

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基 金

2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十九日

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 2012 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	36
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.....	36

7.9 投资组合报告附注.....	36
8 基金份额持有人信息.....	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
9 开放式基金份额变动.....	37
10 重大事件揭示.....	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	41
12 备查文件目录.....	41
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点.....	42
12.3 查阅方式.....	42

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	浦银安盛精致生活混合
基金主代码	519113
交易代码	519113
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月4日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
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	109,589,186.35份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>在中国经济健康快速的可持续发展过程中，寻找由于经济结构优化、产业结构升级而涌现的那些最能够代表居民生活水平表征的以及满足居民生活需求升级的提供生活产品和服务的上市公司，分享其快速及长期稳定增长，并关注其他金融工具的投资机会，通过灵活配置资产，在严格控制风险的基础上，谋求基金资产的长期稳定增值。</p>
投资策略	<p>本基金坚持“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略，通过灵活资产配置、行业发展趋势判断、个股精选选择代表居民生活水平表征的以及满足居民生活需求升级要求的快速及长期稳定增长的上市公司。</p> <p>具体来说，在资产配置策略方面，本基金将根据宏观经济、市场政策、估值水平和市场情绪等因素对未来资本市场的发展做出趋势性判断，进而确定大类资产的配置比例。而在行业配置策略方面，本基金是重点关注居民生活的主题基金，因此将从行业覆盖范围和行业精选策略两个方面进行实施。在个股选择策略方面，本基金将采取精选个股的策略，并辅之以公司特有的数量化公司财务研究模型FFM对拟投资的上市公司加以甄别。</p>

	在债券投资策略方面，在资本市场国际化的背景下，通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合。在权证投资策略方面，本基金将按照法律法规相关规定进行权证投资。
业绩比较基准	中信标普A股综合指数×55%+中信标普全债指数×45%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，坚持长期和力争为基金持有人带来稳健回报的投资理念，属于证券投资基金中的中等收益、中等风险品种。一般情形下，其风险和收益低于股票型基金，高于货币型基金、债券型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的安全和增值。

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		浦银安盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	尹东
	联系电话	021-23212812	010-67595003
	电子邮箱	guj@py-axa.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	010-67595096
传真		021-23212985	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区浦东大道 981号3幢316室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市淮海中路381号中环 广场38楼	北京市西城区闹市口大街1 号院1号楼
邮政编码		200020	100033
法定代表人		姜明生	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,507,994.78
本期利润	6,934,761.49
加权平均基金份额本期利润	0.0623
本期加权平均净值利润率	7.46%
本期基金份额净值增长率	7.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-14,322,859.72
期末可供分配基金份额利润	-0.1307
期末基金资产净值	95,266,326.63
期末基金份额净值	0.869
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-8.35%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人申购、赎回基金等各项交易费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、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。

