

---

**纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金**  
**2012 年年度报告**  
**2012 年 12 月 31 日**

基金管理人：纽银梅隆西部基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年三月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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 2013 年 3 月 28 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。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	1
1.1	重要提示 .....	1
1.2	目录 .....	2
§ 2	基金简介 .....	4
2.1	基金基本情况 .....	4
2.2	基金产品说明 .....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式 .....	5
2.5	其他相关资料 .....	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现 .....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4	管理人报告 .....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§ 5	托管人报告 .....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
§ 6	审计报告 .....	14
6.1	审计报告基本信息 .....	14
6.2	审计报告的基本内容 .....	14
§ 7	年度财务报表 .....	15
7.1	资产负债表 .....	15
7.2	利润表 .....	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4	报表附注 .....	19
§ 8	投资组合报告 .....	38
8.1	期末基金资产组合情况.....	38
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	39
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
8.6	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 .....	46

8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	46
8.8	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 .....	46
8.9	投资组合报告附注 .....	46
§ 9	基金份额持有人信息 .....	47
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
§ 10	开放式基金份额变动 .....	47
§ 11	重大事件揭示 .....	48
11.1	基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
11.4	基金投资策略的改变 .....	48
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	49
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
11.8	其他重大事件 .....	51
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§ 13	备查文件目录 .....	53
13.1	备查文件目录 .....	53
13.2	存放地点 .....	53
13.3	查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	纽银新动向混合
基金主代码	673010
交易代码	673010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 18 日
基金管理人	纽银梅隆西部基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	76,670,400.98 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	把握中国经济结构转型的驱动因素，分享转型中传统产业升级与新兴产业加速发展的长线成果，挖掘价格合理有持续增长潜力的公司，在控制风险的前提下力争为基金持有人谋求长期、持续、稳定的超额收益。
投资策略	<p>本基金为灵活配置的混合型基金，投资中运用的策略主要包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 资产配置策略：本基金运用自身研发的股票/债券收益率定量模型，并参考纽约梅隆集团 iFlow 全球资金流量统计数据，分析全球及中国宏观经济走势和政策走向、资本市场估值来综合确定基金的大类资产配置（主要是股票与债券比例）。</li> <li>2. 行业配置：本基金认为经济转型期间对经济增长的贡献将逐渐由传统工业化向城市化与工业现代化过渡，具体来说可以体现在两个方面：GDP 中传统产业升级占比提高，产业结构中新兴产业占比提高。行业配置策略主要目的是把握这一轮中国经济转型的新动向，挖掘传统产业升级与新兴产业加速推进过程中产生的投资机会。</li> <li>3. 股票精选策略：根据本基金的投资策略重点在于受益于传统产业升级与新兴产业加速发展的行业与个股，因此在股票精选方面将采取“自下而上”积极主动的选股策略，动态分析上市公司股价运行规律，投资 A 股市场内重点行业中具有合理估值、高成长性及风险相对合理的公司，股票精选目的在于挖掘出上市公司内在价值与波动率区间。</li> <li>4. 债券投资策略：本基金投资的债券包括国债、央票、金融债、公司债、企业债（含可转换债券）等债券品种。基金经理根据经投资决策委员会审批的资产配置计划，参考固定收益分析师在对利率变动趋势、债券市场发展方向和各债券品种的流动性、安全性和收益</li> </ol>

	<p>性等因素的研究成果基础上，进行综合分析并制定债券投资方案。</p> <p>5. 权证投资策略：本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>6. 股指期货投资策略：若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，并严格遵守本公司经董事会批准的针对股指期货交易制定的投资决策流程风险控制等制度。基金在进行股指期货投资时，将通过研究对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其长期的预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益的基金产品。

### 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	纽银梅隆西部基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐剑钧
	联系电话	021-38572888
	电子邮箱	service@bnyfund.com
客户服务电话	4007-007-818;021-38572666	010-67595096
传真	021-38572750	010-66275853
注册地址	上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心19楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心19楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	安保和	王洪章

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bnyfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区世纪大道100

	号上海环球金融中心19楼
--	--------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
注册登记机构	纽银梅隆西部基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心19楼

## § 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	2012 年	2011 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-11,432,021.09	-13,920,501.56
本期利润	-1,066,539.20	-18,789,588.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0107	-0.0881
本期加权平均净值利润率	-1.24%	-9.02%
本期基金份额净值增长率	-0.45%	-10.60%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	-15,732,943.27	-14,250,668.12
期末可供分配基金份额利润	-0.2052	-0.1062
期末基金资产净值	68,253,843.21	119,940,919.91
期末基金份额净值	0.890	0.894
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	-11.00%	-10.60%

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.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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.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）。

