

**纽银稳健双利债券型证券投资基金**  
**2014 年半年度报告**  
**2014 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：二〇一四年八月二十六日

## 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 2014 年 8 月 25 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
<b>4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
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
<b>5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
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
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
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
<b>7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	34
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 .....	35
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序的前五名债券投资明细 .....	36
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 .....	36
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	36
7.9 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 .....	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	37
7.12 投资组合报告附注 .....	37
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>

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
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	39
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>39</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>39</b>
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 .....	40
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	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
<b>11 备查文件目录 .....</b>	<b>43</b>
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	30,550,469.81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	16,026,085.10份	14,524,384.71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	《证券日报》、《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（2014 年 1 月 1 日至 2014 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	-121,688.45	-198,212.26
本期利润	426,052.50	406,688.46
加权平均基金份额本期利润	0.0210	0.0187
本期加权平均净值利润率	2.08%	1.87%
本期基金份额净值增长率	2.40%	2.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 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	397,216.80	233,411.81
期末可供分配基金份额利润	0.0248	0.0161
期末基金资产净值	16,423,301.90	14,757,796.52
期末基金份额净值	1.025	1.016
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 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	2.50%	1.60%

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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	0.69%	0.10%	0.70%	0.10%	-0.01%	0.00%
过去三个月	1.79%	0.08%	3.06%	0.11%	-1.27%	-0.03%
过去六个月	2.40%	0.12%	4.51%	0.13%	-2.11%	-0.01%
过去一年	-1.16%	0.23%	2.61%	0.14%	-3.77%	0.09%
自基金合同生效起至今	2.50%	0.26%	4.52%	0.15%	-2.02%	0.11%

##### 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	0.59%	0.10%	0.70%	0.10%	-0.11%	0.00%
过去三个月	1.60%	0.09%	3.06%	0.11%	-1.46%	-0.02%
过去六个月	2.11%	0.13%	4.51%	0.13%	-2.40%	0.00%
过去一年	-1.55%	0.23%	2.61%	0.14%	-4.16%	0.09%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.26%	4.52%	0.15%	-2.92%	0.11%

注：本基金的业绩基准指数=中国债券综合财富指数收益率\*90%+沪深300指数收益率\*10% 其中：中国债券综合财富指数作为衡量基金债券投资部分的业绩基准，沪深300指数作为衡量股票投资部分的业绩基准。

中国债券综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，能够反映债券市场总体走势，具有较强的代表性、权威性，并得到投资人的广泛认同，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、央行票据、政策性银行金融债、企业债券等所有主要债券种类。沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

benchmark(0)=1000;

%benchmark(t) =90%\*(中国债券综合财富指数收益率(t)/ 中国债券综合财富指数收益率(t-1)-1)+10%\*(沪深300指数收益率(t)/ 沪深300指数收益率(t-1)-1);

