
浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资
基金

2012 年年度报告摘要

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：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：二〇一三年三月三十日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

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

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	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	105,800,595.16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
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> <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。</p>
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	田青
	联系电话	021-23212888	010-67595096
	电子邮箱	guj@py-axa.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	010-67595096
传真		021-23212985	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-5,172,361.28	-9,156,865.31	19,682,221.40
本期利润	7,776,078.37	-30,684,152.67	14,284,820.77
加权平均基金份额本期利润	0.0709	-0.2530	0.0642
本期基金份额净值增长率	8.80%	-24.30%	7.89%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1215	-0.1930	0.0656
期末基金资产净值	92,942,075.98	90,809,305.70	147,349,834.79
期末基金份额净值	0.878	0.807	1.066

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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	------	-------	-------	--------	-----	-----

	增长率①	长率标准差 ②	准收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	5.02%	1.05%	4.52%	0.73%	0.50%	0.32%
过去六个月	1.04%	1.13%	0.66%	0.71%	0.38%	0.42%
过去一年	8.80%	1.13%	5.37%	0.73%	3.43%	0.40%
过去三年	-11.13%	1.11%	-10.48%	0.78%	-0.65%	0.33%
自基金合同 生效起至今	-7.40%	0.84%	1.89%	1.14%	-9.29%	-0.30%

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
 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12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金
 合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



本基金合同于 2009 年 6 月 4 日生效,因此 2009 年的净值增长率及业绩比较基准收益率是按照基金合同生效后的实际存续期计算的。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
2010年	0.600	7,229,736.29	1,904,783.30	9,134,519.59	-
合计	0.600	7,229,736.29	1,904,783.30	9,134,519.59	-

§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 2.4 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 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 9 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、浦银安盛增利分级债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金和浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金。

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	本公司权益投资部总监，本基金基金经理兼浦银安盛红利精选股票基金基金经理	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基金经理。2011年5月起，兼任本基金基金经理之职。2012年11月起，担任本公司权益投资部总监。
刘佳玮	本基金基金经理助理兼浦银安盛红利精选股票基金基金经理助理	2011-07-01	-	5	刘佳玮，伦敦大学经济学硕士。2007年7月起先后任职于中投证券、中银证券和上海从容投资管理公司，历任助理研究员、分析师和周期性行业研究员。2010年9月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任行业研究员。2011年7月起，担任本基金基金经理助理以及浦银安盛红利精选股票型证券投资基金基金经理助理。

注：1、此处的“任职日期”为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 公平交易制度和控制方法

管理人于 2009 年颁布了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》(以下简称公平交易管理规定)，并分别于 2011 年及 2012 年进行了两次修订。现行公平交易管理规定分为总则、实现公平交易的具体措施、公平交易监控与实施效果评估、公平交易的报告和信息披露、隔离及保密、附则等六部分。公平交易管理规定从投资决策、研究支持、交易实施、监控与评估、报告与披露等各个环节，预防和发现可能违反公平交易的异常情况，并予以及时纠正与改进。

管理人用于公平交易控制方法包括：

- 公司建立严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；
- 相对所有组合建立并使用统一的、系统化的研究平台；
- 明确了投资决策委员会、投资总监、投资组合经理三级授权体系；
- 证券投资基金经理及其助理和特定客户资产投资组合经理及其助理相互隔离，不得相互兼任、互为备份；
- 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；
- 执行投资交易系统中的公平交易程序；
- 银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配严格依照制度和程序规范进行，并对该分配过程进行监控；
- 定期对投资目标和投资策略类似的投资组合的业绩表现进行分析、归因和评估；
- 对不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）管理人管理的不同投资合同向交易的交易价差进行分析。分析如发现涉嫌不公平的交易，投资组合经理及交易主管对该情况需提供详细的原因说明，并将检查结果向公司管理层和督察长汇报。同时改进公平交易管理方法及流程。

- 其他能够防范公平交易异常情况的有效方式。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人修订了《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投资组合。

