

---

**纽银策略优选股票型证券投资基金**  
**2012 年年度报告摘要**  
**2012 年 12 月 31 日**

基金管理人：纽银梅隆西部基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年三月二十九日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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 2012 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	纽银策略优选股票
基金主代码	671010
交易代码	671010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 25 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	488,589,301.34 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活运用多种投资策略，挖掘价格合理、有可持续增长潜力的公司，分享中国经济增长和证券市场发展的长线成果，在控制风险的前提下力争为基金持有人谋求长期回报。
投资策略	<p>本基金采用多个策略进行资产配置、行业配置和股票精选。投资中运用的策略主要包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 资产配置策略：本基金认为市场估值、市场流动性和市场情绪是中国股市的主要驱动因素。通过建立指数收益率与这三个指标的定量模型，来确定基金的资产配置。</li> <li>2. 行业配置策略：用各行业当月的估值、流动性、市场情绪因素来预测下一个月行业的收益率。我们研究行业收益率与行业各因子之间的实证 Pearson 相关系数，运用主成分分析来筛选出各个行业独特的市场估值、流动性和情绪指标。最后通过线性回归分析来建立各行业统计模型，并作实证检验。</li> <li>3. 股票精选策略：本基金将动态分析上市公司股价运行规律，投资 A 股市场内具有合理估值、高成长性及风险相对合理的公司，股票精选的目的在于挖掘出上市公司的内在价值与波动率区间。</li> </ol>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动型股票基金，属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，风险与预期收益均高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要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	2012 年	2011 年 1 月 25 日至 2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-75,684,022.50	-144,895,790.97
本期利润	-16,072,792.14	-191,464,649.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0305	-0.2234
本期基金份额净值增长率	-3.80%	-26.30%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3304	-0.2626
期末基金资产净值	346,621,876.15	460,127,351.01
期末基金份额净值	0.709	0.737

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

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

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

4.本基金合同生效日为 2011 年 1 月 25 日，合同生效当期不是完整报告期（一年）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

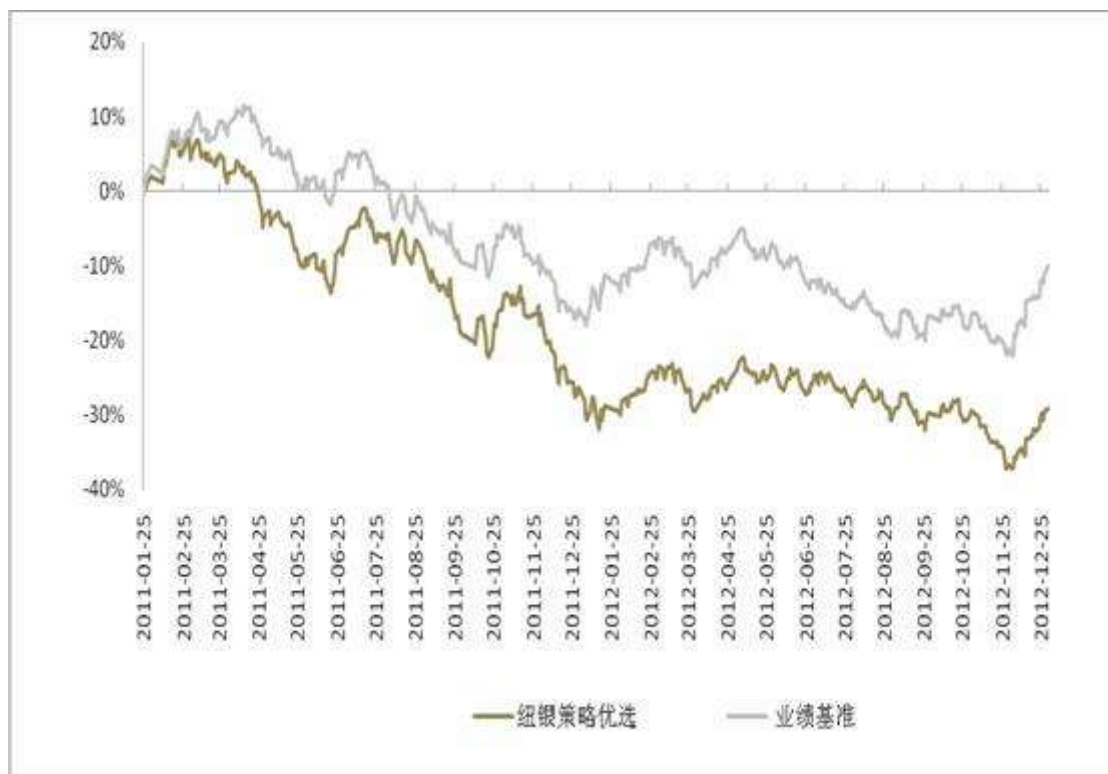
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.00%	1.01%	8.18%	1.02%	-7.18%	-0.01%
过去六个月	-4.45%	1.00%	2.46%	0.99%	-6.91%	0.01%
过去一年	-3.80%	1.11%	7.04%	1.02%	-10.84%	0.09%
自基金合同生效起至今	-29.10%	1.15%	-10.05%	1.02%	-19.05%	0.13%

