

纽银稳健双利债券型证券投资基金
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
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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名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	37
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	38
9 开放式基金份额变动	38

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.....	39
10.4 基金投资策略的改变	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件	41
11 备查文件目录	42
11.1 备查文件目录	42
11.2 存放地点	42
11.3 查阅方式	42

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	纽银稳健双利债券型证券投资基金	
基金简称	纽银稳健双利债券	
基金主代码	675011	
交易代码	675011	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年6月26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	118,249,357.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	纽银稳健双利债券A	纽银稳健双利债券C
下属分级基金的交易代码	675011	675013
报告期末下属分级基金的份额总额	48,426,609.54份	69,822,747.88份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持资产流动性的前提下，对固定收益类资产辅以权益类资产增强性配置，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1.资产配置策略</p> <p>本基金根据对宏观经济趋势、国家宏观调控政策方向、行业和企业盈利、信用状况及其变化趋势、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等因素的动态分析，在限定投资范围内，决定债券类资产和权益类资产的配置比例，并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期或不定期对大类资产配置比例进行调整。</p> <p>2.债券配置策略</p> <p>债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理，识别收益率曲线中价值低估的部分以及各类债券中价值低估的种类。本基金在充分研究债券市场宏观环境和仔细分析利率走势基础上，通过久期管理、期限结构配置、个券选择等策略依次完成组合构建。在投资过程中，以中长期利率趋势分析为主，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判及收益率曲线分析，在保证流动性和风险可控的前提下，实施积极的债券投资组合管理。</p>

	<p>3.股票配置策略</p> <p>(1) 新股投资策略</p> <p>本基金将深入研究新股发行公司的基本价值、可比公司估值水平、近期新股发行市盈率、二级市场走势等因素，制定相应的申购策略，并于锁定期后在控制组合波动率的前提下择时出售，以提高基金资产的收益率水平。</p> <p>(2) 二级市场股票投资策略</p> <p>本基金在大类资产配置基础上，进行行业配置。在个股选择方面，本基金主要采取自下而上的精选策略，考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、盈利能力、公司治理结构、价格趋势、成长性和估值水平等多种因素,精选流动性好，成长性高，估值水平低的股票进行投资。</p> <p>(3) 权证投资策略</p> <p>本基金结合自身资产状况审慎投资权证，主要运用价值发现和价差策略，力图获得最佳风险调整后的收益。</p>
业绩比较基准	中国债券综合财富指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金属债券型证券投资基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		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	tianqing1.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	《证券时报》、《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）	
	纽银稳健双利债券 A	纽银稳健双利债券 C
本期已实现收益	2,701,532.30	2,739,943.34
本期利润	4,527,537.50	6,854,117.24
加权平均基金份额本期利润	0.0328	0.0343
本期加权平均净值利润率	3.20%	3.37%
本期基金份额净值增长率	2.98%	2.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)	
	纽银稳健双利债券 A	纽银稳健双利债券 C
期末可供分配利润	1,678,060.49	2,104,082.36
期末可供分配基金份额利润	0.0347	0.0301
期末基金资产净值	50,206,533.07	72,074,100.27
期末基金份额净值	1.037	1.032
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)	
	纽银稳健双利债券 A	纽银稳健双利债券 C
基金份额累计净值增长率	3.70%	3.20%

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）。

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

纽银稳健双利债券A

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	-1.05%	0.68%	-1.92%	0.29%	0.87%	0.39%
过去三个月	1.47%	0.49%	-0.37%	0.19%	1.84%	0.30%
过去六个月	2.98%	0.41%	0.83%	0.18%	2.15%	0.23%
过去一年	3.70%	0.29%	1.70%	0.15%	2.00%	0.14%
自基金合同生效起至今	3.70%	0.28%	1.86%	0.15%	1.84%	0.13%

