

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2014年半年度报告

2014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

送出日期：2014年8月26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2014年8月22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2014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	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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的说明	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	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	15
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	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49

10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8	其他重大事件	51
§11	影响投资者决策的其他重要信息	53
§12	备查文件目录	53
12.1	备查文件目录	54
12.2	存放地点	54
12.3	查阅方式	54

§ 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	75,870,315.88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</p>

	<p>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
	联系电话	021-23212888
	电子邮箱	compliance@py-axa.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（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	7,805,392.09
本期利润	12,284,054.94
加权平均基金份额本期利润	0.1535
本期加权平均净值利润率	14.17%
本期基金份额净值增长率	13.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	9,644,066.41
期末可供分配基金份额利润	0.1271
期末基金资产净值	85,514,382.29
期末基金份额净值	1.127
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	18.86%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

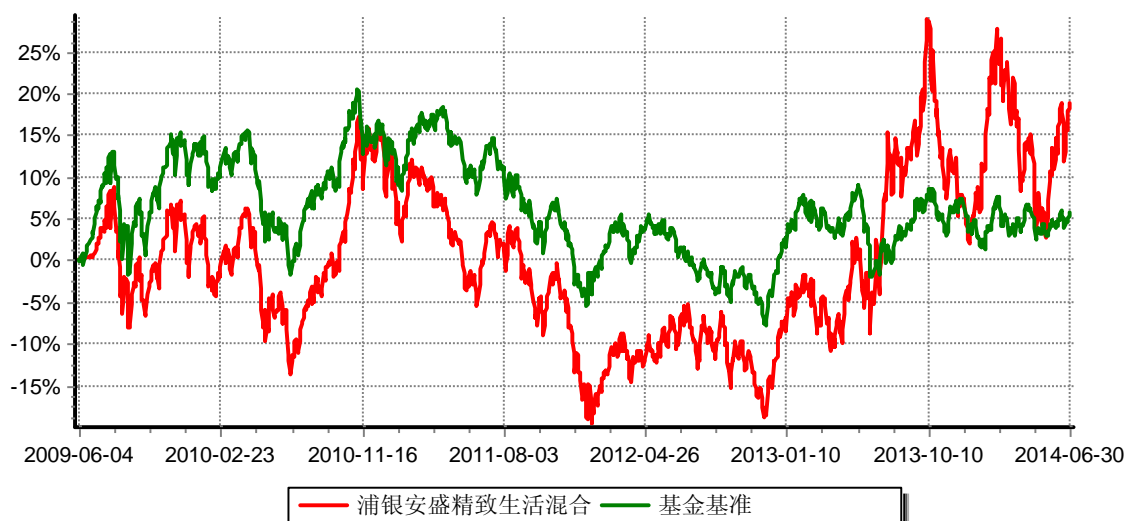
3.2 基金净值表现

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	7.03%	1.56%	1.34%	0.46%	5.69%	1.10%
过去三个月	9.74%	1.51%	2.23%	0.50%	7.51%	1.01%
过去六个月	13.04%	1.65%	0.97%	0.59%	12.07%	1.06%
过去一年	25.50%	1.68%	7.30%	0.65%	18.20%	1.03%
过去三年	18.51%	1.38%	-5.32%	0.73%	23.83%	0.65%
自基金合同生效日起至今	18.86%	1.30%	5.81%	0.80%	13.05%	0.50%

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-2014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2.8亿元，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2014年6月30日止，浦银安盛旗下共管理16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、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、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金和浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金。

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）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、浦银安盛新兴产业混合基金基金经理以及浦银安盛消费升级混合基金基金经理	2011年5月5日	—	7	吴勇先生, 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研究员, 2009年8月起担任浦银安盛精致生活混合基金基金经理助理。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日起兼任浦银安盛新兴产业混合基金基金经理。2013年12月4日起兼任浦银安盛消费升级混合基金基金经理。
王爽	公司旗下权益类基金基金经理	2013年2月1日	—	6	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