### 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

纽银策略优选股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 1 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日)



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

### 3.2.3 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

纽银策略优选股票型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



1) 本基金的基金合同于 2011 年 1 月 25 日生效，截至 2012 年 12 月 31 日，基金运作未满三年。

2) 本基金基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金自 2011 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日未进行过利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
闫旭	本基金基金经理、公司投资副总监	2011-01-25	-	十二年	复旦大学经济学硕士；曾在华宝兴业基金管理有限公司和富国基金管理有限公司从事投资研究工作。2010 年 7 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
罗彦	本基金基金经理助理	2011-03-01	-	六年	麻省理工学院斯隆商学院 MBA；曾在中银基金管理有限公司任助理副总裁。2009 年 11 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

注：1.基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

当监控到疑似异常交易时，本基金管理人监察稽核部及时要求相关投资组合经理给予解释，该解释经监察稽核部辨认后确认该交易无异常情况后留档备查，公平交易季报及年报由投资组合经理、督察长、总经理签署后，由监察稽核部妥善保存分析报告备查。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易



时机和交易价差监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾过去的一年，中国经济在年初季节性补库后又经历了持续下滑，在三季度随着政府投资的加大，经济逐步企稳，地产、汽车等销量出现了环比较快的增长，四季度经济出现了显著的回升态势。A 股市场的走势基本反映了对于经济的预期，一季度上涨，随后的三个季度震荡下行，四季度在金融股的带领下大幅反弹。

一月份基金持仓的成长股出现较大幅度的回调，本基金在调仓周期股的过程中损失较大，但 5 月份对周期股的减持取得了较好的效果。下半年本基金坚持在成长相对明确的领域寻找投资机会，因此增加了电子、传媒、医药及环保的投资比例。同时我们看好金融改革以及地产销量的回升，进行了适当配置。但消费品中白酒塑化剂事件对净值造成一定负面影响。

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.709 元，本报告期份额净值增长率为 -3.80%，同期业绩比较基准增长率为 7.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为中国经济目前正在经历复苏的拐点，尽管周期性底部已现，但在阶段性去库存结束后，去产能将是一个更为漫长而复杂的过程。因此，传统产业在供需结构达到弱平衡时仍存在阶段性的投资机会。

同时，中国经济已迎来真正转型的开端，我们看到通过降低资源消耗与环境损害来提供绿色环境，通过医疗体系建设、加强教育投入等方式来提高人民福祉，通过体制改革来提高效率，通过政策倾斜来鼓励核心产业升级、增加消费对经济的拉动作用等等这些都是中国未来中长期发展的方向，但如何真正通过市场化的奖惩机制来实现生态的经济、人文结构实则任重而道远。另外，在资本市场方面，金融体系的改革将带来更多的源头活水，化解系统风险。这些都是我们在未来较长时间内关注的投资机会。