4.本基金合同生效日为 2011 年 8 月 18 日，合同生效当期不是完整报告期（一年）。

### 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

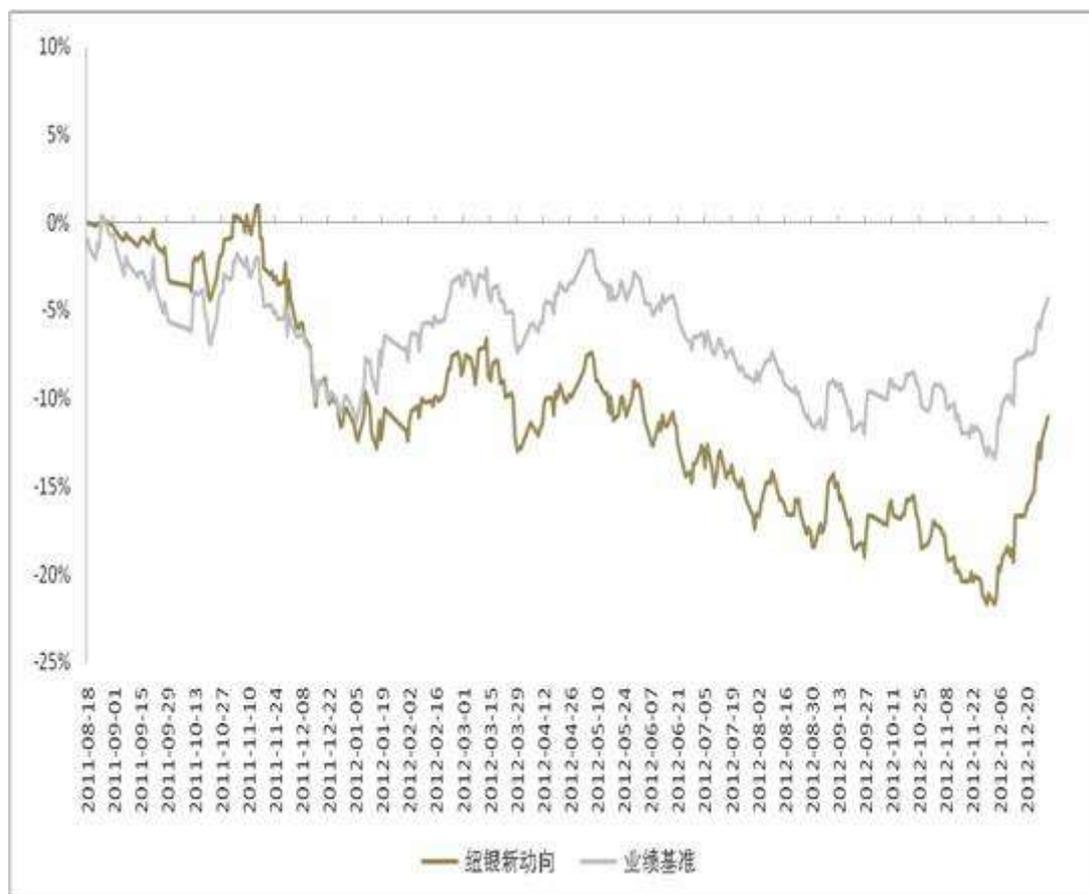
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	6.84%	0.88%	5.87%	0.70%	0.97%	0.18%
过去六个月	3.13%	0.90%	2.31%	0.68%	0.82%	0.22%
过去一年	-0.45%	0.89%	6.16%	0.70%	-6.61%	0.19%
自基金合同生效起至今	-11.00%	0.86%	-4.33%	0.73%	-6.67%	0.13%

#### 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

纽银新动向灵活配置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历史走势对比图

(2011 年 8 月 18 日至 2012 年 12 月 31 日)



注：1. 按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

#### 3.2.3 合同生效日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

纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金

基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注：1) 本基金的基金合同于 2011 年 8 月 18 日生效，截至 2012 年 12 月 31 日，基金运作未满三年。  
2) 本基金基金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

本基金自 2011 年 8 月 18 日至 2012 年 12 月 31 日未进行过利润分配。

## § 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

纽银梅隆西部基金管理有限公司（简称“纽银基金”）经中国证券监督管理委员会(证监许可[2010]864号)批准，于 2010 年 7 月 20 日成立。公司由西部证券股份有限公司和纽约银行梅隆资产管理国际有限公司合资设立，注册资本 2 亿元人民币，其中中方股东西部证券股份有限公司出资 51%，外方股东纽约银行梅隆资产管理国际有限公司出资 49%，注册地上海。

截至 2012 年 12 月 31 日，纽银基金共管理四只开放式基金——纽银策略优选股票型证券投资基金、纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金、纽银稳健双利债券型证券投资基金和纽银稳定增利债券型

发起式证券投资基金。

#### 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		
闫旭	本基金基金经理、公司投资副总监	2011-08-18	-	十二年	复旦大学经济学硕士；曾在华宝兴业基金管理有限公司和富国基金管理有限公司从事投资研究工作。2010 年 7 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
赵忆波	本基金基金经理	2011-11-21	-	十年	英国南安普顿大学国际金融硕士；曾在泰信基金管理有限公司和 Martin Currie（瀚伦投资顾问（上海）有限公司）从事投资研究工作。2009 年 11 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
倪海达	本基金基金经理助理	2011-11-01	2012-08-15	六年	美国罗切斯特理工学院统计学硕士；曾在花旗集团、摩根斯坦利从事量化投资研究工作。2009 年 8 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

注：1.基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；

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

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人已根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证

券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了公司《投资管理制度》、《集中交易室部门规章》、《公平交易管理制度》及《异常交易监控及报告制度》并遵守上述制度和流程，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节公平对待不同投资组合，严禁直接或者间接通过与第三方的交易安排等在不同投资组合之间进行利益输送，通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易执行，以公平对待投资人。

控制方法包括：1.研究环节：公募基金投资和专户投资共用研究平台、共享信息。2.投资及授权环节：公司建立不同投资组合层面的投资对象与交易对手备选库。公司建立了分层投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。3.交易环节：为确保交易的公平执行，将公司投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易室集中统一完成。（1）所有交易所指令必须通过系统下达，通过系统方式进行公平交易。（2）对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配制度。在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易室。交易室以价格优先、比例分配原则进行分配。（3）对于银行间交易，交易室在银行间市场上按照时间优先、价格优先的原则进行分配。

此外，公司通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。公司建立异常交易监控及报告制度，通过事前监控、事中监控、事后监控三个异常交易监控体系环节、建立异常交易行为日常监控和分析评估制度、异常交易分析报告和信息披露，进一步规范和完善投资和交易管理，以确保公司管理的不同投资组合获得公平对待。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

对于场内交易，本基金管理人按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金，采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；对于场外交易，本基金管理人按照公司制度和流程执行。

本基金管理人监察稽核部及风险管理部负责对各账户公平交易进行事后监察，在每日公平交易报表中记录不同投资组合当天整体收益率、交易所股票同向（1日、3日、5日）交易价差分析、交易所债券同向（1日、3日、5日）交易价差分析、银行间交易价格偏离度分析；并分别于季度和年度末编制公平交易季度收益率差异分析报告及公平交易年度收益率差异分析报告，对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向（1日、3日、5日）交易的交易价差、银行间交易价格偏离度进行分析。

当监控到疑似异常交易时，本基金管理人监察稽核部及时要求相关投资组合经理给予解释，该解

释经监察稽核部辨认后确认该交易无异常情况后留档备查，公平交易季报及年报由投资组合经理、督察长、总经理签署后，由监察稽核部妥善保存分析报告备查。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

