(上接B34版)

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	193,403.10	0.42
B	采矿业	647,699.42	1.39
C	制造业	24,516,365.05	52.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	380,598.36	0.82
E	建筑业	647,501.77	1.39
F	批发和零售业	740,840.48	1.59
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	1,747,950.86	3.76
J	金融业	5,650,759.84	12.14
K	房地产业	4,430,129.58	9.52
L	租赁和商务服务业	410,402.79	0.88
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,340,119.78	2.88
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	997,710.89	2.14
S	综合	391,533.08	0.84
	合计	42,095,015.00	90.45

(2)积极投资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	采掘业	268,731.18	0.58
C	制造业	3,424,881.44	7.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	215,009.64	0.46
E	建筑业	27,229.92	0.06
F	批发和零售业	612,149.32	1.32
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	871,647.18	1.87
J	金融业	147,322.35	0.32
K	房地产业	332,410.50	0.71
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	102,119.68	0.22
S	综合	-	-
	合计	6,001,501.21	12.89

3、截至2014年6月30日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：

(1)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	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	356,477	2,948,064.79	6.33
2	000651	格力电器	85,948	2,531,168.60	5.44
3	000001	平安银行	208,496	2,066,195.36	4.44
4	000063	中兴通讯	121,976	1,600,325.12	3.44
5	000538	云南白药	20,423	1,066,080.60	2.29
6	000562	宏源证券	132,298	993,557.98	2.13
7	000858	五 粮 液	54,418	975,714.74	2.10
8	000776	广发证券	91,742	899,071.60	1.93
9	000895	双汇发展	24,171	865,080.09	1.86
10	000625	长安汽车	65,308	803,941.48	1.73

(2)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	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	79,056	1,527,361.92	3.28
2	600085	同仁堂	27,804	484,623.72	1.04
3	600703	三安光电	19,850	465,085.50	1.00
4	002063	远光软件	22,200	453,990.00	0.98
5	600637	百视通	8,262	264,631.86	0.57
6	000963	华东医药	3,909	211,086.00	0.45
7	600376	首开股份	46,019	198,802.08	0.43
8	600519	贵州茅台	1,210	171,795.80	0.37
9	600660	福耀玻璃	20,200	169,680.00	0.36
10	600588	用友软件	10,876	153,025.32	0.33

4、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、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。

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五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

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、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

本基金报告期末未持有权证。

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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1)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，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

(2)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。

(3)期末其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,176.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	682.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.14
8	其他	-
9	合计	38,105.84

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000562	宏源证券	993,557.98	2.13	重大事项停牌

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	600637	百视通	264,631.86	0.57	重大事项停牌

(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。

十三、基金的业绩

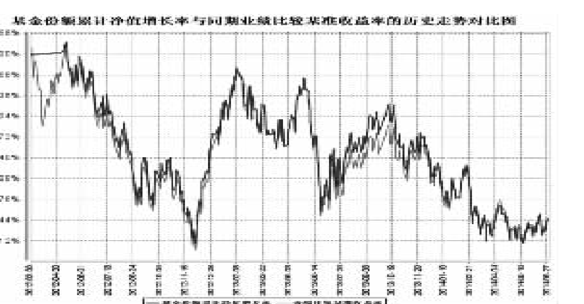
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(1)东吴深证100指数增强型证券投资基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较：

时间	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
2012.03.09-2012.12.31	-10.40%	1.17%	-12.00%	1.30%	1.60%	-0.13%
2013.01.01-2013.12.31	-4.24%	1.34%	-4.64%	1.35%	0.40%	-0.01%
2014.01.01-2014.06.30	-8.28%	1.09%	-7.47%	1.09%	-0.81%	0.00%
2012.03.09-2014.06.30	-21.30%	1.23%	-21.13%	1.28%	-0.17%	-0.05%

注：统计截至2014年6月30日，比较基准=95%*深证100价格指数收益率+5%*商业银行活期存款利率(税后)

(2)东吴深证100指数增强型证券投资基金累计净值增长率历史走势图(2012年3月9日至2014年6月30日)



注：东吴深证100指数增强型证券投资基金从2012年3月9日起正式运作。

十四、基金费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金合同生效后的信息披露费用；

4、基金份额持有人大会费用；

5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

6、基金的证券交易费用；

7、基金财产拨划支付的银行费用；

8、基金上市费及年费；

9、基金的指数使用费；

10、基金的开户费用、账户维护费用；

11、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

12、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为1%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为0.15%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提，且收取下限为每季度(《基金合同》生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限)人民币5万元。计算方法如下：