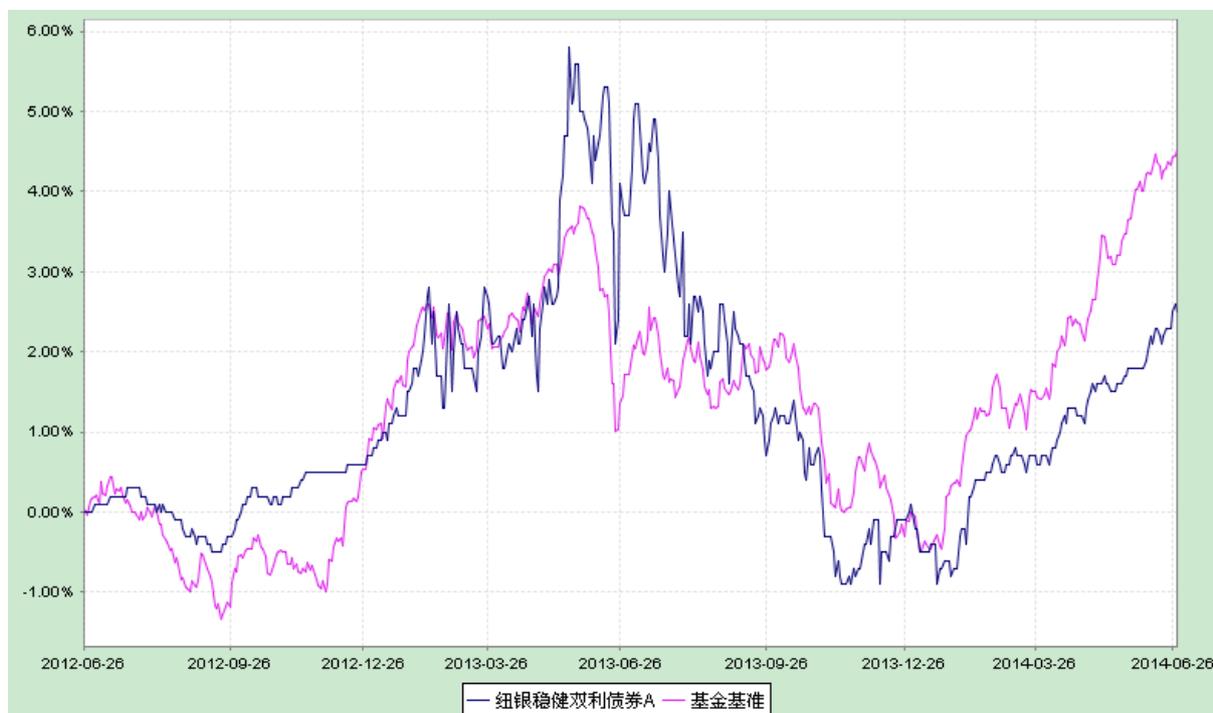
benchmark(t)=(1+%benchmark(t))\* benchmark(t-1) ; 其中t=1,2,3,⋯。