### 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

2012 年的 A 股市场纠结于经济走向和政策预期，呈现出大幅振荡态势。大致可分为三个阶段，第一段为 1 月至 3 月，经济增速下行有预期但有待验证，在充裕的流动性和政策期望下，股指走出一波向上行情，其中估值较高的小盘股受压；第二阶段为 4 月至 8 月，出现经济放缓和企业盈利恶化，大盘在政策预期下 4 月还有一定涨幅，之后便陷入戴维斯双杀的困境，跌势一直持续到 12 月初；第三阶段为 9 月至年底，用电量、规模以上工业企业盈利和上市公司盈利预报已反复证实了去库存结束经济见底，不过市场惯性向下直到最后一个月才展开绝地反击，尽管银行已于 9 月见底回升。

综观全年，由于对上半年经济运行态势过于乐观，我们的投资策略有些紊乱，年初对政策预期下的做多动能估计不足，仓位偏低，其后又跟随市场被动上调，造成业绩表现不佳。尤其是上半年，业绩落后于基准 7.24%，下半年略有好转。

感谢持有人的支持，我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，努力为持有人带来良好的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.890 元，本报告期份额净值增长率为 -0.45%，同期业绩比较基准增长率为 6.16%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

长期来看，中国经济处于转型的阵痛期，下降的人口红利和上升的环保问题，使得中国面临产业向海外转移的风险。不过，中国经济增长潜力仍然巨大。当前的人均 GDP 仅及日本的十分之一，相当于日本 1974 年的水平。从城市化率看，中国也与发达国家相差近三十个百分点。新一届政府对城镇化的提出将成为中国经济继续增长的强大政策保障，使中国得以规避“中等收入陷阱”的宿命。

过高的房价已成为政治问题，将持续受到政策抑制；同时，政府正在检讨以地产为主导的经济发展模式。不过，我们也不必过于担心泡沫破灭的风险，原因是仍在高速增长轨道上的经济会在未来弥补支付能力与房价间的深沟。

展望 2013 年股票市场走势，我们仍持积极看法。国际经济和国内经济的持续走强将有力支持市场长期向好。一季度关注市场上涨后调整的可能，风险回素可能来自于 2013 年 1 季度通胀过快上升的压力、IPO 重启、大小非减持及房地产政策趋紧等方面。

对民生的持续关注将成为今年乃至未来若干年内的投资主题。环境问题的日益突出、户籍制度、计划生育制度和收入体制的改革和老龄化将是主要驱动因素。包含可选消费和医疗在内的大消费行业有望在未来获得爆炸性增长，清洁能源和提升能源利用效率的行业将长期受益，此外，为保障能源安全的替代能源开发和传统能源深度开发也将胜出。

有核心竞争力的高端制造业将在替代进口和出口市场不断胜出，海内外并购将是获取持续增长动力的方式。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对公司经营、旗下投资组合及员工行为的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期向监管机构、公司董事会出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

一、 根据基金监管法律法规及公司业务开展的实际情况，进一步完善公司各项内部制度和细化各项业务流程；

二、 加强内部监察稽核工作，对投资研究质量控制、投资管理人员通讯管理、投资交易系统风控阈值、公平交易、反洗钱、基金销售各个环节、员工行为规范、直销柜台客服录音、即时通讯监控、基金宣传推介材料、后台运营参数设置等重点项目进行内部检查稽核，进一步强化了对公司制度执行和风控措施的落实；

三、 根据法律法规及时、准确、完整的披露与本基金有关的各项法定信息披露文件，并在指定报刊和公司网站进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和本基金的各项公开信息；

四、 严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定、监管要求及公

司内部制度，严格执行公司旗下不同交易组合之间的公平交易监督检查，通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易执行；

五、 牵头推动公司反洗钱制度的修改和创新，强化了反洗钱异常报告筛选并完善相关工作流程，组织反洗钱宣传培训、数据报送和工作总结报告等工作，进一步贯彻落实反洗钱法规及监管要求；

六、 加强员工合规培训，规范员工执业操守。同时，进行“反洗钱”、“投资管理合规培训”、“防范内幕交易”、“销售合规培训”、“新法律法规解读”等专题培训。

通过上述工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生禁止性关联交易、内幕交易及非公平交易，基金运作整体合法合规。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

估值委员会的成员包括投资管理部、风险控制岗、监察稽核部、基金运营部等有关人员组成。所有成员均须具备必要的专业知识、专业技能和独立性，参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突，并按照制度规定的专业职责分工和估值流程履行估值程序。

基金经理如认为持仓品种的估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，通过参与对估值问题的讨论和与估值委员会共同商定估值原则和政策等方式，对估值议案提出反馈意见。作为公司估值委员会委员，基金经理有权投票表决有关议案。

本基金管理人尚未签订任何与估值相关的定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂未进行利润分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，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，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2013)第20420号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“纽银新动向混合基金”)的财务报表,包括2012年12月31日的资产负债表、2012年度利润表

	和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是纽银新动向混合基金的基金管理人纽银梅隆西部基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述纽银新动向混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了纽银新动向混合基金2012年12月31日的财务状况以及2012年度经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	单峰 刘颖
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
审计报告日期	2013-03-13

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,054,944.90	22,079,502.55
结算备付金		693,610.65	1,334,061.15
存出保证金		500,000.00	-
交易性金融资产	7.4.7. 2	53,267,610.37	97,079,555.97
其中：股票投资		53,267,610.37	68,053,555.97
基金投资		-	-
债券投资		-	29,026,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7. 3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7. 4	10,000,000.00	-
应收证券清算款		2,034,755.12	579,135.54
应收利息	7.4.7. 5	1,474.50	531,362.98
应收股利		-	-
应收申购款		11,067.17	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7. 6	-	-
资产总计		69,563,462.71	121,603,618.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,019,949.37
应付赎回款		117,897.26	26,128.65
应付管理人报酬		81,135.51	159,614.30
应付托管费		13,522.60	26,602.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7. 7	200,449.59	310,305.10

应交税费		96,288.00	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	800,326.54	120,098.47
负债合计		1,309,619.50	1,662,698.28
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	76,670,400.98	134,191,588.03
未分配利润	7.4.7.10	-8,416,557.77	-14,250,668.12
所有者权益合计		68,253,843.21	119,940,919.91
负债和所有者权益总计		69,563,462.71	121,603,618.19

