华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人：华宸未来基金管理有限公司
基金托管人：中信银行股份有限公司
报告送出日期：2013年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宸300
基金主代码	167901
交易代码	167901
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2013年4月26日
报告期末基金份额总额	43,601,215.27份
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以"指数化投资为主、积极增强投资为辅"，在复制沪深300指数的基础上，结合深入的基本面研究及数量化投资技术对投资组合进行适度优化调整，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率 * 95% + 银行活期存款利率（税后）* 5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	华宸未来基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年7月1日 - 2013年9月30日）
1.本期已实现收益	-127,316.74
2.本期利润	2,922,453.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0617
4.期末基金资产净值	41,951,730.94
5.期末基金份额净值	0.962

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，包含停牌股票按公允价值调整的影响。

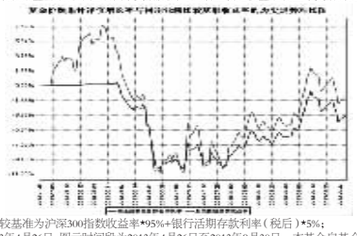
2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	6.77%	0.87%	9.01%	1.36%	-2.24%	-0.49%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：1、本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%；

2、本基金成立于2013年4月26日，图示时间段为2013年4月26日至2013年9月30日。本基金自基金合同生效日至本报告期末不满一年；

3、本基金建仓期为2013年4月26日至2013年10月25日。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王宇	本基金基金经理兼金融工程部总监	2013年4月26日	-	14	毕业于美国加州州立大学获金融学硕士学位，十四年证券投资基金工作经历，历任美国加州美国运通投资顾问公司分析师，鹏华基金管理有限公司研究部研究员，招商基金管理有限公司基金管理部高级研究员，泰达宏利基金管理有限公司产品及金融工程部总经理等职。

注：1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，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关于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守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求，并通过对投资交易行为的监控和分析，确保管理人旗下各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节均得到公平对待。本报告期内，管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 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

2013年3季度，国内各项宏观经济指标持续改善，经济稳中有升，社会融资总额大幅增长，进出口回暖，通货膨胀压力呈现。国际方面，美国经济持续复苏，美联储QE货币宽松政策的退出预期成为影响全球经济的主要因素；日本继续采取宽松货币政策，日本经济总体平稳；欧洲经济结束了持续4个季度的衰退。在投资者对经济状况、流动性状况改善等的较强预期下，国内证券市场总体上呈大幅反弹走势。沪深300指数期间涨幅接近 9.47%。

报告期内，本基金大幅加仓，在做好跟踪标的指数的基础上，努力为投资者带来更好的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日，本基金份额净值为0.962元，本报告期份额净值增长率为 6.77%，同期沪深300指数增长率为 9.47%。本基金本报告期跟踪偏离度为 -2.7%。

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2013年4季度，十八届三中全会即将召开，市场预期改革红利，催生主题投资机会和热点；美国量化宽松政策或将退出，国内宏观经济增速较三季度总体保持平稳，货币政策保持稳健，市场资金面不会太宽松；个股业绩分化 。总体判断市场震荡走势。

由于金融服务板块在沪深300指数中的地位，4季度决定沪深300指数走势需观察银行股估值修复的程度。由于钢铁、石化等周期股板块基本面较差，当这些板块补涨时则预示市场波动风险加大。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	33,400,098.31	78.84
	其中：股票	33,400,098.31	78.84
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,000,000.00	2.36
	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	4,006,392.51	9.46
6	其他资产	3,960,361.98	9.35
7	合计	42,366,852.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	196,554.32	0.47
B	采矿业	2,349,183.84	5.60
C	制造业	10,836,625.23	25.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,113,419.24	2.65
E	建筑业	1,216,427.09	2.90
F	批发和零售业	1,091,467.88	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	824,541.91	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	822,492.10	1.96
J	金融业	12,258,685.06	29.22
K	房地产业	1,661,200.25	3.96
L	租赁和商务服务业	185,924.46	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	282,198.00	0.67
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	166,371.83	0.40
S	综合	395,007.10	0.94
	合计	33,400,098.31	79.62