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。

4.3.3 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年，受国内外需求疲软的影响，国内经济增速下滑明显。除银行以外的上市公司盈利增速呈现下滑趋势，显示尽管央行采取降息、下调准备金等措施释放了流动性，但需求不足和产能过剩的格局难以在短期内扭转。

从市场角度来看，A 股全年呈现大幅震荡格局，年底在十八大召开、政策预期明朗以后市场开始了大幅反弹。从全年角度来看，低估值的地产、银行、汽车板块和高成长的装饰园林、部分 TMT 板块都有比较好的表现。

生活基金在全年保持了高于基准的仓位，在行业方面对食品饮料、房地产、装饰园林、汽车、TMT 等板块进行了超配，而在银行、煤炭、钢铁等板块保持了低配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

由于超配的房地产、装饰园林、食品饮料、汽车等板块在报告期内表现较好，本年度净值表现高于比较基准，报告期内基金净值增长率为 8.80%，基准收益率为 5.37%。

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，由于政府换届结束，且十八大明确提出了经济增长目标，因此，从全年来看，对 A 股的预期相对乐观，但从行业角度来看，周期性板块产能过剩格局并未改变，相对比较看好医药、房地产、汽车、银行等板块。

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、合规风控部负责人、基金运营部负责人组成。估值委员会成员均具有 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。

本基金管理人已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 12 月 31 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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

普华永道中天审字(2013)第 20171 号

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金 全体基金份额持有人：

我们审计了后附的 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“浦银安盛精致生活基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度 的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是浦银安盛精致生活基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会

计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述 浦银安盛精致生活基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了浦银安盛精致生活基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 汪棣 屈斯洁

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

2013-03-27

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	22,254,814.30	22,308,942.19
结算备付金		730,790.31	438,302.59
存出保证金		750,000.00	500,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	71,976,374.30	68,115,121.38
其中：股票投资		71,976,374.30	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	810,670.77
应收利息	7.4.7.5	5,149.89	4,494.26
应收股利		-	-
应收申购款		1,675.17	21,872.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		95,718,803.97	92,199,403.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,281,774.94	434,960.24
应付赎回款		114,016.09	11,499.69
应付管理人报酬		111,347.55	121,517.86
应付托管费		18,557.92	20,252.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	411,023.49	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	7.4.7.8	840,008.00	630,000.64
负债合计		2,776,727.99	1,390,098.00
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	105,800,595.16	112,522,254.57
未分配利润	7.4.7.10	-12,858,519.18	-21,712,948.87
所有者权益合计		92,942,075.98	90,809,305.70

负债和所有者权益总计		95,718,803.97	92,199,403.70
------------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.878 元，基金份额总额 105,800,595.16

份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12 月31日
一、收入		11,800,111.89	-27,292,994.06
1. 利息收入		191,453.13	258,261.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	177,821.33	240,604.49
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		13,631.80	3,793.29
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,360,834.49	-6,040,463.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,981,955.19	-7,077,638.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	478,690.35
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	621,120.70	558,484.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	12,948,439.65	-21,527,287.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	21,053.60	16,495.61
减：二、费用		4,024,033.52	3,391,158.61
1. 管理人报酬		1,379,408.54	1,755,909.03
2. 托管费		229,901.43	292,651.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,053,370.55	938,750.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	361,353.00	403,847.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,776,078.37	-30,684,152.67

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,776,078.37	-30,684,152.67

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	7,776,078.37	7,776,078.37
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）	-6,721,659.41	1,078,351.32	-5,643,308.09
其中：1. 基金申购款	1,395,879.27	-222,068.73	1,173,810.54
2. 基金赎回款	-8,117,538.68	1,300,420.05	-6,817,118.63
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）	105,800,595.16	-12,858,519.18	92,942,075.98
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-30,684,152.67	-30,684,152.67
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）	-25,757,807.20	-98,569.22	-25,856,376.42
其中：1. 基金申购款	3,452,109.59	-105,994.18	3,346,115.41
2. 基金赎回款	-29,209,916.79	7,424.96	-29,202,491.83
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）	112,522,254.57	-21,712,948.87	90,809,305.70

