

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基 金

2013 年半年度报告

2013 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：二〇一三年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42

7.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.10	投资组合报告附注	42
8	基金份额持有人信息	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
9	开放式基金份额变动	44
10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	46
11	备查文件目录	47
11.1	备查文件目录	47
11.2	存放地点	47
11.3	查阅方式	47

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	96,097,496.29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	田青
	联系电话	021-23212888	010-67595096
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tianqingl.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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	9,476,031.99
本期利润	2,218,362.20
加权平均基金份额本期利润	0.0219
本期加权平均净值利润率	2.43%
本期基金份额净值增长率	2.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-9,801,369.39
期末可供分配基金份额利润	-0.1020
期末基金资产净值	86,296,126.90
期末基金份额净值	0.898
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-5.29%

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	-6.46%	2.18%	-8.98%	1.03%	2.52%	1.15%
过去三个	2.51%	1.67%	-5.09%	0.80%	7.60%	0.87%

月						
过去六个月	2.28%	1.49%	-3.22%	0.80%	5.50%	0.69%
过去一年	3.34%	1.31%	-2.58%	0.75%	5.92%	0.56%
过去三年	7.62%	1.16%	-0.70%	0.77%	8.32%	0.39%
自基金合同生效起至今	-5.29%	1.18%	-1.38%	0.84%	-3.91%	0.34%

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 2013 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 2.4 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 2013 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 12 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、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

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以及浦银	2011-05-05	-	6	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

	安盛战略新兴产业混合基金基金经理				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。自 2013 年 3 月 25 日起兼任浦银安盛战略新兴产业混合基金基金经理。
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	2013-02-01	6	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。
褚艳辉	本公司股票型基金基金经理助理	2013-02-01	-	5	褚艳辉, 南京理工大学经济学硕士。2004 年 8 月至 2008 年 4 月间曾在上海信息中心担任宏观经济、政策研究员。2008 年 5 月到 2010 年 9 月在爱建证券公司担任制造与消费大类行业高级研究员, 后在上海汽车财

					务公司短暂担任投资经理助理之职。2011 年 4 月起加盟浦银安盛基金公司从事行业研究工作。2013 年 2 月 1 日起，担任公司股票基金经理助理。
王爽	本公司股票型基金基金经理助理	2013-02-01	-	5	王爽，华东政法大学经济、法律专业学士。2008 年 5 月至 2010 年 9 月在天相投资顾问有限公司担任行业研究员。2010 年 9 月起加盟浦银安盛基金公司担任行业研究员之职。2013 年 2 月 1 日起，担任公司股票基金经理助理。

注：1、此处的“任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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》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中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

年初在政策放松的预期下，市场在金融、机械等周期股的带动下呈现了短暂的上冲，随后经济数据的持续低迷以及政府对于经济结构转型的表态捅破了上述幻想。随着一季报和半年报的逐渐披露，符合经济转型方向的新兴产业如传媒、信息服务、通信、医药、乳业等板块获得市场的认可。总体来看，上述市场表现反映了国内实体经济的状况和中央强调经济结构转型的决心。从宏观经济角度来看，传统的实体经济过剩产能的状况仍然十分严重，去产能是个艰巨、长期的任务，因此从中长期来看，传统板块缺乏基本面支持。而以传媒、医药、电子消费为代表的板块在经济结构转型的背景下具有比较好的发展前景和投资机会。

生活基金在上半年对持仓的行业结构进行了调整，减持了房地产、金融等周期性行业，增持了传媒、信息服务等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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 2.28%，基准收益率为 -3.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年是新一届政府执政的第一年，新政府在经济结构转型方面的表态和决心远大于以往。当前社会贫富差距、环境污染等问题较为严重，也预示着中国经济也到了非转型不可的