纽银稳健双利债券C

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	-1.15%	0.67%	-1.92%	0.29%	0.77%	0.38%
过去三个月	1.38%	0.49%	-0.37%	0.19%	1.75%	0.30%
过去六个月	2.69%	0.41%	0.83%	0.18%	1.86%	0.23%
过去一年	3.20%	0.29%	1.70%	0.15%	1.50%	0.14%
自基金合同生效至今	3.20%	0.28%	1.86%	0.15%	1.34%	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

纽银稳健双利债券型证券投资基金

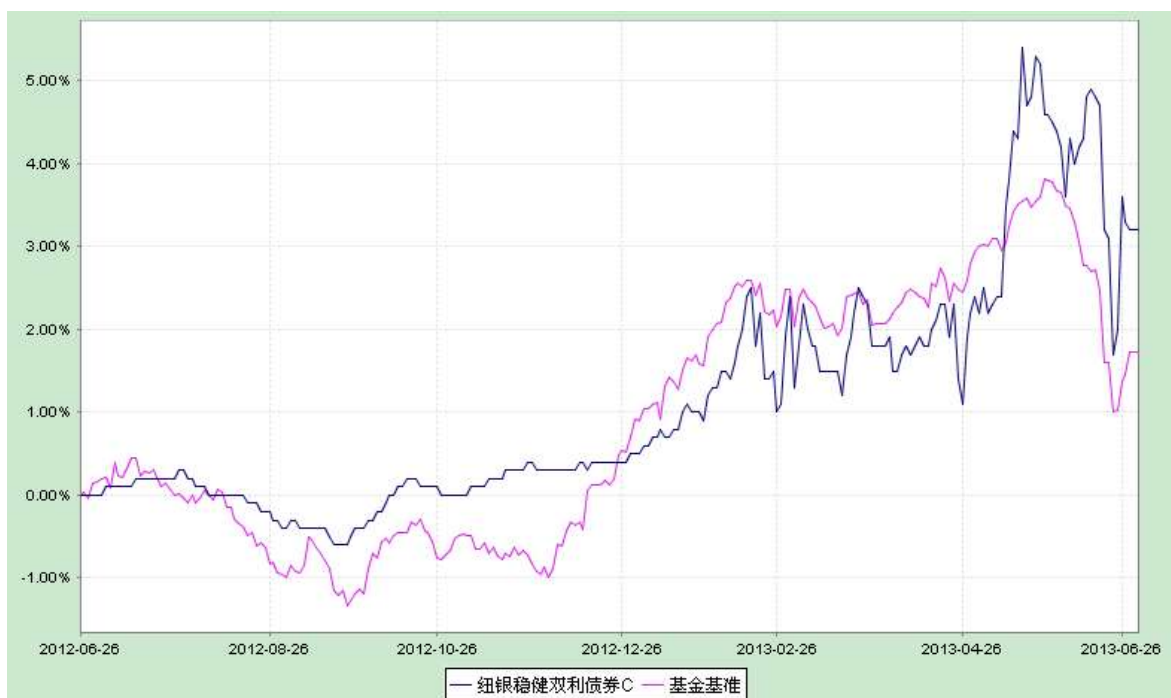
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年6月26日至2013年6月30日)

纽银稳健双利债券 A



纽银稳健双利债券 C



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2012年6月26日至2012年12月25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		
李健	本基金基金经理	2012-06-26	-	十年	上海交通大学工业设计/金融学双学士；曾任东亚银行（中国）有限公司债券投资及利率衍生品交易主管、招商基金管理有限公司债券交易高级经理。2011 年 8 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
闫旭	本基金基金经理、公司投资副总监	2013-01-31	-	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。
陶翀	本基金基金经理助理	2012-06-26	-	九年	上海财经大学投资经济学硕士；曾任新理益集团有限公司投资研究部高级分析师、国华人寿保险股份有限公司资产管理部投资经理。2012 年 3 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》、《纽银稳健双利债券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，本基金通过固定收益平台卖出债券时出现固定收益类资产市值占基金资产净值的比例低于 80% 的情况，托管行对此进行了提示，本基金在一个交易日内调整完毕，对基金份额持有人利益未造成损害。除上述情况外，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