	理助理				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,担任公司旗下权益类基金基金经理助理。
褚艳辉	浦银安盛盛世精选混合基金经理,公司旗下权益类基金前任基金经理助理	2013年2月1日	2014年6月25日	10	褚艳辉先生,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担任投资经理助理之职。2011年4月起加盟我司担任高级行业研究员。2013年2月至2014年6月,担任本公司权益类基金基金经理助理。2014年6月起,担任浦银安盛盛世精选混合基金基金经理。

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

2014年上半年国内经济政策主要体现在稳增长和调结构--经济增速保持稳定，更重视经济增长的质量。传统周期性行业由于产能过剩等因素，缺乏业绩弹性；而以信息安全、移动支付等为代表的新兴产业受益于经济结构转型，具有较好的发展前景。从货币政策的角度来看，央行定调2014年M2的增速大约13%左右，另外由于金融机构减少了资产和负债的久期错配，因此货币总体保持相对宽松的状态，对资本市场较为有利。

基于以上的判断，本基金在上半年保持了信息服务、传媒、通信等行业的超配，对传统周期性行业保持低配的状态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年上半年净值表现高于比较基准，报告期内基金净值增长率为13.04%，基准收益率为0.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新一届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，我们看好未来中国资本市场的表现。

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。

本基金本报告期内未进行利润分配，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：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,030,590.20	17,608,603.15
结算备付金		446,919.07	2,101,474.03
存出保证金		76,324.54	110,129.63
交易性金融资产	6.4.7.2	68,715,857.71	72,667,842.63
其中：股票投资		68,715,857.71	72,667,842.63
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
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		12,002,664.99	2,446,702.99
应收利息	6.4.7.5	3,453.97	4,920.02
应收股利		—	—
应收申购款		33,701.40	7,202.06
递延所得税资产		—	—

其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		86,309,511.88	94,946,874.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		—	1,612,269.16
应付赎回款		291,876.66	154,249.54
应付管理人报酬		101,573.10	121,343.01
应付托管费		16,928.89	20,223.85
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	235,416.68	990,037.34
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	149,334.26	316,160.32
负债合计		795,129.59	3,214,283.22
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	75,870,315.88	91,962,726.96
未分配利润	6.4.7.10	9,644,066.41	-230,135.67
所有者权益合计		85,514,382.29	91,732,591.29
负债和所有者权益总计		86,309,511.88	94,946,874.51

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.127元，基金份额总额75,870,315.88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：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		14,368,895.87	4,779,497.83
1.利息收入		111,758.65	82,400.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,067.47	80,549.33
债券利息收入		28,010.96	1,850.87
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		15,680.22	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,739,690.37	11,953,546.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,455,258.90	11,550,730.89
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	43,792.73	7,449.88
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—	—
股利收益	6.4.7.16	240,638.74	395,365.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,478,662.85	-7,257,669.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	38,784.00	1,220.66
减：二、费用		2,084,840.93	2,561,135.63
1. 管理人报酬		647,208.14	678,739.35
2. 托管费		107,868.08	113,123.22

3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.19	1,166,079.19	1,609,780.54
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.20	163,685.52	159,492.52
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		12,284,054.94	2,218,362.20
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		12,284,054.94	2,218,362.20

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：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014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)	91,962,726.96	-230,135.67	91,732,591.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	12,284,054.94	12,284,054.94
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)	-16,092,411.08	-2,409,852.86	-18,502,263.94
其中：1.基金申购款	12,314,370.90	1,306,950.23	13,621,321.13
2.基金赎回款	-28,406,781.98	-3,716,803.09	-32,123,585.07
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)	75,870,315.88	9,644,066.41	85,514,382.29

项 目	上年度可比期间 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

报表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：

郁蓓华

郁蓓华

钱琨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

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2014年1月1日至2014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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014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》、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 2014年6月30日
活期存款	5,030,590.20
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	5,030,590.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	63,453,120.20	68,715,857.71	5,262,737.51

贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
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		63,453,120.20	68,715,857.71	5,262,737.51

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 2014年6月30日
应收活期存款利息	3,241.87
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	181.23
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	30.87

合计	3,453.97
----	----------

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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	235,416.68
银行间市场应付交易费用	—
合计	235,416.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	566.74
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	119,014.74
合计	149,334.26