#### 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。所有成员均须具备必要的专业知识、专业技能和独立性，参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突，并按照制度规定的专业职责分工和估值流程履行估值程序。

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

本基金管理人尚未签订任何与估值相关的定价服务。

#### 4.7 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2013)第20419号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	纽银策略优选股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的纽银策略优选股票型证券投资基金(以下简称“纽银策略优选基金”)的财务报表，包括2012年12月31日的资产负债表、2012年度利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是纽银策略优选基金的基金管理人纽银梅隆西部基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管

	理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述纽银策略优选基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了纽银策略优选基金2012年12月31日的财务状况以及2012年度经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰 刘颖
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
审计报告日期	2013-03-13

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：纽银策略优选股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	39,397,544.85	106,998,966.58
结算备付金		2,065,153.76	1,173,424.65
存出保证金		3,250,000.00	3,000,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	306,127,972.09	363,986,482.84
其中：股票投资		302,257,227.06	363,986,482.84
基金投资		-	-
债券投资		3,870,745.03	-
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	-	-
应收证券清算款		2,342,645.70	-
应收利息	7.4.7.5	196,246.83	20,842.78
应收股利		-	-
应收申购款		54,643.12	989.61

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		353,434,206.35	475,180,706.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,349,090.37	9,208,158.09
应付赎回款		148,657.05	993,418.67
应付管理人报酬		413,967.45	627,519.03
应付托管费		68,994.58	104,586.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,301,320.16	1,027,929.10
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	3,530,300.59	3,091,744.02
负债合计		6,812,330.20	15,053,355.45
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	488,589,301.34	623,999,138.51
未分配利润	7.4.7.10	-141,967,425.19	-163,871,787.50
所有者权益合计		346,621,876.15	460,127,351.01
负债和所有者权益总计		353,434,206.35	475,180,706.46

注：1.报告截止日 2012 年 12 月 31 日，纽银策略优选基金份额净值 0.709 元，基金份额总额 488,589,301.34 份。

2.本基金合同生效日为 2011 年 1 月 25 日，合同生效当期不是完整报告期（一年）。

## 7.2 利润表

会计主体：纽银策略优选股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月25日至2011年12 月31日
<b>一、收入</b>		<b>-1,789,582.42</b>	<b>-167,901,689.03</b>
1. 利息收入		1,112,854.04	1,104,336.44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	544,762.52	1,104,336.44
债券利息收入		568,091.52	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-62,608,748.31	-123,330,487.22
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-65,003,808.10	-127,758,126.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-195,399.35	-
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	2,590,459.14	4,427,639.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	59,611,230.36	-46,568,858.50
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	95,081.49	893,320.25
<b>减：二、费用</b>		<b>14,283,209.72</b>	<b>23,562,960.44</b>
1. 管理人报酬		5,707,690.16	11,229,777.18
2. 托管费		951,281.62	1,871,629.58
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	7,324,770.94	10,113,143.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	299,467.00	348,410.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-16,072,792.14</b>	<b>-191,464,649.47</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-16,072,792.14</b>	<b>-191,464,649.47</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：纽银策略优选股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	623,999,138.51	-163,871,787.50	460,127,351.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,072,792.14	-16,072,792.14
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）	-135,409,837.17	37,977,154.45	-97,432,682.72
其中：1. 基金申购款	17,357,045.98	-4,844,943.97	12,512,102.01
2. 基金赎回款	-152,766,883.15	42,822,098.42	-109,944,784.73
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）	488,589,301.34	-141,967,425.19	346,621,876.15
项目	上年度可比期间		
	2011年1月25日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,063,046,976.37	-	1,063,046,976.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-191,464,649.47	-191,464,649.47
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）	-439,047,837.86	27,592,861.97	-411,454,975.89
其中：1. 基金申购款	272,403,811.78	858,216.59	273,262,028.37
2. 基金赎回款	-711,451,649.64	26,734,645.38	-684,717,004.26
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）	623,999,138.51	-163,871,787.50	460,127,351.01

