

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2014年年度报告摘要

2014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

送出日期：2015年3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2015年3月24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2014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	47,919,484.64
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</p>

	<p>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	<p>中信标普A股综合指数×55%+中信标普全债指数×45%</p>
风险收益特征	<p>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。</p>

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	12,906,580.29	15,807,210.53	-5,172,361.28
本期利润	12,885,146.68	9,847,598.77	7,776,078.37
加权平均基金份额本期利润	0.1822	0.1010	0.0709
本期基金份额净值增长率	11.74%	13.55%	8.80%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.1143	-0.0025	-0.1215
期末基金资产净值	53,395,018.88	91,732,591.29	92,942,075.98
期末基金份额净值	1.114	0.997	0.878

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
过去三个月	-8.61%	1.45%	15.10%	0.80%	-23.71%	0.65%
过去六个月	-1.15%	1.20%	28.51%	0.66%	-29.66%	0.54%
过去一年	11.74%	1.43%	29.76%	0.63%	-18.02%	0.80%
过去三年	38.04%	1.40%	40.62%	0.71%	-2.58%	0.69%
过去五年	12.75%	1.29%	19.47%	0.75%	-6.72%	0.54%
自基金合同生效起至今	17.49%	1.29%	35.98%	0.79%	-18.49%	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12月31日)



3.2.3 过去五年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



注：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

本基金过去三年未进行过利润分配。

§ 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，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产管理有限公司，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12月31日止，浦银安盛旗下共管理17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证券投资基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金及浦银安盛月月盈安心养老定期支付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了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（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, 公司旗下浦银安盛红利精选股票基金、浦银安盛精致生活混合基金、浦银安盛新兴产业混合基金、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, 上海交通大学材料工程系学士, 上海交通大学工商管理硕士, CPA, CFA, 中国注册造价师。1993年8月至2007年8月先后就职于上海电力建设有限责任公司任预算主管、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先后担任行业研究员、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月起兼任浦银安盛精致生活混合基金基金经理。2013年3月起, 兼任浦银安盛战略新兴产业混合基金基金经理。2013年12月起兼任浦银安盛消费升级股票基金基金经理。2012年11月起兼任本公司权益投资部总监。
陈蔚丰	本公司旗下权益类基金基金经理助理	2014年7月1日	—	6	陈蔚丰女士, 南京大学生物学硕士。2008年2月至2010年11月在江苏瑞华投资发展有限公司担任行业研究员。2010年11月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任行业研究员之职。

					<p>2013年2月, 提拔至高级研究员, 先后负责过医药、煤炭、旅游、计算机等行业及上市公司的研究。</p> <p>2014年7月, 陈蔚丰女士调转至权益投资部, 担任公司旗下股票基金经理助理。</p>
王爽	原权益类基金经理助理	2013年2月1日	2014年7月31日	6	<p>王爽女士, 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管理有限公司担任行业研究员之职。2013年2月起, 担任本公司权益类基金基金经理助理。2014年8月起, 调转至专户管理部担任投资经理。</p>
褚艳辉	原权益类基金经理助理	2013年2月1日	2014年6月25日	10	<p>褚艳辉先生, 南京理工大学经济学硕士。2004年至2010年, 先后就职于上海信息中心、爱建证券公司从事宏观经济、政策以及制造与消费行业研究工作, 后在上海汽车财务公司担任投资经理助理之职。2011年4月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, 担任公司旗下浦银安盛盛世</p>

					精选混合基金基金经理。 2014年7月起,兼任公司旗下浦银安盛新经济结构混合基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。分析如发现有涉嫌不公平的交易，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，本基金管理人根据《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年国内经济总体表现平稳，GDP增速维持在7-7.5%之间，但工业企业利润增速下滑较多，显示国内传统行业过剩产能状况依然突出。政府推出了高铁、一路一带等走出去项目，期望以国外市场消化国内产能，由此带动了传统基建行业较好的预期行情。从货币政策来看，央行在2014年末降息一次，释放了保持较为宽松货币政策的预期。由于利率市场化进程的推进，市场总体资金成本可能保持相对稳定，但银行业的利差缩减未来可能是大概率事件。总体来看，国内经济的可持续发展还是需要经济结构的转型，因此，新兴产业、消费等行业的发展前景还是值得期待的。