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	91,962,726.96	91,962,726.96
本期申购	12,314,370.90	12,314,370.90
本期赎回（以“-”号填列）	-28,406,781.98	-28,406,781.98
本期末	75,870,315.88	75,870,315.88

注：申购含红利再投、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	12,423,692.50	-12,653,828.17	-230,135.67
本期利润	7,805,392.09	4,478,662.85	12,284,054.94
本期基金份额交易产生的变动数	-3,968,323.77	1,558,470.91	-2,409,852.86
其中：基金申购款	2,801,821.69	-1,494,871.46	1,306,950.23
基金赎回款	-6,770,145.46	3,053,342.37	-3,716,803.09
本期已分配利润	—	—	—
本期末	16,260,760.82	-6,616,694.41	9,644,066.41

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	60,229.75
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	6,924.15
其他	913.57
合计	68,067.47

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	388,223,182.37
减：卖出股票成本总额	378,767,923.47
买卖股票差价收入	9,455,258.90

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	10,285,248.90
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	9,984,689.05
减：应收利息总额	256,767.12
债券投资收益	43,792.73

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	240,638.74

基金投资产生的股利收益	—
合计	240,638.74

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	4,478,662.85
——股票投资	4,478,662.85
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	4,478,662.85

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	22,287.23
转换费收入	521.67
其他	15,975.10
合计	38,784.00

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,165,729.19
银行间市场交易费用	350.00
合计	1,166,079.19

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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	2,518.00
债券帐户维护费	12,000.00
其他费用	400.00
合计	163,685.52

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**

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的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	基金托管人、基金代销机构

银行)	
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

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 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 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 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	647,208.14	678,739.35
其中：支付销售机构的客户维护费	155,342.97	157,308.58

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% ÷ 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6 月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6 月30日	
	当期发生的基金应支付的托 管费	107,868.08		113,123.22

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 股份有限公司	5,030,590.20	60,229.75	16,354,358.77	71,385.45

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进行利润分配。

6.4.12 期末（2014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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
603328	依顿电子	2014-06-23	2014-07-01	非公开发行	15.31	15.31	1,000	15,310	15,310

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	期末成本总额	期末估值总额
002502	骅威股份	2014-05-14	重大事项停牌	12.83	2014-07-28	14.11	20,424	238,699.56	262,039.92
300025	华星创业	2014-06-16	重大事项停牌	15.64	2014-07-23	14.51	144,792	2,016,779.96	2,264,546.88
300050	世纪鼎利	2014-05-30	重大事项停牌	17.78	2014-07-30	19.56	10,352	159,673.24	184,058.56
300271	华宇软件	2014-06-27	重大事项停牌	40.30		—	8,000	246,624.02	322,400.00
300295	三六五网	2014-04-11	重大事项停牌	96.81	2014-07-08	105.00	10,000	1,008,877.96	968,100.00
300369	绿盟科技	2014-06-26	重大事项停牌	61.27		—	7,574	360,122.07	464,058.98
300379	东方通	2014-06-23	重大事项停牌	62.17	2014-08-15	67.39	39,554	2,464,807.74	2,459,072.18
000547	闽福发A	2014-04-17	重大事项停牌	6.05		—	20,000	105,600.00	121,000.00
300166	东方国信	2014-04-09	重大事项停牌	19.88	2014-07-09	20.58	19,498	364,863.64	387,620.24

注：本基金截至2014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

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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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%。本基金投资于资产支持证券的比例遵从法律法规及监管机构的规定。如果法律法规对投资组合比例的规定有变更的，本基金投资范围在履行相应程序后将及时做出相应调整，以调整变更后的比例为准。

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限定的范围之内，谋求实现基金财产的安全和增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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发行的证券不得超过该证券的10%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于2014年06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%(2013年12月31日：0%)。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于2014年06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%(2013年12月31日：0%)。

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、组合在短时间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