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告页码从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：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

7.4 报表附注

7.4.1 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》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》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 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%。投资于权证的比例范围占基金资产净值的 0%-3%。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浦银安盛基金管理有限公司于 2013 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操

作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最新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 2011 年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金代销机构
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

法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海盛融投资有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度可比期均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,379,408.54	1,755,909.03
其中：支付销售机构的客户维护费	320,550.20	405,183.33

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：

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	229,901.43	292,651.46

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：

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用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。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日		2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	22,254,814.30	169,603.81	22,308,942.19	236,559.73
合计	22,254,814.30	169,603.81	22,308,942.19	236,559.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间承销期内未参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期内未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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
300315	掌趣科技	2012-12-04	重大事项停牌	22.86	2013-02-05	25.15	545	13,467.00	12,458.70	-

注：本基金截至 2012 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 71,963,915.60 元，属于第二层级的余额为 12,458.70 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 67,579,621.38 元，第二层级 535,500.00 元，

无第三层级)。

(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。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	71,976,374.30	75.20
	其中：股票	71,976,374.30	75.20
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	-	-
	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	22,985,604.61	24.01
6	其他各项资产	756,825.06	0.79
7	合计	95,718,803.97	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	33,700.80	0.04
B	采掘业	1,769,883.00	1.90
C	制造业	33,720,038.93	36.28
C0	食品、饮料	1,772,790.50	1.91

C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,239,409.40	2.41
C5	电子	298,420.00	0.32
C6	金属、非金属	5,074,420.22	5.46
C7	机械、设备、仪表	21,732,681.58	23.38
C8	医药、生物制品	2,602,317.23	2.80
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,824,555.96	9.49
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	8,149,223.29	8.77
H	批发和零售贸易	1,840,379.50	1.98
I	金融、保险业	6,595,672.92	7.10
J	房地产业	8,286,239.82	8.92
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	138,680.08	0.15
M	综合类	2,618,000.00	2.82
	合计	71,976,374.30	77.44

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600376	首开股份	207,774	2,725,994.88	2.93
2	002375	亚厦股份	101,085	2,676,730.80	2.88
3	002146	荣盛发展	189,382	2,649,454.18	2.85
4	600805	悦达投资	220,000	2,618,000.00	2.82
5	300156	天立环保	199,984	2,469,802.40	2.66
6	601166	兴业银行	144,200	2,406,698.00	2.59
7	600587	新华医疗	74,950	2,331,694.50	2.51
8	002431	棕榈园林	100,591	2,313,593.00	2.49
9	601318	中国平安	49,500	2,241,855.00	2.41
10	002439	启明星辰	127,725	1,883,943.75	2.03