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于每季度结束后10个工作日内从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

4、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)场外申购费用和赎回费用

1、申购费用

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金申购费率如下：

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	1.2%
100万元以上(含)-200万元以下	0.8%
200万元以上(含)-500万元以下	0.4%
500万元以上(含)	1000元/笔

2、赎回费用

赎回费用由基金份额赎回人承担，赎回费的25%归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

本基金赎回费率如下：

持有时间	赎回费率
1年以内(含1年)	0.5%
1年-2年(含2年)	0.25%
2年以上	0

基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整费率或收费方式，最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(七)场内申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金申购费率如下：

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	1.2%
100万元以上(含)-200万元以下	0.8%
200万元以上(含)-500万元以下	0.4%
500万元以上(含)	1000元/笔

2、投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由基金份额赎回人承担，赎回费的25%归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

场内赎回费率统一为0.5%。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(八)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1、在"重要提示"中，更新了"所载内容截止日期"及"有关财务数据和净值表现截止日期"。

2、在"三、基金管理人"中，对主要人员情况等内容进行了更新。

3、在"四、基金托管人"中，更新了相关内容。

4、在"五、相关服务机构"中，增加了部分代销机构，更新了部分代销机构在报告期内的变化情况。

5、在"十一、基金的投资"中，更新了基金投资组合报告的内容，更新了基金业绩的内容。数据内容截止时间为2014年6月30日。

6、在"二十三、其他应披露事项"中，增加了其他披露事项：

(1)2014年3月12日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在海通证券股份有限公司网上交易系统推出定期定额申购费率优惠的公告》；

(2)2014年3月12日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(3)2014年3月17日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券股份有限公司手机客户端申购场外开放式基金费率优惠活动的公告》；

(4)2014年3月20日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(5)2014年3月29日在公司网站上公告了《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)2013年年度报告》；

(6)2014年3月29日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)2013年年度报告摘要》；

(7)2014年4月1日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》；

(8)2014年4月1日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(9)2014年4月4日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增万联证券有限责任公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》；

(10)2014年4月4日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在万联证券有限责任公司网上交易系统申购费率优惠的公告》；

(11)2014年4月10日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(12)2014年4月21日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)2014年第一季度报告》；

(13)2014年4月22日在公司网站上公告了《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2014年1号)》；

(14)2014年4月22日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要(2014年1号)》；

(15)2014年7月1日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告》；

(16)2014年7月1日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(17)2014年7月18日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)2014年第二季度报告》；

(18)2014年8月28日在公司网站上公告了《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)2014年半年度报告》；

(19)2014年8月28日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)2014年半年度报告摘要》；

十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2014年10月23日签署。

东吴基金管理有限公司

二零一四年十月二十三日

纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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：二〇一四年十月二十三日

§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2014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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	纽银新动向混合
基金主代码	673010
交易代码	673010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月18日
报告期末基金份额总额	20,826,032.07份
投资目标	把握中国经济结构转型的驱动因素，分享转型中传统产业升级与新兴产业加速发展的长线成果，挖掘价格合理有持续增长潜力的公司，在控制风险的前提下力争为基金持有人谋求长期、持续、稳定的超额收益。
投资策略	本基金为灵活配置的混合型基金，投资中运用的策略主要包括： 1.资产配置策略：本基金运用自身研发的股票/债券收益率定量模型，并参考纽约梅隆集团iFlow全球资金流量统计数据，分析全球及中国宏观经济走势和政策走向、资本市场估值来综合确定基金的大类资产配置(主要是股票与债券比例)。 2.行业配置：本基金认为经济转型期间对经济增长的贡献将逐渐由传统工业化向城市化与工业现代化过渡，具体来说可以体现在两个方面：GDP中传统产业升级占比提高，产业结构中新兴产业占比提高。行业配置策略主要目的是把握这一轮中国经济转型的新动向，挖掘传统产业升级与新兴产业加速推进过程中产生的投资机会。 3.股票精选策略：根据本基金的投资策略重点在于受益于传统产业升级与新兴产业加速发展的行业与个股，因此在股票精选方面将采取"自下而上"积极主动的选股策略，动态分析上市公司股价运行规律，投资A股市场内重点行业中具有合理估值、高成长性及风险相对合理的公司，股票精选目的在于挖掘出上市公司内在价值与波动率区间。 4.债券投资策略：本基金投资的债券包括国债、央票、金融债、公司债、企业债(含可转换债券)等债券品种。基金经理根据经投资决策委员会审批的资产配置计划，参考固定收益分析师在对利率变动趋势、债券市场发展方向和各债券品种的流动性、安全性和收益性等因素的研究成果基础上，进行综合分析并制定债券投资方案。 5.权证投资策略：本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。 6.股指期货投资策略：若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，并严格遵守本公司经董事会批准的针对股指期货交易制定的投资决策流程和风险控制等制度。基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其长期的预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益的基金产品。
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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	1,572,417.56
2.本期利润	1,800,272.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0667
4.期末基金资产净值	21,411,972.14
5.期末基金份额净值	1.028

