

# 新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

## 重要提示

新华中小市值优选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2010年10月12日证监许可【2010】1403号核准募集。本基金的基金合同已于2011年1月28日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购或申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2017年1月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年12月31日（财务数据未经会计师事务所审计）。

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

## 一 基金管理人

### （一）基金管理人概况

1、名称：新华基金管理股份有限公司

- 2、住所：重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层
- 3、设立日期：2004年12月9日
- 4、法定代表人：陈重
- 5、办公地址：北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座  
重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层；
- 6、电话：010—68779666  
传真：010—68779528
- 7、联系人：齐岩
- 8、注册资本：21,750万元人民币
- 9、股权结构：  
出资单位 出资额（万元） 占注册资本金比例  
恒泰证券股份有限公司 12,750 58.62%  
新华信托股份有限公司 7,680 35.31%  
杭州永原网络科技有限公司 1,320 6.07%  
合计 21,750 100%

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

陈重先生：董事长，金融学博士。历任原国家经委中国企业管理协会研究部副主任、主任；中国企业报社社长；中国企业管理科学基金会秘书长；重庆市政府副秘书长；中国企业联合会常务副理事长；享受国务院特殊津贴专家。现任新华基金管理股份有限公司董事长。

张宗友先生：董事，硕士。历任内蒙古证券有限责任公司营业部经理、人事部经理；太平洋证券股份有限公司副总经理，分管经纪业务；恒泰证券股份有限公司副总经理，分管人力资源、信息技术、经纪业务等事务。现任新华基金管理股份有限公司总经理。

胡三明先生：董事，博士。曾就职于中国太平洋财产保险股份有限公司、泰康资产管理有限公司、合众资产管理有限公司、中英益利资产管理公司，历任泰康资产管理有限公司资产负债管理部组合经理、合众资产权益投资部高级投资经理、中英益利资产管理公司权益投资部总经理，现任恒泰证券股份有限公司投资总监。

于芳女士：董事。历任北京市水利建设管理中心项目管理及法务专员、新时代证券有限责任公司总经理助理、副总经理。现任恒泰证券股份有限公司合规总监。

胡波先生：独立董事，博士，历任中国人民大学财政金融学院教师、中国人民大学风险投资发展研究中心研究员、副主任、执行主任，现任中国人民大学财政金融学院副教授。

张贵龙先生：独立董事，硕士，历任山西临汾地区教育学院从事教育学、管理学课程的教学工作。现任职于北京大学财务部。

宋敏女士：独立董事，硕士，历任四川省资阳市人民法院法官、中国电子系统工程总公司法务人员、北京市中济律师事务所执业律师，现任北京东清律师事务所合伙人。

## 2、基金管理人监事会成员

刘淑飞女士：监事会主席，硕士。历任航天科工财务公司结算部经理、航天科工财务公司风险管理部经理，航天科工财务公司总会计师、总法律顾问、董秘、副总裁，华浩信联（北京）科贸有限公司财务总监，现任恒泰证券股份有限公司财务总监。

张浩先生：职工监事，硕士。历任长盛基金管理有限公司信息技术部副总监，长盛基金管理有限公司风险管理部副总监，合众资产管理股份有限公司风险管理部总监，房宝信业（北京）投资管理有限公司总经理。现任新华基金管理股份有限公司监察稽核部总监。

别冶女士：职工监事，金融学学士。十年证券从业经验，历任《每日经济新闻》、《第一财经日报》财经记者，新华基金媒体经理，现任新华基金总经理办公室主任助理。

## 3、高级管理人员

陈重先生：董事长，简历同上。

张宗友先生：总经理，简历同上。

徐端骞先生：副总经理，学士。历任上海君创财经顾问有限公司并购部经理、上海力矩产业投资管理有限公司并购部经理、新时代证券有限责任公司投行部项目经理、新华基金管理股份有限公司总经理助理兼运作保障部总监。现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