注：1.报告截止日 2012 年 12 月 31 日，纽银新动向混合基金份额净值 0.890 元，基金份额总额 76,670,400.98 份。

2.本基金合同生效日为 2011 年 8 月 18 日，合同生效当期不是完整报告期（一年）。

## 7.2 利润表

会计主体：纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效日）至2011年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>2,637,766.77</b>	<b>-16,473,497.65</b>
1. 利息收入		838,822.82	1,326,517.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	85,975.05	114,171.21
债券利息收入		643,723.92	507,122.72
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		109,123.85	705,224.03
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,625,234.77	-13,198,077.33
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-9,706,834.56	-13,965,161.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	354,058.57	718,483.93
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-

股利收益	7.4.7.15	727,541.22	48,600.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	10,365,481.89	-4,869,086.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	58,696.83	267,148.51
<b>减：二、费用</b>		<b>3,704,305.97</b>	<b>2,316,090.70</b>
1. 管理人报酬		1,306,285.52	1,163,962.18
2. 托管费		217,714.34	193,993.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,845,530.75	833,016.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	334,775.36	125,118.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,066,539.20</b>	<b>-18,789,588.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,066,539.20</b>	<b>-18,789,588.35</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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）	134,191,588.03	-14,250,668.12	119,940,919.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,066,539.20	-1,066,539.20
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）	-57,521,187.05	6,900,649.55	-50,620,537.50
其中：1. 基金申购款	1,257,532.61	-172,002.04	1,085,530.57
2. 基金赎回款	-58,778,719.66	7,072,651.59	-51,706,068.07
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）	76,670,400.98	-8,416,557.77	68,253,843.21
项目	上年度可比期间		

	2011年8月18日（基金合同生效日）至2011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）	347,347,368.89	-	347,347,368.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,789,588.35	-18,789,588.35
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）	-213,155,780.86	4,538,920.23	-208,616,860.63
其中：1. 基金申购款	510,905.84	-21,547.25	489,358.59
2. 基金赎回款	-213,666,686.70	4,560,467.48	-209,106,219.22
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）	134,191,588.03	-14,250,668.12	119,940,919.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：安保和，主管会计工作负责人：安保和，会计机构负责人：李健

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2011]878号《关于核准纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由纽银梅隆西部基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 347,308,174.69 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 321 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 8 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 347,347,368.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 39,194.20 份基金份额。本基金的基金管理人为纽银梅隆西部基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围是为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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、

以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规和监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%-80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等其他证券品种占 20%-70%，其中扣除股指期货保证金之后基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

本财务报表由本基金的基金管理人纽银梅隆西部基金管理有限公司于 2013 年 3 月 13 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2011 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易为目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融

资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 对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) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	3,054,944.90	22,079,502.55
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	3,054,944.90	22,079,502.55

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	47,771,215.27	53,267,610.37	5,496,395.10
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	47,771,215.27	53,267,610.37	5,496,395.10

项目		上年度末 2011 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		72,943,982.76	68,053,555.97	-4,890,426.79
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	29,004,660.00	29,026,000.00	21,340.00
	合计	29,004,660.00	29,026,000.00	21,340.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		101,948,642.76	97,079,555.97	-4,869,086.79

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所	10,000,000.00	-
合计	10,000,000.00	-
项目	上年度末 2011年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	1,131.19	4,746.37
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	343.31	660.33
应收债券利息	-	525,956.28
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-

其他	-	-
合计	1,474.50	531,362.98

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度期末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	200,449.59	306,605.10
银行间市场应付交易费用	-	3,700.00
合计	200,449.59	310,305.10

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	-
应付赎回费	326.54	98.47
应付后端申购费	-	-
债券利息税	-	-
预提费用	300,000.00	120,000.00
银行手续费	-	-
其他	-	-
合计	800,326.54	120,098.47

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	134,191,588.03	134,191,588.03
本期申购	1,257,532.61	1,257,532.61
本期赎回（以“-”号填列）	-58,778,719.66	-58,778,719.66
本期末	76,670,400.98	76,670,400.98

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,230,512.31	-2,020,155.81	-14,250,668.12

本期利润	-11,432,021.09	10,365,481.89	-1,066,539.20
本期基金份额交易产生的变动数	7,929,590.13	-1,028,940.58	6,900,649.55
其中：基金申购款	-195,014.35	23,012.31	-172,002.04
基金赎回款	8,124,604.48	-1,051,952.89	7,072,651.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,732,943.27	7,316,385.50	-8,416,557.77

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效日）至2011年12月31日
活期存款利息收入	74,982.74	90,997.12
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	10,992.31	23,148.12
其他	-	25.97
合计	85,975.05	114,171.21

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效日）至2011年12月31日
卖出股票成交总额	610,334,627.29	240,966,543.94
减：卖出股票成本总额	620,041,461.85	254,931,705.20
买卖股票差价收入	-9,706,834.56	-13,965,161.26

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效日）至2011年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	80,836,191.29	180,772,892.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	78,523,584.82	177,725,511.37
减：应收利息总额	1,958,547.90	2,328,896.93
债券投资收益	354,058.57	718,483.93

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本报告期内及上年度期内均未持有衍生工具。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效 日）至2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	727,541.22	48,600.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	727,541.22	48,600.00

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效 日）至2011年12月31日
1. 交易性金融资产	10,365,481.89	-4,869,086.79
——股票投资	10,386,821.89	-4,890,426.79
——债券投资	-21,340.00	21,340.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	10,365,481.89	-4,869,086.79

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效日） 至2011年12月31日
基金赎回费收入	58,079.29	261,325.45
基金转换费收入	617.54	58.73
募集期间认购资金产生的利息收入	-	5,764.33
合计	58,696.83	267,148.51

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年8月18日（基金合同生效日）至2011年12月31日
交易所市场交易费用	1,844,980.75	828,241.71
银行间市场交易费用	550.00	4,775.00
合计	1,845,530.75	833,016.71

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效日） 至2011年12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	240,000.00	70,000.00
银行汇划费用	1,375.36	4,218.14
债券账户维护费	33,400.00	-
其他	-	900.00
合计	334,775.36	125,118.14