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	7.31%	0.84%	7.66%	0.49%	-0.35%	0.35%

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

纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金

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8月18日至2014年9月30日)

注：本基金建仓期自2011年8月18日至2012年2月17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		
付琦	本基金基金经理	2013-8-19	-	十三年	加拿大渥太华大学工商管理硕士；曾任海通证券股份有限公司业务董事、招商基金管理有限公司机构理财部高级经理、研究部高级研究员。2013年7月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
刘吉林	本基金基金经理	2014-2-14	-	十年	上海财经大学产业经济学硕士。曾任爱建证券有限责任公司研究员，德邦证券有限责任公司分析师、投资经理、董事总经理/投资主办。2013年10月起在我司担任专户投资经理。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》、《纽银新动向灵活配置混合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

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，在无风险收益率下降以及改革的预期下，市场的风险偏好程度加强，A股的各主要指数呈现震荡向上的走势。本基金保持了一定的灵活度，且风险偏向有所上升，在自下而上优选个股的同时，适度参与结构性行情。

展望四季度，我们判断在房地产调控政策回归常态的情况下，有利于巩固经济增长企稳回升的成果。同时，在沪港通、国企改革、四中全会等事件的刺激下，股指可能继续振荡上行，但因前期股指涨幅较大，也累积了一定的调整风险，要时刻保持警惕。

从中长期来看，伴随无风险收益率的下行，企业业绩增速的回升，以及市场风险偏好程度增加的情况下，看好A股市场的表现。相对看好：一是业绩稳定增长且估值相对合理的行业，如生物医药、食品饮料等；二是新兴产业中，如医疗服务、信息安全、精密自动化制造、新能源汽车等；三是继续沪港通、混合所有制改革等重大制度变改所带来的投资机会。

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2014年9月30日，本基金份额净值为1.028元，本报告期份额净值增长率为7.31%，同期业绩比较基准增长率为7.66%。

§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	16,682,866.94	71.15
	其中：股票	16,682,866.94	71.15
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,000,000.00	12.79
	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	2,225,277.04	9.49
7	其他资产	1,540,757.79	6.57
8	合计	23,448,901.77	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	507,360.00	2.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,265,646.94	57.28
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	547,800.00	2.56
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	1,080,560.00	5.05
J	金融业	1,150,200.00	5.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,131,300.00	5.28
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	16,682,866.94	77.91

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	600872	中炬高新	120,000	1,320,000.00	6.16
2	600276	恒瑞医药	35,000	1,297,450.00	6.06
3	002400	省广股份	45,000	1,131,300.00	5.28
4	002475	立讯精密	30,000	982,500.00	4.59
5	002073	软控股份	78,000	959,400.00	4.48
6	600557	康缘药业	35,000	959,350.00	4.48
7	600887	伊利股份	35,000	906,500.00	4.23
8	300217	东方电热	80,000	838,400.00	3.92
9	002065	东华软件	40,000	836,400.00	3.91
10	300124	汇川技术	27,000	812,430.00	3.79

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序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序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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不在本基金投资范围内。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体除省广股份(002400)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东华软件(002065)和康缘药业(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。

2014年3月10日，广东省广告股份有限公司公告："2014年3月7日，本公司接中国证监会通知，因参与本次重组的有关方面涉嫌违法被稽查立案，本公司本次重组申请被暂停审核。本公司目前尚未收到对上市公司的立案调查通知书。"

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，认为省广股份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。