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

600519	贵州茅台	14,681,800.00	16.17
600702	沱牌舍得	14,291,836.70	15.74
002310	东方园林	13,402,633.65	14.76
002146	荣盛发展	13,190,349.15	14.53
600376	首开股份	11,731,787.69	12.92
600199	金种子酒	10,882,080.97	11.98
002375	亚厦股份	10,800,158.50	11.89
000961	中南建设	9,094,814.52	10.02
600067	冠城大通	8,287,586.15	9.13
002474	榕基软件	7,745,806.59	8.53
601288	农业银行	7,542,231.25	8.31
300156	天立环保	6,711,985.31	7.39
300020	银江股份	6,630,865.12	7.30
600742	一汽富维	6,411,423.59	7.06
601166	兴业银行	6,351,462.00	6.99
600066	宇通客车	6,243,068.05	6.87
300090	盛运股份	6,189,185.00	6.82
600887	伊利股份	6,159,515.97	6.78
600594	益佰制药	5,650,236.98	6.22
300267	尔康制药	5,603,898.12	6.17
601318	中国平安	5,438,789.21	5.99
002503	搜于特	5,352,826.27	5.89
600048	保利地产	5,306,125.00	5.84
600079	人福医药	5,059,417.89	5.57
600805	悦达投资	4,806,149.18	5.29
300212	易华录	4,791,994.00	5.28
002673	西部证券	4,728,900.23	5.21
300291	华录百纳	4,711,168.48	5.19
300309	吉艾科技	4,683,943.32	5.16
300315	掌趣科技	4,674,226.02	5.15
300104	乐视网	4,607,942.58	5.07
000858	五粮液	4,489,692.23	4.94
600397	安源煤业	4,429,975.40	4.88
300293	蓝英装备	4,403,964.75	4.85
300177	中海达	4,403,344.29	4.85
000616	亿城股份	4,397,517.00	4.84
002157	正邦科技	4,372,204.58	4.81
002368	太极股份	4,350,464.25	4.79
002041	登海种业	4,336,492.00	4.78
600559	老白干酒	4,293,139.93	4.73
002325	洪涛股份	4,285,515.79	4.72

	000550	江铃汽车	4,114,557.09	4.53
	002658	雪迪龙	3,879,401.00	4.27
	000596	古井贡酒	3,825,967.73	4.21
	002612	朗姿股份	3,805,604.08	4.19
	600197	伊力特	3,778,568.90	4.16
	600395	盘江股份	3,706,700.70	4.08
	002344	海宁皮城	3,669,798.88	4.04
	002567	唐人神	3,526,195.60	3.88
	601601	中国太保	3,516,897.84	3.87
	002170	芭田股份	3,431,622.01	3.78
	002205	国统股份	3,395,464.00	3.74
	300168	万达信息	3,348,273.53	3.69
	300287	飞利信	3,261,805.18	3.59
	000651	格力电器	3,249,698.00	3.58
	600420	现代制药	3,243,033.33	3.57
	603001	奥康国际	3,238,930.05	3.57
	002589	瑞康医药	3,205,027.83	3.53
	000970	中科三环	3,194,667.60	3.52
	000049	德赛电池	3,182,710.00	3.50
	002155	辰州矿业	3,120,379.87	3.44
	000338	潍柴动力	3,109,338.89	3.42
	002313	日海通讯	3,099,963.43	3.41
	300336	新文化	3,050,777.23	3.36
	002305	南国置业	3,039,509.27	3.35
	300075	数字政通	2,992,500.30	3.30
	300024	机器人	2,991,329.33	3.29
	002052	同洲电子	2,989,095.44	3.29
	600587	新华医疗	2,857,085.50	3.15
	300079	数码视讯	2,854,481.00	3.14
	300251	光线传媒	2,833,246.60	3.12
	002400	省广股份	2,813,562.04	3.10
	600031	三一重工	2,771,681.00	3.05
	600366	宁波韵升	2,766,467.00	3.05
	000540	中天城投	2,723,841.00	3.00
	000551	创元科技	2,714,344.85	2.99
	300088	长信科技	2,710,711.05	2.99
	002439	启明星辰	2,702,258.78	2.98
	000650	仁和药业	2,685,123.07	2.96
	000581	威孚高科	2,683,296.90	2.95
	600616	金枫酒业	2,680,380.50	2.95
	002430	杭氧股份	2,632,164.29	2.90