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

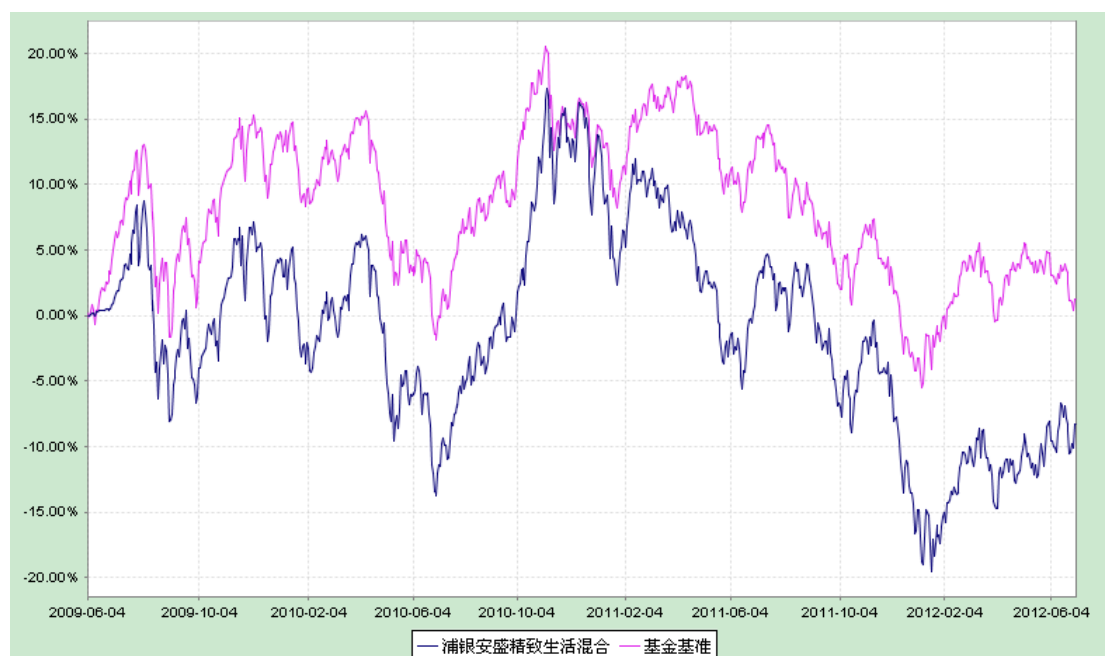
过去一个月	-0.11%	1.03%	-3.37%	0.61%	3.26%	0.42%
过去三个月	7.42%	0.98%	1.57%	0.61%	5.85%	0.37%
过去六个月	7.68%	1.13%	4.68%	0.76%	3.00%	0.37%
过去一年	-8.62%	1.11%	-9.42%	0.78%	0.80%	0.33%
过去三年	-8.81%	1.16%	-1.88%	0.87%	-6.93%	0.29%
自基金合同生效起至今	-8.35%	1.14%	1.23%	0.86%	-9.58%	0.28%

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

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金

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

(2009 年 6 月 4 日至 2012 年 6 月 30 日)



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

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，由上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海盛融投资有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 2 亿元，股东持股比例分别为 51%、39%和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和证监会许可的其他业务。

截至 2012 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 8 只基金，即浦银安盛价值成长股票型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选股票型证券投资基金、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛分级增利债券型证券投资基金和浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金。

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		
吴勇	本基金基金经理兼浦银安盛红利精选股票基金经理	2011-05-05	-	5	吴勇，上海交通大学工商管理硕士，上海交通大学材料工程系学士，CPA，CFA，中国注册造价师。1993 年 8 月至 2002 年 12 月在上海电力建设有限责任公司任预算主管，2003 年 1 月至 2007 年 8 月在国家开发银行上海市分行任评审经理，2007 年 9 月起加盟浦银安盛基金管理有限公司任职研究员，2009 年 8 月起担任浦银安盛精致生活混合型证券投资基金基金经理助理。2010 年 2 月至 4 月，担任浦银安盛红利精选股票基金经理助理。2010 年 4 月起，担任浦银安盛红利精选股票基金经理。2011 年 5 月起，兼任本基金基金经理之职。

注：1、此处的“任职日期”指公司决定确定的聘任日期。

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守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，以及公司的规章制度，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有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

本基金管理人已制定了《公平交易管理规定》，建立健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制；在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日，3日，5日）发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的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的 5% 的情形。

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

2012 年上半年，受国内外需求疲软的影响，国内经济增速下滑明显。尽管央行采取降息、下调准备金等措施释放流动性，中长期贷款占银行新增信贷的比重还是比较低，显示企

业投资欲望较弱。在全球经济增速放缓，国内经济结构转型的背景下，预计中国经济增速放缓的趋势在短期内难以扭转，相对看好有确定型增长的食品饮料、品牌服饰、医药等消费品板块，以及受益于调控政策不再加码、销量有所回升的房地产、装饰园林等板块。

生活基金在上半年保持了高于基准的仓位，在行业方面保持了对食品饮料、纺织服装、房地产、装饰园林、农业等板块的超配，而在银行、钢铁、化工等板块保持了低配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

