

纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金

2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 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：二〇一三年八月二十七日

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。本半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 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 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.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 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.....	37

7.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	37
7.10	投资组合报告附注	38
8	基金份额持有人信息	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
9	开放式基金份额变动	39
10	重大事件揭示	39
10.1	基金份额持有人大会决议	39
10.2	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	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4	基金投资策略的改变	40
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	40
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8	其他重大事件	42
11	备查文件目录	43
11.1	备查文件目录	43
11.2	存放地点	43
11.3	查阅方式	43

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	71,252,905.98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> <p>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）。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>公司股价运行规律，投资A股市场中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。</p> <p>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和风险控制等制度。基金在进行股指期货投资时，将通过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	田青
	联系电话	021-38572888	010-67595096
	电子邮箱	service@bnyfund.com	tianqingl.zh@ccb.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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.bnyfund.com
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	8,142,235.20
本期利润	2,207,173.08
加权平均基金份额本期利润	0.0320
本期加权平均净值利润率	3.48%
本期基金份额净值增长率	5.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）

期末可供分配利润	-6,596,100.43
期末可供分配基金份额利润	-0.0926
期末基金资产净值	66,599,208.83
期末基金份额净值	0.935
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-6.50%

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。

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
过去一个月	-4.40%	1.68%	-8.66%	1.03%	4.26%	0.65%
过去三个月	4.94%	1.37%	-6.18%	0.80%	11.12%	0.57%
过去六个月	5.06%	1.39%	-6.23%	0.82%	11.29%	0.57%
过去一年	8.34%	1.15%	-4.06%	0.75%	12.40%	0.40%
自基金合同生效至今	-6.50%	1.02%	-10.29%	0.75%	3.79%	0.27%

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 2013 年 6 月 30 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。

2. 本基金建仓期自 2011 年 8 月 18 日至 2012 年 2 月 17 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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 3 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 2013 年 6 月 30 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、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	-	十三年	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	2013-05-06	十一年	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。

注：1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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合规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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《公平交易管理制度》及《异常交易监控及报告制度》并严格遵守上述制度和流程，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。

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进行规范。

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，分别于每季度和每年度末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交易的交易价差进行分析。

4.3.2 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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年证券市场经历了先扬后抑，转而急剧下跌的走势，沪深 300 跌幅超过 12%。随着制造业 PMI 的持续回落，投资者对经济复苏的预期不断调低。直至六月流动性的骤紧，导致了市场的极度悲观与恐慌。大部分传统产业在此背景下持续下跌，而景气持续向好的 TMT、环保及医药板块则不断上涨。上半年我们逐步减持了周期股，并加大了对于 TMT 及环保、医药板块的投资，取得了较好的效果。

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 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.935 元，本报告期份额净值增长率为 5.06%，同期业绩比较基准增长率为 -6.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，中国经济正面临转型的开端，一方面需要通过抑制高耗能高排放行业淘汰落后产能、调整能源消费结构，从而实现产业结构优化、促进资源节约利用，提高使用效率，并进一步推进服务业与战略新兴产业的发展。另一方面，扩大内需也带来消费的增量与升级，随着对产品质量诉求的提高，大众消费趋于品牌化。下半年流动性边际趋紧，金融系统的风险仍然存在进一步释放的要求，投资中我们依然关注服务业、战略新兴产业与品牌消费品的投资机会，同时也要更为关注企业的盈利质量。

4.6 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及其适用性的情况，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。各成员平均具有 7 年以上的基金相关从业经验，且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验并具备必要的专业知识和独立性，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。

4.7 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,322,817.77	3,054,944.90
结算备付金		221,704.19	693,610.65
存出保证金		78,718.77	500,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	55,550,127.53	53,267,610.37
其中：股票投资		45,603,127.53	53,267,610.37
基金投资		-	-
债券投资		9,947,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	10,000,000.00
应收证券清算款		-	2,034,755.12
应收利息	6.4.7.5	199,169.35	1,474.50
应收股利		-	-
应收申购款		494.07	11,067.17
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		67,373,031.68	69,563,462.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		6,127.83	117,897.26
应付管理人报酬		86,657.52	81,135.51
应付托管费		14,442.91	13,522.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	181,445.25	200,449.59
应交税费		96,288.00	96,288.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	388,861.34	800,326.54
负债合计		773,822.85	1,309,619.50
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	71,252,905.98	76,670,400.98
未分配利润	6.4.7.10	-4,653,697.15	-8,416,557.77
所有者权益合计		66,599,208.83	68,253,843.21
负债和所有者权益总计		67,373,031.68	69,563,462.71

