

纽银策略优选股票型证券投资基金

2013 年半年度报告摘要

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：纽银梅隆西部基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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	411,944,556.44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> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

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

登载基金半年度报告摘要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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	48,579,440.12
本期利润	39,139,549.02
加权平均基金份额本期利润	0.0867
本期基金份额净值增长率	12.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2204
期末基金资产净值	327,460,094.00
期末基金份额净值	0.795

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

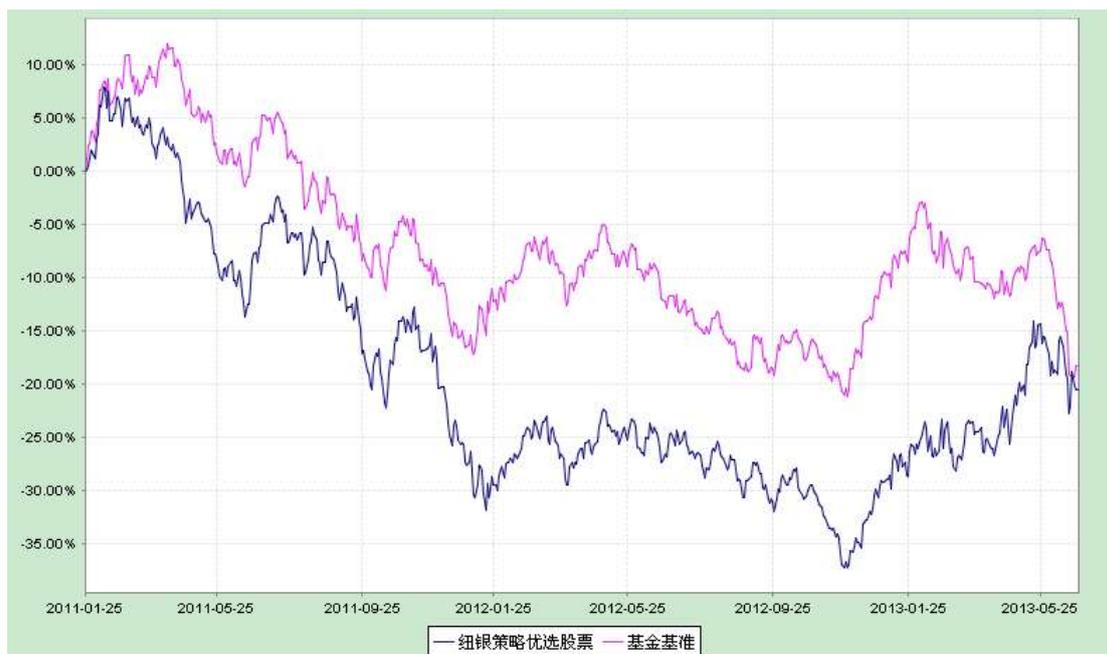
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.02%	2.06%	-12.55%	1.49%	7.53%	0.57%
过去三个月	5.16%	1.75%	-9.32%	1.16%	14.48%	0.59%
过去六个月	12.13%	1.62%	-9.86%	1.20%	21.99%	0.42%
过去一年	7.14%	1.33%	-7.65%	1.09%	14.79%	0.24%
自基金合同生效至今	-20.50%	1.26%	-18.93%	1.06%	-1.57%	0.20%

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

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2011年1月25日至2013年6月30日）



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

2. 本基金建仓期自 2011 年 1 月 25 日至 2011 年 7 月 24 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

纽银梅隆西部基金管理有限公司（简称“纽银基金”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2010]864号）批准，于 2010 年 7 月 20 日成立。公司由西部证券股份有限公司和纽约银行梅隆资产管理国际有限公司合资设立，注册资本 3 亿元人民币，其中中方股东西部证券股份有限公司出资 51%，外方股东纽约银行梅隆资产管理国际有限公司出资 49%，注册地上海。