#### 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

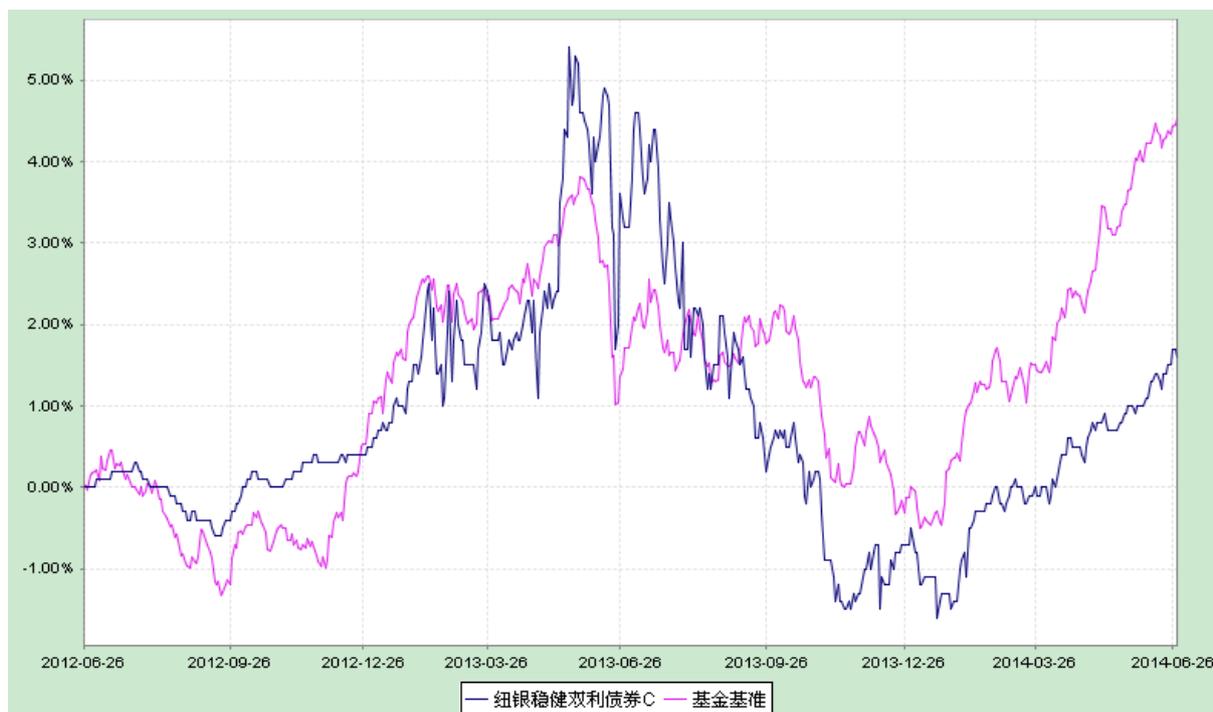
较

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 2014 年 6 月 30 日)

纽银稳健双利债券 A



纽银稳健双利债券 C



## 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银梅隆投资管理 EMEA 有限公司（原纽约银行梅隆资产管理国际有限公司现已更名为纽银梅隆投资管理 EMEA 有限公司，下同）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%，外方股东纽银梅隆投资管理 EMEA 有限公司出资 49%，注册地上海。

截至 2014 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		
傅明笑	本基金基金经理	2013-10-09	-	十年	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。
闫旭	本基金基金经理	2013-01-31	2014-02-14	十四年	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	-	十年	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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、《纽银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，本基金通过银行间市场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

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。

本基金管理人风险控制岗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，本基金管理人风险控制岗及时要求相关投资组合经理给予解释，该解释经风险控制岗辨认后确认该交易无异常情况后备档备查，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，由风险控制岗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。

##### 4.3.2 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

年初以来宏观经济增速持续下降。房地产投资进入下行周期，制造业面临去产能和高成本压力，投资增速同样放缓，出口受海外天气影响也一度陷入低迷。管理层为稳定经济、实现全年增长目标，出台多项稳增长政策，加大财政支出力度，拉动基建投资来对冲房地产投资的下滑。在新增外汇占款持续下滑的背景下，央行调整基础货币投放机制，通过定向降准和再贷款向市场注入流动性，并

通过货币政策工具创新增加投放渠道，使资金面整体保持相对宽松。在稳增长和定向宽松政策作用下，国内经济有所企稳，但回暖基础依然较弱。报告期内，利率债和高评级信用债收益率整体出现较大幅度的下降，而低评级债收益率由于负面信用事件频发、信用风险不断上升而呈高位震荡走势，信用利差有所扩大。

本基金在报告期采取了偏乐观的投资策略，大类资产配置上增加了可转债的配置。在债券组合管理中保持了相对积极的久期，并以利率债以及高评级的信用债为主，规避信用事件及信用利差扩大带来的负面冲击。同时基金组合根据市场行情的节奏变化进行了适当的波段性操作，但受限于基金规模的制约，弱化了组合获取超额收益的能力，在报告期获取较为稳定的收益。在股票投资方面，上半年 A 股低迷，沪深 300 跌幅超过 7%，本基金股票仓位一直较低，力求获取绝对收益，在医药、食品等稳定增长行业中寻找投资机会，获得较好收益。