经历去年四季度环比明显反弹后，年初以来宏观经济持续低迷，制造业去产能仍在进行，工业品价格持续通缩。政策面看，政府风险偏好明显降低，以“控风险”和“调结构”的思路为主导，直接导致融资收缩。影子银行大发展出现停滞，地方政府、企业信用风险加大。上半年债券市场主要受流动性驱动。受日本、美国 2012 年下半年量化宽松影响，资金面在一季度处于季度宽裕状态，导致收益率下滑至近年低位。但二季度以后监管政策开始发酵，导致微观流动性下滑，同时银行资产负债表错配威胁也开始显现。在五月后美国 QE 退出预期加剧以及日元大幅升值后，外生流动性与内生流动性开始共振，致使资金面大幅飙升，债券收益率开始了上行趋势。六月中下旬时点，市场流动性异常紧张，资金利率飙升至十年新高。报告期内，收益率曲线整体平坦化，长端十年国债收益率基本走平，短端大幅上行。

报告期初由于资金面相对宽松，本基金采取了中性偏乐观的投资策略，在债券组合管理中重点配置有一定票息保护的银行间信用债，同时根据市场行情的节奏变化及时进行了组合调整，并进行了适当的波段性操作，获得了较好收益。报告期中后期，始于四月的监管风暴事件升级，资金结构

调整，以及季节性因素等等，使得流动性变得日趋紧张。因此二季度债券组合管理采取了中性偏保守的策略，维持 2-3 年中性偏短久期。尽管本基金在报告期内面临较大的市场资金面紧张和赎回带来的冲击，但集中在中期品种的配置品种起到了较好的防御作用。在股票投资方面，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。本基金主要在 TMT 等行业中精选个股，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 A 类份额净值为 1.037 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 2.98%；本基金 C 类份额净值为 1.032 元，本报告期 C 类份额净值增长率为 2.69%，同期业绩比较基准增长率为 0.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

汇丰 PMI 数值持续下滑，显示中国制造业增长势头进一步放缓。上半年经济增速为 7.6%，处于合理区间偏低的位置，而全年 GDP 增长 7.5% 的目标预期依旧没有改变。回顾历史，单纯依靠传统的刺激政策拉高增长率，必然会因为大幅超越潜在增长率而导致价格扭曲、通胀和资源浪费等不良后果。因此下半年，结构性改革与去杠杆成为政府工作的首要目标，以保证“稳增长”的顺利进行。物价仍会处于温和水平，综合考虑翘尾因素和新涨价因素，预计三季度 CPI 同比涨幅略低于二季度。外需方面，全球经济复苏缓慢对我国出口拉动作用有限，不会带来太多的惊喜。二季度是虚假贸易套利打击已显成效，出口虚假泡沫被有效挤出，下半年步入圣诞供货季，进出口数量或将会出现回升。由于利率市场化的推进，银行资金成本抬升致使短端利率偏高的局面仍将持续。对于利率产品而言，收益率曲线向上调整的节奏可能放缓，曲线形态逐步呈现陡峭化。而随着审计深入与经济增速下行，信用风险也在积聚。地方政府融资比例的上升与企业信用资质的下降，微观层面部分行业风险恶化的可能性加大，个别违约事件可能偶有爆发，因此资质较好信用债券或将受益。在外生流动性趋向紧张的影响下，商业银行资产负债错配的威胁不会主动消除。银行与监管风险偏好的差异可能对新一轮去杠杆下的资金面产生冲击，从而限制了转债市场上行空间。股票投资方面，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，因此在投资中依然关注服务业、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遵规守信、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：纽银稳健双利债券型证券投资基金

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	969,981.69	14,821,433.47
结算备付金		791,825.75	1,523,292.72
存出保证金		87,216.43	-
交易性金融资产	6.4.7.2	167,980,833.88	831,185,293.11
其中：股票投资		21,216,212.94	-