	002099	海翔药业	2,625,558.01	2.89
	002037	久联发展	2,624,352.84	2.89
	002195	海隆软件	2,580,720.24	2.84
	300171	东富龙	2,579,591.80	2.84
	600816	安信信托	2,574,499.20	2.84
	600157	永泰能源	2,560,320.00	2.82
	002320	海峡股份	2,544,497.88	2.80
	000811	烟台冰轮	2,527,285.79	2.78
	002554	惠博普	2,519,383.66	2.77
	002509	天广消防	2,478,179.34	2.73
	300246	宝莱特	2,428,305.11	2.67
	002700	新疆浩源	2,374,292.00	2.61
	000823	超声电子	2,358,083.93	2.60
	002431	棕榈园林	2,348,380.50	2.59
	300048	合康变频	2,339,347.84	2.58
	002244	滨江集团	2,334,687.00	2.57
	601918	国投新集	2,327,026.00	2.56
	600585	海螺水泥	2,289,321.00	2.52
	300170	汉得信息	2,288,068.00	2.52
	000562	宏源证券	2,277,609.24	2.51
	600138	中青旅	2,254,176.27	2.48
	002369	卓翼科技	2,235,217.02	2.46
	300188	美亚柏科	2,229,156.31	2.45
	002663	普邦园林	2,197,650.37	2.42
	000625	长安汽车	2,167,650.00	2.39
	002482	广田股份	2,165,239.29	2.38
	002341	新纶科技	2,125,841.56	2.34
	002457	青龙管业	2,122,666.08	2.34
	600422	昆明制药	2,058,056.26	2.27
	600266	北京城建	2,032,881.80	2.24
	002345	潮宏基	2,008,690.00	2.21
	002429	兆驰股份	1,998,157.10	2.20
	300355	蒙草抗旱	1,992,641.63	2.19
	600016	民生银行	1,990,400.00	2.19
	002237	恒邦股份	1,989,682.00	2.19
	000024	招商地产	1,970,119.00	2.17
	002029	七匹狼	1,935,118.04	2.13
	002396	星网锐捷	1,933,969.00	2.13
	600801	华新水泥	1,924,576.00	2.12
	002398	建研集团	1,914,869.41	2.11
	002081	金螳螂	1,884,253.00	2.07

	002690	美亚光电	1,881,096.00	2.07
	002570	贝因美	1,839,005.50	2.03
	002025	航天电器	1,834,871.00	2.02
	002340	格林美	1,816,889.00	2.00
	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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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（%）
	600199	金种子酒	16,645,670.92	18.33
	600519	贵州茅台	15,666,200.62	17.25
	600702	沱牌舍得	14,019,415.85	15.44
	002310	东方园林	13,700,101.34	15.09
	002146	荣盛发展	11,282,259.05	12.42
	002375	亚厦股份	9,278,742.15	10.22
	600376	首开股份	9,241,393.61	10.18
	600887	伊利股份	8,694,377.76	9.57
	000961	中南建设	8,596,401.76	9.47
	600067	冠城大通	8,148,993.99	8.97
	601288	农业银行	7,499,814.75	8.26
	300020	银江股份	7,120,477.72	7.84
	300090	盛运股份	6,494,773.49	7.15
	002474	榕基软件	6,388,575.67	7.04
	600742	一汽富维	6,040,548.53	6.65
	002325	洪涛股份	5,965,544.90	6.57
	002503	搜于特	5,962,895.42	6.57
	600016	民生银行	5,944,662.42	6.55
	300267	尔康制药	5,750,106.18	6.33
	002157	正邦科技	5,614,794.64	6.18
	300156	天立环保	5,604,051.95	6.17
	601601	中国太保	5,497,658.08	6.05
	600048	保利地产	5,195,277.30	5.72
	300315	掌趣科技	5,090,017.18	5.61
	000596	古井贡酒	4,999,637.69	5.51
	600594	益佰制药	4,965,505.85	5.47
	300309	吉艾科技	4,870,435.58	5.36
	300291	华录百纳	4,740,308.68	5.22