本基金全年总体超配了信息技术、通信、电力设备、医药等行业，对传统的金融、煤炭、钢铁等行业保持低配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本年度净值表现低于比较基准，报告期内基金净值增长率为11.74%，基准收益率为29.76%。

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2015年，国内政治经济结构决定了国内经济不会大起大落，货币政策可能保持在适度宽松的状态，但房地产市场和传统行业的需求低迷可能对相关行业形成较大的压制，因此，未来还是重点看好新兴产业和消费行业。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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合规守信、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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对浦银安盛基金管理有限公司浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金2014年12月31日的资产负债表，2014年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见(普华永道中天审字(2015)第20453号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§ 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：2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	12,148,758.63	17,608,603.15
结算备付金		699,565.72	2,101,474.03
存出保证金		63,481.58	110,129.63
交易性金融资产	7.4.7.2	42,665,722.61	72,667,842.63
其中：股票投资		42,665,722.61	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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		653,365.62	2,446,702.99
应收利息	7.4.7.5	2,846.38	4,920.02
应收股利		—	—
应收申购款		23,006.53	7,202.06
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		56,256,747.07	94,946,874.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		1,677,138.23	1,612,269.16
应付赎回款		266,978.18	154,249.54
应付管理人报酬		76,353.44	121,343.01
应付托管费		12,725.56	20,223.85
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	528,481.87	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	7.4.7.8	300,050.91	316,160.32
负债合计		2,861,728.19	3,214,283.22
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	47,919,484.64	91,962,726.96

未分配利润	7.4.7.10	5,475,534.24	-230,135.67
所有者权益合计		53,395,018.88	91,732,591.29
负债和所有者权益总计		56,256,747.07	94,946,874.51

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.114元，基金份额总额47,919,484.64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：2014年1月1日-2014年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年12月31日
一、收入		17,396,514.78	15,999,092.31
1.利息收入		194,937.24	181,248.79
其中：存款利息收入	7.4.7.11	128,176.16	173,593.68
债券利息收入		28,010.96	4,064.14
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		38,750.12	3,590.97
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,163,932.09	21,760,163.70
其中：股票投资收益	7.4.7.12	16,834,628.76	21,284,202.39
基金投资收益	7.4.7.13		
债券投资收益	7.4.7.14	43,792.73	78,129.86
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.3	—	—
贵金属投资收益	7.4.7.15	—	—
衍生工具收益	7.4.7.16	—	—
股利收益	7.4.7.17	285,510.60	397,831.45
3.公允价值变动收益（损失以	7.4.7.18	-21,433.61	-5,959,611.76

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.19	59,079.06	17,291.58
减: 二、费用		4,511,368.10	6,151,493.54
1. 管理人报酬		1,188,576.75	1,428,824.97
2. 托管费		198,096.20	238,137.48
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.20	2,801,645.73	4,162,868.10
5. 利息支出		—	—
其中: 卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.21	323,049.42	321,662.99
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		12,885,146.68	9,847,598.77
减: 所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		12,885,146.68	9,847,598.77

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: 2014年1月1日-2014年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期 2014年1月1日-2014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)	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)	—	12,885,146.68	12,885,146.68
三、本期基金份额交易产生的	-44,043,242.32	-7,179,476.77	-51,222,719.09

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	16,327,088.72	1,964,115.12	18,291,203.84
2.基金赎回款	-60,370,331.04	-9,143,591.89	-69,513,922.93
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)	47,919,484.64	5,475,534.24	53,395,018.88
项 目	上年度可比期间 2013年1月1日-2013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)	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)	—	9,847,598.77	9,847,598.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-13,837,868.20	2,780,784.74	-11,057,083.46
其中: 1.基金申购款	33,127,276.26	4,322,794.14	37,450,070.40
2.基金赎回款	-46,965,144.46	-1,542,009.40	-48,507,153.86
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)	91,962,726.96	-230,135.67	91,732,591.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