2013年12月5日，东华软件股份公司公告："东华软件股份公司股票期权激励计划第一期股票上市流通，刘志华先生作为激励对象总共授予股票期权数量共计10.4万份，第一期行权数量3.12万份，行权价格16.25元/份，交易金额507,000元。2014年1月8日，刘志华先生通过深圳证券交易所交易系统卖出公司股票7,800股，交易均价34.00元，交易金额265,200，获利138,450元(不含交易手续费及税费)。由于刘志华先生在买入该公司股票后六个月之内将其卖出，其买卖公司股票的行为违反了《证券法》第四十七条、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》第3.8.15条、《深圳证券交易所上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理业务指引》第18条及本公司《公司章程》第二十九条的有关规定，构成短线交易。因此，该公司董事会没收了刘志华先生本次短线交易收益所得，并向刘志华先生进一步说明了有关买卖公司股票的规定，并要求其严格规范买卖持有本公司股票的行为。"

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，认为东华软件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，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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,447.68
2	应收证券清算款	1,415,407.32
3	应收股利	-
4	应收利息	544.92
5	应收申购款	107,357.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,540,757.79

5.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002065	东华软件	836,400.00	3.91	-

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	29,842,616.80
报告期期间基金总申购份额	255,503.92
减：报告期期间基金总赎回份额	9,272,088.65
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	20,826,032.07

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

报告期末，本基金已连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金设立的相关文件；

(2)《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

(3)《纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

(4)《纽银新动向灵活配置混合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)报告期内纽银新动向灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 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

9.3 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

二〇一四年十月二十三日

证券代码：002390 证券简称：信邦制药 公告编号：2014-122

贵州信邦制药股份有限公司关于深圳证券交易所问询函的回复公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

贵州信邦制药股份有限公司(以下简称"公司")于2014年10月17日收到深圳证券交易所《关于对贵州信邦制药股份有限公司应收款项坏账准备计提事项的问询函》(中小板问询函【2014】第104号，以下简称"问询函")。经公司认真复核，现就问询函中所列问题向深圳证券交易所做如下回复：

1.请分析此次会计估计变更对定期报告的影响金额及比例，说明该事项是否需要提交股东大会审议；

说明：我公司于2014年3月完成对贵州科开医药有限公司(以下简称"科开医药")的收购后，完善了医药医疗产业链，新增了医药流通和医疗服务业务，原有应收款项坏账准备计提方法已不能覆盖公司新增业务范围，因此，公司于2014年10月15日召开了第二十八次董事会，对原有会计估计方法进行了补充完善。本次会计估计变更仅针对新增的医药流通和医疗服务业务，不涉及原有制药业务的应收款项。因此，本次会计估计变更对2013年年报财务数据无影响。

本次会计估计方法变更后，公司下属医药流通企业3个月以内的应收账款坏账准备计提比例由5%变更为0.5%。截止2014年9月30日，预计公司下属医药流通企业3个月以内的应收账款为16,579万元，若按变更后的坏账准备计提比例0.5%计提坏账准备，将减少资产减值损失约746万元，增加未分配利润约560万元。

根据《中小企业板信息披露业务备忘录第13号：会计政策及会计估计变更》的规定，本次会计估计变更对最近一个会计年度经审计的净利润的影响比例未超过50%，对最近一期经审计的所有者权益的影响比例未超过50%，且不会导致公司定期报告的盈亏性质发生变化。因此，本次会计估计变更无需提交股东大会审议。

2.请说明此次公告中列示的变更前"单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法"与2014年半年报、2013年年报所列示的相应计提方法是否一致，如果不一致，请说明原因并做出更正；

回复：公司2013年年报中披露单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法为：单独进行减值测试，如有客观证据表明其发生了减值的，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，确认减值损失，计提坏账准备；经单独测试后未减值的单项金额重大的应收款项，按照账龄分析法计提坏账准备。