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署；

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

纽银策略优选股票型证券投资基金(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[2010]1645 号《关于核准纽银策略优选股票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》、《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》和《纽银策略优选股票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 1,062,757,169.06 元，业经普华

永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 035 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,063,046,976.37 份基金份额,其中认购资金利息折合 289,807.31 份基金份额。本基金的基金管理人为纽银梅隆西部基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》和最新公布的《纽银策略优选股票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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%;债券、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 0%-35%;权证投资比例不高于基金资产净值的 3%;本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+上证国债指数收益率 $\times$ 20%。

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2011 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。



#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部

分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净

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

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

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

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类

别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

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

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### **7.4.7 关联方关系**

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

#### 7.4.8 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月25日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
西部证券	485,734,480.53	10.15%	2,805,168,666.43	41.10%

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
西部证券	412,871.56	9.98%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月25日至2011年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
西部证券	2,349,362.68	41.13%	-	-

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的净额列示。权证交易不计佣金。

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

##### 7.4.8.2 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 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年1月25日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,707,690.16	11,229,777.18
其中：支付销售机构的客户维护费	2,357,520.79	4,352,773.77

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年1月25日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	951,281.62	1,871,629.58

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

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

#### 7.4.8.4 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自有资金投资本基金的情况

本基金管理人于本报告期及上年度均未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度期末，无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 7.4.8.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月25日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	39,397,544.85	517,537.54	106,998,966.58	1,033,997.39

合计	39,397,544.85	517,537.54	106,998,966.58	1,033,997.39
----	---------------	------------	----------------	--------------

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未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.9 期末（2012 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 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 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余

额为 306,127,972.09 元，无属于第二层级和第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 358,730,811.34 元，第二层级 5,255,671.50 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2011 年 12 月 31 日：同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元(2011 年度：无)，涉及酒鬼酒股份有限公司发行的股票。

(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	302,257,227.06	85.52
	其中：股票	302,257,227.06	85.52
2	固定收益投资	3,870,745.03	1.10
	其中：债券	3,870,745.03	1.10
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	41,462,698.61	11.73
6	其他各项资产	5,843,535.65	1.65
7	合计	353,434,206.35	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------



A	农、林、牧、渔业	2,805,000.00	0.81
B	采掘业	13,130,264.84	3.79
C	制造业	140,060,499.13	40.41
C0	食品、饮料	3,455,416.80	1.00
C1	纺织、服装、皮毛	2,900,000.00	0.84
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,626,000.00	1.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,101,125.04	2.05
C5	电子	38,728,432.20	11.17
C6	金属、非金属	23,062,423.57	6.65
C7	机械、设备、仪表	29,964,742.08	8.64
C8	医药、生物制品	31,222,359.44	9.01
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,742,059.80	0.50
F	交通运输、仓储业	8,878,104.00	2.56
G	信息技术业	7,239,020.07	2.09
H	批发和零售贸易	14,144,600.00	4.08
I	金融、保险业	57,523,679.72	16.60
J	房地产业	45,135,084.50	13.02
K	社会服务业	5,736,315.00	1.65
L	传播与文化产业	5,862,600.00	1.69
M	综合类	-	-
	合计	302,257,227.06	87.20

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600030	中信证券	1,200,000	16,032,000.00	4.63
2	000024	招商地产	460,000	13,749,400.00	3.97
3	601377	兴业证券	859,100	10,549,748.00	3.04
4	600837	海通证券	1,000,000	10,250,000.00	2.96
5	601601	中国太保	450,000	10,125,000.00	2.92
6	600376	首开股份	560,000	7,347,200.00	2.12
7	000786	北新建材	419,910	7,344,225.90	2.12
8	600266	北京城建	470,000	6,998,300.00	2.02
9	000671	阳光城	450,000	6,975,000.00	2.01
10	002237	恒邦股份	299,938	6,949,563.46	2.00