地步。我们相信，基于中国巨大的经济体量和弹性，未来应该能够逐步成功转型，同时也能创造出一些欣欣向荣的新兴行业。因此，我们坚定看好符合经济转型方向的节能环保、高端装备等行业以及与大众消费相关的传媒、信息服务、医药等行业。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 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：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,354,358.77	22,254,814.30
结算备付金		659,208.74	730,790.31
存出保证金		117,696.20	750,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	70,949,591.00	71,976,374.30
其中：股票投资		68,583,689.00	71,976,374.30

基金投资		-	-
债券投资		2,365,902.00	-
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	-	-
应收证券清算款		323,771.59	-
应收利息	6.4.7.5	6,379.15	5,149.89
应收股利		-	-
应收申购款		690.81	1,675.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		88,411,696.26	95,718,803.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,116,811.13	1,281,774.94
应付赎回款		126,179.56	114,016.09
应付管理人报酬		108,931.63	111,347.55
应付托管费		18,155.25	18,557.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	346,703.54	411,023.49
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	398,788.25	840,008.00
负债合计		2,115,569.36	2,776,727.99
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	96,097,496.29	105,800,595.16
未分配利润	6.4.7.10	-9,801,369.39	-12,858,519.18
所有者权益合计		86,296,126.90	92,942,075.98
负债和所有者权益总计		88,411,696.26	95,718,803.97

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.898 元，基金份额总额 96,097,496.29 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		4,779,497.83	8,710,875.92
1.利息收入		82,400.20	99,013.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	80,549.33	87,733.30
债券利息收入		1,850.87	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	11,280.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,953,546.76	-1,851,325.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,550,730.89	-2,254,457.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,449.88	-
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	395,365.99	403,132.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-7,257,669.79	10,442,756.27
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	1,220.66	20,431.30
减：二、费用		2,561,135.63	1,776,114.43
1. 管理人报酬		678,739.35	692,123.75
2. 托管费		113,123.22	115,353.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,609,780.54	788,728.51
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	159,492.52	179,908.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,218,362.20	6,934,761.49
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,218,362.20	6,934,761.49
-------------------	--	--------------	--------------

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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	105,800,595.16	-12,858,519.18	92,942,075.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,218,362.20	2,218,362.20
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）	-9,703,098.87	838,787.59	-8,864,311.28
其中：1. 基金申购款	2,024,379.86	-175,389.47	1,848,990.39
2. 基金赎回款	-11,727,478.73	1,014,177.06	-10,713,301.67
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）	96,097,496.29	-9,801,369.39	86,296,126.90
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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

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：

基金管理人负责人：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(特殊普通合伙)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%。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 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和、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》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,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。2013 年 1 月 1 日以前,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。自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。

(4) 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。

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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	16,354,358.77
定期存款	-
其他存款	-
合计	16,354,358.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		69,021,865.46	68,583,689.00	-438,176.46
债券	交易所市场	2,441,708.91	2,365,902.00	-75,806.91
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,441,708.91	2,365,902.00	-75,806.91
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		71,463,574.37	70,949,591.00	-513,983.37

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

本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2013 年 6 月 30 日
----	------------------------

应收活期存款利息	2,831.97
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	267.03
应收债券利息	3,232.54
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	47.61
合计	6,379.15

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 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	346,703.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	346,703.54

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	20.73
预提费用	148,767.52
合计	398,788.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	105,800,595.16	105,800,595.16
本期申购	2,024,379.86	2,024,379.86
本期赎回（以“-”号填列）	-11,727,478.73	-11,727,478.73
本期末	96,097,496.29	96,097,496.29

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	-3,868,770.70	-8,989,748.48	-12,858,519.18
本期利润	9,476,031.99	-7,257,669.79	2,218,362.20
本期基金份额交易产生的变动数	-244,658.93	1,083,446.52	838,787.59
其中：基金申购款	85,834.05	-261,223.52	-175,389.47
基金赎回款	-330,492.98	1,344,670.04	1,014,177.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,362,602.36	-15,163,971.75	-9,801,369.39

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	71,385.45
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	8,201.26
其他	962.62
合计	80,549.33

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	533,966,525.00
减：卖出股票成本总额	522,415,794.11
买卖股票差价收入	11,550,730.89