晏益民先生：副总经理，学士。历任大通证券投行总部综合部副总经理，泰信基金机构理财部总经理，天治基金北京分公司总经理，天治基金总经理助理，新华基金总经理助理，现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

沈健先生：副总经理，硕士。历任嘉实基金管理有限公司机构客户部高级客户经

理、海富通基金管理有限公司渠道副总监、天治基金管理有限公司市场总监、纽银梅隆西部基金管理有限公司渠道销售副总监、华商基金管理有限公司渠道业务部门总经理，现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

齐岩先生：督察长，学士。历任中信证券股份有限公司解放北路营业部职员、天津管理部职员、天津大港营业部综合部经理，现任新华基金管理股份有限公司督察长兼任子公司北京新华富时资产管理有限公司董事。

崔建波先生：副总经理，经济学硕士。历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、海融资讯系统有限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究部、理财服务部经理、北方国际信托股份有限公司投资部信托高级投资经理、新华基金管理股份有限公司总经理助理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、基金管理部总监、基金经理。

#### 4、本基金基金经理

##### （1）历任基金经理

王卫东先生：管理本基金时间：2011年1月28日到2012年3月27日。

桂跃强先生：管理本基金时间：2011年7月12日到2014年1月2日。

贲兴振先生：管理本基金时间：2014年1月2日到2016年6月28日。

##### （2）现任基金经理

付伟：西安交通大学工学硕士，北京大学工商管理硕士，7年证券从业经验。历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理，新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与TMT组组长，先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。现任新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选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。

#### 5、投资管理委员会成员

主席：总经理张宗友先生；成员：副总经理兼投资总监、权益投资部总监崔建波先生、投资总监助理于泽雨先生、研究部总监张霖女士、金融工程部副总监李会忠先生、固定收益与平衡投资部总监姚秋先生、基金经理付伟先生。

#### 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2016年一季度末，中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。

中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。
3. 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。
4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

### 三 相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、场外发售机构

###### （1）直销机构：

新华基金管理股份有限公司北京直销中心

办公地址：北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座

法定代表人：陈重

联系人：王志强

电话：（010）68730999

传真：（010）68731199

客服电话：400-819-8866

网址：[www.ncfund.com.cn](http://www.ncfund.com.cn)

电子直销：新华基金网上交易平台

网址：<https://trade.ncfund.com.cn>

###### （2）其他销售机构

##### 1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：张静

客服电话：95533

公司网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

##### 2) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

联系人：唐文勇

客服电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

3) 北京银行股份有限公司

北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街丙 17 号首层

法定代表人：闫冰竹

联系人：孔超

客服电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

4) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

联系人：廉赵峰

客服电话：95558

网址：[www.bank.ecitic.com](http://www.bank.ecitic.com)

5) 平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

客服电话：95511-3

网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

6) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：王硕

客服电话：95580

公司网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

7) 华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：徐昊光

客服电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

8) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：杨菲

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

9) 重庆银行股份有限公司

住所：重庆市渝中区邹容路 153 号

法定代表人：甘为民

客服电话：96899（重庆地区）400-70-96899（其他地区）

网址：www.cqcbank.com

10) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

11) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：唐苑

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

12) 浙商银行股份有限公司

住所：杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

联系人：毛真海

客服电话：95527

网址：www.czbank.com

13) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：朱雅威、芮敏祺

客服电话：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

14) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 698 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

客服电话：95553

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

15) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

客服电话：95587

网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

16) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：邓颜

客服电话：400-888-8888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

17) 新时代证券股份有限公司

住所：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：田德军

联系人：田芳芳

客服电话：400-698-9898

公司网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

18) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

联系人：李颖

客服电话：95536

网址: [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

19) 华安证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人: 李工

联系人: 甘霖

客服电话: 96518 (安徽) 400-80-96518 (全国)

网址: [www.hazq.com](http://www.hazq.com)