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 2014 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.025 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 2.40%；本基金 C 类份额净值为 1.016 元，本报告期 C 类份额净值增长率为 2.11%，同期业绩比较基准增长率为 4.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在稳增长和定向宽松政策以及海外经济体缓慢复苏的作用下，上半年经济增速实现 7.4%，接近全年增速目标。但由于要兼顾调结构和促改革等目标，管理层主要采用定向宽松而非全面宽松的方式，政策放松力度较小，对经济的持续拉动作用也相对有限。目前房地产投资处于下行周期，是拖累经济下滑的最大因素。预计下半年整体经济增速或保持平稳，基本能够实现全年增速目标。目前猪肉价格处于底部区域，未来大概率将上行，但考虑到经济依然较弱，反弹力度不会太大，通胀整体或将保持温和。在定向宽松政策作用下，经济摆脱大幅下行的态势，但鉴于复苏力度较弱，预计政策下半年仍将以定向宽松的方式为主，以实现全年增长目标。随着海外经济体尤其是美国经济复苏，以及我国进一步推进汇改，人民币一改过去单边升值的走势，资金也呈现双向流动的特征。在此背景下，外汇占款波动加大，原先主要依靠外汇占款进行基础货币投放的模式也发生变化，央行将更多依靠公开市场工具进行基础货币投放，同时进行货币政策工具创新，如推出 PSL，一方面将资金定向投放，兼顾稳增长和促改革；另一方面，打造中期基准利率，从而有利于引导社会融资成本下降。在政策保持适度宽松的背景下，预计下半年资金面整体将保持平稳。综合前面的判断，预计下半年利率产品收益率以宽幅震荡为主。在弱复苏态势下，微观企业盈利能力和偿债能力难以出现明显改善，部分行业尤其是中小企业依然是负面信用事件高发区，预计中高评级债仍将有相对较好的表现。预计转债市场主要呈结构性行情，国企改革、沪港通、互联网金融相关以及业绩有明显改善的转债或将有更好的表现。

#### 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应用性的情况，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 8 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,412.68	24,401.19
结算备付金		924,496.79	427,154.05
存出保证金		2,610.94	21,494.75
交易性金融资产	6.4.7.2	34,047,590.00	33,229,500.00
其中：股票投资		1,750,600.00	-
基金投资		-	-
债券投资		32,296,990.00	33,229,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	19,400,269.10
应收证券清算款		699,496.59	399,710.83
应收利息	6.4.7.5	811,328.48	1,309,004.51
应收股利		-	-
应收申购款		597.62	95,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>36,500,533.10</b>	<b>54,906,534.43</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,100,000.00	900,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		559,606.28	484,846.20
应付管理人报酬		19,349.86	32,472.22
应付托管费		5,528.52	9,277.79
应付销售服务费		5,456.59	9,671.20
应付交易费用	6.4.7.7	1,443.21	12,583.02
应交税费		501,600.00	501,600.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.8	126,450.22	260,089.22
<b>负债合计</b>		<b>5,319,434.68</b>	<b>2,210,539.65</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	30,550,469.81	52,798,426.91
未分配利润	6.4.7.10	630,628.61	-102,432.13
<b>所有者权益合计</b>		<b>31,181,098.42</b>	<b>52,695,994.78</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>36,500,533.10</b>	<b>54,906,534.43</b>

注：报告截止日2014年6月30日，A类基金份额净值1.025元，C类基金份额净值1.016元，基金份额总额30,550,469.81份，其中A类基金份额16,026,085.10份，C类基金份额14,524,384.71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：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>1,224,131.12</b>	<b>15,114,340.77</b>
1.利息收入		1,012,511.16	8,258,367.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,448.09	104,653.89
债券利息收入		697,429.86	7,677,153.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		304,633.21	476,560.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-942,171.45	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	-943,881.45	3,429,326.92
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,710.00	141,246.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,152,641.67	5,940,179.10
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	1,149.74	47,683.73
<b>减：二、费用</b>		<b>391,390.16</b>	<b>3,732,686.03</b>

1. 管理人报酬		147,021.21	1,232,958.79
2. 托管费		42,006.04	352,273.91
3. 销售服务费		43,338.04	421,112.17
4. 交易费用	6.4.7.18	3,020.18	362,812.45
5. 利息支出		10,040.54	1,212,201.79
其中：卖出回购金融资产支出		10,040.54	1,212,201.79
6. 其他费用	6.4.7.19	145,964.15	151,326.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>832,740.96</b>	<b>11,381,654.74</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>832,740.96</b>	<b>11,381,654.74</b>