注: 报告截止日 2013 年 6 月 30 日, 基金份额净值 0.935 元, 基金份额总额 71,252,905.98 份。

6.2 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: 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		3,751,454.72	-313,074.99
1.利息收入		194,090.97	449,084.52
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	27,611.95	53,649.40

债券利息收入		154,041.09	381,258.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,437.93	14,176.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,468,175.77	-4,195,900.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,281,241.37	-4,981,319.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	332,871.54
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	186,934.40	452,547.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,935,062.12	3,382,697.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	24,250.10	51,043.83
减：二、费用		1,544,281.64	2,223,531.95
1. 管理人报酬		473,428.40	775,134.66
2. 托管费		78,904.74	129,189.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	834,221.67	1,154,075.36
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	157,726.83	165,132.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,207,173.08	-2,536,606.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,207,173.08	-2,536,606.94

6.3 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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）	76,670,400.98	-8,416,557.77	68,253,843.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,207,173.08	2,207,173.08
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）	-5,417,495.00	1,555,687.54	-3,861,807.46
其中：1. 基金申购款	26,827,269.67	-605,714.43	26,221,555.24
2. 基金赎回款	-32,244,764.67	2,161,401.97	-30,083,362.70
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）	71,252,905.98	-4,653,697.15	66,599,208.83
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）	-	-2,536,606.94	-2,536,606.94
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）	-44,856,429.18	4,558,005.23	-40,298,423.95
其中：1. 基金申购款	596,614.88	-60,616.58	535,998.30
2. 基金赎回款	-45,453,044.06	4,618,621.81	-40,834,422.25
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）	89,335,158.85	-12,229,269.83	77,105,889.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈喆，主管会计工作负责人：陈喆，会计机构负责人：李健

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

6.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《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 6.4.4 所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“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”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 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

本报告期内,本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与 2012 年年度财务报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股票红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的税项列示如下:

(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,包括基金买卖股票、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,暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税,自 2013 年 1 月 1 日起,对个人投资者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。

(4) 自 2008 年 9 月 19 日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,证券交易印花税改为单边征收,即仅对卖出股票按 0.1%的税率征收。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
活期存款	11,322,817.77
定期存款	-
其他存款	-
合计	11,322,817.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		45,999,284.55	45,603,127.53	-396,157.02
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	9,989,510.00	9,947,000.00	-42,510.00
	合计	9,989,510.00	9,947,000.00	-42,510.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		55,988,794.55	55,550,127.53	-438,667.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	2,253.43
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	99.70
应收债券利息	196,780.82
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	35.40
合计	199,169.35

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	181,445.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	181,445.25

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	12.62
预提费用	138,848.72
合计	388,861.34

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	76,670,400.98	76,670,400.98
本期申购	26,827,269.67	26,827,269.67
本期赎回（以“-”号填列）	-32,244,764.67	-32,244,764.67
本期末	71,252,905.98	71,252,905.98

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	-15,732,943.27	7,316,385.50	-8,416,557.77
本期利润	8,142,235.20	-5,935,062.12	2,207,173.08
本期基金份额交易产生的	994,607.64	561,079.90	1,555,687.54

变动数			
其中：基金申购款	-3,322,156.58	2,716,442.15	-605,714.43
基金赎回款	4,316,764.22	-2,155,362.25	2,161,401.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,596,100.43	1,942,403.28	-4,653,697.15

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	21,175.19
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	5,853.71
其他	583.05
合计	27,611.95

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	277,754,119.86
减：卖出股票成本总额	268,472,878.49
买卖股票差价收入	9,281,241.37

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内未投资债券，债券投资收益为零。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	186,934.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	186,934.40

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,935,062.12

——股票投资	-5,892,552.12
——债券投资	-42,510.00
——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	-5,935,062.12

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	23,903.44
转换费收入	346.66
合计	24,250.10

注：本基金赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	834,046.67
银行间市场交易费用	175.00
合计	834,221.67

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	109,095.94
银行汇划费用	478.11
债券账户维护费	18,000.00
其他	400.00
合计	157,726.83