由于超配的食品饮料、纺织服装、房地产、装饰园林等板块在报告期内表现较好，本季度净值表现高于比较基准，报告期内基金净值增长率为 7.68%，基准收益率为 4.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在经济增速疲软的背景下，预计国家将保持较为宽松的货币政策，并采用结构性减税等财政政策对经济进行微调，以确保经济平稳增长。从市场角度来看，经历了二季度的大幅下跌后，低估值的蓝筹股具有一定的投资机会；而前期上涨的成长股将会分化，行业趋势向好、盈利增速较高、估值合理的公司依然具有较好的投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、监察稽核部负责人、基金会计部负责人组成。估值委员会成员五分之三以上具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大

利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》第十六部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金自 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日期间未进行收益分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

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：浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,298,009.38	22,308,942.19
结算备付金		577,496.22	438,302.59
存出保证金		500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	74,918,010.15	68,115,121.38
其中：股票投资		74,918,010.15	68,115,121.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	10,000,125.00	-
应收证券清算款		759,857.82	810,670.77
应收利息	6.4.7.5	5,528.76	4,494.26
应收股利		-	-
应收申购款		11,829.96	21,872.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		97,070,857.29	92,199,403.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,005,639.32	434,960.24
应付赎回款		1,338.17	11,499.69
应付管理人报酬		116,784.53	121,517.86
应付托管费		19,464.07	20,252.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	242,230.54	171,866.59

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	419,074.03	630,000.64
负债合计		1,804,530.66	1,390,098.00
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	109,589,186.35	112,522,254.57
未分配利润	6.4.7.10	-14,322,859.72	-21,712,948.87
所有者权益合计		95,266,326.63	90,809,305.70
负债和所有者权益总计		97,070,857.29	92,199,403.70

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.869 元，基金份额总额 109,589,186.35 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		8,710,875.92	-12,844,712.98
1.利息收入		99,013.42	149,440.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	87,733.30	131,783.79
债券利息收入		-	13,863.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,280.12	3,793.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,851,325.07	1,438,941.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,254,457.77	535,600.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	478,690.35
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	403,132.70	424,650.81
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	10,442,756.27	-14,447,522.05
4.汇兑收益（损失以“-”号		-	-

填列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	20,431.30	14,426.27
减: 二、费用		1,776,114.43	1,627,376.79
1. 管理人报酬		692,123.75	954,047.54
2. 托管费		115,353.95	159,007.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	788,728.51	312,573.00
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	179,908.22	201,748.33
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		6,934,761.49	-14,472,089.77
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		6,934,761.49	-14,472,089.77

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 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)	112,522,254.57	-21,712,948.87	90,809,305.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,934,761.49	6,934,761.49
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)	-2,933,068.22	455,327.66	-2,477,740.56
其中: 1. 基金申购款	518,993.42	-82,875.08	436,118.34
2. 基金赎回款	-3,452,061.64	538,202.74	-2,913,858.90
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)	109,589,186.35	-14,322,859.72	95,266,326.63

项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	138,280,061.77	9,069,773.02	147,349,834.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,472,089.77	-14,472,089.77
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）	-18,924,855.68	-442,837.40	-19,367,693.08
其中：1. 基金申购款	2,546,938.34	-27,593.10	2,519,345.24
2. 基金赎回款	-21,471,794.02	-415,244.30	-21,887,038.32
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）	119,355,206.09	-5,845,154.15	113,510,051.94

报告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：

基金管理公司负责人：郁蓓华，主管会计工作负责人：郁蓓华，会计机构负责人：赵迎华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金(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[2009] 73 号《关于核准浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 836,466,510.59 元，已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(2009)第 109 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2009 年 6 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 836,989,022.73 份基金份额，其中认购资金利息折合 522,512.14 份基

金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛精致生活灵活配置混合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比例为 30%-80%；债券、货币市场工具、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 20%-70%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中信标普 A 股综合指数 X55%+中信标普全债指数 X45%。

本财务报表由本基金的基金管理人于 2012 年 8 月 29 日批准报出。

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 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》、《浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日期间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 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(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派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。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，暂不征收企业所得税。

(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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	10,298,009.38
定期存款	-
其他存款	-
合计	10,298,009.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		70,680,007.11	74,918,010.15	4,238,003.04
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		70,680,007.11	74,918,010.15	4,238,003.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间	10,000,125.00	-
合计	10,000,125.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	3,405.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	233.91
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	1,889.26
应收申购款利息	0.58
其他	-
合计	5,528.76

