
纽银稳健双利债券型证券投资基金

2013 年年度报告摘要

2013 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：二〇一四年三月二十七日

§ 1 重要提示

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 2014 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	52,798,426.91 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	25,360,203.16 份	27,438,223.75 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>本基金将深度研究新股发行公司的基本价值、可比公司估值水平、</p>

	<p>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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4007-007-818;021-38572666	010-67595096
传真		021-38572750	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013 年	2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
---------------	--------	--

	纽银稳健双利债券 A	纽银稳健双利债券 C	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	2,948,050.48	3,011,389.64	3,614,482.75	7,591,519.49
本期利润	3,289,427.84	5,064,232.54	2,362,773.16	5,565,378.90
加权平均基金份额 本期利润	0.0391	0.0424	0.0064	0.0062
本期基金份额净值 增长率	-0.60%	-1.00%	0.70%	0.50%
3.1.2 期末数据和 指标	2013 年末		2012 年末	
	纽银稳健双利债券 A	纽银稳健双利债券 C	纽银稳健双利债券 A	纽银稳健双利债券 C
期末可供分配基金 份额利润	0.0014	-0.0050	0.0072	0.0051
期末基金资产净值	25,396,028.11	27,299,966.67	248,339,825.52	822,290,710.41
期末基金份额净值	1.001	0.995	1.007	1.005

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 2012 年 6 月 26 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

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
过去三个月	-0.99%	0.21%	-1.86%	0.15%	0.87%	0.06%
过去六个月	-3.47%	0.30%	-1.82%	0.15%	-1.65%	0.15%
过去一年	-0.60%	0.36%	-1.00%	0.16%	0.40%	0.20%
自基金合同生效 起至今	0.10%	0.29%	0.01%	0.15%	0.09%	0.14%

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	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①—③	②—④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	-1.00%	0.21%	-1.86%	0.15%	0.86%	0.06%
过去六个月	-3.59%	0.30%	-1.82%	0.15%	-1.77%	0.15%
过去一年	-1.00%	0.36%	-1.00%	0.16%	0.00%	0.20%
自基金合同生效 起至今	-0.50%	0.29%	0.01%	0.15%	-0.51%	0.14%

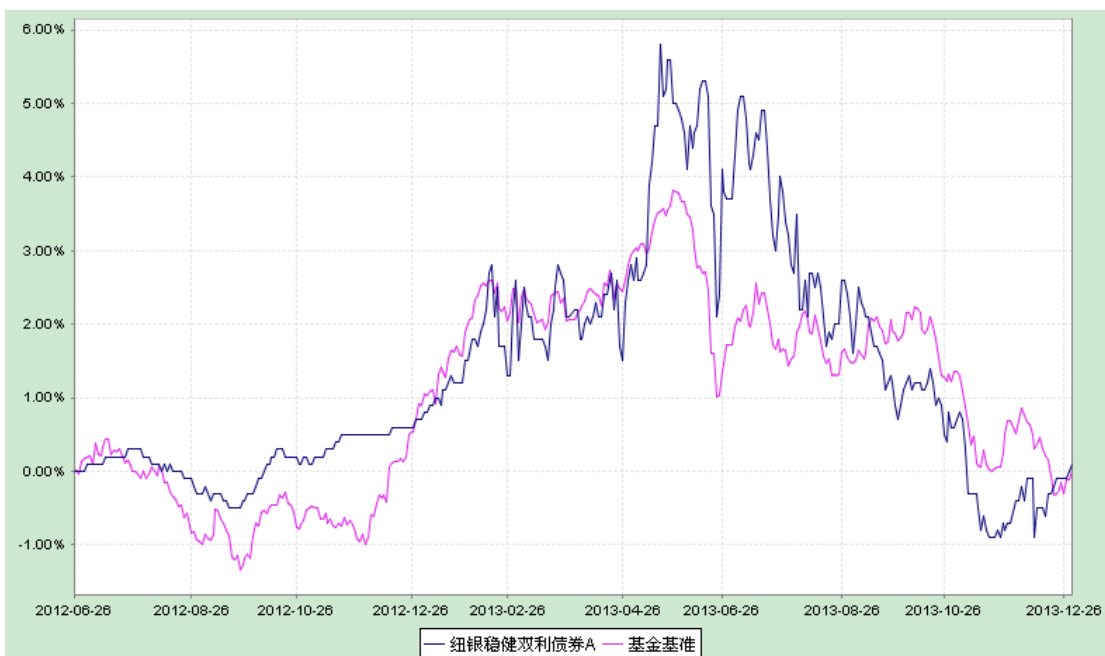
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