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至 2013 年 6 月 30 日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	5,036,372.67	0.93%	0.00	0.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易，并无上年度可比期间。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易，并无上年度可比期间。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易，并无上年度可比期间。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30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	4,584.99	0.93%	4,584.99	2.53%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	473,428.40	775,134.66
其中：支付销售机构的客户 维护费	205,139.29	397,229.32

注：1) 支付基金管理人纽银梅隆西部基金管理有限公司的基金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。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	78,904.74	129,189.24

注：1) 支付基金托管人中国建设银行的基金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。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，并无上年度可比期间。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况，并无上年度可比期间。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况，并无上年度可比期间。

6.4.10.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	11,322,817.77	21,175.19	7,153,748.17	47,675.89

注：1) 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

2) 本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2013 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 221,704.19 元。(2012 年 6 月 30 日：人民币 629,514.45 元)

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况，并无上年度可比期间。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 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
300020	银江股份	2013-06-03	重大事项	22.67	-	-	29,999	620,995.47	680,077.33	-
601886	江河创建	2013-06-20	重大事项	13.22	2013-07-16	13.78	77,662	796,362.85	1,026,691.64	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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，由投资风险管理人員负责投资风险管理及绩效评估。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 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同责任，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人中国建设银行，因而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，因此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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且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%。于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。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。

本基金所持有的全部金融负债的合约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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2013年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,322,817.77	-	-	-	11,322,817.77
结算备付金	221,704.19	-	-	-	221,704.19
存出保证金	78,718.77	-	-	-	78,718.77
交易性金融资产	9,947,000.00	-	-	45,603,127.53	55,550,127.53
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	199,169.35	199,169.35
应收申购款	-	-	-	494.07	494.07
资产总计	21,570,240.73	-	-	45,802,790.95	67,373,031.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,127.83	6,127.83
应付管理人报酬	-	-	-	86,657.52	86,657.52
应付托管费	-	-	-	14,442.91	14,442.91
应付交易费用	-	-	-	181,445.25	181,445.25
应交税费	-	-	-	96,288.00	96,288.00
其他负债	-	-	-	388,861.34	388,861.34
负债总计	-	-	-	773,822.85	773,822.85

利率敏感度缺口	21,570,240.73	-	-	45,028,968.10	66,599,208.83
上年度末 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

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 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）	
		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	市场利率上升25个基点	增加约0.96万元	-
	市场利率下降25个基点	减少约0.96万元	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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。

6.4.13.4.3 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的股票，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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占本基金资产的 30%-80%；债券、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%；本基金保留的现金或者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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	45,603,127.53	68.47	53,267,610.37	78.04
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	45,603,127.53	68.47	53,267,610.37	78.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)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)	
		本期末	上年度末

	2013 年 6 月 30 日	2012 年 12 月 31 日
1. 业绩比较基准(附注 6.4.1) 上升5%	增加约176.00万元	增加约403.00万元
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降5%	减少约176.00万元	减少约403.00万元

6.4.14 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) 各层次金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 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 43,896,358.56 元,属于第二层级的余额为 11,653,768.97 元,无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日: 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)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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) 第三层次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。

7 投资组合报告

7.1 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	45,603,127.53	67.69
	其中：股票	45,603,127.53	67.69
2	固定收益投资	9,947,000.00	14.76
	其中：债券	9,947,000.00	14.76
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	11,544,521.96	17.14
6	其他各项资产	278,382.19	0.41
7	合计	67,373,031.68	100.00

7.2 报告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	采矿业	-	-
C	制造业	36,755,384.98	55.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,749,423.62	5.63
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	680,077.33	1.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,990,223.60	4.49
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,428,018.00	2.14
S	综合	-	-
	合计	45,603,127.53	68.47