20) 恒泰证券股份有限公司

住所: 内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人: 庞介民

联系人: 熊丽

客服电话: 400-196-6188

网址: [www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

21) 中泰证券股份有限公司

住所: 济南市经七路 86 号

法定代表人: 李玮

联系人: 吴阳

客服电话: 95538

网址: [www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

22) 民生证券股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人: 余政

联系人: 赵明

客服电话: 400-619-8888

公司网站: [www.msza.com](http://www.msza.com)

23) 东北证券股份有限公司

住所: 长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 杨树财

联系人: 安岩岩

客服电话: 400-600-0686

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

24) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座

办公地址：北京朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

25) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

客服电话：95548

联系人：吴忠超

网址：www.citicssd.com

26) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

27) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

28) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张宗锐

客服电话：0591-96326

网址：www.hfzq.com.cn

29) 中国民族证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：赵大建

联系人：李微

客服电话：400-889-5618

网址：www.e5618.com

30) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：鹿馨方

客服电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

31) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

32) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

33) 方正证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

客服电话：95571

网址：www.foundersc.com

34) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

客服电话：95565

网站：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

35) 平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

联系人：石静武

客服电话：95511-8

网址：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

36) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：李良

客服电话：95579 或 4008-888-999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

37) 申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：钱达琛

客服电话：95523 或 4008895523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

38) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

联系人：梅文焯

客服电话：400-800-1001

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

39) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区陕西街 239 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：张曼

客服电话：95584

网址: [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

40) 嘉实财富管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

办公地址: 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人: 赵学军

联系人: 余永健

客户服务电话: 400-021-8850

网址: [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

41) 中信期货股份有限公司

住所: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人: 张皓

联系人: 洪诚

客服电话: 400-990-8826

网址: [www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

42) 华龙证券股份有限公司

住所: 兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心

法定代表人: 李晓安

联系人: 李昕田

客服电话: 400-689-8888、0931-96668

网址: [www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

43) 天相投资顾问有限公司

注册地址: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人: 林义相

客户服务热线: 010-66045678

联系人: 尹伶

网址: [www.txsec.com](http://www.txsec.com)

44) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

45) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

联系人：张裕

网址：www.noah-fund.com

46) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：胡凯隽

客户服务电话：400-700-9665

公司网址：www.howbuy.com

47) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

联系人：丁姗姗

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com

48) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn, www.jjmmw.com

49) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：唐诗洋

客服电话：400-089-1289

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

50) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦

法定代表人：王莉

客服电话：4009-200-022

联系人：刘洋

公司网站：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

51) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21&28 层

联系人：殷雯

法定代表人：蒋煜

客服电话：400-818-8866

网址：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

52) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-678-5095

联系人：盛海娟

公司网站：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

53) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-888-6661

联系人：马林

公司网站：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

54) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址: 浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人: 凌顺平

联系人: 林海明

客服电话: 4008-773-772

公司网站: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

55) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人: 梁越

联系人: 张晔

客服电话: 4007-868-868

公司网站: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

56) 北京增财基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人: 罗细安

联系人: 张蕾

客服电话: 400-001-8811

公司网站: [www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

57) 一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址: 北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

办公地址: 北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人: 吴雪秀

联系人: 刘栋栋

客服电话: 400-001-1566

网址: [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

58) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712 号

法定代表人: 梁蓉

联系人: 李婷婷

客服电话：400-6262-818

公司网站：www.5irich.com

59) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 国际企业大厦 C 座 9 层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

客服电话：400-166-1188

网址：8.jrj.com.cn

60) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：何雪

客服电话：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

61) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：钟琛

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

62) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：葛佳蕊

客服电话：4000-178-000

网址：www.lingxianfund.com

63) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层

法定代表人：董浩

联系人：于婷婷

客服电话：400-068-1176

网址：[www.jimu.com](http://www.jimu.com)

64) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

法定代表人：彭运年

联系人：仲甜甜

客服电话：4008-909-998

网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

65) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115、1116、1307室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：项晶晶

客服电话：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

66) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

联系人：孙成岩

客服电话：400-068-0058

网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

67) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

客服电话：4000-466-788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

68) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

联系人：曹怡晨

客服电话：400-067-6266

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

69) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

客服电话：010-62675369

公司网站：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

70) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

71) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

汇付网站：<https://tty.chinapnr.com>

汇付客服热线：400-820-2819

72) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

客服电话：个人业务：95118 企业业务：400 088 8816

网址：<http://fund.jd.com>

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金

并及时公告。具体名单见基金份额发售公告。

#### （二）基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系人：朱立元

电话：（010）59378839

传真：（010）59378907

#### （三）律师事务所与经办律师

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系人：陆奇

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：安冬、陆奇

#### （四）会计师事务所与经办注册会计师

会计师事务所：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层

法定代表人：杨剑涛

电话：010—88095588

传真：010—88091199

经办注册会计师：张伟、胡慰

联系人：胡慰

#### 四 基金的名称

本基金名称：新华中小市值优选混合型证券投资基金。

#### 五 基金的类型

基金类型：契约型开放式。

#### 六 基金的投资目标

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。

## 七 基金的投资方向

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%。

如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

## 八 基金的投资策略

（一）资产配置策略：本基金采用战略性资产配置与战术性资产配置相结合的策略，即在各类资产的投资比例范围内，持续评估各类资产的风险收益状况，并据此动态调整资产配置比例，以从变化的市场环境下最大程度地获利。

资产配置策略重点考虑以下四个因素：一是宏观经济因素；二是估值因素；三是制度和政策变化因素；四是市场情绪因素。

（二）股票投资策略：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。

### 1、中小市值股票的界定

本基金所指的中小市值股票是申银万国一级行业划分标准下各行业内的中小市值股票。

本基金将定期及不定期对备选股票进行调整。基金管理人每半年按照申银万国一级行业划分标准对 A 股市场的所有股票进行分类，按总市值将各行业中的样本股从小到大进行排序并累加，取累计市值占各行业总市值 70%以下且累计股票数量不超过各行业股票数量 2/3 的股票作为备选股票。对于由于上市公司重组、合并、分立、新股上市或其他因素等导致的股票市值变化，本基金管理人将根据以上标准及时调整。

如申银万国一级行业划分标准暂停或终止发布，基金管理人有权在与基金托管人协商一致后，根据本基金的投资目标及投资策略，以维护基金份额持有人利益为原则，选择新的中小市值股票界定标准。

### 2、合理价格成长选股策略（GARP）

GARP (Growth At Reasonable Price) 是国际上普遍应用的选股策略，其核心思想是以相对较低的价格买入成长性较高的公司股票，综合运用成长性指标和价值性指标对股票进行筛选。

#### (1) 定量分析

##### I. 成长性指标

i. 营业收入增长率。该指标所隐含的往往是企业市场份额的扩大，体现公司未来盈利潜力的提高，盈利稳定性的加大，公司持续成长能力的提升。本基金选取过去两年的平均营业收入增长率。

ii. 净利润增长率。该指标反映上市公司的盈利能力和盈利增长情况，是衡量上市公司经营效益的主要指标。本基金选取过去两年的平均净利润增长率。

iii. 净资产收益率。该指标着眼于企业整体的经营效率，充分反映投资者投入企业的自由资本获取收益的能力。本基金选取过去两年平均净资产收益率。

##### II. 价值性指标

价值性指标是基于上市公司的估值水平而确定的，本基金主要选取市盈率倒数 (E/P)、市净率倒数 (B/P) 以及 PEG 指标作为企业价值性的考察指标。

##### III. 综合评分

本基金采用加权评分法，根据各指标的重要性、影响力以及包含信息量的大小设定相应权数，在此基础上对各指标分值进行加权汇总得到股票的综合评分。本基金将重点投资于综合评分排名居前的股票。