截至 2013 年 6 月 30 日，纽银基金共管理四只开放式基金——纽银策略优选股票型证券投资基金、纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金、纽银稳健双利债券型证券投资基金、纽银稳定增利债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

闫旭	本基金基金经理、公司投资副总监	2011-01-25	-	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。
罗彦	本基金基金经理助理	2011-03-01	-	七年	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. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、《纽银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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易管理制度》及《异常交易监控及报告制度》并严格遵守上述制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易执行，以公平对待投资人。

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

本基金管理人监察稽核部及风险管理部负责对各账户公平交易进行事后监察，分别于每季度和每年度末对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年证券市场经历了先扬后抑，转而急剧下跌的走势，沪深 300 跌幅超过 12%。随着制造业 PMI 的持续回落，投资者对经济复苏的预期不断调低。直至六月流动性的骤紧，导致了市场的极度悲观与恐慌。大部分传统产业在此背景下持续下跌，而景气持续向好的 TMT、环保及医药板块则不断上涨。上半年我们在 1 月减持了周期股，并加大了对于 TMT 及环保、医药板块的投资，取得了较好的效果。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.795 元，本报告期份额净值增长率为 12.13%，同期业绩比较基准增长率为 -9.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

估值委员会的成员包括投资管理部、风险控制岗、监察稽核部、基金运营部等有关人员组成。各成员平均具有 7 年以上的基金相关从业经验，且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验并具备必要的专业知识和独立性，参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突，并按照制度规定的专业职责分工和估值流程履行估值程序。

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

本基金管理人尚未签订任何与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂未进行利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：纽银策略优选股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	49,524,177.80	39,397,544.85
结算备付金	1,517,128.52	2,065,153.76
存出保证金	332,463.92	3,250,000.00
交易性金融资产	279,154,978.79	306,127,972.09
其中：股票投资	278,545,831.79	302,257,227.06
基金投资	-	-
债券投资	609,147.00	3,870,745.03
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	2,342,645.70
应收利息	11,208.80	196,246.83
应收股利	-	-
应收申购款	18,765.92	54,643.12
递延所得税资产	-	-

其他资产	-	-
资产总计	330,558,723.75	353,434,206.35
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2013 年 6 月 30 日	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	297.20	1,349,090.37
应付赎回款	96,442.28	148,657.05
应付管理人报酬	416,912.83	413,967.45
应付托管费	69,485.45	68,994.58
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	636,470.43	1,301,320.16
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,879,021.56	3,530,300.59
负债合计	3,098,629.75	6,812,330.20
所有者权益:		
实收基金	411,944,556.44	488,589,301.34
未分配利润	-84,484,462.44	-141,967,425.19
所有者权益合计	327,460,094.00	346,621,876.15
负债和所有者权益总计	330,558,723.75	353,434,206.35

注：1. 报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.795 元，基金份额总额 411,944,566.44 份。

6.2 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入	45,299,970.11	8,493,942.02
1.利息收入	230,117.10	613,998.92
其中：存款利息收入	207,358.02	214,562.87

债券利息收入	22,759.08	399,436.05
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)	54,499,159.14	-41,636,197.01
其中: 股票投资收益	53,477,049.80	-43,101,076.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	36,677.26	-116,890.97
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	985,432.08	1,581,770.50
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-9,439,891.10	49,440,693.60
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	10,584.97	75,446.51
减: 二、费用	6,160,421.09	7,330,216.23
1. 管理人报酬	2,566,757.19	3,023,369.44
2. 托管费	427,792.85	503,894.84
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,027,540.13	3,654,075.81
5. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	138,330.92	148,876.14
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	39,139,549.02	1,163,725.79
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	39,139,549.02	1,163,725.79