7.3 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	002241	歌尔声学	141,300	5,127,777.00	7.70
2	600703	三安光电	219,080	4,302,731.20	6.46
3	002415	海康威视	115,670	4,087,777.80	6.14
4	002450	康得新	128,353	3,591,316.94	5.39
5	002521	齐峰股份	427,125	3,083,842.50	4.63
6	300058	蓝色光标	71,708	2,990,223.60	4.49
7	300177	中海达	159,128	2,832,478.40	4.25
8	300088	长信科技	95,023	2,004,035.07	3.01
9	600360	华微电子	487,186	1,856,178.66	2.79
10	601928	凤凰传媒	169,800	1,428,018.00	2.14
11	002325	洪涛股份	119,593	1,423,156.70	2.14
12	002022	科华生物	91,400	1,353,634.00	2.03
13	002431	棕榈园林	68,543	1,299,575.28	1.95
14	300110	华仁药业	163,416	1,289,352.24	1.94
15	300298	三诺生物	28,100	1,246,235.00	1.87
16	002106	莱宝高科	76,000	1,166,600.00	1.75
17	601886	江河创建	77,662	1,026,691.64	1.54
18	600388	龙净环保	38,900	881,863.00	1.32
19	300303	聚飞光电	50,000	797,500.00	1.20
20	600557	康缘药业	26,042	691,415.10	1.04
21	002038	双鹭药业	11,676	684,213.60	1.03
22	300020	银江股份	29,999	680,077.33	1.02
23	300026	红日药业	15,877	538,865.38	0.81
24	300054	鼎龙股份	30,000	515,700.00	0.77
25	000100	TCL 集团	200,000	454,000.00	0.68
26	600867	通化东宝	16,781	249,869.09	0.38

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300088	长信科技	7,447,701.41	10.91
2	601318	中国平安	6,907,345.50	10.12
3	601166	兴业银行	5,768,091.15	8.45
4	600388	龙净环保	5,754,074.89	8.43
5	601117	中国化学	5,343,193.00	7.83
6	300207	欣旺达	4,454,663.81	6.53
7	002521	齐峰股份	4,372,601.80	6.41
8	600703	三安光电	4,348,374.20	6.37
9	002415	海康威视	4,326,361.42	6.34
10	002241	歌尔声学	4,323,913.36	6.34
11	300177	中海达	4,262,851.42	6.25
12	600418	江淮汽车	4,111,141.00	6.02
13	600000	浦发银行	3,908,835.00	5.73
14	002450	康得新	3,561,112.26	5.22
15	300328	宜安科技	3,549,922.36	5.20
16	601038	一拖股份	3,492,157.50	5.12
17	600050	中国联通	3,339,440.00	4.89
18	601288	农业银行	3,248,000.00	4.76
19	601398	工商银行	3,198,240.00	4.69
20	600360	华微电子	3,157,342.80	4.63
21	300134	大富科技	3,156,090.79	4.62
22	300271	华宇软件	3,152,309.10	4.62
23	002318	久立特材	3,150,903.80	4.62
24	600016	民生银行	3,134,512.30	4.59
25	300115	长盈精密	3,036,504.00	4.45
26	300058	蓝色光标	2,909,501.07	4.26
27	601886	江河创建	2,866,650.54	4.20
28	601111	中国国航	2,774,976.92	4.07
29	601699	潞安环能	2,726,928.36	4.00
30	000002	万科 A	2,714,776.80	3.98
31	600029	南方航空	2,644,703.09	3.87
32	002618	丹邦科技	2,609,747.00	3.82
33	000655	金岭矿业	2,587,425.00	3.79
34	002172	澳洋科技	2,455,382.00	3.60

35	002271	东方雨虹	2,310,791.29	3.39
36	000651	格力电器	2,286,944.21	3.35
37	601009	南京银行	2,277,769.00	3.34
38	600867	通化东宝	2,231,624.65	3.27
39	600967	北方创业	2,178,668.55	3.19
40	002038	双鹭药业	2,161,725.00	3.17
41	600372	中航电子	2,124,898.52	3.11
42	601918	国投新集	2,109,320.51	3.09
43	300110	华仁药业	2,108,655.01	3.09
44	300026	红日药业	2,078,789.00	3.05
45	300054	鼎龙股份	2,072,618.01	3.04
46	601555	东吴证券	2,013,536.00	2.95
47	000761	本钢板材	1,975,515.90	2.89
48	600978	宜华木业	1,922,099.00	2.82
49	601857	中国石油	1,916,288.00	2.81
50	002185	华天科技	1,877,233.00	2.75
51	002073	软控股份	1,871,295.46	2.74
52	000783	长江证券	1,844,917.00	2.70
53	000789	江西水泥	1,807,744.00	2.65
54	300298	三诺生物	1,804,436.00	2.64
55	601933	永辉超市	1,792,713.13	2.63
56	300159	新研股份	1,740,114.71	2.55
57	600705	中航投资	1,710,341.00	2.51
58	300303	聚飞光电	1,650,974.60	2.42
59	002325	洪涛股份	1,645,021.38	2.41
60	002273	水晶光电	1,624,102.00	2.38
61	600446	金证股份	1,592,336.91	2.33
62	300178	腾邦国际	1,555,516.00	2.28
63	601928	凤凰传媒	1,548,775.00	2.27
64	002155	辰州矿业	1,504,977.18	2.20
65	002106	莱宝高科	1,498,945.00	2.20
66	600252	中恒集团	1,486,937.00	2.18
67	000786	北新建材	1,481,310.00	2.17
68	002431	棕榈园林	1,481,016.54	2.17
69	002022	科华生物	1,472,972.00	2.16
70	002456	欧菲光	1,440,742.70	2.11
71	000024	招商地产	1,414,510.00	2.07
72	000937	冀中能源	1,403,660.00	2.06