#### (2) 定性分析

##### I. 盈利能力的稳定性和持续性

主要分析公司盈利的构成、盈利主要来源、公司盈利模式和扩张方式等。

##### II. 核心竞争力

主要分析上市公司是否拥有领先的核心技术，该技术是否具备一定的竞争壁垒；是否具备较强的自主研发能力和技术创新能力；未来公司主业的产品线是否存在进一步延伸的可能；在所属的细分行业是否已经拥有较高的市场份额、较为强大的品牌和良好的口碑等。

##### III. 法人治理结构及管理层能力

主要分析公司股权结构是否规范；是否建立了有效的股东大会制度以保障中小股东利益；董事会权利的合理界定与约束；管理层对公司的控制力如何；公司是否建立了对管理层有效的激励和约束机制；管理层是否具有良好的诚信度；管理层是否稳定。

3、行业配置：本基金的行业配置从定性分析和定量分析两个角度进行考察，依

据行业周期轮动特征以及行业相对投资价值评估结果，精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业进行重点配置。

定性分析方面，以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础，结合对我国行业周期轮动特征的考察，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势。本基金重点关注行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。

定量分析方面，主要依据行业相对估值水平（行业估值/市场估值）、行业相对利润增长率（行业利润增长率/市场利润增长率）、行业 PEG（行业估值/行业利润增长率）三项指标进行筛选，上述三项指标的数值均大于 1 的行业将是本基金的投资重点。

（三）债券投资策略：本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。

#### 1、久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

#### 2、收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（四）其他投资策略：本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

本基金还将积极参与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资，以增加收益。

### 九 基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{中证 700 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

中证 700 指数由中证指数有限公司编制，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体状况，适合作为本基金股票投资部分的基准。

上证国债指数由上交所编制，具有较长的编制和发布历史，以及较高的知名度和

市场影响力，适合作为本基金债券投资部分的基准。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案并公告。

#### 十 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

#### 十一 基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 12 月 31 日。

##### （一）报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 151,508,045.70 83.40

其中：股票 151,508,045.70 83.40

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 24,555,334.31 13.52

7 其他各项资产 5,604,068.49 3.08

8 合计 181,667,448.50 100.00

##### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业	--
B 采矿业	-
	-
C 制造业	89,517,299.65 50.93
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66 0.02
E 建筑业	15,592.23 0.01
F 批发和零售业	--
G 交通运输、仓储和邮政业	9,458.68 0.01
H 住宿和餐饮业	--
I 信息传输、软件和信息技术服务业	35,126,334.12 19.99
J 金融业	3,829,780.00 2.18
K 房地产业	12,496,192.16 7.11
L 租赁和商务服务业	--
M 科学研究和技术服务业	--
N 水利、环境和公共设施管理业	3,971,571.20 2.26
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	6,503,900.00 3.70
S 综合	--
合计	151,508,045.70 86.21

(三) 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600963	岳阳林纸	850,000	6,944,500.00	3.95
2	000403	ST生化	200,000	6,562,000.00	3.73
3	300271	华宇软件	360,034	6,282,593.30	3.57
4	603160	汇顶科技	60,000	6,164,400.00	3.51
5	600520	*ST中发	220,000	5,937,800.00	3.38
6	300321	同大股份	150,081	5,793,126.60	3.30
7	000779	三毛派神	280,720	5,406,667.20	3.08

8 000948 南天信息 300,003 5,310,053.10 3.02  
9 300452 山河药辅 120,039 5,250,505.86 2.99  
10 600686 金龙汽车 360,000 5,115,600.00 2.91

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末, 本基金未持有债券。

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

报告期末, 本基金未持有债券。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末, 本基金未持有资产支持证券。

(七) 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

报告期末, 本基金未持有贵金属。

(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末, 本基金未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金投资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。