纽银稳健双利债券 A

(2012 年 6 月 26 日至 2013 年 12 月 31 日)



纽银稳健双利债券 C

(2012 年 6 月 26 日至 2013 年 12 月 31 日)

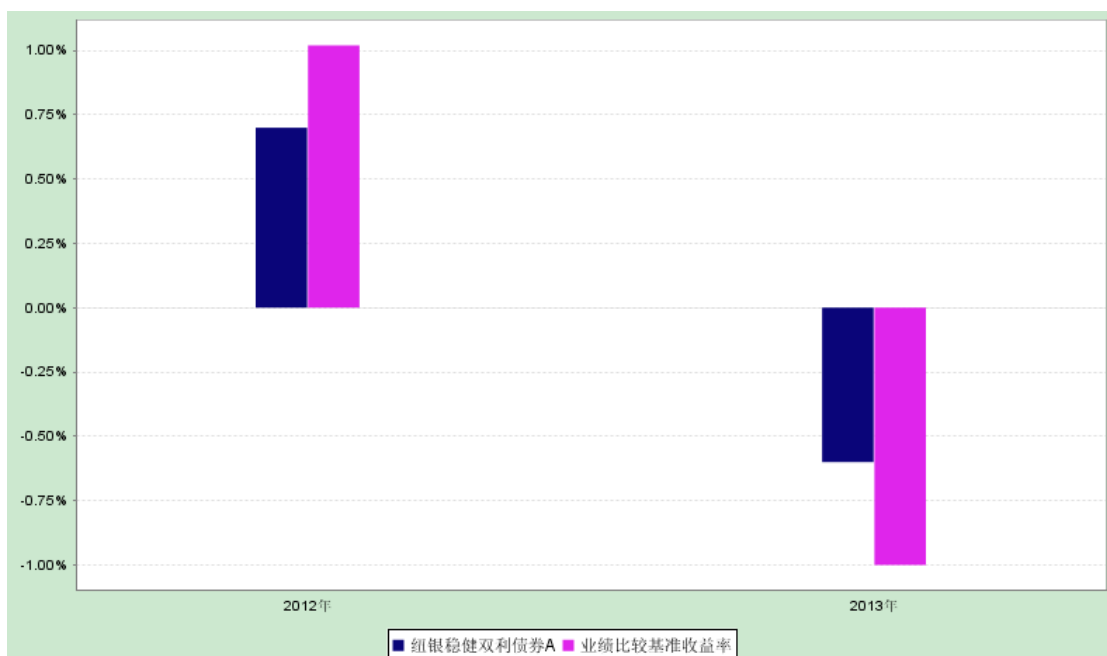


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

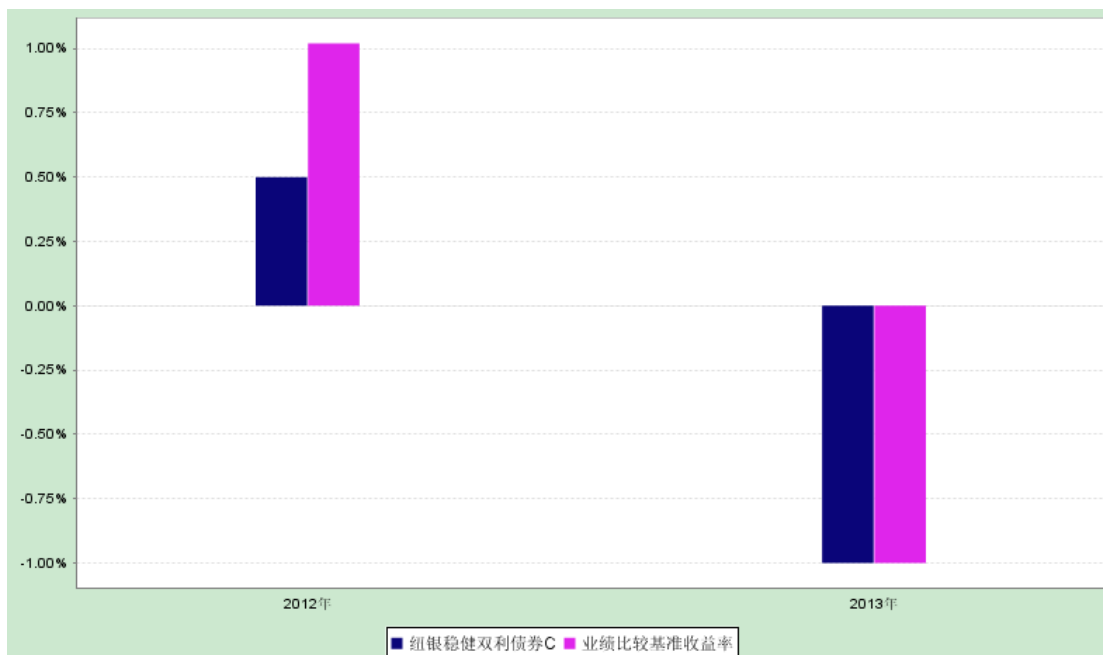
纽银稳健双利债券型证券投资基金

基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图

纽银稳健双利债券 A



纽银稳健双利债券 C



注：1. 本基金的基金合同于 2012 年 6 月 26 日生效，截至 2013 年 12 月 31 日，基金运作未满五年。

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 2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2013 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 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 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	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	2013-08-08	-	九年	上海财经大学经济学硕士；2005 年至 2008 年在新理益集团有限公司担任高级分析师，2008 年至 2012 年在国华人寿保险股份有限公司担任投资经理，2012 年 3 月至 2013 年 8 月在我司担任固定收益助理基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
傅明笑	本基金基金经理	2013-10-09	-	九年	清华大学化学硕士；曾任海通证券股份有限公司研究所研究员、国联安基金管理有限公司研究员、高级研究员、基金经理。2013 年 7 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