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[2012]85 号《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》(以下简称“通知”), 要求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。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得, 按照本通知的规定计征个人所得税。通知自 2013 年 1 月 1 日起施行。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
纽银梅隆西部基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
西部证券股份有限公司（“西部证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效日）至2011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
西部证券	37,322,457.03	3.10%	15,440,178.18	2.71%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012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
西部证券	33,978.30	3.30%	8,720.54	4.35%
关联方名称	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效日）至2011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
西部证券	13,123.99	2.77%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年8月18日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,306,285.52	1,163,962.18
其中：支付销售机构的客户维护费	638,884.61	451,517.35

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，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 X 1.5% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年8月18日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	217,714.34	193,993.67

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期末及上年度期末均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金管理人于本报告期及上年度均未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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期末，无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日		2011年8月18日（基金合同生效日）至2011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
建设银行	3,054,944.90	74,982.74	22,079,502.55	90,997.12
合计	3,054,944.90	74,982.74	22,079,502.55	90,997.12

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金于 2012 年度未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

#### 7.4.12.2 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（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000002	万科 A	2012-12-26	公告 重大 事项	10.12	2013-01-21	11.13	61,651	573,544.71	623,908.12	-

注：本基金截至 2012 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人力争在严格控制风险的情况下实现基金资产长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规审核委员会，负责对公司经营的合法合规性进行监督检查，对经营活动进行审计；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由投资风险管理人员负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各

种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2011 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2012 年 12 月 31 日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,054,944.90	-	-	-	3,054,944.90
结算备付金	693,610.65	-	-	-	693,610.65
存出保证金	-	-	-	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	-	-	-	53,267,610.37	53,267,610.37
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,474.50	1,474.50
应收申购款	-	-	-	11,067.17	11,067.17
应收证券清算款	-	-	-	2,034,755.12	2,034,755.12
资产总计	13,748,555.55	-	-	55,814,907.16	69,563,462.71

负债					
应付赎回款	-	-	-	117,897.26	117,897.26
应付管理人报酬	-	-	-	81,135.51	81,135.51
应付托管费	-	-	-	13,522.60	13,522.60
应付交易费用	-	-	-	200,449.59	200,449.59
应交税费	-	-	-	96,288.00	96,288.00
其他负债	-	-	-	800,326.54	800,326.54
负债总计	-	-	-	1,309,619.50	1,309,619.50
利率敏感度缺口	13,748,555.55	-	-	54,505,287.66	68,253,843.21
上年度末2011年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,079,502.55	-	-	-	22,079,502.55
结算备付金	1,334,061.15	-	-	-	1,334,061.15
交易性金融资产	29,026,000.00	-	-	68,053,555.97	97,079,555.97
应收利息	-	-	-	531,362.98	531,362.98
应收证券清算款	-	-	-	579,135.54	579,135.54
资产总计	52,439,563.70	-	-	69,164,054.49	121,603,618.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,227.12	26,227.12
应付管理人报酬	-	-	-	159,614.30	159,614.30
应付托管费	-	-	-	26,602.39	26,602.39
应付交易费用	-	-	-	310,305.10	310,305.10
其他负债	-	-	-	120,000.00	120,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,019,949.37	1,019,949.37
负债总计	-	-	-	1,662,698.28	1,662,698.28
利率敏感度缺口	52,439,563.70	-	-	67,501,356.21	119,940,919.91

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）

	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
市场利率上升 25 个基点	-	增加约 3.12 万元
市场利率下降 25 个基点	-	减少约 3.11 万元

注：于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%-80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等其他证券品种占 20%-70%，其中扣除股指期货保证金之后基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	53,267,610.37	78.04	68,053,555.97	56.74
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	53,267,610.37	78.04	68,053,555.97	56.74

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 403.00	-
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 403.00	-	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 52,643,702.25 元,属于第二层级的余额为 623,908.12 元,无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日:第一层级 68,053,555.97 元,第二层级 29,026,000.00 元,无第三层级)。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无

(2) 除公允价值外，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	53,267,610.37	76.57
	其中：股票	53,267,610.37	76.57
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	10,000,000.00	14.38
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,748,555.55	5.39
6	其他各项资产	2,547,296.79	3.66
7	合计	69,563,462.71	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

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	2,550,840.00	3.74
C	制造业	22,063,696.48	32.33
C0	食品、饮料	413,849.10	0.61
C1	纺织、服装、皮毛	348,000.00	0.51
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,037,878.92	1.52
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,525,915.97	3.70
C5	电子	5,349,811.71	7.84
C6	金属、非金属	5,823,478.05	8.53
C7	机械、设备、仪表	5,338,554.45	7.82

C8	医药、生物制品	1,226,208.28	1.80
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	394,535.84	0.58
E	建筑业	2,224,704.18	3.26
F	交通运输、仓储业	500,480.00	0.73
G	信息技术业	1,110,641.74	1.63
H	批发和零售贸易	592,680.00	0.87
I	金融、保险业	13,745,590.01	20.14
J	房地产业	4,741,691.76	6.95
K	社会服务业	2,004,363.94	2.94
L	传播与文化产业	2,461,826.42	3.61
M	综合类	876,560.00	1.28
	合计	53,267,610.37	78.04

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601169	北京银行	279,797	2,602,112.10	3.81
2	601166	兴业银行	154,665	2,581,358.85	3.78
3	600000	浦发银行	257,770	2,557,078.40	3.75
4	300251	光线传媒	70,358	2,461,826.42	3.61
5	600837	海通证券	167,099	1,712,764.75	2.51
6	601601	中国太保	64,685	1,455,412.50	2.13
7	300128	锦富新材	65,965	1,296,871.90	1.90
8	000651	格力电器	46,592	1,188,096.00	1.74
9	000656	金科股份	80,461	1,166,684.50	1.71
10	300088	长信科技	70,950	1,078,440.00	1.58
11	002521	齐峰股份	70,317	1,037,878.92	1.52
12	601669	中国水电	260,335	994,479.70	1.46
13	002146	荣盛发展	70,959	992,716.41	1.45
14	600362	江西铜业	40,800	973,488.00	1.43
15	601299	中国北车	208,000	938,080.00	1.37
16	000430	张家界	100,000	931,000.00	1.36
17	300115	长盈精密	33,571	899,031.38	1.32
18	601818	光大银行	279,775	853,313.75	1.25
19	000024	招商地产	28,000	836,920.00	1.23
20	600340	华夏幸福	28,251	797,525.73	1.17
21	002618	丹邦科技	64,164	793,708.68	1.16