金额单位：人民币元

本期末 2014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	5,030,590.20	—	—	—	5,030,590.20
结算备付金	446,919.07	—	—	—	446,919.07
存出保证金	76,324.54	—	—	—	76,324.54
证券清算款	—	—	—	12,002,664.99	12,002,664.99
交易性金融资产	—	—	—	68,715,857.71	68,715,857.71
买入返售金融资产	—	—	—	—	—
应收股利	—	—	—	—	—
应收利息	—	—	—	3,453.97	3,453.97
应收申购款	—	—	—	33,701.40	33,701.40
其他应收款	—	—	—	—	—
待摊费用	—	—	—	—	—
其他资产	—	—	—	—	—
资产总计	5,553,833.81	—	—	80,755,678.07	86,309,511.88
负债					
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—
应付证券清算款	—	—	—	—	—
应付赎回款	—	—	—	291,876.66	291,876.66
应付赎回费	—	—	—	566.74	566.74
应付管理人报酬	—	—	—	101,573.10	101,573.10
应付托管费	—	—	—	16,928.89	16,928.89
应付销售服务	—	—	—	—	—

费					
应付交易费用	—	—	—	235,416.68	235,416.68
应交税费	—	—	—	—	—
应付利息	—	—	—	—	—
应付收益	—	—	—	—	—
其他应付款	—	—	—	—	—
预提费用	—	—	—	148,767.52	148,767.52
其他负债	—	—	—	—	—
负债总计	—	—	—	795,129.59	795,129.59
利率敏感度缺口	5,553,833.81	—	—	79,960,548.48	85,514,382.29
上年度末 2013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	17,608,603.15	—	—	—	17,608,603.15
结算备付金	2,101,474.03	—	—	—	2,101,474.03
存出保证金	110,129.63	—	—	—	110,129.63
证券清算款	—	—	—	2,446,702.99	2,446,702.99
交易性金融资产	—	—	—	72,667,842.63	72,667,842.63
买入返售金融资产	—	—	—	—	—
应收股利	—	—	—	—	—
应收利息	—	—	—	4,920.02	4,920.02
应收申购款	—	—	—	7,202.06	7,202.06
其他应收款	—	—	—	—	—
待摊费用	—	—	—	—	—
其他资产	—	—	—	—	—

资产总计	19,820,206.81	—	—	75,126,667.70	94,946,874.51
负债					
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—
应付证券清算款	—	—	—	1,612,269.16	1,612,269.16
应付赎回款	—	—	—	154,249.54	154,249.54
应付赎回费	—	—	—	185.22	185.22
应付管理人报酬	—	—	—	121,343.01	121,343.01
应付托管费	—	—	—	20,223.85	20,223.85
应付销售服务费	—	—	—	—	—
应付交易费用	—	—	—	990,037.34	990,037.34
应交税费	—	—	—	—	—
应付利息	—	—	—	—	—
应付收益	—	—	—	—	—
其他应付款	—	—	—	15,975.10	15,975.10
预提费用	—	—	—	300,000.00	300,000.00
其他负债	—	—	—	—	—
负债总计	—	—	—	3,214,283.22	3,214,283.22
利率敏感度缺口	19,820,206.81	—	—	71,912,384.48	91,732,591.29

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2014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%(2013年12月31日为0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无影响(2013年12月31日:同)。

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%。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，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 2014年6月30日		上年度末 2013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	68,715,857.71	80.36	72,667,842.63	79.22
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	68,715,857.71	80.36	72,667,842.63	79.22

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：人民币元）	
		本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	业绩比较基准上升5%	8,568,478.26	7,119,933.79
	业绩比较基准下降5%	-8,568,478.26	-7,119,933.79

§ 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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	68,715,857.71	79.62
	其中：股票	68,715,857.71	79.62
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	5,477,509.27	6.35
7	其他各项资产	12,116,144.90	14.04
8	合计	86,309,511.88	100.00

7.2 报告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（元）	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	26,999,393.30	31.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	35,026,968.52	40.96
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	6,054,995.89	7.08
S	综合	634,500.00	0.74
	合计	68,715,857.71	80.36