基金投资		-	-
债券投资		146,764,620.94	831,185,293.11
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	2,300,000.00	210,100,955.15
应收证券清算款		20,141,322.50	-
应收利息	6.4.7.5	3,282,971.27	20,278,918.16
应收股利		-	-
应收申购款		5,300.00	896.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		195,559,451.52	1,077,910,788.66
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		70,599,582.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,734,789.15	5,842,258.93
应付管理人报酬		92,117.84	687,039.13
应付托管费		26,319.38	196,296.90
应付销售服务费		27,116.20	296,683.71
应付交易费用	6.4.7.7	67,651.39	16,322.05
应交税费		501,600.00	-
应付利息		100,351.72	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	129,290.50	241,652.01
负债合计		73,278,818.18	7,280,252.73
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	118,249,357.42	1,064,683,194.21
未分配利润	6.4.7.10	4,031,275.92	5,947,341.72
所有者权益合计		122,280,633.34	1,070,630,535.93
负债和所有者权益总计		195,559,451.52	1,077,910,788.66

注：报告截止日2013年6月30日，A类基金份额净值1.037元，C类基金份额净值1.032元，基金份额总额118,249,357.42份，其中A类基金份额48,426,609.54份，C类基金份额69,822,747.88份。

6.2 利润表

会计主体：纽银稳健双利债券型证券投资基金

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6月26日（基 金合同生效日）至 2012年6月30日
一、收入		15,114,340.77	589,748.04
1.利息收入		8,258,367.54	587,615.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	104,653.89	63,943.73
债券利息收入		7,677,153.36	281.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		476,560.29	523,390.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		868,110.40	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,702,463.37	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,429,326.92	-
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	141,246.85	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,940,179.10	-5,062.12
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	47,683.73	7,194.51
减：二、费用		3,732,686.03	191,625.12
1. 管理人报酬		1,232,958.79	111,839.06
2. 托管费		352,273.91	31,954.01
3. 销售服务费		421,112.17	44,808.77
4. 交易费用	6.4.7.18	362,812.45	6.88
5. 利息支出		1,212,201.79	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,212,201.79	-
6. 其他费用	6.4.7.19	151,326.92	3,016.40

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,381,654.74	398,122.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,381,654.74	398,122.92

注：本基金合同生效日为2012年6月26日，2012年实际报告期间为2012年6月26日至2012年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：纽银稳健双利债券型证券投资基金

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）	1,064,683,194.21	5,947,341.72	1,070,630,535.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,381,654.74	11,381,654.74
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）	-946,433,836.79	-13,297,720.54	-959,731,557.33
其中：1.基金申购款	5,097,544.49	93,168.98	5,190,713.47
2.基金赎回款	-951,531,381.28	-13,390,889.52	-964,922,270.80
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）	118,249,357.42	4,031,275.92	122,280,633.34
项目	上年度可比期间 2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）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）	1,461,786,202.78	-	1,461,786,202.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	398,122.92	398,122.92

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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	1,461,786,202.78	398,122.92	1,462,184,325.70

注：本基金合同生效日为2012年6月26日，2012年实际报告期间为2012年6月26日至2012年6月30日。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

纽银稳健双利债券型证券投资基金(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[2012]483 号《关于核准纽银稳健双利债券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》、《纽银稳健双利债券型证券投资基金基金合同》和《纽银稳健双利债券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 1,460,990,933.52 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(2012)第 234 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《纽银稳健双利债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,461,786,202.78 份基金份额，其中认购资金利息折合 795,269.26 份基金份额，划入基金份额持有人账户。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《纽银稳健双利债券型证券投资基金基金合同》，本基金根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的，称为 A 类；不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

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》、《纽银稳健双利债券型证券投资基金基金合同》和最新公布的《纽银稳健双利债券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：固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，并保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

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》、《纽银稳健双利债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监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	969,981.69
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	969,981.69	

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	17,417,886.92	21,216,212.94	3,798,326.02
债券	交易所市场	80,237,396.24	80,051,620.94
	银行间市场	67,663,221.80	66,713,000.00
	合计	147,900,618.04	146,764,620.94
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	165,318,504.96	167,980,833.88	2,662,328.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于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