22	300241	瑞丰光电	49,855	770,259.75	1.13
23	002653	海思科	27,921	767,827.50	1.12
24	600123	兰花科创	37,000	750,730.00	1.10
25	002271	东方雨虹	49,197	750,254.25	1.10
26	600352	浙江龙盛	119,983	728,296.81	1.07
27	002663	普邦园林	25,094	700,624.48	1.03
28	002541	鸿路钢构	52,624	695,163.04	1.02
29	600031	三一重工	62,464	661,493.76	0.97
30	002155	辰州矿业	32,000	642,560.00	0.94
31	300345	红宇新材	38,721	633,088.35	0.93
32	000002	万科 A	61,651	623,908.12	0.91
33	600801	华新水泥	40,000	606,800.00	0.89
34	603000	人民网	16,000	603,360.00	0.88
35	002589	瑞康医药	17,960	592,680.00	0.87
36	300306	远方光电	40,000	591,600.00	0.87
37	601628	中国人寿	26,969	577,136.60	0.85
38	300328	宜安科技	33,859	575,264.41	0.84
39	600426	华鲁恒升	72,308	560,387.00	0.82
40	002398	建研集团	28,538	553,922.58	0.81
41	600372	中航电子	34,900	553,165.00	0.81
42	601699	潞安环能	25,000	547,250.00	0.80
43	600010	包钢股份	100,000	540,000.00	0.79
44	002375	亚厦股份	20,000	529,600.00	0.78
45	601117	中国化学	63,039	519,441.36	0.76
46	600707	彩虹股份	93,000	511,500.00	0.75
47	600029	南方航空	128,000	500,480.00	0.73
48	600309	烟台万华	31,856	497,272.16	0.73
49	600418	江淮汽车	70,261	479,882.63	0.70
50	600252	中恒集团	50,206	458,380.78	0.67
51	600406	国电南瑞	28,000	448,840.00	0.66
52	601988	中国银行	152,481	445,244.52	0.65
53	000778	新兴铸管	68,000	439,280.00	0.64
54	002216	三全食品	17,970	413,849.10	0.61
55	002369	卓翼科技	24,378	410,281.74	0.60
56	600027	华电国际	100,136	394,535.84	0.58
57	000937	冀中能源	28,000	387,240.00	0.57
58	000783	长江证券	40,997	385,371.80	0.56
59	600765	中航重机	50,143	381,588.23	0.56
60	002588	史丹利	12,000	373,440.00	0.55
61	600143	金发科技	68,000	366,520.00	0.54
62	002044	江苏三友	48,000	348,000.00	0.51

63	600585	海螺水泥	18,000	332,100.00	0.49
64	600639	浦东金桥	35,993	323,937.00	0.47
65	000562	宏源证券	16,890	318,376.50	0.47
66	002073	软控股份	38,000	287,280.00	0.42
67	002237	恒邦股份	12,000	278,040.00	0.41
68	600705	ST 航投	20,000	273,200.00	0.40
69	601336	新华保险	8,932	257,420.24	0.38
70	000049	德赛电池	8,419	257,368.83	0.38
71	300302	同有科技	12,000	251,520.00	0.37
72	600583	海油工程	38,000	223,060.00	0.33

#### 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	601717	郑煤机	12,658,198.20	10.55
2	600837	海通证券	11,429,212.68	9.53
3	000157	中联重科	10,364,601.27	8.64
4	601166	兴业银行	9,828,663.38	8.19
5	601601	中国太保	9,227,921.59	7.69
6	600395	盘江股份	9,135,376.50	7.62
7	600547	山东黄金	8,407,839.11	7.01
8	600048	保利地产	7,349,581.07	6.13
9	600637	百视通	7,293,113.70	6.08
10	601328	交通银行	7,237,574.00	6.03
11	002277	友阿股份	7,193,540.80	6.00
12	601088	中国神华	7,144,369.00	5.96
13	002155	辰州矿业	6,989,884.36	5.83
14	601117	中国化学	6,850,421.76	5.71
15	002369	卓翼科技	6,435,719.25	5.37
16	002655	共达电声	6,233,627.73	5.20
17	601318	中国平安	6,089,040.00	5.08
18	300115	长盈精密	5,953,126.57	4.96
19	600143	金发科技	5,933,497.46	4.95
20	300207	欣旺达	5,888,213.96	4.91
21	000063	中兴通讯	5,838,335.75	4.87
22	600000	浦发银行	5,745,575.62	4.79
23	000960	锡业股份	5,703,549.48	4.76

24	601169	北京银行	5,572,236.00	4.65
25	300241	瑞丰光电	5,390,776.91	4.49
26	600050	中国联通	5,381,770.00	4.49
27	002385	大北农	5,333,411.49	4.45
28	600123	兰花科创	5,027,281.05	4.19
29	000786	北新建材	4,801,029.39	4.00
30	300128	锦富新材	4,798,422.44	4.00
31	600519	贵州茅台	4,742,738.81	3.95
32	600406	国电南瑞	4,609,386.40	3.84
33	000651	格力电器	4,592,210.84	3.83
34	000001	平安银行	4,535,655.27	3.78
35	601766	中国南车	4,520,158.00	3.77
36	002055	得润电子	4,448,103.75	3.71
37	600707	彩虹股份	4,398,802.01	3.67
38	000937	冀中能源	4,329,061.00	3.61
39	600491	龙元建设	4,272,430.00	3.56
40	600549	厦门钨业	4,116,043.15	3.43
41	002431	棕榈园林	4,047,354.68	3.37
42	601369	陕鼓动力	4,013,195.73	3.35
43	600809	山西汾酒	3,979,300.00	3.32
44	600362	江西铜业	3,897,213.30	3.25
45	002415	海康威视	3,763,713.60	3.14
46	002521	齐峰股份	3,729,156.31	3.11
47	000423	东阿阿胶	3,724,549.99	3.11
48	000430	张家界	3,709,639.00	3.09
49	300070	碧水源	3,686,552.97	3.07
50	002241	歌尔声学	3,611,835.50	3.01
51	000049	德赛电池	3,569,565.14	2.98
52	002146	荣盛发展	3,567,026.61	2.97
53	601998	中信银行	3,566,032.57	2.97
54	002013	中航精机	3,510,265.77	2.93
55	002375	亚厦股份	3,480,905.02	2.90
56	601398	工商银行	3,461,669.32	2.89
57	600585	海螺水泥	3,373,279.11	2.81
58	300079	数码视讯	3,368,006.61	2.81
59	600009	上海机场	3,366,390.73	2.81
60	000592	中福实业	3,358,684.42	2.80
61	000002	万科 A	3,340,857.00	2.79
62	000983	西山煤电	3,328,335.41	2.77
63	000656	金科股份	3,320,580.31	2.77
64	600183	生益科技	3,246,728.00	2.71