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.3 报告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

5.3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	162,734	1,555,737.04	3.71
2	600036	招商银行	125,531	1,370,798.52	3.27
3	601166	兴业银行	83,951	937,732.67	2.24
4	600000	浦发银行	83,461	842,121.49	2.01
5	601318	中国平安	22,070	787,899.00	1.88
6	000002	万 科A	70,158	640,542.54	1.53
7	600837	海通证券	50,679	633,994.29	1.51
8	600030	中信证券	45,737	562,107.73	1.34
9	601328	交通银行	124,243	534,244.90	1.27
10	601288	农业银行	190,424	476,060.00	1.13

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本期，本基金持有的中国平安于2013年5月21日公告其集团控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称"平安证券"）于近日收到中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《行政处罚和市场禁入事先告知书》，中国证监会对平安证券给予警告及行政处罚。中国平安为本基金跟踪标的指数的样本股，基金管理人将密切跟踪相关进展，在严格执行内部投资决策流程的基础上进行投资。

除此之外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,954,438.14
3	应收股利	3,660.65
4	应收利息	2,263.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,960,361.98

5.10.4 报告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出于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的股票中，四季度内均未存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	51,788,379.27
报告期期间基金总申购份额	768,786.29
减：报告期期间基金总赎回份额	8,955,950.29
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	43,601,215.27

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,250.00	22.94	10,001,250.00	22.94	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,250.00	-	10,001,250.00	-	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金设立的文件；

2、《华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、《华宸未来沪深300指数增强型发起式证券投资基金（LOF）招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

10.3 查阅方式

投资者可登陆基金管理人互联网站（http://www.hcmirae.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

华宸未来基金管理有限公司
2013年10月24日

纽银策略优选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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：二〇一三年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	379,142,752.43份
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	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： 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。 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。 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。
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	22,494,427.16
2.本期利润	29,035,552.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0729
4.期末基金资产净值	328,176,780.28
5.期末基金份额净值	0.866

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	8.93%	1.58%	7.70%	1.15%	1.23%	0.43%

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9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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2011-1-25	-	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。
傅明笑	本基金基金经理	2013-8-27	-	九年	清华大学化学硕士；曾任海通证券股份有限公司研究所研究员，国联安基金管理有限公司研究员、高级研究员、基金经理。2013年7月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

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 公平交易专项说明

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本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 报告期内基金的投资策略和运作分析

在经历了六月份流动性紧张导致的市场恐慌之后，三季度宏观基本面逐步企稳，各项数据如工业增加值增速、PMI等同比均有所回升，A股市场呈现各行业普涨格局，其中创业板依然涨幅最大。三季度本基金继续配置估值可以接受的业绩高成长和稳定增长类个股，行业配置上更为多元，在持续看好电子、医药、环保、传媒等高成长个股的同时，我们也适度增加了装饰、信息技术等成长类个股，在三季度中后期，我们在宏观数据持续向好的背景下也做了一些风格切换的尝试。

我们一直在反思对泛新兴产业的理解和研究方法，在三季度，我们感受到泛新兴产业的投资难度在增大，商业模式创新带来的长远潜力和短期的利润与估值碰撞在一起时，我们倾向于要在绝对收益和风险之间取得一定平衡。

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。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日，本基金份额净值为0.866元，本报告期份额净值增长率为8.93%，同期业绩比较基准增长率为7.70%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	269,488,791.40	79.01
	其中：股票	269,488,791.40	79.01
2	固定收益投资	620,046.60	0.18
	其中：债券	620,046.60	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	40,000,000.00	11.73
	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	30,752,297.66	9.02
6	其他各项资产	235,436.14	0.07
7	合计	341,096,571.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	174,643,333.87	53.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,583,885.44	1.09
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,230,500.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	20,022,306.40	6.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,449,233.48	1.05
J	金融业	38,002,015.61	11.58
K	房地产业	12,189,251.00	3.71
L	租赁和商务服务业	7,710,859.46	2.35
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,125,250.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,532,156.14	1.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	269,488,791.40	82.12