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300047	天源迪科	632,833	8,283,783.97	9.69
2	300339	润和软件	297,885	5,421,507.00	6.34
3	000938	紫光股份	194,998	4,976,348.96	5.82
4	300223	北京君正	144,236	4,735,267.88	5.54
5	300043	互动娱乐	195,000	3,615,300.00	4.23
6	300336	新文化	131,280	3,523,555.20	4.12

7	300378	鼎捷软件	120,860	3,202,790.00	3.75
8	300379	东方通	39,554	2,459,072.18	2.88
9	300188	美亚柏科	120,500	2,441,330.00	2.85
10	300025	华星创业	144,792	2,264,546.88	2.65
11	000673	当代东方	145,000	2,117,000.00	2.48
12	002329	皇氏乳业	105,450	1,736,761.50	2.03
13	300083	劲胜精密	78,719	1,705,053.54	1.99
14	002108	沧州明珠	125,000	1,583,750.00	1.85
15	600584	长电科技	165,000	1,456,950.00	1.70
16	600536	中国软件	66,000	1,419,000.00	1.66
17	002354	科冕木业	30,000	1,320,000.00	1.54
18	002197	证通电子	79,950	1,246,420.50	1.46
19	300300	汉鼎股份	40,000	1,063,600.00	1.24
20	002368	太极股份	31,750	1,063,307.50	1.24
21	300168	万达信息	53,364	979,229.40	1.15
22	300295	三六五网	10,000	968,100.00	1.13
23	002174	游族网络	15,000	825,450.00	0.97
24	300371	汇中股份	27,356	702,228.52	0.82
25	002439	启明星辰	29,802	637,464.78	0.75
26	600149	廊坊发展	50,000	634,500.00	0.74
27	600571	信雅达	31,079	605,729.71	0.71
28	300038	梅泰诺	30,600	539,478.00	0.63
29	002117	东港股份	30,000	519,000.00	0.61
30	002474	榕基软件	60,000	517,800.00	0.61
31	300299	富春通信	39,980	512,543.60	0.60
32	300010	立思辰	20,000	498,400.00	0.58
33	300369	绿盟科技	7,574	464,058.98	0.54
34	300020	银江股份	13,486	412,671.60	0.48
35	300166	东方国信	19,498	387,620.24	0.45
36	300291	华录百纳	11,000	385,990.00	0.45

37	300296	利亚德	23,000	381,340.00	0.45
38	300352	北信源	17,476	373,986.40	0.44
39	002185	华天科技	33,300	372,294.00	0.44
40	002281	光迅科技	10,000	343,900.00	0.40
41	300271	华宇软件	8,000	322,400.00	0.38
42	300177	中海达	20,000	311,000.00	0.36
43	002502	骅威股份	20,424	262,039.92	0.31
44	300085	银之杰	12,000	207,720.00	0.24
45	002268	卫士通	5,400	200,070.00	0.23
46	300050	世纪鼎利	10,352	184,058.56	0.22
47	300269	联建光电	5,068	174,491.24	0.20
48	000547	闽福发 A	20,000	121,000.00	0.14
49	002609	捷顺科技	8,008	115,635.52	0.14
50	002412	汉森制药	2,119	31,509.53	0.04
51	002699	美盛文化	1,657	28,450.69	0.03
52	300131	英唐智控	1,987	24,499.71	0.03
53	300229	拓尔思	786	20,278.80	0.02
54	603328	依顿电子	1,000	15,310.00	0.02
55	300104	乐视网	6	263.40	—

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	000938	紫光股份	11,871,767.22	12.94
2	300269	联建光电	9,475,837.49	10.33
3	300378	鼎捷软件	7,225,972.17	7.88
4	300047	天源迪科	7,205,633.89	7.86
5	300358	楚天科技	6,331,054.90	6.90
6	600767	运盛实业	6,097,143.46	6.65