李健	本基金基金经理	2012-06-26	2013-08-09	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 月至 2013 年 8 月任职于本公司。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；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、分投资类别（股票、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及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（股票、债券）不同时间窗口同向（1 日、3 日、5 日）交易的交易价差以及 T 检验、银行间交易价格偏离度进行了分析。

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

国内经济增速整体保持平稳，2013 年 GDP 增长 7.7%，与前一年持平。在中性偏紧政策以及高企利率作用下，固定资产投资增速出现小幅下行，而消费增速整体保持平稳。受海外经济波动影响，出口形势不乐观，对国内经济增速造成拖累。全年 CPI 同比增长 2.6%，通胀保持温和水平。但在利率市场化以及货币政策持续偏紧的背景下，全年资金面整体保持

偏紧的格局，局部时点更是发生钱荒事件，资金利率出现大幅飙升。

债券市场先扬后抑，上半年债市呈小牛市格局，下半年受资金面紧张、利率市场化等因素影响，债市出现大幅调整。10 年期国债收益率最高上升至 4.72% 的水平，为 2005 年以来的新高。信用债收益率也受资金面紧张、基准利率大幅抬升、信用风险加大等因素影响而出现持续上升。下半年整个债券市场均出现较大幅度调整。

报告期初，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。同时由于股市上行，基金组合开始放开对权益类资产的限制，均获得了一定收益。三、四季度在监管风暴事件升级后，流动性变得日趋紧张，基金组合采取了偏谨慎的投资策略，保持低仓位运作，以获取了高利率的资金利息，并且有效躲避债券市场大跌带来的损失，股票部分也偏向谨慎，大幅降低了股票投资比例，并坚持在 TMT、大消费等行业中精选个股。