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	109,451.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	101,916.67
减：应收利息总额	84.95
债券投资收益	7,449.88

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 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	395,365.99
基金投资产生的股利收益	-
合计	395,365.99

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-7,257,669.79
——股票投资	-7,181,862.88
——债券投资	-75,806.91
——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	-7,257,669.79

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	999.51
转换费收入	221.15
合计	1,220.66

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	1,609,780.54
银行间市场交易费用	-
合计	1,609,780.54

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
----	----------------------------

审计费用	29,752.78
信息披露费	119,014.74
银行汇划费用	1,325.00
债券帐户维护费	9,400.00
合计	159,492.52

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	678,739.35	692,123.75
其中：支付销售机构的客户维护费	157,308.58	160,878.79

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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	113,123.22	115,353.95

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		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年6月30日		2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	16,354,358.77	71,385.45	10,298,009.38	84,415.09

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（2013 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

本基金在本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
300027	华谊兄弟	2013-06-05	重大 事项 停牌	28.55	2013-07-24	31.41	80,000	2,345,147.00	2,284,000.00	-
601886	江河创建	2013-06-20	重大 事项 停牌	12.20	2013-07-16	13.78	77,067	969,303.70	940,217.40	-
300020	银江股份	2013-06-03	重大 事项 停牌	21.22	-	-	91,986	1,827,818.60	1,951,942.92	-

注：本基金截至 2013 年 6 月 30 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。

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、合规风控部的风险管理；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。

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。公司设立合规风控部，独立地监控公司面临的各类风险，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，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

风险控制可在可承受的范围内。

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%。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

长期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年末 2012 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	2,365,902.00	-
未评级	-	-
合计	2,365,902.00	-

注:长期信用评级以持有的信用债项评级为依据进行披露。2012 年 12 月 31 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%。

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同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 2013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	16,354,358.77	-	-	-	16,354,358.77
结算备付金	659,208.74	-	-	-	659,208.74

存出保证金	117,696.20	-	-	-	117,696.20
证券清算款	-	-	-	323,771.59	323,771.59
交易性金融资产	-	-	2,365,902.00	68,583,689.00	70,949,591.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	6,379.15	6,379.15
应收申购款	-	-	-	690.81	690.81
其他应收款	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,131,263.71	-	2,365,902.00	68,914,530.55	88,411,696.26
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,116,811.13	1,116,811.13
应付赎回款	-	-	-	126,179.56	126,179.56
应付赎回费	-	-	-	20.73	20.73
应付管理人报酬	-	-	-	108,931.63	108,931.63
应付托管费	-	-	-	18,155.25	18,155.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	346,703.54	346,703.54
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付收益	-	-	-	-	-
其他应付款	-	-	-	250,000.00	250,000.00
预提费用	-	-	-	148,767.52	148,767.52
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	2,115,569.36	2,115,569.36

利率敏感度缺口	17,131,263.71	-	2,365,902.00	66,798,961.19	86,296,126.90
上年度末 2012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	22,254,814.30	-	-	-	22,254,814.30
结算备付金	730,790.31	-	-	-	730,790.31
存出保证金	-	-	-	750,000.00	750,000.00
证券清算款	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	71,976,374.30	71,976,374.30
应收利息	-	-	-	5,149.89	5,149.89
应收申购款	-	-	-	1,675.17	1,675.17
资产总计	22,985,604.61	-	-	72,733,199.36	95,718,803.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,281,774.94	1,281,774.94
应付赎回款	-	-	-	114,016.09	114,016.09
应付管理人报酬	-	-	-	111,347.55	111,347.55
应付托管费	-	-	-	18,557.92	18,557.92
应付交易费用	-	-	-	411,023.49	411,023.49
其他负债	-	-	-	840,008.00	840,008.00
负债总计	-	-	-	2,776,727.99	2,776,727.99
利率敏感度缺口	22,985,604.61	-	-	69,956,471.37	92,942,075.98