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。

7.4.2 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	601166	兴业银行	8,355,002.03	12.24
2	300088	长信科技	7,366,363.14	10.79
3	601117	中国化学	6,642,074.91	9.73
4	600000	浦发银行	6,522,756.61	9.56
5	601318	中国平安	6,515,224.86	9.55
6	600388	龙净环保	5,683,935.58	8.33
7	300207	欣旺达	4,936,002.21	7.23
8	600418	江淮汽车	4,564,663.11	6.69
9	300328	宜安科技	4,091,427.83	5.99
10	300115	长盈精密	4,004,129.94	5.87
11	002318	久立特材	3,809,904.61	5.58
12	601038	一拖股份	3,722,318.46	5.45
13	002618	丹邦科技	3,551,125.16	5.20
14	000651	格力电器	3,479,612.45	5.10
15	000002	万科 A	3,476,024.41	5.09
16	300134	大富科技	3,341,720.25	4.90
17	600016	民生银行	3,296,885.20	4.83
18	600050	中国联通	3,240,805.99	4.75
19	601288	农业银行	3,231,000.00	4.73
20	601398	工商银行	3,183,520.00	4.66
21	002271	东方雨虹	3,153,565.42	4.62
22	600029	南方航空	3,151,621.06	4.62
23	601699	潞安环能	3,060,947.73	4.48
24	300271	华宇软件	2,881,928.04	4.22
25	601111	中国国航	2,863,506.88	4.20
26	300251	光线传媒	2,758,511.84	4.04
27	600372	中航电子	2,726,857.44	4.00
28	601169	北京银行	2,569,038.79	3.76
29	002172	澳洋科技	2,567,522.32	3.76
30	000655	金岭矿业	2,369,114.16	3.47
31	000656	金科股份	2,279,955.81	3.34
32	601918	国投新集	2,238,575.44	3.28
33	002073	软控股份	2,220,114.82	3.25
34	600967	北方创业	2,211,611.72	3.24
35	601009	南京银行	2,171,913.50	3.18
36	002155	辰州矿业	2,154,352.69	3.16
37	002185	华天科技	2,150,798.92	3.15
38	600252	中恒集团	2,113,259.31	3.10
39	000783	长江证券	2,040,966.04	2.99

40	601886	江河创建	2,037,136.58	2.98
41	600705	中航投资	2,015,669.80	2.95
42	600867	通化东宝	1,997,022.86	2.93
43	600978	宜华木业	1,955,505.25	2.87
44	000761	本钢板材	1,953,542.85	2.86
45	600123	兰花科创	1,940,505.81	2.84
46	601555	东吴证券	1,902,297.03	2.79
47	000024	招商地产	1,874,421.50	2.75
48	601857	中国石油	1,870,000.00	2.74
49	300241	瑞丰光电	1,859,476.10	2.72
50	002521	齐峰股份	1,816,177.03	2.66
51	002456	欧菲光	1,811,560.79	2.65
52	300054	鼎龙股份	1,811,214.48	2.65
53	002273	水晶光电	1,809,301.21	2.65
54	300128	锦富新材	1,806,200.78	2.65
55	000789	江西水泥	1,792,762.00	2.63
56	300159	新研股份	1,782,489.50	2.61
57	601299	中国北车	1,744,727.56	2.56
58	000937	冀中能源	1,733,893.40	2.54
59	601933	永辉超市	1,732,951.00	2.54
60	000049	德赛电池	1,713,308.35	2.51
61	600837	海通证券	1,654,280.10	2.42
62	600446	金证股份	1,646,734.21	2.41
63	002038	双鹭药业	1,640,130.64	2.40
64	600340	华夏幸福	1,621,360.96	2.38
65	300026	红日药业	1,612,787.37	2.36
66	601601	中国太保	1,542,468.90	2.26
67	300178	腾邦国际	1,514,738.59	2.22
68	300177	中海达	1,481,167.47	2.17
69	002308	威创股份	1,461,682.21	2.14
70	000786	北新建材	1,410,733.71	2.07
71	600801	华新水泥	1,409,351.86	2.06
72	600518	康美药业	1,409,200.00	2.06