### 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	52,798,426.91	-102,432.13	52,695,994.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	832,740.96	832,740.96
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）	-22,247,957.10	-99,680.22	-22,347,637.32
其中：1.基金申购款	93,201.76	412.79	93,614.55
2.基金赎回款	-22,341,158.86	-100,093.01	-22,441,251.87
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）	30,550,469.81	630,628.61	31,181,098.42
项目	上年度可比期间 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

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：安保和，主管会计工作负责人：安保和，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 2013 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。

#### 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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	14,412.68
定期存款	-
其他存款	-
合计	14,412.68

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,737,454.23	1,750,600.00	13,145.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,426,684.69	9,526,090.00
	银行间市场	22,614,439.33	22,770,900.00
	合计	32,041,124.02	32,296,990.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	33,778,578.25	34,047,590.00	269,011.75

##### 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

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 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	139.94
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	416.00
应收债券利息	810,771.34
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.20
合计	811,328.48

#### 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 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	424.71
银行间市场应付交易费用	1,018.50
合计	1,443.21

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	126,450.22

合计	126,450.22
----	------------

#### 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 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	25,360,203.16	25,360,203.16
本期申购	57,735.99	57,735.99
本期赎回（以“-”号填列）	-9,391,854.05	-9,391,854.05
本期末	16,026,085.10	16,026,085.10

##### 纽银稳健双利债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	27,438,223.75	27,438,223.75
本期申购	35,465.77	35,465.77
本期赎回（以“-”号填列）	-12,949,304.81	-12,949,304.81
本期末	14,524,384.71	14,524,384.71

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	848,634.72	-812,809.77	35,824.95
本期利润	-121,688.45	547,740.95	426,052.50
本期基金份额交易产生的变动数	-250,515.18	185,854.53	-64,660.65
其中：基金申购款	1,281.81	-903.25	378.56
基金赎回款	-251,796.99	186,757.78	-65,039.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	476,431.09	-79,214.29	397,216.80

##### 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	736,697.53	-874,954.61	-138,257.08

本期利润	-198,212.26	604,900.72	406,688.46
本期基金份额交易产生的变动数	-232,737.34	197,717.77	-35,019.57
其中：基金申购款	561.20	-526.97	34.23
基金赎回款	-233,298.54	198,244.74	-35,053.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	305,747.93	-72,336.12	233,411.81

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,939.18
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	7,441.60
其他	67.31
合计	10,448.09

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内未卖出股票，股票投资收益为零。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	56,993,039.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,097,662.29
减：应收利息总额	1,839,258.38
债券投资收益	-943,881.45

#### 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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,710.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,710.00

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	1,152,641.67
——股票投资	13,145.77
——债券投资	1,139,495.90
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	1,152,641.67

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	1,149.61
转换费收入	0.13
合计	1,149.74

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 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,777.68
银行间市场交易费用	1,242.50
合计	3,020.18

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日

审计费用	27,273.08
信息披露费	99,177.14
银行汇划费用	1,113.93
债券账户维护费	18,000.00
其他	400.00
合计	145,964.15

#### 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 2014 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 2014 年 6 月 30 日止，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（“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。

#### 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 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 2014年1月1日至2014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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

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。

#### 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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月	2013年1月1日至2013年6月

	30日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	147,021.21	1,232,958.79
其中：支付销售机构的客户维护费	72,033.01	850,724.90

注：支付基金管理人 纽银梅隆西部基金管理有限公司 的基金管理费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：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.7% / 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
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	42,006.04	352,273.91

注：支付基金托管人 中国建设银行股份有限公司 的基金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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 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		
	2014年1月1日至2014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
中国建设银行	-	43,256.80	43,256.80
西部证券	-	10.41	10.41
合计	-	43,267.21	43,267.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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