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所	2,300,000.00	-
合计	2,300,000.00	-

6.4.7.4.2 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	943.78
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	356.40
应收债券利息	3,279,381.79
应收买入返售证券利息	2,250.00
应收申购款利息	-
其他	39.30
合计	3,282,971.27

6.4.7.6 其他资产

本基金于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	65,321.99
银行间市场应付交易费用	2,329.40
合计	67,651.39

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	-
应付赎回费	360.58
预提费用	128,929.92
合计	129,290.50

6.4.7.9 实收基金

纽银稳健双利债券 A

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	账面金额
上年度末	246,572,735.49	246,572,735.49
本期申购	73,871.00	73,871.00
本期赎回（以“-”号填列）	-198,219,996.95	-198,219,996.95

本期末	48,426,609.54	48,426,609.54
-----	---------------	---------------

纽银稳健双利债券 C

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	账面金额
上年度末	818,110,458.72	818,110,458.72
本期申购	5,023,673.49	5,023,673.49
本期赎回（以“-”号填列）	-753,311,384.33	-753,311,384.33
本期末	69,822,747.88	69,822,747.88

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

纽银稳健双利债券 A

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	2,482,731.64	-715,641.61	1,767,090.03
本期利润	2,701,532.30	1,826,005.20	4,527,537.50
本期基金份额交易产生的变动数	-3,506,203.45	-1,008,500.55	-4,514,704.00
其中：基金申购款	1,151.05	582.03	1,733.08
基金赎回款	-3,507,354.50	-1,009,082.58	-4,516,437.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,678,060.49	101,863.04	1,779,923.53

纽银稳健双利债券 C

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	6,555,818.49	-2,375,566.80	4,180,251.69
本期利润	2,739,943.34	4,114,173.90	6,854,117.24
本期基金份额交易产生的变动数	-7,191,679.47	-1,591,337.07	-8,783,016.54
其中：基金申购款	56,395.25	35,040.65	91,435.90
基金赎回款	-7,248,074.72	-1,626,377.72	-8,874,452.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,104,082.36	147,270.03	2,251,352.39

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	80,136.80
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	24,124.65
其他	392.44
合计	104,653.89

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	111,548,379.87
减：卖出股票成本总额	114,250,843.24
买卖股票差价收入	-2,702,463.37

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,030,182,313.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,002,607,894.27
减：应收利息总额	24,145,091.97
债券投资收益	3,429,326.92

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本报告期末持有衍生工具。

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	141,246.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	141,246.85

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	5,940,179.10

——股票投资	3,798,326.02
——债券投资	2,141,853.08
——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	5,940,179.10

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	47,676.28
转换费收入	7.45
合计	47,683.73

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.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

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	356,472.45
银行间市场交易费用	6,340.00
合计	362,812.45

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	99,177.14
银行汇划费用	3,997.00
债券账户维护费	18,000.00
其他	400.00
合计	151,326.92

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

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6月26日（基金合同生效日） 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	143,627,771.77	59.05%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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6月26日（基金合同生效日） 至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
西部证券	369,935,447.58	63.80%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

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6月26日（基金合同生效日） 至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
西部证券	1,492,842,000.00	61.06%	-	-

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	122,904.62	57.55%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2012年6月26日（基金合同生效日）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6月26日（基金合同 生效日）至2012年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,232,958.79
其中：支付销售机构的客户维护费	850,724.90	81,291.80

注：支付基金管理人 纽银梅隆西部基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%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X0.7%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年6月26日（基金合同生效日）至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	352,273.91	31,954.01