### 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	601398	工商银行	80,584,000.00	17.51
2	000937	冀中能源	54,281,851.54	11.80
3	600123	兰花科创	50,597,706.21	11.00
4	601288	农业银行	44,958,000.00	9.77
5	000799	酒鬼酒	44,323,472.81	9.63
6	600111	包钢稀土	40,573,388.55	8.82
7	600036	招商银行	35,662,978.40	7.75
8	600547	山东黄金	31,316,642.19	6.81
9	000776	广发证券	30,163,809.06	6.56
10	601318	中国平安	25,891,661.03	5.63
11	601328	交通银行	24,592,153.84	5.34
12	600489	中金黄金	24,306,020.55	5.28
13	601788	光大证券	24,117,010.69	5.24
14	002385	大北农	23,775,111.26	5.17
15	002241	歌尔声学	23,679,907.77	5.15
16	000603	盛达矿业	22,440,504.66	4.88
17	600048	保利地产	20,596,860.51	4.48
18	600519	贵州茅台	20,305,654.06	4.41
19	600188	兖州煤业	20,149,403.74	4.38
20	000858	五粮液	20,129,799.15	4.37
21	600893	航空动力	19,737,734.94	4.29
22	600030	中信证券	19,648,218.00	4.27
23	601717	郑煤机	19,583,174.85	4.26
24	600518	康美药业	19,039,977.00	4.14
25	600837	海通证券	18,987,986.13	4.13
26	601117	中国化学	18,909,965.35	4.11
27	002236	大华股份	18,806,310.47	4.09
28	600060	海信电器	18,578,660.95	4.04
29	600031	三一重工	18,236,434.97	3.96
30	000024	招商地产	18,219,442.02	3.96
31	601336	新华保险	18,214,194.72	3.96
32	300070	碧水源	17,730,286.21	3.85
33	300058	蓝色光标	16,817,380.80	3.65
34	600612	老凤祥	16,797,370.02	3.65
35	600316	洪都航空	16,456,747.19	3.58
36	600366	宁波韵升	16,196,186.68	3.52
37	000651	格力电器	16,011,655.82	3.48
38	600376	首开股份	15,784,645.94	3.43

39	002450	康得新	15,164,567.28	3.30
40	002475	立讯精密	15,128,538.90	3.29
41	601669	中国水电	14,984,500.00	3.26
42	000157	中联重科	14,971,472.27	3.25
43	300188	美亚柏科	14,945,331.27	3.25
44	300115	长盈精密	14,055,028.30	3.05
45	600888	新疆众和	13,999,728.76	3.04
46	600585	海螺水泥	13,776,254.53	2.99
47	000826	桑德环境	13,627,308.20	2.96
48	601766	中国南车	13,626,518.00	2.96
49	300267	尔康制药	13,210,883.32	2.87
50	600742	一汽富维	13,051,182.54	2.84
51	000725	京东方 A	12,924,885.60	2.81
52	000630	铜陵有色	12,607,037.96	2.74
53	002477	雏鹰农牧	12,354,418.06	2.68
54	601988	中国银行	12,282,094.20	2.67
55	601166	兴业银行	12,242,398.45	2.66
56	600809	山西汾酒	12,207,258.83	2.65
57	002431	棕榈园林	11,741,238.98	2.55
58	002325	洪涛股份	11,729,498.76	2.55
59	002306	湘鄂情	11,473,959.60	2.49
60	000671	阳光城	11,350,325.70	2.47
61	000656	金科股份	11,137,781.65	2.42
62	002038	双鹭药业	11,032,772.67	2.40
63	600362	江西铜业	10,959,123.00	2.38
64	600535	天士力	10,868,859.52	2.36
65	600332	广州药业	10,859,442.81	2.36
66	600016	民生银行	10,794,000.00	2.35
67	600596	新安股份	10,752,879.70	2.34
68	600027	华电国际	10,671,761.94	2.32
69	600050	中国联通	10,457,500.00	2.27
70	601377	兴业证券	10,438,962.70	2.27
71	002415	海康威视	10,341,621.74	2.25
72	002041	登海种业	10,199,090.08	2.22
73	601601	中国太保	9,990,000.00	2.17
74	600389	江山股份	9,979,260.52	2.17
75	601699	潞安环能	9,868,731.66	2.14
76	600720	祁连山	9,851,827.88	2.14
77	600348	阳泉煤业	9,815,061.78	2.13
78	000001	平安银行	9,751,797.18	2.12
79	000415	渤海租赁	9,593,336.80	2.08