(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。

(3) 本基金投资国债期货的投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

(十一) 投资组合报告附注

(1) 本基金投资前十名股票不存在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。

(2) 本报告期内, 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	220,044.17
2	应收证券清算款	5,352,891.37
3	应收股利	-
4	应收利息	13,028.54
5	应收申购款	18,104.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,604,068.49

(4) 报告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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)  
流通受限情况说明

1	300271	华宇软件	6,282,593.30	3.57	重大资产重组停牌
---	--------	------	--------------	------	----------

(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。

## 十二 基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下:

(一) 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 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

2011.1.28-2011.12.31 -18.50% 1.08% -21.89% 1.15% 3.39% -0.07%

2012.1.1-2012.12.31 6.75% 1.14% 1.82% 1.19% 4.93% -0.05%

2013.1.1-2013.12.31 19.31% 1.13% 9.00% 1.13% 10.31% 0.00%

2014.1.1-2014.12.31 34.68% 0.91% 31.22% 0.95% 3.46% -0.04%

2015. 1. 1-2015. 12. 31 80. 87% 2. 39% 28. 04% 2. 23% 52. 83% 0. 16%  
2016. 1. 1-2016. 12. 31 -10. 79% 1. 69% -13. 19% 1. 45% 2. 4% 0. 24%  
自基金成立至 2016. 12. 31 125. 57% 1. 49% 26. 44% 1. 42% 99. 13% 0. 07%

(二) 自基金合同生效以来基金累计份额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累计份额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 2016 年 12 月 31 日)

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 十三 基金的费用概览

#### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产拨划支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- 9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### （四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

## 十四 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售方法》、《信息披露办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2016 年 9 月 9 日刊登的本基金招募说明书（《新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书（更新）》）进行了更新，主要更新的内容如下：

1. 在“重要提示”中，更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2. 在“三、基金管理人”中，对有关基金管理人概况及主要人员情况进行了更新。

3. 在“五、相关服务机构”中，更新了代销机构的相关信息。
4. 在“十二、基金的投资”中，更新了本基金投资组合报告的内容，数据截至时间为2016年12月31日。
5. 更新了“十三、基金的业绩”数据。
7. 在“二十五、其他应披露事项”中，披露了自2016年7月29日至2017年1月28日期间本基金的公告信息：
  - 1、本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。
  - 2、2016年8月24日 新华中小市值优选混合型证券投资基金2016年半年度报告。
  - 3、2016年9月9日 新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要及全文。
  - 4、2016年9月19日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告。
  - 5、2016年9月21日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构并开通基金定投、转换业务以及参加费率优惠活动的公告。
  - 6、2016年9月22日 新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金通过中国工商银行股份有限公司办理定期定额投资业务起点金额的公告。
  - 7、2016年10月26日 新华中小市值优选混合型证券投资基金2016年第3季度报告。
  - 8、2016年11月8日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加汇成基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告。
  - 9、2016年11月9日 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加和讯开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告。
  - 10、2016年11月28日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告。
  - 11、2016年11月29日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加汇付金融为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告。
  - 12、2016年11月29日 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加钱景财富开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告。
  - 13、2016年12月22日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告。

- 14、2016年12月29日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告。
- 15、2016年12月29日 新华基金管理股份有限公司参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资业务的优惠活动公告。
- 16、2016年12月29日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司基金申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告。
- 17、2016年12月31日 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金2016年年度资产净值的公告。
- 18、2017年1月7日 新华基金管理股份有限公司关于调整创金启富代销的部分开放式基金申购金额下限的公告。
- 19、2017年1月7日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加肯瑞特财富为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告。
- 20、2017年1月17日 新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告。
- 21、2017年1月19日 新华基金管理股份有限公司关于总经理、督察长不再持有子公司股权的公告。
- 22、2017年1月20日新华中小市值优选混合型证券投资基金2016年第4季度报告。

新华基金管理股份有限公司

2017年3月13日