本报告7.1至7.4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

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,业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。

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%。

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日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会颁布的《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2014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

2014年12月31日的财务状况以及2014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估计与2013年度报告相一致；本报告期所采用的会计政策变更的说明在7.4.5.1会计政策变更的说明中披露。

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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号--公允价值计量》、《企业会计准则第40号--合营安排》、《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号--长期股权投资》、《企业会计准则第9号--职工薪酬》、《企业会计准则第30号--财务报表列报》、《企业会计准则第33号--合并财务报表》以及《企业会计准则第37号--金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号--金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收

入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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（“上海浦东发展银行”）	基金管理人的股东、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
上海国盛集团资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
上海盛融投资有限公司	基金管理人的原股东

注：1、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。

2、本报告期内，根据上海市政府的要求，经上海国盛（集团）有限公司批准，本基金管理人原股东上海盛融投资有限公司（以下简称“上海盛融”）由其母公司上海国盛集团资产管理有限公司（以下简称“上海国盛”）吸收合并，上海盛融持有的本基金管理人10%的股权由上海国盛承继，本基金管理人股东因此由上海盛融变更为上海国盛。本基金管理人正在就此事项履行相关工商变更手续。

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 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 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 2014年1月1日-2014年12月31 日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,188,576.75	1,428,824.97
其中：支付销售机构的客户维护费	282,376.25	337,881.60

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日-2014年12月31 日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	198,096.20	238,137.48

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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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 2014年1月1日-2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日-2013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 股份有限公司	12,148,758.63	114,161.01	17,608,603.15	153,487.41

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均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均无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2014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

本基金本报告期末未持有因认购新发/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 (单位: 股)	期末 成本总额	期末 估值总额
000897	津滨发展	2014-12-26	重大事项停牌	7.55	2015-01-21	7.50	100,000	760,000.00	755,000.00
002324	普利特	2014-10-08	重大事项停牌	19.90	2015-01-14	21.89	15,000	299,756.00	298,500.00
002675	东诚药业	2014-10-10	重大事项停牌	24.18		—	30,000	592,032.92	725,400.00
300025	华星创业	2014-12-01	重大事项停牌	20.01		—	28,478	493,352.57	569,844.78
600061	中纺投资	2014-12-30	重大事项停牌	23.04	2015-01-07	25.34	41,785	995,573.85	962,726.40
600129	太极集团	2014-12-17	重大事项停牌	15.79		—	91,700	1,559,952.04	1,447,943.00

注：本基金截至2014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

截止本报告期末2014年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末2014年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014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次的余额为37,906,308.43元，属于第二层次的余额为4,759,414.18元，无属于第三层次的余额(2013年12月31日：第一层次71,234,068.07元，第二层次1,433,774.56元，无第三层次)。

(ii)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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；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次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日：同)。

(d)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。

(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	42,665,722.61	75.84
	其中：股票	42,665,722.61	75.84
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	12,848,324.35	22.84
7	其他各项资产	742,700.11	1.32
8	合计	56,256,747.07	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	—	—

B	采矿业	222,320.00	0.42
C	制造业	18,797,586.37	35.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	156,200.00	0.29
E	建筑业	2,195,300.00	4.11
F	批发和零售业	571,000.00	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,197,032.91	2.24
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,178,146.86	2.21
J	金融业	7,101,231.50	13.30
K	房地产业	9,715,396.29	18.20
L	租赁和商务服务业	111,710.40	0.21
M	科学研究和技术服务业	18,560.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,107,200.00	2.07
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	294,038.28	0.55
	合计	42,665,722.61	79.91