80	000655	金岭矿业	9,372,760.03	2.04
81	000069	华侨城 A	9,355,589.82	2.03
82	300027	华谊兄弟	9,335,371.77	2.03

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	81,268,631.06	17.66
2	601288	农业银行	59,089,845.64	12.84
3	000937	冀中能源	55,518,100.96	12.07
4	600123	兰花科创	51,473,626.15	11.19
5	600547	山东黄金	41,883,549.04	9.10
6	600111	包钢稀土	41,473,155.93	9.01
7	000799	酒鬼酒	38,591,391.71	8.39
8	600036	招商银行	36,101,830.79	7.85
9	601669	中国水电	29,013,292.92	6.31
10	000776	广发证券	28,574,415.83	6.21
11	300058	蓝色光标	26,709,221.50	5.80
12	601318	中国平安	25,923,862.29	5.63
13	601788	光大证券	24,108,910.40	5.24
14	002241	歌尔声学	23,419,746.24	5.09
15	002450	康得新	23,277,080.43	5.06
16	002477	雏鹰农牧	22,964,289.18	4.99
17	600489	中金黄金	22,828,339.98	4.96
18	600048	保利地产	22,633,046.09	4.92
19	002007	华兰生物	21,946,222.28	4.77
20	300188	美亚柏科	21,248,273.57	4.62
21	002230	科大讯飞	21,216,733.42	4.61
22	002385	大北农	20,680,575.08	4.49
23	600188	兖州煤业	19,667,993.44	4.27
24	300070	碧水源	19,628,281.41	4.27
25	600519	贵州茅台	19,610,500.11	4.26
26	002236	大华股份	19,417,372.53	4.22
27	000858	五粮液	19,167,474.68	4.17
28	601336	新华保险	19,139,693.40	4.16
29	601717	郑煤机	19,048,613.38	4.14
30	600837	海通证券	19,033,453.81	4.14

31	601328	交通银行	18,952,722.96	4.12
32	601117	中国化学	18,505,096.08	4.02
33	600031	三一重工	18,330,084.55	3.98
34	000603	盛达矿业	18,135,864.48	3.94
35	600893	航空动力	17,558,317.13	3.82
36	600366	宁波韵升	17,522,602.77	3.81
37	600518	康美药业	17,369,319.87	3.77
38	600016	民生银行	16,183,814.95	3.52
39	000651	格力电器	16,075,407.77	3.49
40	600612	老凤祥	15,643,006.07	3.40
41	000826	桑德环境	15,487,897.38	3.37
42	600060	海信电器	15,315,720.75	3.33
43	300027	华谊兄弟	15,306,643.69	3.33
44	600888	新疆众和	14,913,041.49	3.24
45	002038	双鹭药业	14,309,822.98	3.11
46	601766	中国南车	14,240,176.89	3.09
47	600585	海螺水泥	13,601,175.32	2.96
48	600316	洪都航空	13,576,266.22	2.95
49	000630	铜陵有色	13,565,741.72	2.95
50	300115	长盈精密	13,178,663.15	2.86
51	002012	凯恩股份	13,070,055.90	2.84
52	600809	山西汾酒	12,798,320.83	2.78
53	600880	博瑞传播	12,341,767.05	2.68
54	002475	立讯精密	12,271,054.57	2.67
55	601988	中国银行	11,997,020.50	2.61
56	002306	湘鄂情	11,809,726.23	2.57
57	600332	广州药业	11,759,360.32	2.56
58	002431	棕榈园林	11,744,543.66	2.55
59	601166	兴业银行	11,733,883.28	2.55
60	600161	天坛生物	11,450,198.35	2.49
61	002415	海康威视	11,449,482.20	2.49
62	002325	洪涛股份	11,242,369.69	2.44
63	000598	兴蓉投资	10,896,290.29	2.37
64	601699	潞安环能	10,809,439.14	2.35
65	600030	中信证券	10,587,120.14	2.30
66	002041	登海种业	10,468,568.28	2.28
67	000939	凯迪电力	10,458,796.00	2.27
68	300257	开山股份	10,402,014.93	2.26
69	300039	上海凯宝	10,178,030.34	2.21
70	600376	首开股份	10,129,762.08	2.20
71	600596	新安股份	9,884,366.69	2.15