6.3 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: 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	488,589,301.34	-141,967,425.19	346,621,876.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,139,549.02	39,139,549.02
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）	-76,644,744.90	18,343,413.73	-58,301,331.17
其中：1. 基金申购款	6,443,774.92	-1,527,569.25	4,916,205.67
2. 基金赎回款	-83,088,519.82	19,870,982.98	-63,217,536.84
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）	411,944,556.44	-84,484,462.44	327,460,094.00
项目	上年度可比期间		
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	1,163,725.79	1,163,725.79
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）	-104,400,838.58	28,743,573.40	-75,657,265.18
其中：1. 基金申购款	9,106,042.89	-2,464,553.50	6,641,489.39
2. 基金赎回款	-113,506,881.47	31,208,126.90	-82,298,754.57
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）	519,598,299.93	-133,964,488.31	385,633,811.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈喆，主管会计工作负责人：陈喆，会计机构负责人：李健

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

纽银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》和《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》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 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》和《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》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。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%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 80%+上证国债指数收益率 \times 20%。

根据《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资组合应在基金成立 6 个月内达到基金合同规定的比例限制。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《纽银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 6.4.4 所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操

作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股票红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括基金买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税,自 2013 年 1 月 1 日起,对个人投资者从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
西部证券	339,027,232.70	17.20%	485,734,480.53	20.53%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
西部证券	2,111,804.48	53.29%	-	-

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西部证券	308,649.63	17.35%	8,507.40	1.34%
关联方名称	上年度可比期间			

	2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
西部证券	412,871.56	20.77%	323,044.20	28.42%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,566,757.19	3,023,369.44
其中：支付销售机构的客户维护费	1,088,347.32	1,265,440.12

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

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	427,792.85	503,894.84

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.8.5 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6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	49,524,177.80	185,978.66	99,342,952.01	201,419.28

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

2) 本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2013 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 1,517,128.52 元。(2012 年 6 月 30 日：人民币 2,452,122.76 元)

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
300027	华谊兄弟	2013-06-05	重大 事项 停牌	28.55	2013-07-24	31.41	368,149	11,524,483.84	10,510,653.95	-
300133	华策影视	2013-05-28	重大 事项 停牌	24.43	2013-07-30	26.87	156,710	3,645,026.26	3,828,425.30	-
600088	中视传媒	2013-05-30	重大 资产	14.29	-	-	130,900	1,698,762.71	1,870,561.00	-

			重 组 停 牌							
60188 6	江河 创建	2013-06- 20	重 大 事 项 停 牌	13.22	2013-0 7-16	13.7 8	548,603	7,912,385. 30	7,252,531. 66	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.10 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) 各层次金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 255,692,806.88 元，属于第二层级的余额为 23,462,171.91 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 306,127,972.09 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金分别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不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或第三层级。

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	278,545,831.79	84.27
	其中：股票	278,545,831.79	84.27
2	固定收益投资	609,147.00	0.18
	其中：债券	609,147.00	0.18
	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	51,041,306.32	15.44
6	其他各项资产	362,438.64	0.11
7	合计	330,558,723.75	100.00

7.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	208,086,757.36	63.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	31,919,031.68	9.75
F	批发和零售业	1,557,500.00	0.48
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	12,375,517.50	3.78
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	24,607,025.25	7.51
S	综合	-	-
	合计	278,545,831.79	85.06

7.3 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	002241	歌尔声学	860,000	31,209,400.00	9.53
2	002415	海康威视	680,695	24,055,761.30	7.35
3	600703	三安光电	953,913	18,734,851.32	5.72
4	300177	中海达	961,430	17,113,454.00	5.23
5	002450	康得新	582,450	16,296,951.00	4.98
6	600867	通化东宝	1,000,000	14,890,000.00	4.55
7	002521	齐峰股份	2,052,763	14,820,948.86	4.53
8	300058	蓝色光标	296,775	12,375,517.50	3.78
9	002431	棕榈园林	574,252	10,887,817.92	3.32
10	300088	长信科技	500,100	10,547,109.00	3.22

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于纽银梅隆西部基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

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	002241	歌尔声学	36,804,927.41	10.62
2	002415	海康威视	25,864,693.52	7.46