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	266,700,947.77
卖出股票的收入（成交）总额	277,754,119.86

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,947,000.00	14.94
	其中：政策性金融债	9,947,000.00	14.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,947,000.00	14.94

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	120245	12 国开 45	100,000	9,947,000.00	14.94
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。本基金投资的前十名证券的发行主体除三安光电（600703）外，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

三安光电（600703）2012 年 7 月 31 日发布公告称，收到《中国证监会行政处罚决定书（林科闯）（2012）36 号》及《中国证监会行政处罚决定书（易生泽）（2012）33 号》，因原总经理林科闯（任职期间 2008 年至 2011 年 11 月）、原董事会秘书易生泽（任职期间 2008 年至 2011 年 9 月），操作他人账户买卖三安光电股票，非法获利，证监会对林科闯、易生泽给予警告并罚款。

该情况发生后，本基金管理人针对上述事件进行了及时分析和研究，认为三安光电的违规问题对公司的经营和财务状况未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响，投资行为符合本基金管理人内部投资管理制度。

7.10.2 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。

7.10.3 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	78,718.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	199,169.35
5	应收申购款	494.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	278,382.19

7.10.4 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。

7.10.5 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。

7.10.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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	户均持有的	持有人结构
------	-------	-------

数(户)	基金份额	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
1,476	48,274.33	98,814.23	0.14%	71,154,091.75	99.86%

8.2 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	1,415.34	0.002%

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。

9 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
本报告期初基金份额总额	76,670,400.98
本报告期基金总申购份额	26,827,269.67
减：本报告期基金总赎回份额	32,244,764.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	71,252,905.98

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：根据基金管理人第一届董事会第二十九次会议决议通过，及中国证券监督管理委员会证监许可[2013]276号文核准，陈喆先生自 2013 年 3 月 25 日起担任本基金管理人总经理职务，董事长安保和先生不再代为履行总经理职责。基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中投证券	2	137,200,716.10	25.20%	123,100.85	25.05%	-
申银万国	2	124,094,271.34	22.79%	112,975.12	22.99%	-
安信证券	2	93,093,054.18	17.10%	82,378.38	16.76%	-
第一创业	1	65,273,756.04	11.99%	59,425.14	12.09%	-
招商证券	2	37,639,720.95	6.91%	34,267.16	6.97%	-
英大证券	1	30,401,700.29	5.58%	27,677.69	5.63%	-
兴业证券	2	24,426,784.93	4.49%	22,238.19	4.52%	-
国泰君安	2	19,276,639.07	3.54%	17,549.59	3.57%	-
长江证券	1	8,012,052.06	1.47%	7,293.98	1.48%	-
西部证券	3	5,036,372.67	0.93%	4,584.99	0.93%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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.报告期内新增交易单元为：

- 1) 长江证券
- 2) 招商证券

3.报告期内退租的交易单元为：

- 1) 东海证券

10.7.2 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
中投证券	-	-	-	-	-	-

申银万国	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	19,500,000.00	76.47%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	6,000,000.00	23.53%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	纽银梅隆西部基金管理有限公司关于旗下开放式基金2012年12月31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、上海证券报、公司网站	2013-01-01
2	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金2012年4季度报告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2013-01-21
3	纽银梅隆西部基金管理有限公司关于总经理任职的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2013-03-28
4	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金2012年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、公司网站	2013-03-29
5	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（2013年第一期）公告	中国证券报、公司网站	2013-03-29
6	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金2013年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2013-04-19

7	纽银梅隆西部基金管理有限公司关于增加注册资本和修改公司章程的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2013-04-22
8	纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2013-05-07
9	关于纽银基金旗下证券投资基金持有的长期停牌股票采用指数收益法估值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2013-05-07

11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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

11.3 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
二〇一三年八月二十七日