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 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.001 元，本报告期 A 类份额净值增长率为-0.60%；本基金 C 类份额净值为 0.995 元，本报告期 C 类份额净值增长率为-1.00%，同期业绩比较基准增长率为-1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央经济工作会议确定 2014 年基调：稳增长、调结构、促改革，预计 2014 年政府将平衡稳增长和调结构的关系，在确保经济增速在 7.5% 的前提下，更倾向于经济结构调整和改革。在经济增速有所下降的背景下，预计通胀水平依然保持温和，通胀压力不大。

在经济和通胀上行风险均不大的情况下，货币政策进一步收紧的可能性不大。但在国内经济面临转型的背景下，政策也难以放松，预计货币政策整体保持中性基调。在目前政策基调、高企利率以及对非标资产清理规范政策等作用下，社会融资增速将出现下降。近期央行动作频繁，包括重启逆回购、开展 SLF 等，显示央行稳定短期资金面的意图。预计资金面整体将保持紧平衡，但在资金利率出现大幅飙升时，央行将灵活运用各项公开市场工具来维稳，因此，出现 2013 年局部时点资金面大幅波动的概率不大，市场恐慌情绪有所平复。利

率债收益率在经历 2013 年下半年大幅飙升后，纷纷创出历史新高，估值具有一定吸引力。基于对未来基本面和资金面的判断，利率债收益率继续大幅上升的概率不大。另一方面，已经出台或将要出台的各种对非标资产、影子银行进行规范的文件也在一定程度上利好于利率债。相对而言，政策性金融债收益率水平以及与国债利差均处于历史高位，具有较好的配置价值。在经济增速下滑、地方政府面临去杠杆的背景下，信用风险逐渐上升，预计未来依然会出现评级下调的情况，负面信用事件将依然不断，不排除实质违约情况在今年发生。因此，对中低评级信用债保持谨慎。高评级信用债目前收益率处于历史高位，又有较强的抵御信用风险的能力，预计未来会有较好的表现。此外，受股市结构性行情影响，部分转债品种也有望出现投资机会。股票部分本基金认为在上半年存在一定投资机会，宏观数据也保持平稳的背景下，流动性的相对宽松有利于股票市场整体表现，而至年中，信用风险的不确定性可能给股票市场带来冲击，因此本基金认为股票投资机会大部分集中于上半年，本基金将根据市场变化，在控制净值波动风险的前提下，积极寻找股票投资机会。

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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对纽银梅隆西部基金管理有限公司纽银稳健双利债券型证券投资基金 2013 年 12 月 31 日的资产负债表，2013 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天

审字(2014)第 20614 号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	24,401.19	14,821,433.47
结算备付金		427,154.05	1,523,292.72
存出保证金		21,494.75	-
交易性金融资产	7.4.7.2	33,229,500.00	831,185,293.11
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		33,229,500.00	831,185,293.11
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	19,400,269.10	210,100,955.15
应收证券清算款		399,710.83	-
应收利息	7.4.7.5	1,309,004.51	20,278,918.16
应收股利		-	-
应收申购款		95,000.00	896.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		54,906,534.43	1,077,910,788.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		900,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		484,846.20	5,842,258.93
应付管理人报酬		32,472.22	687,039.13
应付托管费		9,277.79	196,296.90

应付销售服务费		9,671.20	296,683.71
应付交易费用	7.4.7.7	12,583.02	16,322.05
应交税费		501,600.00	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	260,089.22	241,652.01
负债合计		2,210,539.65	7,280,252.73
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	52,798,426.91	1,064,683,194.21
未分配利润	7.4.7.10	-102,432.13	5,947,341.72
所有者权益合计		52,695,994.78	1,070,630,535.93
负债和所有者权益总计		54,906,534.43	1,077,910,788.66

注：1. 报告截止日 2013 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.001 元，C 类基金份额净值 0.995 元，基金份额总额 52,798,426.91 份，其中 A 类基金份额 25,360,203.16 份，C 类基金份额 27,438,223.75 份。