公司于2014年3月完成对科开医药的收购，科开医药单项金额重大的应收款项中包含科开医药为关联医院及下属医院提供药品耗材、医疗器械等配送而产生的应收帐款、科开医药及下属医药流通企业为得到医院药品配送权而支付的保证金、应收各级医保中心结算款。公司在编制2014年半年报时，对此类应收款项进行了单独的减值测试，未发生减值，由于公司原有会计估计方法中没有与以上应收款项信用风险特征相类似的组合，此类款项的信用风险特征与单位性质相关，与账龄为信用风险特征的组合存在显著不同，公司根据《企业会计准则》、《企业会计准则应用指南》及《企业会计准则讲解》中的相关规定"对于单项金额重大的金融资产应当单独进行减值测试，单独测试未发生减值的金融资产应当包括在具有类似信用风险特征的金融资产组合中再进行减值测试。如果企业没有具有类似信用风险特征的金融资产，不需进行额外的减值测试"，对上述应收款项未再进行额外的减值测试并计提坏帐准备。同时，在2014年半年报中披露单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法为：单独进行减值测试，如有客观证据表明其发生了减值的，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，确认减值损失，计提坏账准备。

公司此次会计估计变更严格按照《企业会计准则》、《企业会计准则应用指南》及《企业会计准则讲解》，统一规范更正为"单独进行减值测试，如有客观证据表明其发生了减值的，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，确认减值损失，计提坏账准备；经单独测试后未减值的单项金额重大的应收款项，应当包括在具有类似信用风险特征的金融资产组合中再进行减值测试。"

3.你公司2014年半年报显示，报告期末单项金额重大并单项计提坏账准备的应收账款余额为3.98亿元，占应收账款总额的47.46%，单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款余额为2,600万元，占其他应收账款总额的22.18%。请说明你公司对这两类应收款项未计提坏账准备的原因，是否符合《企业会计准则》和公司会计政策的规定。

回复：公司于2014年半年报中披露报告期末单项金额重大并单项计提坏账准备的应收账款余额为3.98亿元、单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款余额为2,600万元，公司对以上应收款项进行了单独的减值测试，其中：

(1)应收贵阳医学院附属医院157,721,438.89元。贵阳医学院附属医院是公司下属贵州省肿瘤医院股东，为公司关联方，预计2014年4至12月交易金额为51000万元，根据以往历史回款情况，公司认为以上货款均能按时足额收回。

(2)应收贵阳医学院附属白云医院39,590,152.09元。贵阳医学院附属白云医院为公司下属非营利性医院，因其非营利性质未纳入公司合并报表范围，公司能够确保以上货款按时足额收回。

(3)应收贵阳医学院附属乌当医院29,494,291.46元。贵阳医学院附属乌当医院为公司下属非营利性医院，因其非营利性质未纳入公司合并报表范围，公司能够确保以上货款按时足额收回。

(4)应收贵阳市医疗保险费用结算中心48,679,852.15元。该款项为贵州省肿瘤医院提供医疗服务所产生，预计2014年医疗服务收入5亿元。以上款项已得到医保部门的确认，公司认为该款项能足额收回。

(5)应收贵州盛远医药有限公司88,260,700.81元。公司第五届董事会第二十五次会议审议通过全资收购贵州盛远医药有限公司股权和2014年半年度报告等事项的议案，公司能够确保以上货款按时足额收回。因此未对该款项计提坏账准备。2014年9月公司已将其纳入合并报表范围。

(6)应收贵阳医学院第二附属医院34,668,563.28元。公司与贵阳医学院第二附属医院合作设立黔东南肿瘤医院有限公司和贵医附属精神病医院，相关议案经公司第五届董事会第二十七次会议审议通过，由公司出资设立黔东南肿瘤医院有限公司、贵医附属精神病医院，贵阳医学院第二附属医院将综合大楼、门诊楼等房屋及其相应的土地使用权专用于黔东南肿瘤医院有限公司、贵医附属精神病医院的经营场所，黔东南肿瘤医院有限公司、贵医附属精神病医院按照相关协议支付贵阳医学院第二附属医院场地使用费及管理费。鉴于以上长期合作关系，公司认为该款项能够足额收回。

(7)应收黔西县中心医院1600万元、修文县人民医院1000万元。该应收款项为药品配送保证金，合同约定配送期限结束时足额归还，公司认为该款项能够足额收回。

以上应收款项通过减值测试未发生减值，由于公司原有应收款项坏账准备计提方法不能覆盖以上业务发生的应收款项，因此，公司按照《企业会计准则》、《企业会计准则应用指南》及《企业会计准则讲解》中"对于单项金额重大的金融资产应当单独进行减值测试，单独测试未发生减值的金融资产应当包括在具有类似信用风险特征的金融资产组合中再进行减值测试。如果企业没有具有类似信用风险特征的金融资产，不需进行额外的减值测试"的相关规定对以上事项进行了会计处理，未再进行额外的减值测试，未计提坏账准备。