6.4.7.6 其他资产

本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	241,980.54
银行间市场应付交易费用	250.00
合计	242,230.54

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	3.31
预提费用	169,070.72

合计	419,074.03
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	112,522,254.57	112,522,254.57
本期申购	518,993.42	518,993.42
本期赎回（以“-”号填列）	-3,452,061.64	-3,452,061.64
本期末	109,589,186.35	109,589,186.35

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,116,490.41	-22,829,439.28	-21,712,948.87
本期利润	-3,507,994.78	10,442,756.27	6,934,761.49
本期基金份额交易产生的变动数	83,096.28	372,231.38	455,327.66
其中：基金申购款	-14,772.09	-68,102.99	-82,875.08
基金赎回款	97,868.37	440,334.37	538,202.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,308,408.09	-12,014,451.63	-14,322,859.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	活期存款利息收入	84,415.09
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	3,317.63	
其他	0.58	
合计	87,733.30	

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	卖出股票成交总额	261,200,683.94
减：卖出股票成本总额	263,455,141.71	
买卖股票差价收入	-2,254,457.77	

6.4.7.13 债券投资收益

本基金在本报告期末进行债券投资交易。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金在本报告期末进行权证投资交易。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	403,132.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	403,132.70

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	10,442,756.27
——股票投资	10,442,756.27
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	10,442,756.27

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	415.75
转换费收入	15.55
其他	20,000.00
合计	20,431.30

注 1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

3. 本基金的其他收入为预提的 2011 年度信息披露费用与实际支付费用的差额部分。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	788,728.51
银行间市场交易费用	-
合计	788,728.51

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	139,235.46
银行汇划费用	1,437.50
债券帐户维护费	9,400.00
合计	179,908.22

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

本基金在本报告期无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金在本报告期无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期与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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	692,123.75	954,047.54
其中：支付销售机构的客户 维护费	160,878.79	219,315.86

注：支付基金管理人浦银安盛基金管理有限公司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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	115,353.95	159,007.92

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值

0.25%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：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	10,298,009.38	84,415.09	26,752,239.36	130,520.95

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期与上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期与上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金在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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金在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。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只偏股型的混合型证券投资基金，属于中等风险品种，一般情形下，其风险和收益低于股票型基金，高于货币型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括股

票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，谋求实现基金财产的安全和增值。

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部、监察部、法务部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长和内部审计部。

本基金管理人下设的各业务部门是公司第一线风险控制的实施者，均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准

本基金管理人设立的风险控制委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权利机构，制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立风险管理部和监察部，独立地监控公司面临的各类风险。风险管理部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估。监察部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性进行审议和评估。同时，督察长及合规及审计委员会负责检查、评价公司风险控制的充分性和有效性，并向董事会报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险可能产生的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本

基金的托管行中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,298,009.38	-	-	-	10,298,009.38
结算备付金	577,496.22	-	-	-	577,496.22
存出保证金	-	-	-	500,000.00	500,000.00
证券清算款	-	-	-	759,857.82	759,857.82
买入返售金融资产	10,000,125.00	-	-	-	10,000,125.00
交易性金融资产	-	-	-	74,918,010.15	74,918,010.15
应收利息	-	-	-	5,528.76	5,528.76
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	11,829.96	11,829.96
资产总计	20,875,630.60	0.00	0.00	76,195,226.69	97,070,857.29
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,005,639.32	1,005,639.32
应付赎回款	-	-	-	1,338.17	1,338.17
应付管理人报酬	-	-	-	116,784.53	116,784.53
应付托管费	-	-	-	19,464.07	19,464.07
应付销售费用	-	-	-	0.00	0.00