	002673	西部证券	4,638,278.84	5.11
	300212	易华录	4,638,208.35	5.11
	300177	中海达	4,597,869.05	5.06
	300293	蓝英装备	4,587,581.18	5.05
	600066	宇通客车	4,519,176.60	4.98
	600559	老白干酒	4,509,182.67	4.97
	002041	登海种业	4,423,330.85	4.87
	300104	乐视网	4,419,230.18	4.87
	002400	省广股份	4,409,153.43	4.86
	000858	五粮液	4,378,168.68	4.82
	601166	兴业银行	4,354,955.39	4.80
	000616	亿城股份	4,343,157.98	4.78
	000540	中天城投	4,324,492.00	4.76
	600397	安源煤业	4,285,296.05	4.72
	600079	人福医药	4,093,130.41	4.51
	000895	双汇发展	4,061,070.95	4.47
	000970	中科三环	3,984,389.25	4.39
	600197	伊力特	3,874,745.03	4.27
	002344	海宁皮城	3,745,577.34	4.12
	002567	唐人神	3,559,253.29	3.92
	300168	万达信息	3,527,975.92	3.89
	002658	雪迪龙	3,517,055.87	3.87
	002612	朗姿股份	3,487,902.91	3.84
	000650	仁和药业	3,486,503.32	3.84
	600266	北京城建	3,485,955.33	3.84
	600015	华夏银行	3,454,553.24	3.80
	600395	盘江股份	3,408,278.32	3.75
	000550	江铃汽车	3,402,237.12	3.75
	002368	太极股份	3,321,409.01	3.66
	600420	现代制药	3,283,471.21	3.62
	300075	数字政通	3,260,423.51	3.59
	601318	中国平安	3,257,454.32	3.59
	603001	奥康国际	3,243,211.66	3.57
	300171	东富龙	3,229,164.49	3.56
	000651	格力电器	3,215,484.18	3.54
	002205	国统股份	3,125,848.18	3.44
	002170	芭田股份	3,093,201.75	3.41
	002155	辰州矿业	3,086,136.30	3.40
	002589	瑞康医药	3,064,361.38	3.37
	300024	机器人	3,046,063.95	3.35
	002313	日海通讯	2,951,277.05	3.25

	002554	惠博普	2,941,903.00	3.24
	002140	东华科技	2,872,284.52	3.16
	600805	悦达投资	2,866,524.40	3.16
	000551	创元科技	2,857,452.96	3.15
	300287	飞利信	2,852,488.47	3.14
	000049	德赛电池	2,847,045.40	3.14
	002052	同洲电子	2,822,951.76	3.11
	300088	长信科技	2,747,273.53	3.03
	600366	宁波韵升	2,719,714.81	2.99
	601009	南京银行	2,701,118.28	2.97
	600616	金枫酒业	2,696,965.20	2.97
	300336	新文化	2,691,999.58	2.96
	002430	杭氧股份	2,658,492.93	2.93
	300079	数码视讯	2,607,958.90	2.87
	601808	中海油服	2,582,687.54	2.84
	300058	蓝色光标	2,574,253.98	2.83
	300246	宝莱特	2,568,162.98	2.83
	002509	天广消防	2,565,271.81	2.82
	002099	海翔药业	2,559,228.75	2.82
	300251	光线传媒	2,548,744.31	2.81
	600816	安信信托	2,547,144.91	2.80
	002037	久联发展	2,461,020.05	2.71
	002195	海隆软件	2,454,672.75	2.70
	002320	海峡股份	2,449,843.74	2.70
	002179	中航光电	2,407,000.33	2.65
	000789	江西水泥	2,403,802.66	2.65
	002700	新疆浩源	2,381,142.76	2.62
	600157	永泰能源	2,366,977.61	2.61
	300048	合康变频	2,363,678.87	2.60
	601918	国投新集	2,323,572.13	2.56
	000823	超声电子	2,303,427.15	2.54
	000562	宏源证券	2,293,755.91	2.53
	600557	康缘药业	2,198,121.15	2.42
	002482	广田股份	2,192,892.77	2.41
	002341	新纶科技	2,164,774.11	2.38
	300170	汉得信息	2,154,288.75	2.37
	002429	兆驰股份	2,114,482.80	2.33
	002457	青龙管业	2,099,909.23	2.31
	002369	卓翼科技	2,099,098.06	2.31
	600138	中青旅	2,074,043.75	2.28
	600240	华业地产	2,045,126.57	2.25