65	600104	上汽集团	3,164,164.72	2.64
66	601669	中国水电	3,057,252.00	2.55
67	000338	潍柴动力	3,049,620.20	2.54
68	600036	招商银行	3,038,706.00	2.53
69	600016	民生银行	3,023,200.00	2.52
70	601288	农业银行	3,009,500.00	2.51
71	300345	红宇新材	2,969,611.69	2.48
72	600801	华新水泥	2,905,905.50	2.42
73	600141	兴发集团	2,876,004.30	2.40
74	000596	古井贡酒	2,817,978.80	2.35
75	601818	光大银行	2,812,914.00	2.35
76	601009	南京银行	2,794,353.31	2.33
77	600111	包钢稀土	2,788,745.60	2.33
78	600418	江淮汽车	2,762,942.76	2.30
79	000639	西王食品	2,671,818.00	2.23
80	002185	华天科技	2,659,794.00	2.22
81	600581	八一钢铁	2,655,355.20	2.21
82	600015	华夏银行	2,640,010.00	2.20
83	600697	欧亚集团	2,626,599.56	2.19
84	300020	银江股份	2,608,385.00	2.17
85	600261	阳光照明	2,588,744.80	2.16
86	000858	五粮液	2,523,631.00	2.10
87	600742	一汽富维	2,518,892.00	2.10
88	002271	东方雨虹	2,486,201.92	2.07
89	002589	瑞康医药	2,463,848.81	2.05
90	000999	华润三九	2,402,961.52	2.00

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）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	601717	郑煤机	16,572,397.34	13.82
2	601601	中国太保	12,917,940.81	10.77
3	600016	民生银行	10,646,030.00	8.88
4	600837	海通证券	10,279,929.26	8.57
5	600637	百视通	10,222,755.11	8.52
6	601166	兴业银行	10,163,222.57	8.47
7	000157	中联重科	10,049,212.64	8.38

8	601288	农业银行	9,322,442.00	7.77
9	600395	盘江股份	8,992,570.06	7.50
10	600547	山东黄金	8,470,677.16	7.06
11	600050	中国联通	7,887,986.00	6.58
12	000063	中兴通讯	7,489,673.28	6.24
13	601328	交通银行	7,475,748.63	6.23
14	600015	华夏银行	7,428,144.44	6.19
15	002277	友阿股份	7,298,606.83	6.09
16	600048	保利地产	7,034,561.58	5.87
17	601088	中国神华	6,988,918.26	5.83
18	601117	中国化学	6,956,844.57	5.80
19	002155	辰州矿业	6,449,963.19	5.38
20	002369	卓翼科技	6,296,096.73	5.25
21	002655	共达电声	6,138,410.61	5.12
22	601669	中国水电	5,868,813.94	4.89
23	300207	欣旺达	5,767,437.03	4.81
24	000960	锡业股份	5,649,587.66	4.71
25	601318	中国平安	5,624,515.52	4.69
26	601766	中国南车	5,621,673.90	4.69
27	002385	大北农	5,586,645.13	4.66
28	000592	中福实业	5,512,324.21	4.60
29	600143	金发科技	5,393,284.74	4.50
30	600519	贵州茅台	5,075,720.99	4.23
31	000786	北新建材	4,923,740.46	4.11
32	300115	长盈精密	4,917,774.69	4.10
33	000423	东阿阿胶	4,827,156.00	4.02
34	600104	上汽集团	4,768,986.63	3.98
35	002415	海康威视	4,672,267.22	3.90
36	000001	平安银行	4,664,782.85	3.89
37	300241	瑞丰光电	4,634,384.42	3.86
38	002055	得润电子	4,510,430.71	3.76
39	600491	龙元建设	4,466,244.90	3.72
40	000858	五粮液	4,411,050.04	3.68
41	002431	棕榈园林	4,286,781.60	3.57
42	600406	国电南瑞	4,256,380.65	3.55
43	600123	兰花科创	4,254,907.50	3.55
44	600549	厦门钨业	4,125,997.87	3.44
45	600809	山西汾酒	4,078,139.96	3.40
46	000937	冀中能源	4,008,326.14	3.34
47	600585	海螺水泥	3,949,015.65	3.29
48	300128	锦富新材	3,825,742.88	3.19

49	000651	格力电器	3,797,747.09	3.17
50	300070	碧水源	3,780,234.06	3.15
51	002497	雅化集团	3,757,625.24	3.13
52	600000	浦发银行	3,656,245.85	3.05
53	002241	歌尔声学	3,625,791.02	3.02
54	600707	彩虹股份	3,587,545.37	2.99
55	002013	中航精机	3,585,800.58	2.99
56	000983	西山煤电	3,561,898.12	2.97
57	300079	数码视讯	3,515,098.17	2.93
58	601398	工商银行	3,482,935.90	2.90
59	601369	陕鼓动力	3,419,084.25	2.85
60	600009	上海机场	3,388,469.02	2.83
61	000049	德赛电池	3,376,465.62	2.82
62	601998	中信银行	3,367,995.02	2.81
63	601169	北京银行	3,349,392.63	2.79
64	002375	亚厦股份	3,303,617.67	2.75
65	000999	华润三九	3,268,454.56	2.73
66	600183	生益科技	3,173,247.00	2.65
67	000338	潍柴动力	3,119,348.76	2.60
68	601857	中国石油	3,075,136.40	2.56
69	600036	招商银行	3,048,910.00	2.54
70	600141	兴发集团	3,048,512.52	2.54
71	600111	包钢稀土	3,005,799.78	2.51
72	002484	江海股份	2,972,035.32	2.48
73	002521	齐峰股份	2,925,932.12	2.44
74	002185	华天科技	2,920,271.03	2.43
75	600362	江西铜业	2,867,809.46	2.39
76	002234	民和股份	2,853,986.18	2.38
77	000002	万科 A	2,793,827.05	2.33
78	000430	张家界	2,787,694.45	2.32
79	000596	古井贡酒	2,732,536.40	2.28
80	600581	八一钢铁	2,649,988.86	2.21
81	601009	南京银行	2,636,972.27	2.20
82	000061	农产品	2,630,243.77	2.19
83	600697	欧亚集团	2,629,154.92	2.19
84	600418	江淮汽车	2,583,898.82	2.15
85	600068	葛洲坝	2,583,386.00	2.15
86	002146	荣盛发展	2,562,415.12	2.14
87	600261	阳光照明	2,460,459.70	2.05
88	300020	银江股份	2,438,634.37	2.03
89	600742	一汽富维	2,408,211.00	2.01