注：支付基金托管人 中国建设银行股份有限公司 的托管费按前一日基金资产净值0.2%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X0.2%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	纽银稳健双利债券 A	纽银稳健双利债券 C	合计
纽银梅隆西部基金管理有限公司	-	82,756.09	82,756.09
中国建设银行	-	338,027.55	338,027.55
西部证券	-	72.89	72.89
合计	-	420,856.53	420,856.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2012年6月26日（基金合同生效日）至2012年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	纽银稳健双利债券 A	纽银稳健双利债券 C	合计
纽银梅隆西部基金管理有限公司	-	2,630.45	2,630.45
中国建设银行	-	41,908.43	41,908.43
西部证券	-	264.81	264.81
合计	-	44,803.69	44,803.69

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给纽银梅隆西部基金管理有限公司，再由纽银梅隆西部基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值X0.4%/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

本基金于本报告期末未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

纽银稳健双利债券 A

本基金本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

纽银稳健双利债券 C

本基金本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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6月26日（基金合同生效日）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
中国建设银行	969,981.69	80,136.80	91,211,545.48	63,943.73

注：1) 本基金的银行存款由基金托管人建设银行股份有限公司保管，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791,825.75元。（2012年6月30日：人民币0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

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持暂时停牌股票。

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

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 39,599,620.60 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值 总额
1182146	11凯迪MTN1	2013-07-01	100.62	220,000	22,136,400.00
1182146	11凯迪MTN1	2013-07-15	100.62	100,000	10,062,000.00
1182083	11杉杉MTN1	2013-07-15	101.25	120,000	12,150,000.00
合计		-	-	440,000	44,348,400.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 30,999,961.40 元，于 2013 年 7 月 1 日、2013 年 7 月 4 日、2013 年 7 月 5 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金属债券型证券投资基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括股票（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、权证以及法律法规或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。本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产；本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股，持有可转债转股所得股票以及在二级市场上投资股票、权证等权益类资产。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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、市场风险及本基金的特定风险和投资风格风险等。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设合规审核委员会，负责对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。在管理层层面设立风险控制委员会，负责全面评估公司经营管理及基金运营过程中的各项风险，并提出防范化解措施。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。

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 中国建设银行股份有限公司，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年末 2012 年 12 月 31 日
A-1	-	70,189,000.00
A-1 以下	-	-

未评级	6,189,804.00	99,960,000.00
合计	6,189,804.00	170,149,000.00

注：未评级债券为中央银行票据、国债和银行间短期融资券。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年末 2012 年 12 月 31 日
AAA	10,471,300.00	79,926,000.00
AAA 以下	130,103,516.94	581,110,293.11
未评级	-	-
合计	140,574,816.94	661,036,293.11

6.4.13.3 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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市，因此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。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	969,981.69	-	-	-	969,981.69
结算备付金	791,825.75	-	-	-	791,825.75
存出保证金	87,216.43	-	-	-	87,216.43
交易性金融资产	6,189,804.00	108,402,284.86	32,172,532.08	21,216,212.94	167,980,833.88
买入返售金融资产	2,300,000.00	-	-	-	2,300,000.00
应收证券清算款	-	-	-	20,141,322.50	20,141,322.50
应收利息	-	-	-	3,282,971.27	3,282,971.27
应收申购款	-	-	-	5,300.00	5,300.00
资产总计	10,338,827.87	108,402,284.86	32,172,532.08	44,645,806.71	195,559,451.52
负债					
卖出回购金融资产款	70,599,582.00	-	-	-	70,599,582.00
应付赎回款	-	-	-	1,734,789.15	1,734,789.15
应付管理人报酬	-	-	-	92,117.84	92,117.84
应付托管费	-	-	-	26,319.38	26,319.38
应付销售服务费	-	-	-	27,116.20	27,116.20
应付交易费用	-	-	-	67,651.39	67,651.39
应付利息	-	-	-	100,351.72	100,351.72
应交税费	-	-	-	501,600.00	501,600.00
其他负债	-	-	-	129,290.50	129,290.50
负债总计	70,599,582.00	-	-	2,679,236.18	73,278,818.18
利率敏感度缺口	-60,260,754.13	108,402,284.86	32,172,532.08	41,966,570.53	122,280,633.34
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	14,821,433.47	-	-	-	14,821,433.47