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	600657	信达地产	264,996	2,162,367.36	4.05
2	600702	沱牌舍得	108,500	2,021,355.00	3.79
3	600199	金种子酒	152,308	1,777,434.36	3.33
4	002146	荣盛发展	105,607	1,675,983.09	3.14
5	600016	民生银行	150,000	1,632,000.00	3.06
6	600015	华夏银行	120,000	1,615,200.00	3.03
7	600519	贵州茅台	8,500	1,611,770.00	3.02

8	600970	中材国际	120,000	1,609,200.00	3.01
9	000402	金融街	130,000	1,602,900.00	3.00
10	600388	龙净环保	45,000	1,575,000.00	2.95

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

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(%)
1	300339	润和软件	14,219,934.10	15.50
2	000938	紫光股份	12,764,528.22	13.91
3	300378	鼎捷软件	11,651,536.58	12.70
4	002108	沧州明珠	11,443,069.88	12.47
5	300047	天源迪科	9,791,764.72	10.67
6	300269	联建光电	9,475,837.49	10.33
7	002609	捷顺科技	8,078,584.43	8.81
8	300295	三六五网	8,072,908.56	8.80
9	300293	蓝英装备	7,995,895.84	8.72
10	600149	廊坊发展	7,894,285.63	8.61
11	002712	思美传媒	7,741,095.65	8.44
12	000915	山大华特	7,641,204.03	8.33
13	002657	中科金财	7,262,788.38	7.92
14	300358	楚天科技	7,199,634.10	7.85
15	300038	梅泰诺	7,183,950.30	7.83
16	002635	安洁科技	6,951,665.60	7.58
17	603168	莎普爱思	6,922,593.98	7.55
18	002441	众业达	6,813,732.81	7.43
19	300155	安居宝	6,709,502.15	7.31
20	300379	东方通	6,377,003.90	6.95
21	002417	三元达	6,209,303.95	6.77

22	002035	华帝股份	6,130,296.57	6.68
23	600767	运盛实业	6,097,143.46	6.65
24	600162	香江控股	5,993,078.03	6.53
25	300098	高新兴	5,983,734.80	6.52
26	600571	信雅达	5,735,308.76	6.25
27	300386	飞天诚信	5,701,964.49	6.22
28	002121	科陆电子	5,660,855.80	6.17
29	300166	东方国信	5,638,045.92	6.15
30	300052	中青宝	5,630,817.75	6.14
31	300083	劲胜精密	5,554,038.57	6.05
32	300377	赢时胜	5,513,690.07	6.01
33	300050	世纪鼎利	5,506,877.22	6.00
34	000732	泰禾集团	5,400,811.22	5.89
35	300223	北京君正	5,335,349.20	5.82
36	300020	银江股份	5,271,298.50	5.75
37	300130	新国都	5,186,579.40	5.65
38	300291	华录百纳	5,127,945.91	5.59
39	600067	冠城大通	5,020,698.00	5.47
40	002675	东诚药业	5,005,658.16	5.46
41	600661	新南洋	4,966,710.21	5.41
42	000666	经纬纺机	4,929,083.00	5.37
43	300229	拓尔思	4,854,738.99	5.29
44	002197	证通电子	4,854,172.20	5.29
45	300371	汇中股份	4,830,034.08	5.27
46	000733	振华科技	4,787,223.21	5.22
47	600446	金证股份	4,755,968.47	5.18
48	300041	回天新材	4,755,938.45	5.18
49	000681	视觉中国	4,743,692.58	5.17
50	002235	安妮股份	4,716,010.79	5.14
51	002298	鑫龙电器	4,715,834.71	5.14