应付交易费用	-	-	-	242,230.54	242,230.54
其他负债	-	-	-	419,074.03	419,074.03
负债总计	-	-	-	1,804,530.66	1,804,530.66
利率敏感度缺口	20,875,630.60	0.00	0.00	74,390,696.03	95,266,326.63
上年度末2011年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,308,942.19	-	-	-	22,308,942.19
结算备付金	438,302.59	-	-	-	438,302.59
存出保证金	-	-	-	500,000.00	500,000.00
证券清算款	-	-	-	810,670.77	810,670.77
交易性金融资产	-	-	-	68,115,121.38	68,115,121.38
应收利息	-	-	-	4,494.26	4,494.26
应收申购款	-	-	-	21,872.51	21,872.51
资产总计	22,747,244.78	-	-	69,452,158.92	92,199,403.70
负债					
应付证券清算款	-	-	-	434,960.24	434,960.24
应付赎回款	-	-	-	11,499.69	11,499.69
应付管理人报酬	-	-	-	121,517.86	121,517.86
应付托管费	-	-	-	20,252.98	20,252.98
应付交易费用	-	-	-	171,866.59	171,866.59
其他负债	-	-	-	630,000.64	630,000.64
负债总计	-	-	-	1,390,098.00	1,390,098.00
利率敏感度缺口	22,747,244.78	-	-	68,062,060.92	90,809,305.70

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2011 年 12 月 31 日，为 0%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 30-80%，债券、现金及其它短期金融工具为 20-70%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	74,918,010.15	78.64	68,115,121.38	75.01
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	74,918,010.15	78.64	68,115,121.38	75.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中信标普A股综合指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末	上年度末

		2012 年 6 月 30 日	2011 年 12 月 31 日
	中信标普A股综合指数上升5%	增加2,828,154.88	增加3,212,333.49
	中信标普A股综合指数下降5%	减少2,828,154.88	减少3,212,333.49

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	74,918,010.15	77.18
	其中：股票	74,918,010.15	77.18
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	10,000,125.00	10.30
	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	10,875,505.60	11.20
6	其他各项资产	1,277,216.54	1.32
7	合计	97,070,857.29	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	采掘业	1,715,347.32	1.80
C	制造业	42,182,999.13	44.28
C0	食品、饮料	22,555,788.39	23.68
C1	纺织、服装、皮毛	1,799,580.20	1.89
C2	木材、家具	-	-

C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,557,590.55	3.73
C5	电子	5,408,500.00	5.68
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	5,562,420.00	5.84
C8	医药、生物制品	3,299,119.99	3.46
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,017,189.82	9.47
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	5,913,296.07	6.21
H	批发和零售贸易	3,406,873.20	3.58
I	金融、保险业	2,335,484.98	2.45
J	房地产业	7,518,306.73	7.89
K	社会服务业	2,540,201.58	2.67
L	传播与文化产业	288,311.32	0.30
M	综合类	-	-
	合计	74,918,010.15	78.64

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	289,917	5,966,491.86	6.26
2	600199	金种子酒	205,906	5,143,531.88	5.40
3	600519	贵州茅台	19,471	4,656,489.65	4.89
4	600376	首开股份	339,851	4,499,627.24	4.72
5	002375	亚厦股份	151,048	3,729,375.12	3.91
6	600702	沱牌舍得	92,700	3,360,375.00	3.53
7	002474	榕基软件	147,153	3,088,741.47	3.24
8	603001	奥康国际	100,000	2,691,000.00	2.82
9	600067	冠城大通	370,000	2,060,900.00	2.16
10	000961	中南建设	149,906	1,867,828.76	1.96
11	002325	洪涛股份	118,212	1,751,901.84	1.84
12	002157	正邦科技	160,000	1,686,400.00	1.77
13	600366	宁波韵升	80,000	1,660,800.00	1.74
14	002612	朗姿股份	40,000	1,456,000.00	1.53
15	002146	荣盛发展	131,000	1,427,900.00	1.50
16	002344	海宁皮城	54,610	1,424,228.80	1.49