结算备付金	1,523,292.72	-	-	-	1,523,292.72
交易性金融资产	220,064,000.00	324,460,167.90	286,661,125.21	-	831,185,293.11
买入返售金融资产	210,100,955.15	-	-	-	210,100,955.15
应收利息	-	-	-	20,278,918.16	20,278,918.16
应收申购款	-	-	-	896.05	896.05
资产总计	446,509,681.34	324,460,167.90	286,661,125.21	20,279,814.21	1,077,910,788.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,842,258.93	5,842,258.93
应付管理人报酬	-	-	-	687,039.13	687,039.13
应付托管费	-	-	-	196,296.90	196,296.90
应付销售费	-	-	-	296,683.71	296,683.71
应付交易费用	-	-	-	16,322.05	16,322.05
其他负债	-	-	-	241,652.01	241,652.01
负债总计	-	-	-	7,280,252.73	7,280,252.73
利率敏感度缺口	446,509,681.34	324,460,167.90	286,661,125.21	12,999,561.48	1,070,630,535.93

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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
	市场利率下降25个基点	增加约120.00万元	增加约577.00万元
	市场利率上升25个基点	减少约119.00万元	减少约569.00万元

6.4.13.4.2 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。

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。本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，并保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。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。

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	21,216,212.94	17.35	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,216,212.94	17.35	-	-

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 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约50.00万元	-
	业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约50.00万元	-

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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 101,267,833.88 元，属于第二层级的余额为 66,713,000.00 元，无属于第三层级的余额。于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 136,575,293.11 元，属于第二层级的余额为 694,610,000.00 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

本基金本期及上年度可比期间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	21,216,212.94	10.85
	其中：股票	21,216,212.94	10.85
2	固定收益投资	146,764,620.94	75.05
	其中：债券	146,764,620.94	75.05
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-

4	买入返售金融资产	2,300,000.00	1.18
	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	1,761,807.44	0.90
6	其他各项资产	23,516,810.20	12.03
7	合计	195,559,451.52	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	14,961,212.94	12.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,255,000.00	5.12
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,216,212.94	17.35

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	314,886	11,427,212.94	9.35

2	300058	蓝色光标	150,000	6,255,000.00	5.12
3	002415	海康威视	100,000	3,534,000.00	2.89

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	002415	海康威视	15,253,757.15	1.42
2	002241	歌尔声学	15,128,121.80	1.41
3	000655	金岭矿业	14,508,772.88	1.36
4	600585	海螺水泥	12,879,427.06	1.20
5	300054	鼎龙股份	7,977,121.00	0.75
6	600031	三一重工	7,958,492.00	0.74
7	600527	江南高纤	7,476,033.77	0.70
8	600511	国药股份	7,416,034.10	0.69
9	600016	民生银行	7,102,880.00	0.66
10	000731	四川美丰	6,618,460.80	0.62
11	600028	中国石化	6,449,527.00	0.60
12	300058	蓝色光标	4,302,885.00	0.40
13	002497	雅化集团	3,965,794.68	0.37
14	002037	久联发展	3,931,387.86	0.37
15	002450	康得新	3,723,100.00	0.35
16	002690	美亚光电	2,847,040.00	0.27
17	600406	国电南瑞	2,454,286.06	0.23
18	300088	长信科技	1,558,067.50	0.15
19	600309	万华化学	117,541.50	0.01
20			-	-

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	000655	金岭矿业	12,866,876.04	1.20

2	600585	海螺水泥	11,381,465.86	1.06
3	002415	海康威视	11,315,448.38	1.06
4	300054	鼎龙股份	8,242,727.84	0.77
5	002241	歌尔声学	7,246,575.85	0.68
6	600511	国药股份	7,117,153.20	0.66
7	600031	三一重工	6,928,913.04	0.65
8	600527	江南高纤	6,900,471.92	0.64
9	600016	民生银行	6,599,472.00	0.62
10	000731	四川美丰	6,295,064.40	0.59
11	600028	中国石化	5,592,502.00	0.52
12	002037	久联发展	4,298,919.40	0.40
13	002497	雅化集团	4,289,201.23	0.40
14	002450	康得新	4,260,601.84	0.40
15	002690	美亚光电	3,262,600.03	0.30
16	600406	国电南瑞	2,467,500.00	0.23
17	300088	长信科技	2,367,048.84	0.22
18	600309	万华化学	115,838.00	0.01
19			-	-
20			-	-