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

假设	除市场利率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

		2013 年 6 月 30 日	2012 年 12 月 31 日
	市场利率上升 0.25%	减少 6.55	-
	市场利率下降 0.25%	增加 6.55	-

注：于 2012 年 12 月 31 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%，因此 2012 年 12 月 31 日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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	68,583,689.00	79.47	71,976,374.30	77.44
交易性金融资产-债	2,365,902.00	2.74	-	-

券投资				
衍生金融资产-权证 投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	70,949,591.00	82.22	71,976,374.30	77.44

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除本基金业绩比较标准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 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加5,049,543.31	增加5,042,984.99
	业绩比较基准下降5%	减少5,049,543.31	减少5,042,984.99

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	68,583,689.00	77.57
	其中：股票	68,583,689.00	77.57
2	固定收益投资	2,365,902.00	2.68
	其中：债券	2,365,902.00	2.68
	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	17,013,567.51	19.24
6	其他各项资产	448,537.75	0.51
7	合计	88,411,696.26	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	1,312,830.74	1.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,741,853.82	33.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,868,527.96	7.96
F	批发和零售业	212,947.71	0.25
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	14,416,500.58	16.71
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,688,951.81	4.27
L	租赁和商务服务业	2,515,571.60	2.92
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	10,826,504.78	12.55
S	综合	-	-
	合计	68,583,689.00	79.47

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	300074	华平股份	228,808	4,141,424.80	4.80
2	600880	博瑞传播	193,559	3,412,445.17	3.95
3	600633	浙报传媒	139,951	3,018,743.07	3.50
4	300155	安居宝	181,520	2,519,497.60	2.92
5	300071	华谊嘉信	157,420	2,515,571.60	2.92
6	002310	东方园林	64,318	2,462,736.22	2.85
7	002570	贝因美	87,986	2,459,208.70	2.85

8	300083	劲胜股份	140,000	2,374,400.00	2.75
9	300027	华谊兄弟	80,000	2,284,000.00	2.65
10	300197	铁汉生态	87,792	2,220,259.68	2.57
11	300183	东软载波	78,168	2,202,774.24	2.55
12	300020	银江股份	91,986	1,951,942.92	2.26
13	002146	荣盛发展	138,165	1,949,508.15	2.26
14	000656	金科股份	150,000	1,738,500.00	2.01
15	002055	得润电子	168,441	1,726,520.25	2.00
16	300270	中威电子	85,000	1,723,800.00	2.00
17	300075	数字政通	55,391	1,567,565.30	1.82
18	300311	任子行	65,075	1,555,292.50	1.80
19	300241	瑞丰光电	117,944	1,480,197.20	1.72
20	300136	信维通信	59,100	1,436,130.00	1.66
21	002429	兆驰股份	184,608	1,382,713.92	1.60
22	300188	美亚柏科	78,648	1,285,108.32	1.49
23	600498	烽火通信	72,480	1,194,470.40	1.38
24	300115	长盈精密	36,315	1,167,164.10	1.35
25	300128	锦富新材	52,430	1,048,600.00	1.22
26	300315	掌趣科技	30,044	990,851.12	1.15
27	002313	日海通讯	60,000	989,400.00	1.15
28	601886	江河创建	77,067	940,217.40	1.09
29	300090	盛运股份	30,012	926,770.56	1.07
30	300336	新文化	23,853	924,780.81	1.07
31	002690	美亚光电	38,093	915,374.79	1.06
32	000961	中南建设	87,457	855,329.46	0.99
33	000050	深天马 A	70,000	821,100.00	0.95
34	300106	西部牧业	54,049	813,437.45	0.94
35	300110	华仁药业	100,240	790,893.60	0.92
36	300088	长信科技	36,923	778,706.07	0.90
37	300026	红日药业	19,984	678,256.96	0.79
38	002215	诺普信	100,000	656,000.00	0.76
39	002052	同洲电子	92,668	655,162.76	0.76
40	300043	星辉车模	60,657	645,390.48	0.75
41	300251	光线传媒	19,973	639,335.73	0.74
42	002008	大族激光	50,000	559,500.00	0.65
43	300148	天舟文化	40,000	547,200.00	0.63
44	002041	登海种业	23,523	499,393.29	0.58
45	300281	金明精机	54,600	425,334.00	0.49
46	300002	神州泰岳	26,203	418,985.97	0.49
47	002325	洪涛股份	30,657	364,818.30	0.42
48	300293	蓝英装备	26,636	359,586.00	0.42