52	600702	沱牌舍得	4,714,024.73	5.14
53	300336	新文化	4,653,038.94	5.07
54	002699	美盛文化	4,641,368.40	5.06
55	600129	太极集团	4,595,554.60	5.01
56	000799	酒鬼酒	4,585,001.77	5.00
57	600061	中纺投资	4,583,582.90	5.00
58	600016	民生银行	4,524,175.45	4.93
59	600479	千金药业	4,307,442.31	4.70
60	000820	金城股份	4,286,744.28	4.67
61	002727	一心堂	4,284,521.15	4.67
62	002115	三维通信	4,282,434.12	4.67
63	600633	浙报传媒	4,272,308.57	4.66
64	002329	皇氏集团	4,267,373.00	4.65
65	002055	得润电子	4,259,107.70	4.64
66	000090	天健集团	4,253,066.62	4.64
67	600184	光电股份	4,247,473.00	4.63
68	002325	洪涛股份	4,175,477.40	4.55
69	300043	互动娱乐	4,158,512.00	4.53
70	600303	曙光股份	4,140,377.80	4.51
71	300197	铁汉生态	4,056,893.62	4.42
72	603456	九洲药业	4,015,197.01	4.38
73	300139	福星晓程	3,971,703.51	4.33
74	002261	拓维信息	3,878,128.64	4.23
75	002439	启明星辰	3,860,535.70	4.21
76	002231	奥维通信	3,844,868.25	4.19
77	002412	汉森制药	3,821,647.96	4.17
78	002502	骅威股份	3,777,973.34	4.12
79	600976	健民集团	3,740,193.14	4.08
80	002118	紫鑫药业	3,731,619.00	4.07
81	000004	国农科技	3,684,493.87	4.02

82	002146	荣盛发展	3,677,639.79	4.01
83	600077	宋都股份	3,637,854.76	3.97
84	300170	汉得信息	3,621,471.80	3.95
85	600199	金种子酒	3,602,397.33	3.93
86	002514	宝馨科技	3,598,940.47	3.92
87	002282	博深工具	3,598,354.90	3.92
88	300300	汉鼎股份	3,534,497.64	3.85
89	300150	世纪瑞尔	3,511,949.92	3.83
90	300025	华星创业	3,493,916.26	3.81
91	000766	通化金马	3,433,639.30	3.74
92	600686	金龙汽车	3,431,492.10	3.74
93	600158	中体产业	3,400,501.87	3.71
94	600487	亨通光电	3,394,761.32	3.70
95	300090	盛运股份	3,388,189.00	3.69
96	000639	西王食品	3,338,098.98	3.64
97	300357	我武生物	3,320,925.90	3.62
98	000558	莱茵置业	3,301,393.40	3.60
99	600816	安信信托	3,287,242.99	3.58
100	601000	唐山港	3,232,966.48	3.52
101	002511	中顺洁柔	3,208,515.80	3.50
102	300353	东土科技	3,169,082.00	3.45
103	300016	北陆药业	3,154,289.14	3.44
104	300131	英唐智控	3,133,088.20	3.42
105	300181	佐力药业	3,099,980.88	3.38
106	002410	广联达	3,051,611.60	3.33
107	002654	万润科技	3,002,724.76	3.27
108	603308	应流股份	2,963,301.76	3.23
109	300366	创意信息	2,933,921.68	3.20
110	300359	全通教育	2,927,690.70	3.19
111	300168	万达信息	2,891,825.56	3.15

112	300071	华谊嘉信	2,825,062.18	3.08
113	002281	光迅科技	2,819,171.27	3.07
114	600210	紫江企业	2,790,588.72	3.04
115	300301	长方照明	2,781,237.00	3.03
116	002148	北纬通信	2,755,328.03	3.00
117	002555	顺荣股份	2,746,038.46	2.99
118	600657	信达地产	2,730,544.66	2.98
119	300113	顺网科技	2,722,570.40	2.97
120	000961	中南建设	2,705,045.92	2.95
121	600185	格力地产	2,700,765.00	2.94
122	600990	四创电子	2,674,127.18	2.92
123	300252	金信诺	2,639,314.21	2.88
124	002421	达实智能	2,552,688.35	2.78
125	002181	粤传媒	2,535,667.21	2.76
126	600643	爱建股份	2,531,064.70	2.76
127	300263	隆华节能	2,508,537.28	2.73
128	300079	数码视讯	2,490,590.00	2.72
129	601166	兴业银行	2,488,064.00	2.71
130	300188	美亚柏科	2,433,012.30	2.65
131	300388	国祯环保	2,425,362.00	2.64
132	300032	金龙机电	2,394,362.38	2.61
133	002348	高乐股份	2,374,667.00	2.59
134	600246	万通地产	2,364,416.01	2.58
135	300036	超图软件	2,352,547.60	2.56
136	000903	云内动力	2,333,600.00	2.54
137	000592	平潭发展	2,332,153.80	2.54
138	300232	洲明科技	2,319,486.44	2.53
139	002663	普邦园林	2,287,210.00	2.49
140	300389	艾比森	2,284,470.70	2.49
141	002268	卫士通	2,277,914.43	2.48