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	131,668,730.16
卖出股票的收入（成交）总额	111,548,379.87

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	6,189,804.00	5.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	84,126,816.94	68.80

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	56,448,000.00	46.16
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	146,764,620.94	120.02

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	1182146	11 凯迪 MTN1	400,000	40,248,000.00	32.91
2	122702	12 海安债	200,000	21,596,000.00	17.66
3	1182083	11 杉杉 MTN1	160,000	16,200,000.00	13.25
4	112109	12 南糖债	132,971	13,563,042.00	11.09
5	112138	12 苏宁 01	104,713	10,471,300.00	8.56

7.7 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。

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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	87,216.43
2	应收证券清算款	20,141,322.50
3	应收股利	-
4	应收利息	3,282,971.27
5	应收申购款	5,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	23,516,810.20
---	----	---------------

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

份额级别	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
纽银稳健双利债券A	619	78,233.62	59,698.85	0.12%	48,366,910.69	99.88%
纽银稳健双利债券C	710	98,341.90	0.00	0.00%	69,822,747.88	100.00%
合计	1,329	88,976.19	59,698.85	0.05%	118,189,658.57	99.95%

注：机构/个人投资者持有的份额占总份额的比例计算中，对A/C基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用各分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

1. 本基金本报告期末本公司的从业人员持有本基金份额的总量的数量区间为0，占该只基金总份额的比例为0；
2. 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；
3. 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

项目	纽银稳健双利债券 A	纽银稳健双利债券 C
基金合同生效日(2012年6月26日)基金份额总额	436,857,718.40	1,024,928,484.38
本报告期期初基金份额总额	246,572,735.49	818,110,458.72
本报告期基金总申购份额	73,871.00	5,023,673.49
减：本报告期基金总赎回份额	198,219,996.95	753,311,384.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	48,426,609.54	69,822,747.88
-------------	---------------	---------------

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的情况

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	
西部证券	3	143,627,771.77	59.05%	122,904.62	57.55%	-
中金公司	2	38,592,913.02	15.87%	35,134.73	16.45%	-
招商证券	2	38,333,494.61	15.76%	34,898.78	16.34%	-
中信证券	2	15,617,051.77	6.42%	14,217.88	6.66%	-
东方证券	2	7,045,878.86	2.90%	6,414.53	3.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	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	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	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

西部证券	369,935,447.58	63.80%	1,492,842,000.00	61.06%	-	-
中金公司	139,776,573.54	24.11%	593,400,000.00	24.27%	-	-
招商证券	44,805,393.67	7.73%	91,000,000.00	3.72%	-	-
中信证券	22,471,402.56	3.88%	133,500,000.00	5.46%	-	-
东方证券	2,864,382.28	0.49%	134,200,000.00	5.49%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

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	纽银稳健双利债券型证券投资基金2012年4季度报告	上海证券报、证券时报、公司网站	2013-01-21
3	关于增聘纽银稳健双利债券型证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2013-01-31
4	纽银稳健双利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2013年第一期）公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2013-02-07

5	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
6	纽银稳健双利债券型证券投资基金2012年年度报告（摘要）	上海证券报、证券时报、公司网站	2013-03-29
7	纽银稳健双利债券型证券投资基金2013年第1季度报告	上海证券报、证券时报、公司网站	2013-04-19
8	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
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稳健双利债券型证券投资基金设立的相关文件；
- (2) 《纽银稳健双利债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《纽银稳健双利债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《纽银稳健双利债券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) 报告期内纽银稳健双利债券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