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）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	594,868,694.36
卖出股票的收入（成交）总额	610,334,627.29

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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名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名的所有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 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**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.9 投资组合报告附注**

**8.9.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.9.2** 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。

**8.9.3 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	500,000.00

2	应收证券清算款	2,034,755.12
3	应收股利	-
4	应收利息	1,474.50
5	应收申购款	11,067.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,547,296.79

#### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的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
1,726	44,420.86	10,097,814.23	13.17%	66,572,586.75	86.83%

#### 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	1,415.34	0.0018%

注：1. 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；

2. 本基金基金经理持有本基金份额数量的数量区间为 0。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年8月18日)基金份额总额	347,347,368.89
本报告期期初基金份额总额	134,191,588.03
本报告期基金总申购份额	1,257,532.61
减:本报告期基金总赎回份额	58,778,719.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	76,670,400.98

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内基金管理人重大人事变动如下：根据基金管理人 2012 年 12 月 28 日第一届董事会第二十八次会议决议，自 2012 年 12 月 28 日起，胡斌先生不再担任本基金管理人总经理职务，本基金管理人董事长安保和先生代为履行总经理职责。本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：2012 年 11 月 15 日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕961 号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕1036 号）。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金进行审计。本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所有限公司审计费人民币 60,000 元。

普华永道中天会计师事务所有限公司自本基金成立以来一直提供审计服务。

### 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

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
国泰君安	2	234,456,074.81	19.45%	200,849.28	19.49%	-
中信证券	2	197,978,111.50	16.43%	160,858.58	15.61%	-
国金证券	1	177,024,192.26	14.69%	155,812.03	15.12%	-
广发证券	2	160,400,660.30	13.31%	132,812.05	12.89%	-
中金公司	2	97,833,944.18	8.12%	83,158.90	8.07%	-
东北证券	2	93,941,986.67	7.79%	81,303.48	7.89%	-
安信证券	2	63,621,673.56	5.28%	56,298.87	5.46%	-
英大证券	1	56,019,615.35	4.65%	47,616.50	4.62%	-
第一创业	1	46,430,117.23	3.85%	42,269.90	4.10%	-
高华证券	2	40,166,888.76	3.33%	35,543.86	3.45%	-
西部证券	3	37,322,457.03	3.10%	33,978.30	3.30%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1.基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

2. 第一创业、民生证券、银河证券、国都证券、东北证券为在本报告期内新增。

### 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
国泰君安	18,215,465.34	29.98%	143,200,000.00	24.15%	-	-
中信证券	12,337,766.17	20.30%	-	-	-	-
国金证券	6,121,190.12	10.07%	224,800,000.00	37.91%	-	-
广发证券	4,530,254.03	7.46%	-	-	-	-
中金公司	9,091,852.30	14.96%	-	-	-	-
东北证券	8,248,541.81	13.57%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	5,000,000.00	0.84%	-	-
第一创业	2,219,117.56	3.65%	165,000,000.00	27.82%	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	55,000,000.00	9.27%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

东海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	纽银基金关于旗下开放式基金 2011 年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2012-01-01
2	关于纽银基金旗下基金持有的长期停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2012-01-06
3	纽银梅隆西部基金管理有限公司关于旗下纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金参加建设银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2012-01-13
4	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金 2011 年 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2012-01-20
5	关于纽银基金直销网上交易推出农业银行借记卡持有人基金定期定额投资业务及相关优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2012-02-08
6	关于增加中信证券（浙江）有限责任公司为纽银基金旗下证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2012-02-13
7	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金 2011 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、公司网站	2012-03-26
8	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2012 年第一期）公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2012-03-28
9	纽银基金关于旗下证券投资基金参加国泰君安证券基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2012-04-09
10	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2012-04-23
11	纽银基金关于增加深圳众禄为代销机构及开通基金转换并参加基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2012-06-25
12	纽银基金关于旗下开放式基金 2012 年半年度最后一个自然日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2012-07-02
13	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金 2012 年 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2012-07-18
14	纽银基金关于增加上海天天基金销售有限	中国证券报、证券时	2012-07-24

	公司为旗下证券投资基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	报、上海证券报、公司网站	
15	纽银基金关于增加长量基金为旗下证券投资基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-08-24
16	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金 2012 年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、公司网站	2012-08-29
17	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2012 年第 2 期）公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2012-09-24
18	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金 2012 年 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2012-10-26
19	关于纽银梅隆西部基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-11-23
20	纽银基金旗下证券投资基金参加中国银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-12-03
21	纽银基金关于增加旗下证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-12-13
22	纽银基金关于增加好买基金为旗下证券投资基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-12-17
23	纽银基金关于增加旗下证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-12-17
24	纽银梅隆西部基金管理有限公司关于总经理离职的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2012-12-29

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任中国建设银行董事长、执行董事。

2、2012 年 11 月 15 日，根据工作需要，中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金设立的相关文件；
- (2) 《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》；
- (6) 报告期内纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

### 13.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 19 楼

### 13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资人可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.bnyfund.com> 投资人对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人纽银梅隆西部基金管理有限公司，咨询电话 4007-007-818（免长途话费）或发电子邮件，E-mail:service@bnyfund.com。

纽银梅隆西部基金管理有限公司

二〇一三年三月二十九日