17	600420	现代制药	100,800	1,368,864.00	1.44
18	002310	东方园林	20,710	1,215,884.10	1.28
19	000970	中科三环	30,000	1,190,400.00	1.25
20	600594	益佰制药	60,000	1,188,000.00	1.25
21	002400	省广股份	61,620	1,180,023.00	1.24
22	002673	西部证券	70,000	1,176,000.00	1.23
23	002429	兆驰股份	100,000	1,130,000.00	1.19
24	601633	长城汽车	60,000	1,068,000.00	1.12
25	000799	酒鬼酒	20,000	1,048,000.00	1.10
26	000651	格力电器	50,000	1,042,500.00	1.09
27	002503	搜于特	43,730	997,044.00	1.05
28	002589	瑞康医药	29,912	985,600.40	1.03
29	002410	广联达	39,990	981,354.60	1.03
30	600383	金地集团	150,000	972,000.00	1.02
31	002635	安洁科技	20,000	931,200.00	0.98
32	002313	日海通讯	40,000	912,000.00	0.96
33	002398	建研集团	40,000	911,200.00	0.96
34	000562	宏源证券	49,987	826,784.98	0.87
35	601918	国投新集	60,000	732,600.00	0.77
36	002241	歌尔声学	20,000	729,800.00	0.77
37	000049	德赛电池	20,000	706,000.00	0.74
38	000823	超声电子	50,000	697,500.00	0.73
39	600197	伊力特	50,000	694,500.00	0.73
40	002250	联化科技	40,000	690,000.00	0.72
41	600395	盘江股份	25,000	672,000.00	0.71
42	600266	北京城建	39,971	607,159.49	0.64
43	002663	普邦园林	10,000	452,200.00	0.47
44	600138	中青旅	24,971	448,978.58	0.47
45	002638	勤上光电	22,800	360,240.00	0.38
46	002029	七匹狼	12,359	343,580.20	0.36
47	601601	中国太保	15,000	332,700.00	0.35
48	002358	森源电气	25,000	314,750.00	0.33
49	600157	永泰能源	30,000	272,400.00	0.29
50	002099	海翔药业	20,000	212,800.00	0.22
51	600976	武汉健民	10,000	196,500.00	0.21
52	600422	昆明制药	10,000	186,300.00	0.20
53	000422	湖北宜化	14,327	175,505.75	0.18
54	300058	蓝色光标	10,000	166,900.00	0.18
55	300267	尔康制药	6,921	146,655.99	0.15
56	300104	乐视网	3,800	90,060.00	0.09
57	300291	华录百纳	546	31,351.32	0.03

58	002155	辰州矿业	1,362	26,368.32	0.03
59	002340	格林美	900	11,979.00	0.01
60	600113	浙江东日	1,000	11,620.00	0.01
61	000157	中联重科	1,000	10,030.00	0.01
62	002037	久联发展	48	1,084.80	0.00

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	600519	贵州茅台	6,156,495.90	6.78
2	600376	首开股份	6,122,027.71	6.74
3	600887	伊利股份	5,352,435.97	5.89
4	600067	冠城大通	4,733,997.06	5.21
5	002375	亚厦股份	4,640,048.36	5.11
6	002503	搜于特	4,575,378.57	5.04
7	002325	洪涛股份	4,285,515.79	4.72
8	002474	榕基软件	4,262,872.49	4.69
9	000961	中南建设	4,192,450.90	4.62
10	002310	东方园林	3,983,152.01	4.39
11	601166	兴业银行	3,862,946.00	4.25
12	600199	金种子酒	3,719,744.53	4.10
13	002344	海宁皮城	3,669,798.88	4.04
14	300267	尔康制药	3,531,159.20	3.89
15	002205	国统股份	3,395,464.00	3.74
16	000616	亿城股份	3,257,517.00	3.59
17	002157	正邦科技	3,253,054.98	3.58
18	600702	沱牌舍得	3,243,177.70	3.57
19	000550	江铃汽车	3,159,861.09	3.48
20	000858	五粮液	3,097,234.32	3.41
21	002146	荣盛发展	3,002,866.61	3.31
22	002400	省广股份	2,813,562.04	3.10
23	000650	仁和药业	2,685,123.07	2.96
24	002195	海隆软件	2,580,720.24	2.84
25	600816	安信信托	2,574,499.20	2.84
26	600805	悦达投资	2,569,904.18	2.83
27	603001	奥康国际	2,553,435.05	2.81
28	600197	伊力特	2,440,259.50	2.69