49	002241	歌尔声学	9,141	331,726.89	0.38
50	000400	许继电气	11,121	301,156.68	0.35
51	300212	易华录	9,328	279,840.00	0.32
52	002589	瑞康医药	5,007	212,947.71	0.25
53	300024	机器人	5,000	185,750.00	0.22
54	600312	平高电气	11,895	109,671.90	0.13
55	002138	顺络电子	2,000	36,000.00	0.04
56	000049	德赛电池	451	27,060.00	0.03
57	002273	水晶光电	1,396	25,672.44	0.03
58	002663	普邦园林	1,670	25,166.90	0.03
59	300017	网宿科技	461	17,965.17	0.02
60	600587	新华医疗	206	8,536.64	0.01
61	300168	万达信息	176	4,750.24	0.01
62	600594	益佰制药	68	2,101.88	0.00
63	600340	华夏幸福	29	943.66	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	002570	贝因美	15,469,466.04	16.64
2	600199	金种子酒	13,047,064.76	14.04
3	300197	铁汉生态	12,975,618.24	13.96
4	000961	中南建设	12,195,698.61	13.12
5	000400	许继电气	9,771,842.11	10.51
6	002310	东方园林	9,430,174.68	10.15
7	002325	洪涛股份	9,222,272.39	9.92
8	300090	盛运股份	8,131,014.01	8.75
9	600880	博瑞传播	8,109,631.20	8.73
10	002244	滨江集团	7,817,272.52	8.41
11	300251	光线传媒	7,404,376.50	7.97
12	002146	荣盛发展	7,292,885.95	7.85
13	000860	顺鑫农业	7,037,004.78	7.57
14	600079	人福医药	6,518,662.34	7.01
15	002589	瑞康医药	6,338,626.47	6.82
16	300336	新文化	6,245,493.11	6.72
17	601886	江河创建	6,185,616.73	6.66
18	002179	中航光电	6,071,993.05	6.53

19	000656	金科股份	5,992,740.38	6.45
20	600312	平高电气	5,864,775.36	6.31
21	600073	上海梅林	5,236,918.31	5.63
22	002055	得润电子	5,191,627.94	5.59
23	000028	国药一致	5,059,059.34	5.44
24	000049	德赛电池	5,049,037.84	5.43
25	300115	长盈精密	4,801,317.47	5.17
26	601169	北京银行	4,789,410.46	5.15
27	300088	长信科技	4,507,232.53	4.85
28	600563	法拉电子	4,455,452.86	4.79
29	600104	上汽集团	4,411,380.92	4.75
30	000625	长安汽车	4,266,232.01	4.59
31	600197	伊力特	4,169,022.63	4.49
32	300110	华仁药业	4,126,532.49	4.44
33	300020	银江股份	4,112,439.50	4.42
34	300074	华平股份	4,098,797.95	4.41
35	600587	新华医疗	4,035,321.80	4.34
36	002123	荣信股份	3,883,465.72	4.18
37	000002	万科A	3,866,590.00	4.16
38	300026	红日药业	3,818,994.26	4.11
39	601318	中国平安	3,792,989.54	4.08
40	002305	南国置业	3,698,111.69	3.98
41	002035	华帝股份	3,585,179.46	3.86
42	300188	美亚柏科	3,579,205.94	3.85
43	300083	劲胜股份	3,537,967.10	3.81
44	002620	瑞和股份	3,459,068.43	3.72
45	000963	华东医药	3,257,836.07	3.51
46	300075	数字政通	3,238,725.93	3.48
47	600418	江淮汽车	3,228,936.26	3.47
48	300241	瑞丰光电	3,184,218.46	3.43
49	002431	棕榈园林	3,170,030.62	3.41
50	600383	金地集团	3,104,423.00	3.34
51	002250	联化科技	3,100,040.75	3.34
52	600316	洪都航空	3,035,727.00	3.27
53	300002	神州泰岳	3,028,699.40	3.26
54	002273	水晶光电	3,003,112.50	3.23
55	300212	易华录	3,000,671.44	3.23
56	002467	二六三	2,990,693.00	3.22
57	600184	光电股份	2,982,480.89	3.21
58	002219	独一味	2,953,976.76	3.18
59	002241	歌尔声学	2,953,586.30	3.18