7	300293	蓝英装备	6,054,121.84	6.60
8	300052	中青宝	5,630,817.75	6.14
9	300223	北京君正	5,335,349.20	5.82
10	300130	新国都	5,186,579.40	5.65
11	300339	润和软件	5,124,992.78	5.59
12	300295	三六五网	4,963,150.56	5.41
13	002197	证通电子	4,854,172.20	5.29
14	300371	汇中股份	4,830,034.08	5.27
15	600446	金证股份	4,755,968.47	5.18
16	300020	银江股份	4,680,298.50	5.10
17	002699	美盛文化	4,641,368.40	5.06
18	000681	远东股份	4,635,692.58	5.05
19	300336	新文化	4,388,356.02	4.78
20	600633	浙报传媒	4,272,308.57	4.66
21	600571	信雅达	4,270,061.38	4.65
22	300155	安居宝	4,237,916.60	4.62
23	002712	思美传媒	4,061,846.67	4.43
24	002261	拓维信息	3,878,128.64	4.23
25	002235	安妮股份	3,876,322.79	4.23
26	002231	奥维通信	3,844,868.25	4.19
27	300379	东方通	3,806,756.30	4.15
28	002502	骅威股份	3,777,973.34	4.12
29	300166	东方国信	3,672,545.12	4.00
30	002635	安洁科技	3,616,700.20	3.94
31	002609	捷顺科技	3,546,468.90	3.87
32	002329	皇氏乳业	3,536,905.00	3.86
33	000766	通化金马	3,433,639.30	3.74
34	300357	我武生物	3,320,925.90	3.62
35	000558	莱茵置业	3,301,393.40	3.60
36	300043	互动娱乐	3,180,143.02	3.47

37	300016	北陆药业	3,154,289.14	3.44
38	603308	应流股份	2,963,301.76	3.23
39	300359	全通教育	2,927,690.70	3.19
40	002675	东诚药业	2,858,552.10	3.12
41	300301	长方照明	2,781,237.00	3.03
42	600149	廊坊发展	2,777,197.00	3.03
43	002148	北纬通信	2,755,328.03	3.00
44	300229	拓尔思	2,754,956.52	3.00
45	002439	启明星辰	2,749,389.70	3.00
46	300113	顺网科技	2,722,570.40	2.97
47	300025	华星创业	2,693,552.68	2.94
48	300252	金信诺	2,639,314.21	2.88
49	002421	达实智能	2,552,688.35	2.78
50	002181	粤传媒	2,535,667.21	2.76
51	300263	隆华节能	2,508,537.28	2.73
52	300079	数码视讯	2,490,590.00	2.72
53	300188	美亚柏科	2,433,012.30	2.65
54	002348	高乐股份	2,374,667.00	2.59
55	300032	金龙机电	2,354,982.38	2.57
56	300291	华录百纳	2,352,188.36	2.56
57	300232	洲明科技	2,319,486.44	2.53
58	002663	普邦园林	2,287,210.00	2.49
59	002555	顺荣股份	2,264,908.46	2.47
60	600536	中国软件	2,258,894.80	2.46
61	002315	焦点科技	2,245,698.10	2.45
62	300150	世纪瑞尔	2,213,433.92	2.41
63	002368	太极股份	2,163,805.08	2.36
64	300368	汇金股份	2,146,642.00	2.34
65	600158	中体产业	2,132,882.87	2.33
66	002104	恒宝股份	2,126,079.00	2.32

67	300289	利德曼	2,102,010.66	2.29
68	002354	科冕木业	2,098,576.00	2.29
69	300101	振芯科技	2,096,870.00	2.29
70	300178	腾邦国际	2,088,571.32	2.28
71	000673	当代东方	2,087,275.96	2.28
72	002373	千方科技	2,001,093.17	2.18
73	300090	盛运股份	1,889,085.00	2.06
74	002268	卫士通	1,877,203.01	2.05
75	300332	天壕节能	1,863,085.36	2.03

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	300269	联建光电	10,978,753.18	11.97
2	300358	楚天科技	6,557,877.42	7.15
3	300052	中青宝	5,886,447.04	6.42
4	002242	九阳股份	5,786,692.36	6.31
5	300293	蓝英装备	5,619,667.76	6.13
6	000681	远东股份	5,475,155.47	5.97
7	000938	紫光股份	5,394,846.86	5.88
8	300295	三六五网	5,386,361.42	5.87
9	300074	华平股份	5,329,630.05	5.81
10	002235	安妮股份	5,147,739.65	5.61
11	600446	金证股份	4,865,129.30	5.30
12	600767	运盛实业	4,838,851.65	5.27
13	300183	东软载波	4,818,107.94	5.25
14	300130	新国都	4,808,522.35	5.24
15	002699	美盛文化	4,763,452.39	5.19
16	300020	银江股份	4,679,644.77	5.10