600633	浙报传媒	1,993,508.79	2.20
600801	华新水泥	1,987,016.31	2.19
002398	建研集团	1,977,406.51	2.18
600418	江淮汽车	1,944,716.44	2.14
000799	酒鬼酒	1,937,213.38	2.13
002094	青岛金王	1,934,101.99	2.13
000811	烟台冰轮	1,927,686.01	2.12
002345	潮宏基	1,897,186.40	2.09
002305	南国置业	1,889,491.51	2.08
002690	美亚光电	1,883,537.97	2.07
000024	招商地产	1,875,934.32	2.07
300355	蒙草抗旱	1,872,137.07	2.06
002475	立讯精密	1,862,641.26	2.05
002029	七匹狼	1,850,863.18	2.04
002244	滨江集团	1,850,550.72	2.04
002396	星网锐捷	1,845,490.83	2.03
300159	新研股份	1,836,197.33	2.02
002081	金螳螂	1,836,175.15	2.02
002237	恒邦股份	1,826,152.34	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	674,885,753.32
卖出股票的收入（成交）总额	681,990,984.86

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。

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,149.89
5	应收申购款	1,675.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	756,825.06

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
3,448	30,684.63	197,663.46	0.19%	105,602,931.70	99.81%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	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。

§10 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
本报告期期间基金总申购份额	1,395,879.27
减：本报告期期间基金总赎回份额	8,117,538.68
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	105,800,595.16

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示**11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于 2012 年 4 月 28 日刊登《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》，披露陈箴先生因个人原因不再担任公司副总经理兼首席运营官，周文桐因个人原因不再担任公司副总经理兼首席投资官。

2、基金管理人于 2012 年 5 月 8 日刊登《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》，披露公司聘任李宏宇先生为公司副总经理兼首席市场营销官。

3、基金管理人于 2012 年 7 月 28 日刊登《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》，披露公司原总经理钱华先生因个人原因不再担任公司总经理，由郁蓓华女士接替钱华先生担任公司总经理。

4、基金管理人于 2012 年 7 月 28 日刊登《浦银安盛基金管理有限公司关于独立董事变更的公告》，披露公司原独立董事吴伟聪先生因个人原因不再担任公司独立董事一职，由谢百三先生接替吴伟聪先生出任公司第二届董事会独立董事。

5、2012 年 11 月 15 日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕961 号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕1036 号）。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 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。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 60,000 元，截止本报告期末，普华永道中天会计师事务所已提供审计服务的连续年限为 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	1	573,572,921.23	42.27%	482,580.25	41.27%	-
申银万国	1	438,526,340.48	32.32%	388,469.49	33.22%	-
国泰君安	1	281,615,135.40	20.76%	243,728.30	20.84%	-
东方证券	1	38,651,729.42	2.85%	32,853.98	2.81%	-
中国中投	1	24,434,581.65	1.80%	21,622.43	1.85%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中金	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和中国中投交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	9,000,000.00	100.00%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中国中投	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2013 年 2 月 6 日刊登《浦银安盛基金管理有限公司关于独立董事变更的公告》，披露本基金管理人原独立董事尹应能先生因个人原因申请辞去公司独立董事一职，经 2013 年第一次股东会会议审议批准，自 2012 年 2 月 4 日股东会作出决议之日起由韩启蒙先生接替尹应能先生出任本基金管理人第二届董事会独立董事。上述事项已按规定向证券监管部门报告，履行了相关法律程序。

2、本基金管理人原监事 James Young 先生因个人原因申请辞去公司监事一职，经 2013 年第一次股东会会议审议批准，自 2013 年 2 月 4 日起由 Simon Lopez 先生接替 James Young 先生出任本基金管理人第二届监事会监事。上述事项符合相关法律规定。

3、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。

4、2012 年 11 月 15 日，根据工作需要，中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

浦银安盛基金管理有限公司

二〇一三年三月三十日