72	600348	阳泉煤业	9,858,551.12	2.14
73	600027	华电国际	9,841,117.19	2.14
74	000001	平安银行	9,750,709.00	2.12
75	000999	华润三九	9,646,198.76	2.10
76	000893	东凌粮油	9,374,590.83	2.04
77	600050	中国联通	9,296,700.00	2.02
78	600742	一汽富维	9,222,254.25	2.00

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	2,365,282,785.97
卖出股票的收入（成交）总额	2,421,675,060.71

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,870,745.03	1.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,870,745.03	1.12

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	122831	11 惠通债	20,000	2,063,400.00	0.60
2	111060	10 佳城投	17,491	1,807,345.03	0.52
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-

5	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.9 投资组合报告附注**

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

**8.9.2** 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**8.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,250,000.00
2	应收证券清算款	2,342,645.70
3	应收股利	-
4	应收利息	196,246.83
5	应收申购款	54,643.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,843,535.65

**8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**9 基金份额持有人信息**

**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额比

			比例		例
10,052	48,606.18	26,799,575.65	5.49%	461,789,725.69	94.51%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	336,123.77	0.0688%

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

2.本基金基金经理持有本基金份额数量的数量区间为 0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年1月25日)基金份额总额	1,063,046,976.37
本报告期期初基金份额总额	623,999,138.51
本报告期期间基金总申购份额	17,357,045.98
减：本报告期期间基金总赎回份额	152,766,883.15
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	488,589,301.34

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。



### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金进行审计。本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所有限公司审计费人民币 60,000 元。普华永道中天会计师事务所有限公司自本基金成立以来一直提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	536,010,812.93	11.20%	465,916.30	11.26%	-
申银万国	2	501,525,353.59	10.48%	422,641.52	10.22%	-
西部证券	3	485,734,480.53	10.15%	412,871.56	9.98%	-
英大证券	1	386,088,285.50	8.07%	341,002.08	8.24%	-
光大证券	1	304,000,497.43	6.35%	276,763.70	6.69%	-
国泰君安	2	311,242,553.29	6.50%	275,419.21	6.66%	-
中投证券	2	275,050,611.56	5.75%	233,106.05	5.64%	-
东方证券	2	273,336,670.72	5.71%	227,959.17	5.51%	-
国信证券	2	270,698,775.16	5.65%	225,548.44	5.45%	-
齐鲁证券	2	251,503,586.45	5.25%	213,775.69	5.17%	-
东兴证券	1	233,203,518.36	4.87%	203,586.67	4.92%	-
中信证券	2	222,467,476.49	4.65%	194,221.16	4.70%	-
安信证券	2	210,943,505.56	4.41%	174,918.66	4.23%	-
中金公司	2	190,016,152.98	3.97%	163,336.70	3.95%	-
民生证券	1	169,570,209.29	3.54%	154,375.45	3.73%	-
东北证券	2	118,500,036.49	2.48%	107,883.35	2.61%	-
国都证券	1	47,065,320.35	0.98%	42,847.90	1.04%	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1.基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，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. 第一创业、民生证券、银河证券、国都证券、东北证券为在本报告期内新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	13,602,875.55	38.48%	-	-	-	-
光大证券	2,083,040.17	5.89%	-	-	-	-
国泰君安	1,835,914.99	5.19%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	17,827,683.78	50.43%	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### §12 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

纽银梅隆西部基金管理有限公司

二〇一三年三月二十九日