3	600028	中国石化	19,946,215.59	5.75
4	600703	三安光电	18,098,989.72	5.22
5	002521	齐峰股份	17,161,863.53	4.95
6	002497	雅化集团	16,422,427.68	4.74
7	002450	康得新	15,743,667.65	4.54
8	300177	中海达	15,663,284.97	4.52
9	300090	盛运股份	14,131,424.70	4.08
10	002273	水晶光电	13,687,726.58	3.95
11	600050	中国联通	13,094,532.00	3.78
12	300058	蓝色光标	13,027,616.12	3.76
13	601928	凤凰传媒	12,639,152.00	3.65
14	002431	棕榈园林	12,298,609.71	3.55
15	600867	通化东宝	12,257,717.44	3.54
16	300197	铁汉生态	12,127,690.11	3.50
17	000937	冀中能源	12,113,830.33	3.49
18	000655	金岭矿业	11,713,453.47	3.38
19	300027	华谊兄弟	11,524,483.84	3.32
20	600585	海螺水泥	11,312,123.60	3.26
21	300088	长信科技	11,195,010.40	3.23
22	600549	厦门钨业	10,699,156.00	3.09
23	600837	海通证券	10,458,704.74	3.02
24	601699	潞安环能	10,315,719.74	2.98
25	300105	龙源技术	9,943,070.30	2.87
26	600118	中国卫星	9,145,097.00	2.64
27	300113	顺网科技	9,037,045.43	2.61
28	601555	东吴证券	8,878,858.00	2.56
29	600048	保利地产	8,815,100.00	2.54
30	600031	三一重工	8,507,815.74	2.45
31	601901	方正证券	8,387,268.00	2.42
32	300054	鼎龙股份	8,255,278.00	2.38
33	600062	华润双鹤	8,165,517.26	2.36
34	300037	新宙邦	8,047,642.50	2.32
35	002064	华峰氨纶	8,046,209.00	2.32
36	000157	中联重科	8,021,712.00	2.31
37	000731	四川美丰	7,946,600.16	2.29
38	601886	江河创建	7,912,385.30	2.28
39	002179	中航光电	7,411,317.21	2.14
40	600511	国药股份	7,393,872.77	2.13
41	002148	北纬通信	7,299,696.48	2.11
42	601989	中国重工	7,194,119.01	2.08
43	601336	新华保险	7,185,698.80	2.07

44	002456	欧菲光	7,080,698.00	2.04
45	601888	中国国旅	7,080,120.00	2.04
46	600801	华新水泥	7,077,389.69	2.04
47	600016	民生银行	7,005,018.00	2.02
48	000063	中兴通讯	6,976,802.92	2.01
49	300187	永清环保	6,958,875.00	2.01
50	002065	东华软件	6,947,242.70	2.00

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600028	中国石化	22,138,544.09	6.39
2	600837	海通证券	21,341,358.75	6.16
3	002497	雅化集团	18,214,783.27	5.25
4	000655	金岭矿业	17,164,353.62	4.95
5	600030	中信证券	15,449,549.44	4.46
6	300090	盛运股份	15,147,734.10	4.37
7	002241	歌尔声学	14,627,092.61	4.22
8	002273	水晶光电	14,250,626.78	4.11
9	600050	中国联通	13,523,894.00	3.90
10	000024	招商地产	13,459,628.68	3.88
11	000157	中联重科	13,338,544.44	3.85
12	300113	顺网科技	12,204,235.45	3.52
13	000937	冀中能源	12,201,859.47	3.52
14	300017	网宿科技	11,658,376.95	3.36
15	601601	中国太保	10,154,330.00	2.93
16	601377	兴业证券	10,066,038.00	2.90
17	600585	海螺水泥	10,063,042.80	2.90
18	600549	厦门钨业	10,051,904.10	2.90
19	601699	潞安环能	9,995,757.95	2.88
20	300070	碧水源	9,849,492.34	2.84
21	601901	方正证券	9,803,228.97	2.83
22	600118	中国卫星	9,775,142.19	2.82
23	002456	欧菲光	9,659,063.25	2.79
24	002655	共达电声	9,588,622.90	2.77
25	300088	长信科技	9,506,359.45	2.74
26	601555	东吴证券	9,331,073.40	2.69
27	000786	北新建材	9,183,531.85	2.65
28	000725	京东方 A	8,971,600.00	2.59