特此公告。

贵州信邦制药股份有限公司

董事会

二〇一四年十月二十二日

证券代码：002031 证券简称：巨轮股份 公告编号：2014-054

巨轮股份有限公司关于日常经营重大合同履行情况的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

巨轮股份有限公司(以下简称"本公司")于2013年3月6日与杭州中策清泉实业有限公司(以下简称"中策清泉")签订了《设备采购合同》，中策清泉向本公司订购液压硫化机一批，总价款22,984万元(含税)。(具体情况详见2013年3月9日刊登在《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网的《关于签订重大合同的公告(2013-005)》)。基于双方长期的友好合作关系，为促进共同发展，深化业务合作，经友好协商，双方于2014年5月30日签订了补充协议，一致同意将未交货设备49台总价格8,663.20万元下调424万元，下调后合同总价款为22,560万元。根据《中小企业板信息披露业务备忘录第15号：日常经营重大合同》的相关规定，现就合同的履行情况公告如下：

根据中策清泉的项目建设进度，经双方协商同意，上述合同已交付105台设备，交付金额18,356.33万元，已累计收款14,685.06万元。

因客户情况发生变化，中策清泉就既有合同未履行部分要求主体变更，其余条款均保持不变，即原双方既有合同未履行部分予以终止，合同终止部份由第三方进行承接。三方于2014年7月25日签订了补充协议，一致同意将未交货设备25台总价格4,203.67万元交由中策橡胶(富阳)有限公司(以下简称"中策橡胶")承接并承担相应的债权债务，公司三方都已办妥相关手续。根据补充协议，已交付承接方中策橡胶23台设备，交付金额3,867.38万元，已累计收款3,360万元，其余2台设备根据对方项目建设进度尚未交付，金额336.29万元。

特此公告。

巨轮股份有限公司

董事会

二〇一四年十月二十三日

证券代码：600391 证券简称：成发科技 公告编号：临2014-036

四川成发航空科技股份有限公司关于委托贷款到期收回的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

公司于2013年8月16日召开的第四届董事会第十五次(临时)会议审议并通过了《关于审议"向子公司进行委托贷款"的议案》，同意公司向公司的全资子公司四川成发普睿玛机械工业制造有限责任公司提供2,500万元的委托贷款，用于其流动资金投入，贷款期限为1年，贷款利率为一年期人民币基准利率，实际贷款使用根据其资金需求分期进行。详见公司于2013年8月17日在上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)及中国证券报、上海证券报、证券时报上披露的《第四届董事会第十五次(临时)会议决议公告》(临2013-021)及《委托贷款公告》(临2013-023)。

根据《委托贷款借款合同》约定，该项委托贷款有效期为2013年10月21日~2014年10月20日。2014年10月20日，公司已全额收回该笔委托贷款本金2,500万元，相应的利息同时结清。

特此公告。

四川成发航空科技股份有限公司

董事会

二〇一四年十月二十三日

证券代码：600466 证券简称：迪康药业 公告编号：临2014-036号

四川迪康科技药业股份有限公司诉讼进展公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。

公司曾于2014年9月2日公告了公司原控股股东四川迪康产业控股集团股份有限公司(以下简称"迪康集团")对成都迪康中科生物医学材料有限公司(以下简称"迪康中科")以及第三人四川蓝光实业集团有限公司、重庆迪康长江制药有限公司和本公司提起了民事诉讼，请求成都高新技术产业开发区人民法院确认本公司持有的迪康中科99%的股权归属迪康集团所有(该事项详见公司临时公告2014-031号)。

本案原定于2014年10月14日开庭审理，公司于2014年10月13日接到法院口头通知，获悉迪康集团已于2014年10月8日向法院递交了《撤诉申请书》。2014年10月21日，公司收到成都高新技术产业开发区人民法院于2014年10月17日下达的(2014)高新民初字第3968号《民事裁定书》，裁定：

准许原告四川迪康产业控股集团股份有限公司撤回对被告成都迪康中科生物医学材料有限公司、第三人四川蓝光实业集团有限公司、四川迪康科技药业股份有限公司、重庆迪康长江制药有限公司的起诉。

特此公告。

四川迪康科技药业股份有限公司

董事会

2014年10月23日