142	600536	中国软件	2,258,894.80	2.46
143	300177	中海达	2,253,486.37	2.46
144	002496	辉丰股份	2,252,458.48	2.46
145	002315	焦点科技	2,245,698.10	2.45
146	000712	锦龙股份	2,244,080.39	2.45
147	300254	仟源医药	2,218,723.72	2.42
148	300383	光环新网	2,202,263.86	2.40
149	600894	广日股份	2,185,320.21	2.38
150	002363	隆基机械	2,182,887.07	2.38
151	600222	太龙药业	2,168,439.19	2.36
152	002368	太极股份	2,163,805.08	2.36
153	300368	汇金股份	2,146,642.00	2.34
154	600519	贵州茅台	2,131,391.35	2.32
155	300345	红宇新材	2,130,050.00	2.32
156	002104	恒宝股份	2,126,079.00	2.32
157	600315	上海家化	2,123,592.04	2.31
158	300289	利德曼	2,102,010.66	2.29
159	002354	科冕木业	2,098,576.00	2.29
160	300101	振芯科技	2,096,870.00	2.29
161	300178	腾邦国际	2,088,571.32	2.28
162	000673	当代东方	2,087,275.96	2.28
163	300074	华平股份	2,082,890.49	2.27
164	000001	平安银行	2,062,001.58	2.25
165	002373	千方科技	2,001,093.17	2.18
166	000728	国元证券	1,989,144.48	2.17
167	600647	同达创业	1,974,877.00	2.15
168	300287	飞利信	1,951,466.00	2.13
169	300073	当升科技	1,944,404.10	2.12
170	600833	第一医药	1,917,839.00	2.09
171	002117	东港股份	1,908,212.60	2.08

172	300395	菲利华	1,887,223.50	2.06
173	300385	雪浪环境	1,875,601.00	2.04
174	002280	新世纪	1,864,720.00	2.03
175	300235	方直科技	1,864,105.00	2.03
176	300332	天壕节能	1,863,085.36	2.03
177	600422	昆药集团	1,850,980.44	2.02
178	600325	华发股份	1,837,404.00	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	300339	润和软件	14,820,727.31	16.16
2	002108	沧州明珠	12,608,745.07	13.75
3	300378	鼎捷软件	12,227,598.70	13.33
4	000938	紫光股份	11,342,982.49	12.37
5	300269	联建光电	11,138,987.17	12.14
6	300047	天源迪科	10,301,348.19	11.23
7	300295	三六五网	9,703,485.55	10.58
8	002609	捷顺科技	8,358,670.18	9.11
9	002657	中科金财	8,332,386.91	9.08
10	600149	廊坊发展	8,320,345.46	9.07
11	300293	蓝英装备	7,422,442.12	8.09
12	300358	楚天科技	7,395,394.42	8.06
13	002712	思美传媒	7,272,072.15	7.93
14	000915	山大华特	7,264,391.28	7.92
15	002635	安洁科技	7,177,115.61	7.82
16	603168	莎普爱思	6,998,403.80	7.63
17	002514	宝馨科技	6,866,429.23	7.49
18	002441	众业达	6,714,499.01	7.32