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 × 0.4% / 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**

本基金本报告期及上年度可比期间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未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除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

**纽银稳健双利债券 C**

本基金本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。

**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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	14,412.68	2,939.18	969,981.69	80,136.80

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2014年6月30日的相关余额为人民币924,496.79元。（2013年6月30日：人民币791,825.75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未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（2014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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603328	伊顿电子	2014-06-23	2014-07-01	新股未上市	15.31	15.31	1,000	15,310.00	15,310.00	-

**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

于 2014 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

截至本报告期末 2014 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 4,100,000.00 元，于 2014 年 7 月 1 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。

### 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

本基金是一只进行主动投资的债券型证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人力争在严格控制风险的情况下实现基金资产长期增值。

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

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 2014 年 6 月 30 日	上年末 2013 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,636,520.00	4,965,500.00
合计	1,636,520.00	4,965,500.00

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

#### 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 2014 年 6 月 30 日	上年末 2013 年 12 月 31 日
AAA	1,156,670.00	-
AAA 以下	-	28,264,000.00
未评级	29,503,800.00	-
合计	30,660,470.00	28,264,000.00

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2014 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 4,100,000 元将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金

流量。

#### 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 2014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	14,412.68	-	-	-	14,412.68
结算备付金	924,496.79	-	-	-	924,496.79
存出保证金	2,610.94	-	-	-	2,610.94
交易性金融资产	1,636,520.00	25,429,470.00	5,231,000.00	1,750,600.00	34,047,590.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	811,328.48	811,328.48
应收申购款	-	-	-	597.62	597.62
应收证券清算款	-	-	-	699,496.59	699,496.59
资产总计	2,578,040.41	25,429,470.00	5,231,000.00	3,262,022.69	36,500,533.10
负债					
卖出回购金融资产款	4,100,000.00	-	-	-	4,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	559,606.28	559,606.28
应付管理人报酬	-	-	-	19,349.86	19,349.86
应付托管费	-	-	-	5,528.52	5,528.52
应付销售服务费	-	-	-	5,456.59	5,456.59
应付交易费用	-	-	-	1,443.21	1,443.21

应交税费	-	-	-	501,600.00	501,600.00
其他负债	-	-	-	126,450.22	126,450.22
负债总计	4,100,000.00	-	-	1,219,434.68	5,319,434.68
利率敏感度缺口	-1,521,959.59	25,429,470.00	5,231,000.00	2,042,588.01	31,181,098.42
上年度末 2013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	24,401.19	-	-	-	24,401.19
结算备付金	427,154.05	-	-	-	427,154.05
存出保证金	21,494.75	-	-	-	21,494.75
交易性金融资产	4,965,500.00	18,630,000.00	9,634,000.00	-	33,229,500.00
买入返售金融资产	19,400,269.10	-	-	-	19,400,269.10
应收证券清算款	-	-	-	399,710.83	399,710.83
应收利息	-	-	-	1,309,004.51	1,309,004.51
应收申购款	-	-	-	95,000.00	95,000.00
资产总计	24,838,819.09	18,630,000.00	9,634,000.00	1,803,715.34	54,906,534.43
负债					
卖出回购金融资产款	900,000.00	-	-	-	900,000.00
应付赎回款	-	-	-	484,846.20	484,846.20
应付管理人报酬	-	-	-	32,472.22	32,472.22
应付托管费	-	-	-	9,277.79	9,277.79
应付销售服务费	-	-	-	9,671.20	9,671.20
应付交易费用	-	-	-	12,583.02	12,583.02
应交税费	-	-	-	501,600.00	501,600.00
其他负债	-	-	-	260,089.22	260,089.22
负债总计	900,000.00	-	-	1,310,539.65	2,210,539.65
利率敏感度缺口	23,938,819.09	18,630,000.00	9,634,000.00	493,175.69	52,695,994.78