60	600118	中国卫星	2,953,267.02	3.18
61	300155	安居宝	2,840,971.94	3.06
62	300024	机器人	2,820,412.20	3.03
63	600340	华夏幸福	2,815,615.74	3.03
64	600066	宇通客车	2,795,112.57	3.01
65	002236	大华股份	2,788,740.85	3.00
66	002106	莱宝高科	2,768,871.93	2.98
67	000596	古井贡酒	2,758,678.30	2.97
68	000927	一汽夏利	2,720,051.00	2.93
69	300005	探路者	2,663,379.04	2.87
70	000800	一汽轿车	2,663,193.00	2.87
71	600559	老白干酒	2,623,930.76	2.82
72	601788	光大证券	2,575,810.60	2.77
73	300048	合康变频	2,562,235.35	2.76
74	002429	兆驰股份	2,546,290.55	2.74
75	002168	深圳惠程	2,539,261.81	2.73
76	300183	东软载波	2,529,378.10	2.72
77	300324	旋极信息	2,529,261.58	2.72
78	002309	中利科技	2,489,799.86	2.68
79	600633	浙报传媒	2,436,431.61	2.62
80	600702	沱牌舍得	2,423,263.05	2.61
81	600511	国药股份	2,370,231.36	2.55
82	300027	华谊兄弟	2,345,147.00	2.52
83	600387	海越股份	2,272,828.00	2.45
84	000550	江铃汽车	2,269,338.87	2.44
85	600335	国机汽车	2,265,047.00	2.44
86	000006	深振业 A	2,264,902.00	2.44
87	600153	建发股份	2,262,234.00	2.43
88	600686	金龙汽车	2,223,530.81	2.39
89	300071	华谊嘉信	2,205,056.52	2.37
90	600770	综艺股份	2,204,139.60	2.37
91	600420	现代制药	2,191,622.52	2.36
92	002438	江苏神通	2,151,616.45	2.32
93	002474	榕基软件	2,123,825.85	2.29
94	600594	益佰制药	2,122,306.02	2.28
95	600135	乐凯胶片	2,100,866.82	2.26
96	601336	新华保险	2,094,112.00	2.25
97	002313	日海通讯	2,038,531.70	2.19
98	000970	中科三环	2,004,377.00	2.16
99	300001	特锐德	1,998,855.81	2.15
100	002052	同洲电子	1,951,152.00	2.10

101	601888	中国国旅	1,948,526.27	2.10
102	600166	福田汽车	1,917,823.00	2.06
103	300315	掌趣科技	1,908,882.52	2.05
104	000423	东阿阿胶	1,901,136.05	2.05