17	002197	证通电子	4,533,911.51	4.94
18	002514	宝馨科技	4,379,847.08	4.77
19	300378	鼎捷软件	4,281,471.75	4.67
20	600633	浙报传媒	4,171,661.08	4.55
21	300371	汇中股份	4,169,686.59	4.55
22	002261	拓维信息	4,047,397.61	4.41
23	300155	安居宝	4,041,313.37	4.41
24	300166	东方国信	3,983,526.92	4.34
25	002609	捷顺科技	3,934,898.37	4.29
26	600315	上海家化	3,898,143.36	4.25
27	002400	省广股份	3,873,309.78	4.22
28	002396	星网锐捷	3,852,861.53	4.20
29	002635	安洁科技	3,819,990.49	4.16
30	002229	鸿博股份	3,664,374.47	3.99
31	600571	信雅达	3,661,447.10	3.99
32	002712	思美传媒	3,650,343.48	3.98
33	002178	延华智能	3,453,423.45	3.76
34	002431	棕榈园林	3,424,031.18	3.73
35	002231	奥维通信	3,401,724.26	3.71
36	000766	通化金马	3,311,490.69	3.61
37	000558	莱茵置业	3,293,168.42	3.59
38	002502	骅威股份	3,149,396.01	3.43
39	603308	应流股份	3,126,904.26	3.41
40	300357	我武生物	3,122,805.42	3.40
41	300197	铁汉生态	3,091,640.46	3.37
42	300359	全通教育	3,062,242.90	3.34
43	300252	金信诺	2,925,960.62	3.19
44	002663	普邦园林	2,852,099.79	3.11
45	300131	英唐智控	2,822,820.30	3.08
46	002570	贝因美	2,782,178.85	3.03

47	300079	数码视讯	2,773,788.69	3.02
48	002117	东港股份	2,769,891.33	3.02
49	600158	中体产业	2,752,768.94	3.00
50	300113	顺网科技	2,740,216.34	2.99
51	300229	拓尔思	2,688,756.28	2.93
52	300301	长方照明	2,684,534.35	2.93
53	002148	北纬通信	2,664,238.55	2.90
54	300077	国民技术	2,650,863.97	2.89
55	002181	粤传媒	2,649,121.22	2.89
56	300016	北陆药业	2,617,120.21	2.85
57	300032	金龙机电	2,592,415.04	2.83
58	002555	顺荣股份	2,579,765.99	2.81
59	002185	华天科技	2,546,004.86	2.78
60	002421	达实智能	2,522,303.28	2.75
61	300222	科大智能	2,495,810.45	2.72
62	300232	洲明科技	2,465,355.97	2.69
63	300026	红日药业	2,458,760.46	2.68
64	002439	启明星辰	2,429,011.92	2.65
65	600149	廊坊发展	2,415,967.78	2.63
66	600261	阳光照明	2,408,008.18	2.63
67	002675	东诚药业	2,388,110.54	2.60
68	300101	振芯科技	2,299,505.18	2.51
69	300291	华录百纳	2,270,992.63	2.48
70	300150	世纪瑞尔	2,206,214.83	2.41
71	300315	掌趣科技	2,155,925.17	2.35
72	600563	法拉电子	2,101,674.08	2.29
73	300178	腾邦国际	2,098,644.01	2.29
74	300289	利德曼	2,091,299.46	2.28
75	002348	高乐股份	2,075,625.75	2.26
76	000418	小天鹅A	2,068,069.23	2.25

77	002104	恒宝股份	2,064,858.67	2.25
78	002329	皇氏乳业	2,012,632.15	2.19
79	002315	焦点科技	1,990,161.23	2.17
80	600845	宝信软件	1,972,554.20	2.15
81	002268	卫士通	1,953,094.16	2.13
82	300263	隆华节能	1,950,076.18	2.13
83	300010	立思辰	1,890,304.06	2.06
84	300054	鼎龙股份	1,870,591.26	2.04
85	300090	盛运股份	1,857,792.63	2.03
86	300368	汇金股份	1,849,796.35	2.02