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 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	市场利率上升25个基点	减少约25.00万元	减少约18.00万元
	市场利率下降25个基点	增加约25.00万元	增加约18.00万元

#### 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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	1,750,600.00	5.61	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	1,750,600.00	5.61	-	-
----	--------------	------	---	---

#### 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 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升5%	增加约11.00万元	-
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降5%	减少约11.00万元	-	

#### 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) 各层级金融工具公允价值

于 2014 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 9,624,860 元,属于第二层级的余额为 24,422,730 元,无属于第三层级的余额(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)。

##### (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。

## 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	1,750,600.00	4.80
	其中：股票	1,750,600.00	4.80
2	固定收益投资	32,296,990.00	88.48
	其中：债券	32,296,990.00	88.48
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	938,909.47	2.57
7	其他各项资产	1,514,033.63	4.15
8	合计	36,500,533.10	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	1,260,550.00	4.04
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	490,050.00	1.57
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	-	-
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	1,750,600.00	5.61

### 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	600887	伊利股份	22,000	728,640.00	2.34
2	600557	康缘药业	18,000	516,600.00	1.66
3	002416	爱施德	33,000	490,050.00	1.57
4	603328	依顿电子	1,000	15,310.00	0.05

### 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	600887	伊利股份	786,324.65	1.49
2	600557	康缘药业	469,299.58	0.89
3	002416	爱施德	466,520.00	0.89
4	603328	依顿电子	15,310.00	0.03

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。本基金本报告期仅买入上述股票。

#### 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

本基金本报告期未卖出股票。

#### 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	1,737,454.23
卖出股票的收入（成交）总额	-

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	1,636,520.00	5.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,503,800.00	94.62
	其中：政策性金融债	29,503,800.00	94.62
4	企业债券	1,156,670.00	3.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	32,296,990.00	103.58

### 7.6 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	140201	14 国开 01	100,000	10,262,000.00	32.91
2	140202	14 国开 02	70,000	7,277,900.00	23.34
3	140203	14 国开 03	50,000	5,231,000.00	16.78
4	018001	国开 1301	35,000	3,580,500.00	11.48
5	018002	国开 1302	30,000	3,152,400.00	10.11

### 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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

贵金属不在本基金投资范围内。

### 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体除爱施德(002416)外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康缘药业(600557)外,没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2013 年 12 月 31 日,深圳市爱施德股份有限公司公告:“2012 年 8 月,本公司收到中国证券监督管理委员会(《调查通知书》,称公司其涉嫌信息披露违法违规,中国证监会决定对公司立案调查。后本公司又收到该调查的《结案通知书》,经审理,中国证监会决定对本公司不予行政处罚,本案做结案处理。”

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,认为深圳市爱施德股份有限公司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。

2014 年 1 月 16 日,江苏康缘药业股份有限公司公告:“本公司于 2012 年 10 月 27 日披露 2012 年第三季度报告,本公司董事夏月未遵守《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》第 11 条、第 13 条等有关规定,于 2012 年 10 月 10-12 日期间累计卖出公司股票 59,900 股,且未及时向公司报告并在上海证券交易所网站披露持股变动情况。公司董事夏月的上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》第 3.1.4 条、第 3.1.6 条等有关规定,以及在《董事(监事、高级管理人员)声明及承诺书》中做出的承诺。根据《股票上市规则》第 17.3 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定,上海交易所对本公司董事夏月予以通报批评。”

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,认为康缘药业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。

**7.12.2** 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。

#### 7.12.3 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	2,610.94
2	应收证券清算款	699,496.59
3	应收股利	-
4	应收利息	811,328.48

5	应收申购款	597.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,514,033.63

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603328	依顿电子	15,310.00	0.05	新股未上市