2. 本基金合同生效日为 2012 年 6 月 26 日，合同生效当期不是完整报告期（一年）。

3. 本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年6月26日（基金合同 生效日）至2012年12月31 日
一、收入		13,116,156.15	15,982,691.76
1. 利息收入		10,591,399.47	25,368,026.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	118,798.28	346,129.33
债券利息收入		9,501,859.31	20,680,437.43
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		970,741.88	4,341,460.07
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		78,867.23	-6,209,724.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,014,330.72	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,096,861.77	-6,209,724.38
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	161,398.28	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,394,220.26	-3,277,850.18
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	51,669.19	102,239.49
减：二、费用		4,762,495.77	8,054,539.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,519,129.50	4,511,303.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	434,036.95	1,288,943.94
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	514,302.17	1,822,310.32
4. 交易费用	7.4.7.18	472,100.78	31,366.41
5. 利息支出		1,519,138.49	133,769.11
其中：卖出回购金融资产支出		1,519,138.49	133,769.11
6. 其他费用	7.4.7.19	303,787.88	266,846.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,353,660.38	7,928,152.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,353,660.38	7,928,152.06

注：本基金合同生效日为 2012 年 6 月 26 日，合同生效当期不是完整报告期（一年）。

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	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）	-	8,353,660.38	8,353,660.38

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)	-1,011,884,767.30	-14,403,434.23	-1,026,288,201.53
其中: 1. 基金申购款	5,478,304.03	100,855.80	5,579,159.83
2. 基金赎回款	-1,017,363,071.33	-14,504,290.03	-1,031,867,361.36
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)	52,798,426.91	-102,432.13	52,695,994.78
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)	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)	-	7,928,152.06	7,928,152.06
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)	-397,103,008.57	-1,980,810.34	-399,083,818.91
其中: 1. 基金申购款	637,443,490.13	-240,274.79	637,203,215.34
2. 基金赎回款	-1,034,546,498.70	-1,740,535.55	-1,036,287,034.25
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)	1,064,683,194.21	5,947,341.72	1,070,630,535.93

注: 本基金合同生效日为 2012 年 6 月 26 日, 合同生效当期不是完整报告期(一年)。

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

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

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 2014 年 3 月 21 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 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 2013 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税

(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，应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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(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 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（“中国建设银行”）	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2012年6月26日（基金合同生效日）至2012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	137,009,317.41	45.71%	-	-

7.4.8.1.2 权证交易

本基金于本报告期内及上年度期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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	122,904.62	45.34%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年6月26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	-	-	-	-

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。

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年6月26日（基金合同生效 日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,519,129.50	4,511,303.80
其中：支付销售机构的客户维护费	990,918.74	2,689,205.88

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年6月26日（基金合同生效 日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	434,036.95	1,288,943.94

注：支付基金托管人 中国建设银行 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。

7.4.8.2.3 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12月31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	-	431,011.17	431,011.17
西部证券	-	87.90	87.90
合计	-	513,855.16	513,855.16
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12月31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	-	539,893.67	539,893.67

中国建设银行	-	1,279,899.28	1,279,899.28
西部证券	-	2,383.38	2,383.38
合计	-	1,822,176.33	1,822,176.33

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 X 0.4% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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期末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期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日） 至 2012 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
中国建设银行	24,401.19	87,006.38	14,821,433.47	246,956.63

注：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。

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本报告期末未持有流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 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 900,000.00 元, 于 2014 年 1 月 2 日到期。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。

7.4.10 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 2013 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 18,630,000.00 元, 属于第二层级的余额为 14,599,500.00 元, 无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日, 第一层级余额为 136,575,293.11 元, 第二层级余额为 694,610,000.00 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	33,229,500.00	60.52
	其中：债券	33,229,500.00	60.52
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	19,400,269.10	35.33
	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	451,555.24	0.82
6	其他各项资产	1,825,210.09	3.32
7	合计	54,906,534.43	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金于本报告期末未持有股票。

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

本基金于本报告期末未持有股票。

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	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	600016	民生银行	8,790,360.00	0.82
6	300054	鼎龙股份	7,977,121.00	0.75
7	600031	三一重工	7,958,492.00	0.74
8	600527	江南高纤	7,476,033.77	0.70
9	600511	国药股份	7,416,034.10	0.69
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	601699	潞安环能	2,728,129.00	0.25
18	600422	昆明制药	2,655,878.95	0.25
19	002281	光迅科技	2,568,845.00	0.24
20	600406	国电南瑞	2,454,286.06	0.23