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	002570	贝因美	14,516,959.05	15.62
2	000400	许继电气	12,279,567.48	13.21
3	600199	金种子酒	11,732,206.65	12.62
4	000961	中南建设	11,185,117.69	12.03
5	300197	铁汉生态	10,704,789.52	11.52
6	300090	盛运股份	9,198,599.60	9.90
7	002325	洪涛股份	8,776,631.22	9.44
8	002244	滨江集团	8,076,729.18	8.69
9	600079	人福医药	7,919,087.17	8.52
10	002146	荣盛发展	7,835,151.18	8.43
11	002310	东方园林	7,192,112.10	7.74
12	300251	光线传媒	7,155,589.34	7.70
13	600587	新华医疗	6,691,804.56	7.20
14	000860	顺鑫农业	6,409,335.41	6.90
15	002589	瑞康医药	6,408,320.02	6.89
16	000028	国药一致	6,072,204.09	6.53
17	600312	平高电气	5,973,700.93	6.43
18	002179	中航光电	5,967,175.36	6.42
19	000049	德赛电池	5,928,398.21	6.38
20	601318	中国平安	5,906,937.22	6.36
21	300336	新文化	5,542,127.82	5.96
22	000625	长安汽车	5,517,476.83	5.94
23	600104	上汽集团	5,262,967.68	5.66
24	600073	上海梅林	5,209,105.58	5.60
25	002305	南国置业	5,190,482.08	5.58
26	002431	棕榈园林	5,184,940.72	5.58
27	600880	博瑞传播	5,093,541.01	5.48
28	601886	江河创建	5,058,337.11	5.44
29	601169	北京银行	5,034,852.73	5.42
30	300212	易华录	4,649,633.49	5.00
31	600066	宇通客车	4,576,590.31	4.92

32	300088	长信科技	4,502,229.95	4.84
33	600118	中国卫星	4,364,842.24	4.70
34	002375	亚厦股份	4,255,028.25	4.58
35	002055	得润电子	4,246,767.58	4.57
36	300115	长盈精密	4,214,392.23	4.53
37	600563	法拉电子	4,183,445.04	4.50
38	601166	兴业银行	4,045,511.24	4.35
39	300156	天立环保	4,006,836.26	4.31
40	000002	万科A	3,812,349.21	4.10
41	002123	荣信股份	3,796,282.40	4.08
42	000656	金科股份	3,701,749.68	3.98
43	600197	伊力特	3,683,783.24	3.96
44	300188	美亚柏科	3,551,777.50	3.82
45	002035	华帝股份	3,494,511.92	3.76
46	600418	江淮汽车	3,459,131.69	3.72
47	000596	古井贡酒	3,452,806.82	3.72
48	300026	红日药业	3,416,112.41	3.68
49	000550	江铃汽车	3,332,735.19	3.59
50	002620	瑞和股份	3,321,823.24	3.57
51	300110	华仁药业	3,261,538.76	3.51
52	600383	金地集团	3,256,707.38	3.50
53	600376	首开股份	3,241,547.05	3.49
54	600594	益佰制药	3,241,406.77	3.49
55	002250	联化科技	3,187,524.88	3.43
56	000963	华东医药	3,171,910.39	3.41
57	002474	榕基软件	3,162,372.42	3.40
58	002467	二六三	3,110,576.18	3.35
59	600184	光电股份	3,031,799.19	3.26
60	600340	华夏幸福	3,000,150.22	3.23
61	600316	洪都航空	2,945,803.46	3.17
62	002219	独一味	2,940,591.93	3.16
63	002273	水晶光电	2,934,832.08	3.16
64	002106	莱宝高科	2,900,833.57	3.12
65	300024	机器人	2,900,343.21	3.12
66	002663	普邦园林	2,879,595.16	3.10
67	000800	一汽轿车	2,828,611.04	3.04
68	600422	昆明制药	2,825,160.02	3.04
69	002241	歌尔声学	2,795,485.81	3.01
70	300002	神州泰岳	2,707,796.57	2.91
71	002236	大华股份	2,698,222.16	2.90
72	600335	国机汽车	2,657,385.55	2.86