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	1,207,909	14,845,201.61	4.52
2	002521	齐峰新材	1,493,402	11,947,216.00	3.64
3	002241	歌尔声学	263,880	11,156,846.40	3.40
4	002570	贝因美	259,906	10,812,089.60	3.29
5	600016	民生银行	1,115,200	10,661,312.00	3.25
6	600703	三安光电	462,034	9,374,669.86	2.86
7	601166	兴业银行	813,700	9,089,029.00	2.77
8	600887	伊利股份	203,284	9,082,729.12	2.77
9	600115	东方航空	3,040,000	8,907,200.00	2.71
10	002064	华峰氨纶	823,234	8,454,613.18	2.58

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	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	620,046.60	0.19
8	其他	-	-
9	合计	620,046.60	0.19

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	5,860	620,046.60	0.19

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

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

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	212,499.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,151.46
5	应收申购款	9,785.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	235,436.14

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	620,046.60	0.19

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	411,944,556.44
本报告期基金总申购份额	1,404,508.65
减：本报告期基金总赎回份额	34,206,312.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	379,142,752.43

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准纽银策略优选股票型证券投资基金设立的相关文件；

（2）《纽银策略优选股票型证券投资基金基金合同》；

（3）《纽银策略优选股票型证券投资基金招募说明书》；

（4）《纽银策略优选股票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）报告期内纽银策略优选股票型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 查阅方式

（1）书面查询：查阅时间为每工作日8:30-11:30，13:00-17:30。投资人可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

（2）网站查询：基金管理人网址：http://www.bnyfund.com投资人对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人纽银梅隆西部基金管理有限公司，咨询电话4007-007-818（免长途话费）或发电子邮件，E-mail:service@bnyfund.com。

纽银梅隆西部基金管理有限公司
二〇一三年十月二十四日

汇添富收益快线货币市场基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2013年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富收益快线货币
交易代码	519888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月21日
报告期末基金份额总额	1,450,357,673,741.00份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资将遵循安全性和流动性优先原则，以宏观经济和货币政策分析为基础，在严格控制风险的前提下，合理构建并及时调整投资组合，力争获得稳健的、超越业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	汇添富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	汇添富收益快线货币A　汇添富收益快线货币B
下属两级基金的交易代码	519888　519889
报告期末下属两级基金的份额总额	606,068,497,635.00份　844,289,176,106.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年7月1日 - 2013年9月30日）	
	汇添富收益快线A	汇添富收益快线B
1. 本期已实现收益	74,416,173.39	133,043,578.38
2.本期利润	74,416,173.39	133,043,578.38
3.期末基金资产净值	6,060,684,976.35	8,442,891,761.06

注：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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富收益快线货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9870%	0.0014%	0.0882%	0.0000%	0.8988%	0.0014%

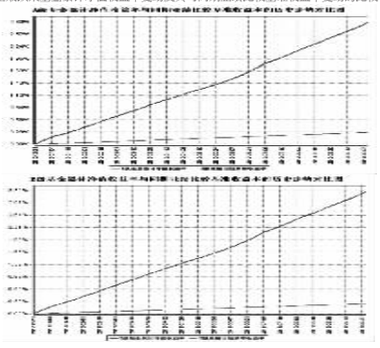
注：本基金收益分配按日结转份额。

汇添富收益快线货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1376%	0.0015%	0.0882%	0.0000%	1.0494%	0.0015%

注：本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金合同生效日为2012年12月21日，截至本报告期末，基金成立未满1 年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2012年12月21日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈加荣	汇添富保本混合基金的基金经理，汇添富收益快线货币基金的基金经理，汇添富信用债债券基金的基金经理，汇添富高息债债券基金的基金经理，汇添富年年利定期开放债券型基金的基金经理。	2012年12月21日	-	12年	国籍：中国。学历：天津大学管理工程硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历