58,000,000.00	11.01%	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

新华基金管理股份有限公司
二〇一六年三月二十六日