73	000927	一汽夏利	2,631,419.69	2.83
74	300005	探路者	2,620,532.01	2.82
75	002309	中利科技	2,553,440.50	2.75
76	600805	悦达投资	2,550,104.53	2.74
77	002168	深圳惠程	2,508,304.91	2.70
78	600686	金龙汽车	2,500,970.84	2.69
79	600559	老白干酒	2,490,904.57	2.68
80	300048	合康变频	2,450,733.35	2.64
81	600387	海越股份	2,428,079.27	2.61
82	601788	光大证券	2,403,777.47	2.59
83	600511	国药股份	2,399,257.21	2.58
84	300324	旋极信息	2,382,379.50	2.56
85	600420	现代制药	2,365,509.49	2.55
86	600166	福田汽车	2,311,261.80	2.49
87	600153	建发股份	2,272,032.13	2.44
88	300020	银江股份	2,217,894.50	2.39
89	002438	江苏神通	2,217,490.94	2.39
90	000338	潍柴动力	2,196,706.38	2.36
91	600702	沱牌舍得	2,191,965.40	2.36
92	000006	深振业 A	2,181,285.86	2.35
93	000970	中科三环	2,140,080.07	2.30
94	600135	乐凯胶片	2,127,451.95	2.29
95	600016	民生银行	2,125,925.00	2.29
96	300001	特锐德	2,013,185.06	2.17
97	601888	中国国旅	2,013,059.68	2.17
98	002439	启明星辰	2,010,538.96	2.16
99	000423	东阿阿胶	1,942,213.22	2.09
100	600519	贵州茅台	1,939,847.56	2.09
101	002368	太极股份	1,921,041.94	2.07
102	600031	三一重工	1,860,460.08	2.00

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	526,204,971.69
卖出股票的收入（成交）总额	533,966,525.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,365,902.00	2.74
8	其他	-	-
9	合计	2,365,902.00	2.74

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110023	民生转债	22,760	2,365,902.00	2.74

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 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	117,696.20
2	应收证券清算款	323,771.59
3	应收股利	-
4	应收利息	6,379.15
5	应收申购款	690.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	448,537.75

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	300027	华谊兄弟	2,284,000.00	2.65	重大事项停牌

注：本基金本报告期末前十名股票中除华谊兄弟外不存在流通受限情况。

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
3,190	30,124.61	-	-	96,097,496.29	100.00%

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
----	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	127,255.94	0.13%
------------------	------------	-------

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	105,800,595.16
本报告期基金总申购份额	2,024,379.86
减：本报告期基金总赎回份额	11,727,478.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	96,097,496.29

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

本基金管理人总经理郁蓓华女士经 2013 年第二次股东会会议审议批准，自 2013 年 3 月起出任公司第二届董事会董事。基金管理人于 2 季度就上述事项完成向监管机关的报备。

另外，朱敏奕女士自 2013 年 3 月起出任公司职工监事。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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（特殊普通合伙），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	
国金证券有限责任公司	1	517,522,289.97	48.81%	466,467.56	48.83%	-
申银万国证券股份有限公司	1	321,533,456.98	30.33%	292,724.21	30.65%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	207,416,146.42	19.56%	183,542.86	19.21%	-
中国国际金融有限公司	1	13,699,603.32	1.29%	12,472.12	1.31%	-

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长城证券交易单元。

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
国金证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	2,559,543.70	100.00%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-

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混合型证券投资基金招募说明书更新正文（2012年第2号）	公司网站	2013-1-18
2	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更新摘要（2012年第2号）	报刊及公司网站	2013-1-18
3	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2012年第4季度报告	报刊及公司网站	2013-1-22
4	关于旗下部分基金参加浦发银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-1-30
5	浦银安盛基金管理有限公司关于独立董事	报刊及公司网站	2013-2-6

	变更的公告		
6	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	报刊及公司网站	2013-3-28
7	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（正文）	公司网站	2013-3-30
8	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）	报刊及公司网站	2013-3-30
9	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2013年第1季度报告	报刊及公司网站	2013-4-20
10	浦银安盛基金管理有限公司关于郁蓓华董事任职的公告	报刊及公司网站	2013-6-25
11	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2013-6-25
12	关于旗下部分基金在好买基金销售开通定期定额投资业务并参加定期定额费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-6-28
13	关于旗下部分基金在上海证券推出定期定额投资业务并参加网上申购费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2013-6-28

11 备查文件目录

11.1 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

11.2 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。

11.3 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
二〇一三年八月二十七日