29	600366	宁波韵升	2,346,367.00	2.58
30	002658	雪迪龙	2,340,366.00	2.58
31	600397	安源股份	2,335,868.40	2.57
32	600594	益佰制药	2,316,873.00	2.55
33	600742	一汽富维	2,281,856.64	2.51
34	002673	西部证券	2,256,504.00	2.48
35	002369	卓翼科技	2,235,217.02	2.46
36	300020	银江股份	2,172,704.13	2.39
37	601288	农业银行	2,152,000.00	2.37
38	002457	青龙管业	2,122,666.08	2.34
39	300291	华录百纳	2,096,938.25	2.31
40	002099	海翔药业	2,084,906.01	2.30
41	600266	北京城建	2,032,881.80	2.24
42	000551	创元科技	2,009,736.85	2.21
43	002345	潮宏基	2,008,690.00	2.21
44	002429	兆驰股份	1,998,157.10	2.20
45	000651	格力电器	1,992,806.00	2.19
46	600066	宇通客车	1,893,637.00	2.09
47	002155	辰州矿业	1,892,768.86	2.08
48	000823	超声电子	1,870,323.93	2.06
49	002313	日海通讯	1,843,449.00	2.03
50	002570	贝因美	1,839,005.50	2.03
51	000540	中天城投	1,830,841.00	2.02
52	600060	海信电器	1,816,815.98	2.00

注：“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	600199	金种子酒	5,212,946.72	5.74
2	600016	民生银行	4,491,950.30	4.95
3	002503	搜于特	4,202,206.76	4.63
4	002325	洪涛股份	4,185,706.59	4.61
5	000895	双汇发展	4,061,070.95	4.47
6	600519	贵州茅台	3,859,962.85	4.25
7	601166	兴业银行	3,792,855.89	4.18
8	300267	尔康制药	3,682,419.37	4.06
9	000540	中天城投	3,503,779.00	3.86
10	000650	仁和药业	3,486,503.32	3.84
11	600015	华夏银行	3,454,553.24	3.80

12	000550	江铃汽车	3,402,237.12	3.75
13	600742	一汽富维	3,345,190.69	3.68
14	002310	东方园林	3,330,835.49	3.67
15	000616	亿城股份	3,262,856.51	3.59
16	002205	国统股份	3,125,848.18	3.44
17	002400	省广股份	3,122,351.63	3.44
18	000596	古井贡酒	3,031,717.07	3.34
19	000858	五 粮 液	3,028,933.32	3.34
20	600266	北京城建	2,936,695.45	3.23
21	002157	正邦科技	2,931,725.92	3.23
22	002140	东华科技	2,872,284.52	3.16
23	600805	悦达投资	2,866,524.40	3.16
24	601601	中国太保	2,839,339.45	3.13
25	601009	南京银行	2,701,118.28	2.97
26	600067	冠城大通	2,641,784.35	2.91
27	601808	中海油服	2,582,687.54	2.84
28	600816	安信信托	2,547,144.91	2.80
29	300020	银江股份	2,542,901.33	2.80
30	002195	海隆软件	2,454,672.75	2.70
31	000961	中南建设	2,422,765.32	2.67
32	000789	江西水泥	2,403,802.66	2.65
33	002344	海宁皮城	2,374,565.24	2.61
34	300058	蓝色光标	2,369,576.47	2.61
35	300171	东富龙	2,350,584.76	2.59
36	600397	安源股份	2,190,046.12	2.41
37	300156	天立环保	2,165,301.50	2.38
38	600376	首开股份	2,144,230.96	2.36
39	601288	农业银行	2,131,500.00	2.35
40	300291	华录百纳	2,114,025.91	2.33
41	002457	青龙管业	2,099,909.23	2.31
42	002369	卓翼科技	2,099,098.06	2.31
43	600240	华业地产	2,045,126.57	2.25
44	600887	伊利股份	2,029,662.34	2.24
45	600633	浙报传媒	1,993,508.79	2.20
46	000551	创元科技	1,988,904.67	2.19
47	002658	雪迪龙	1,942,129.51	2.14
48	002094	青岛金王	1,934,101.99	2.13
49	002345	潮宏基	1,897,186.40	2.09
50	600066	宇通客车	1,881,518.43	2.07
51	002099	海翔药业	1,858,633.74	2.05
52	002179	中航光电	1,829,040.96	2.01