29	002148	北纬通信	8,885,723.78	2.56
30	300105	龙源技术	8,836,813.95	2.55
31	002618	丹邦科技	8,333,930.61	2.40
32	600031	三一重工	8,162,677.05	2.35
33	000671	阳光城	8,096,906.78	2.34
34	300187	永清环保	8,018,534.97	2.31
35	300315	掌趣科技	7,741,930.06	2.23
36	002179	中航光电	7,530,861.58	2.17
37	600583	海油工程	7,511,367.21	2.17
38	600707	*ST 彩虹	7,426,135.89	2.14
39	601888	中国国旅	7,370,122.97	2.13
40	000063	中兴通讯	7,315,172.58	2.11
41	002064	华峰氨纶	7,305,682.37	2.11
42	002292	奥飞动漫	7,209,566.90	2.08
43	601336	新华保险	7,172,541.94	2.07
44	600062	华润双鹤	7,151,294.60	2.06
45	300328	宜安科技	7,111,602.04	2.05
46	601328	交通银行	7,007,000.00	2.02
47	002408	齐翔腾达	6,965,416.38	2.01
48	600376	首开股份	6,944,714.98	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。

7.4.3 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	951,626,007.10
卖出股票的收入（成交）总额	1,019,295,817.37

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

7	可转债	609,147.00	0.19
8	其他	-	-
9	合计	609,147.00	0.19

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	5,860	609,147.00	0.19
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10 投资组合报告附注

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

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

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

7.10.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	332,463.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,208.80
5	应收申购款	18,765.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	362,438.64

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(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
8,789	46,870.47	12,381,623.08	3.01%	399,562,933.36	96.99%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	257,655.61	0.0625%

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

2. 本基金基金经理持有本基金份额数量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 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	488,589,301.34
本报告期基金总申购份额	6,443,774.92
减：本报告期基金总赎回份额	83,088,519.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	411,944,556.44

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金进行审计。本报告期内本基金

未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况

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	
海通证券	2	451,995,329.41	22.93%	403,910.29	22.71%	-
西部证券	3	339,027,232.70	17.20%	308,649.63	17.35%	-
国泰君安	2	175,345,983.05	8.90%	159,635.62	8.98%	-
东北证券	2	165,193,812.89	8.38%	150,392.73	8.46%	-
东方证券	2	157,526,537.11	7.99%	141,870.16	7.98%	-
国信证券	2	132,834,292.85	6.74%	117,545.55	6.61%	-
中信证券	2	127,017,423.65	6.44%	112,398.27	6.32%	-
广发证券	2	116,410,806.21	5.91%	105,980.27	5.96%	-
光大证券	1	95,609,439.29	4.85%	87,043.51	4.89%	-
长江证券	1	88,061,760.70	4.47%	80,171.39	4.51%	-
中投证券	2	58,235,841.13	2.95%	53,018.17	2.98%	-
兴业证券	2	39,919,539.28	2.03%	36,342.87	2.04%	-
国金证券	1	23,743,826.20	1.20%	21,616.77	1.22%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1.基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

2. 报告期内新增交易单元为：

- 1) 长江证券
- 2) 招商证券

3. 报告期内退租的交易单元为：

- 1) 东海证券

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	1,851,214.51	46.71%	-	-	-	-
西部证券	2,111,804.48	53.29%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

纽银策略优选股票型证券投资基金 2013 年半年度报告摘要

东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

纽银梅隆西部基金管理有限公司
二〇一三年八月二十七日