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	370,337,275.70
卖出股票的收入（成交）总额	388,223,182.37

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序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序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1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内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2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。

7.12.3 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	76,324.54
2	应收证券清算款	12,002,664.99
3	应收股利	—
4	应收利息	3,453.97
5	应收申购款	33,701.40
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	12,116,144.90

7.12.4 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。

7.12.5 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	300379	东方通	2,459,072.18	2.88	停牌或网下申购锁定期
2	300025	华星创业	2,264,546.88	2.65	停牌或网下申购锁定期

注：本基金本报告期末前十名股票中除东方通和华星创业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
3,031	25,031.45	3,530.54	0.005%	75,866,785.34	99.995%

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	63,097.46	0.08%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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	91,962,726.96
本报告期基金总申购份额	12,314,370.90
减：本报告期基金总赎回份额	28,406,781.98
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	75,870,315.88

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人2014年2月7日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	1	435,161,007.59	57.38%	396,171.06	57.38%	—
国泰君安	1	229,811,035.32	30.30%	209,220.39	30.30%	—
东方证券	1	87,486,913.45	11.54%	79,647.55	11.53%	—
申银万国	1	5,983,666.71	0.79%	5,447.44	0.79%	—
中金	1	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
国都证券	1	—	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—	—
中国中投	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：

本基金本报告期内无租用证券公司交易的单元变动情况。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
国金证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	56,000,000.00	100.00%	—	—
中金	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
国都证券	—	—	—	—	—	—
国联证券	—	—	—	—	—	—
中国中投	—	—	—	—	—	—

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	关于增加注册资本及修改公司章程的公告	报刊及公司网站	2014-01-04
2	关于旗下部分基金新增北京增财基金销售为代销机构并开通定投业务和参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2014-01-10
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更新摘要（2013年第2号）	报刊及公司网站	2014-01-16
4	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（2013年第2号）	公司网站	2014-01-16

5	关于旗下部分基金在上海银行开通定期定额投资及基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2014-01-17
6	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2013年第4季度报告	报刊及公司网站	2014-01-21
7	关于旗下基金在数米基金开通定投、转换以及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2014-02-14
8	关于旗下部分基金在数米基金调整基金转换申购补差费率优惠方式的公告	报刊及公司网站	2014-02-14
9	关于参加同花顺基金申购费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2014-02-14
10	关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为代销机构并开通定投和转换业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2014-02-14
11	关于旗下部分基金在银河证券开通定投业务和参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2014-02-14
12	关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	报刊及公司网站	2014-03-13
13	关于旗下基金投资中小企业私募债券的公告	报刊及公司网站	2014-03-18
14	关于旗下部分基金在交通银行开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2014-03-21
15	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2013年年度报告摘要	报刊及公司网站	2014-03-27
16	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2013年年度报告(正文)	公司网站	2014-03-27

17	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银消费升级基金和浦银日日盈货币市场基金在浦发银行开通基金转换业务的公告	报刊及公司网站	2014-04-04
18	浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2014年第1季度报告(全文)	报刊及公司网站	2014-04-22
19	浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告	报刊及公司网站	2014-04-25
20	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2014-04-26
21	关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及公司网站	2014-04-29
22	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	2014-04-29
23	浦银安盛关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2014-06-07
24	关于旗下部分基金新增东北证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务的公告	报刊及公司网站	2014-06-10

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2014年1月4日发布《关于增加注册资本及修改公司章程的公告》，披露基金管理人注册资本增至28,000万元人民币并据此修改了公司章程。

本基金管理人于2014年4月25日发布《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》，披露公司第三届董事会成员情况，其中新增霍佳震先生、董叶顺先生为公司独立董事，新增汪素南先生为公司董事，原董事林道峰先生、独立董事谢百三先生不再连任。

§ 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

二〇一四年八月二十六日