#### 7.12.6 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	221	72,516.22	59,698.85	0.37%	15,966,386.25	99.63%
纽银稳健双利债券C	216	67,242.52	-	-	14,524,384.71	100.00%
合计	430	71,047.60	59,698.85	0.20%	30,490,770.96	99.80%

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/个人投资者持有的份额占总份额的比例计算中，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

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人	纽银稳健双利债券 A	-	-

员持有本基金	纽银稳健双利债券 C	95,669.69	0.66%
	合计	95,669.69	0.31%

注：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）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	纽银稳健双利债券 A	0
	纽银稳健双利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	纽银稳健双利债券 A	0
	纽银稳健双利债券 C	0
	合计	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	25,360,203.16	27,438,223.75
本报告期基金总申购份额	57,735.99	35,465.77
减：本报告期基金总赎回份额	9,391,854.05	12,949,304.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,026,085.10	14,524,384.71

## 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：根据基金管理人第二届董事会第十次会议决议，自 2014 年 5 月 20 日起，陈喆先生不再担任本基金管理人总经理职务，由董事长安保和先生代为履行总经理职责。

本报告期内基金托管人重大人事变动如下：本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

### 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 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

#### 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	
申银万国	2	935,819.58	54.34%	851.94	54.34%	-
国信证券	2	410,454.65	23.83%	373.68	23.83%	-
广发证券	2	375,870.00	21.83%	342.18	21.83%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	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) 中银国际

#### 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
申银万国	-	-	209,700,000.00	18.55%	-	-
国信证券	3,515,610.00	11.22%	12,000,000.00	1.06%	-	-
广发证券	-	-	94,800,000.00	8.39%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,014,300.00	3.24%	87,400,000.00	7.73%	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	19,432,251.54	62.01%	89,600,000.00	7.93%	-	-
东方证券	725,740.88	2.32%	87,500,000.00	7.74%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	1,144,020.00	3.65%	25,500,000.00	2.26%	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	3,701,995.00	11.81%	200,000,000.00	17.69%	-	-
国泰君安	-	-	17,600,000.00	1.56%	-	-
海通证券	-	-	8,500,000.00	0.75%	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	731,238.05	2.33%	58,300,000.00	5.16%	-	-
中金公司	-	-	22,000,000.00	1.95%	-	-
中信证券	-	-	11,200,000.00	0.99%	-	-
中银国际	1,069,805.80	3.41%	206,300,000.00	18.25%	-	-

### 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2013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、证券日报、公司网站	2014-01-02
2	关于增加万银财富（北京）基金销售有限公司为纽银基金旗下证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2014-01-13
3	纽银稳健双利债券型证券投资基金2013年第4季度报告	上海证券报、证券日报、公司网站	2014-01-20
4	纽银梅隆西部基金管理有限公司关于在万银财富（北京）基金销售有限公司开通旗下基金定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2014-01-23
5	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年第二期）公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2014-02-08
6	纽银稳健双利债券型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2014-02-14
7	纽银基金关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下证券投资基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2014-03-05
8	纽银稳健双利债券型证券投资基金2013年年度报告	上海证券报、证券日报、公司网站	2014-03-27
9	关于纽银基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2014-03-29
10	纽银基金关于增加和讯信息科技有限公司为	中国证券报、证券时报、	2014-03-29

	旗下证券投资基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、 公司网站	
11	纽银稳健双利债券型证券投资基金2014年第1季度报告	上海证券报、证券日报、 公司网站	2014-04-22
12	关于纽银基金旗下基金持有的停牌股票调整估值价格的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014-04-29
13	纽银梅隆西部基金管理有限公司关于总经理离职的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014-05-21
14	纽银梅隆西部基金管理有限公司关于旗下开放式基金2014年半年度最后一个自然日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014-07-01
15	纽银稳健双利债券型证券投资基金2014年第2季度报告	上海证券报、证券日报、 公司网站	2014-07-18

## 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

二〇一四年八月二十六日