

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。本基金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2014年3月27日复核了本报告中的财务数据、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摘要。

本年度报告需要摘要年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2012年12月31日止。

§2基金简介

新华中小市值优选股票型证券投资基金

519977

519977

契约型开放式

2011年1月28日

新华基金管理有限公司

中国建设银行股份有限公司

185,886,943.81份

不定期

2.1基金基本情况
基金简称
基金代码
交易代码
基金运作方式
基金合同生效日
基金管理人
基金托管人
报告期末基金份额总额
基金合同存续期

新华中小市值优选股票型证券投资基金
519977
519977
契约型开放式
2011年1月28日
新华基金管理有限公司
中国建设银行股份有限公司
185,886,943.81份
不定期

2.2基金产品说明
投资目标
投资策略
业绩比较基准
风险收益特征

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，力求实现基金净值持续稳定的超越比较基准。

本基金以合理价格选股策略(GARP)为核心，精选各行业中具有高成长且价格合理的中小市值股票进行投资。

80%≤中证700指数收益率+20%≤上证国债指数收益率

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的高风险收益品种，预期风险和收益均高于股票型基金和债券型基金。

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
新华基金管理有限公司
中国建设银行股份有限公司
姓名
尹芳
田青
信息披露负责人
联系电话
010-88423386
010-67595096
电子邮件
qyan@nfcfund.com.cn
tianqing1.zghccb.com
客户服务电话
4008198866
010-67595096
传真
010-88423310
010-66275865

2.4信息披露方式
登载基金年度报告的管理人互联网网址
www.nfcfund.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	2013年	2012年	2011年1月29日至2011年12月31日
本期实现收益	91,993,132.54	-70,891,821.36	-26,828,786.29
本期利润	68,245,479.05	24,919,344.22	-91,020,560.73
加权平均基金份额本期利润	0.21801	0.0543	-0.1680
本期基金份额净值增长	19.31%	6.75%	-18.50%

3.1.2期间数据和指标
期末可供分配利润

0.0376 -0.2025 -0.1846

期末基金资产净值

192,881,449.30 369,724,989.18 403,644,402.25

期末基金份额净值

1.038 0.870 0.815

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;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(例如基金申购赎回费等),计入申购后实际收益可能低于所列数字。

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净损益的孰低数(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

7.1资产负债表
会计主体:新华中小市值优选股票型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

阶段	份额净值增长 率 增长 率 单 位 (①) 长 期 单 位 (②)	份额净值 增长 率 长 期 单 位 (③) 基 准 收 益 率 基 准 收 益 率 单 位 (④)	业绩比较基 准 收 益 率 基 准 收 益 率 单 位 (⑤) 基 准 收 益 率 基 准 收 益 率 单 位 (⑥)	①-③ (②-④)	②-④ (③-⑤)	
过去三个月	0.97%	0.99%	-1.0%	1.00%	2.00%	-0.07%
过去六个月	9.73%	1.02%	11.88%	1.00%	-2.16%	-0.07%
过去一年	19.31%	1.15%	9.00%	1.13%	10.31%	0.00%
自基金合同 生效以来	3.80%	1.12%	-13.11%	1.16%	17.11%	-0.04%

注:1.本基金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.本基金对利润分配的计算方法。

3.2.2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

新华中小市值优选股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图
(2011年1月28日至2013年12月31日)

新华中小市值优选股票型证券投资基金
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

新华中小市值优选股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图
(2011年1月28日至2013年12月31日)

新华中小市值优选股票型证券投资基金
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图