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	002241	歌尔声学	20,044,780.54	1.87
2	002415	海康威视	15,932,675.95	1.49
3	000655	金岭矿业	12,866,876.04	1.20
4	600585	海螺水泥	11,381,465.86	1.06
5	300054	鼎龙股份	8,242,727.84	0.77
6	600016	民生银行	8,136,872.00	0.76
7	600511	国药股份	7,117,153.20	0.66
8	600031	三一重工	6,928,913.04	0.65
9	600527	江南高纤	6,900,471.92	0.64
10	300058	蓝色光标	6,503,853.40	0.61
11	000731	四川美丰	6,295,064.40	0.59
12	600028	中国石化	5,592,502.00	0.52
13	002037	久联发展	4,298,919.40	0.40

14	002497	雅化集团	4,289,201.23	0.40
15	002450	康得新	4,260,601.84	0.40
16	002690	美亚光电	3,262,600.03	0.30
17	600406	国电南瑞	2,467,500.00	0.23
18	601699	潞安环能	2,445,256.67	0.23
19	300088	长信科技	2,367,048.84	0.22
20	600422	昆明制药	2,330,592.45	0.22

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	152,168,014.47
卖出股票的收入（成交）总额	154,182,345.19

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

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	4,965,500.00	9.42
	其中：政策性金融债	4,965,500.00	9.42
4	企业债券	28,264,000.00	53.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	33,229,500.00	63.06

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	122702	12 海安债	180,000	18,630,000.00	35.35

2	1280217	12 丽江债	100,000	9,634,000.00	18.28
3	130236	13 国开 36	50,000	4,965,500.00	9.42

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金于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序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不在本基金投资范围内。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不在本基金投资范围内。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不在本基金投资范围内。

8.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	21,494.75
2	应收证券清算款	399,710.83
3	应收股利	-
4	应收利息	1,309,004.51
5	应收申购款	95,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,825,210.09

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 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

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	336	75,476.80	59,698.85	0.24%	25,300,504.31	99.76%
纽银稳健双利债券 C	360	76,217.29	-	-	27,438,223.75	100.00%
合计	686	76,965.64	59,698.85	0.11%	52,738,728.06	99.89%

注：1. “持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额；

2. 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	纽银稳健双利债券 A	-	-
	纽银稳健双利债券 C	95,669.69	0.35%
	合计	95,669.69	0.18%

注：1. 分级基金管理人的从业人员持有基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；

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。

§ 10 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	160,396.88	5,317,907.15
减：本报告期基金总赎回份额	221,372,929.21	795,990,142.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	25,360,203.16	27,438,223.75

§ 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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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(特殊普通合伙)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(特殊普通合伙)审计费人民币 60000 元。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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	
西部证券	3	137,009,317.41	45.71%	122,904.62	45.34%	-
中金公司	2	64,194,665.47	21.42%	58,442.60	21.56%	-
中信证券	2	49,611,425.02	16.55%	45,166.56	16.66%	-
招商证券	2	38,333,494.61	12.79%	34,898.78	12.88%	-
东方证券	2	7,045,878.86	2.35%	6,414.53	2.37%	-
申银万国	2	3,537,123.93	1.18%	3,220.18	1.19%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

注：1.基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，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.报告期内退租交易单元为：

- 1) 东海证券

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
西部证券	363,316,986.78	57.55%	1,492,842,000.00	47.56%	-	-
中金公司	148,106,372.49	23.46%	1,043,300,000.00	33.24%	-	-
中信证券	72,193,153.66	11.44%	250,061,000.00	7.97%	-	-
招商证券	44,805,393.67	7.10%	91,000,000.00	2.90%	-	-
东方证券	2,864,382.28	0.45%	134,200,000.00	4.28%	-	-
申银万国	-	-	127,300,000.00	4.06%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

纽银梅隆西部基金管理有限公司

二〇一四年三月二十七日