53	002155	辰州矿业	1,828,110.41	2.01
----	--------	------	--------------	------

注：“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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	259,815,274.21
卖出股票的收入（成交）总额	261,200,683.94

注：“买入股票的成本”和“卖出股票的收入”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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

7.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

7.9.3 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	500,000.00
2	应收证券清算款	759,857.82

3	应收股利	-
4	应收利息	5,528.76
5	应收申购款	11,829.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,277,216.54

7.9.4 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。

7.9.5 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未存在流通受限的情况。

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
3,604	30,407.65	197,663.46	0.18%	109,391,522.89	99.82%

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	182,092.07	0.17%

注：1、本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0；

2、本基金的基金经理持有该只基金份额总量为0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年6月4日)基金份额总额	836,989,022.73
本报告期期初基金份额总额	112,522,254.57

本报告期基金总申购份额	518,993.42
减：本报告期基金总赎回份额	3,452,061.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	109,589,186.35

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

1、本基金管理人于 2012 年 3 月 16 日召开股东会，审议部分董事及监事更换事项。选举廖正旭先生、林道峰先生为公司内部董事，选举 James Young 先生为公司监事。陈士俊先生为公司新一任职工监事。公司原董事 James Young 先生、刘以研先生，原监事廖正旭先生、戴刚先生（职工监事），均因职务发生变动，不再担任原职；

2、本基金管理人于 2012 年 4 月 28 日发布公告，副总经理兼首席运营官陈箴先生及副总经理兼首席投资官周文桐先生自 2012 年 4 月 27 日起离任；于 2012 年 5 月 8 日发布公告，李宏宇先生自 2012 年 5 月 2 日起，担任公司副总经理兼首席市场营销官。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内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

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所仍为普华永道中天会计师事务所，未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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	
国金证券	1	299,146,381.67	57.42%	244,665.94	56.59%	-
申银万国	1	138,150,823.73	26.52%	118,252.32	27.35%	-
国泰君安	1	44,990,993.33	8.64%	36,555.66	8.46%	-
东方证券	1	38,651,729.42	7.42%	32,853.98	7.60%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

- 财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；
- 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需
要；
- 具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；
- 佣金费率合理；
- 本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

- 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增东方证券交易单元。

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
国金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛精致生活灵活配置股票型证券投资基金招募说明书更新正文（2011年第2号）	公司网站	2012-1-16
2	浦银安盛精致生活灵活配置股票型证券投资基金招募说明书更新摘要（2011年第2号）	三大证券报及公司网站	2012-1-16
3	浦银安盛基金管理有限公司关于新增中信万通证券为旗下部分基金代销机构的公告	三大证券报及公司网站	2012-1-17
4	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2011年第4季度报告	三大证券报及公司网站	2012-1-18
5	浦银安盛基金管理有限公司参加浦发银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2012-2-3
6	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在齐鲁证券开展基金定投业务并参加网上交易申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2012-2-10
7	浦银安盛基金管理有限公司关于新增中信证券（浙江）为旗下部分基金代销机构的公告	三大证券报及公司网站	2012-2-14
8	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基2011年年度报告正文	公司网站	2012-3-26
9	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基2011年年度报告摘要	三大证券报及公司网站	2012-3-26
10	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2012-4-6
11	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2012-4-7
12	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2012年第1季度报告	三大证券报及公司网站	2012-4-24
13	浦银安盛基金管理有限公司关于高级管理	三大证券报及公司网站	2012-4-28

	人员变更的公告		
14	浦银安盛基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	三大证券报及公司网站	2012-5-8
15	关于新增宁波银行为旗下部分基金代销机构的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-15
16	关于旗下部分基金在天相投顾推出定期定额投资业务的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-20
17	关于旗下部分基金在浦发银行开通基金转换业务的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-26
18	关于旗下部分基金在交通银行开通基金转换业务的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-26
19	关于旗下基金参加中信银行电子银行基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-28
20	关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2012-6-28

11 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年7月28日，本基金管理人发布关于总经理变更的公告，自2012年7月23日起，由郁蓓华女士就任本基金管理人总经理一职。

2、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，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.py-axa.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

二〇一二年八月二十九日