19	300038	梅泰诺	6,610,471.21	7.21
20	300166	东方国信	6,556,331.27	7.15
21	300379	东方通	6,472,707.43	7.06
22	300074	华平股份	6,430,922.82	7.01
23	300155	安居宝	6,335,612.64	6.91
24	002417	三元达	6,329,305.83	6.90
25	300197	铁汉生态	6,279,224.90	6.85
26	002035	华帝股份	6,123,555.31	6.68
27	002121	科陆电子	6,063,901.25	6.61
28	300377	赢时胜	6,055,125.78	6.60
29	300223	北京君正	6,012,316.77	6.55
30	002235	安妮股份	5,976,965.21	6.52
31	600315	上海家化	5,955,137.84	6.49
32	300052	中青宝	5,886,447.04	6.42
33	300131	英唐智控	5,829,837.85	6.36
34	600162	香江控股	5,817,264.90	6.34
35	002242	九阳股份	5,786,692.36	6.31
36	002197	证通电子	5,728,734.71	6.25
37	300020	银江股份	5,659,350.13	6.17
38	600571	信雅达	5,595,442.04	6.10
39	000681	视觉中国	5,577,749.55	6.08
40	300098	高新兴	5,558,485.79	6.06
41	300386	飞天诚信	5,517,902.25	6.02
42	300041	回天新材	5,423,969.47	5.91
43	300291	华录百纳	5,407,256.04	5.89
44	300050	世纪鼎利	5,339,468.86	5.82
45	300043	互动娱乐	5,259,559.64	5.73
46	600661	新南洋	5,253,577.32	5.73
47	300083	劲胜精密	5,180,696.82	5.65
48	000732	泰禾集团	4,935,578.93	5.38

49	600446	金证股份	4,865,129.30	5.30
50	300371	汇中股份	4,849,585.12	5.29
51	600767	运盛实业	4,838,851.65	5.27
52	300183	东软载波	4,818,107.94	5.25
53	300130	新国都	4,808,522.35	5.24
54	300229	拓尔思	4,798,577.44	5.23
55	002699	美盛文化	4,794,769.69	5.23
56	002298	鑫龙电器	4,694,559.19	5.12
57	000733	振华科技	4,684,835.81	5.11
58	600067	冠城大通	4,616,918.06	5.03
59	000666	经纬纺机	4,598,620.11	5.01
60	600479	千金药业	4,487,543.42	4.89
61	300139	福星晓程	4,483,558.48	4.89
62	002329	皇氏集团	4,460,062.73	4.86
63	300336	新文化	4,446,786.20	4.85
64	002055	得润电子	4,333,650.19	4.72
65	000799	酒鬼酒	4,332,884.45	4.72
66	002325	洪涛股份	4,270,668.69	4.66
67	002727	一心堂	4,256,601.52	4.64
68	002115	三维通信	4,250,869.03	4.63
69	002439	启明星辰	4,190,260.23	4.57
70	600303	曙光股份	4,179,205.60	4.56
71	600633	浙报传媒	4,171,661.08	4.55
72	600158	中体产业	4,105,326.63	4.48
73	600976	健民集团	4,099,387.35	4.47
74	000090	天健集团	4,061,667.34	4.43
75	002261	拓维信息	4,047,397.61	4.41
76	002675	东诚药业	4,042,228.25	4.41
77	300168	万达信息	4,027,059.40	4.39
78	000004	国农科技	4,025,148.71	4.39

79	603456	九洲药业	4,017,281.26	4.38
80	002412	汉森制药	3,939,647.66	4.29
81	002400	省广股份	3,873,309.78	4.22
82	600184	光电股份	3,868,356.21	4.22
83	002178	延华智能	3,862,526.33	4.21
84	002396	星网锐捷	3,852,861.53	4.20
85	600077	宋都股份	3,836,080.31	4.18
86	002431	棕榈园林	3,782,791.87	4.12
87	002118	紫鑫药业	3,742,198.23	4.08
88	600686	金龙汽车	3,698,960.33	4.03
89	002229	鸿博股份	3,664,374.47	3.99
90	000820	金城股份	3,600,637.24	3.93
91	300150	世纪瑞尔	3,543,162.37	3.86
92	300300	汉鼎股份	3,506,780.58	3.82
93	000639	西王食品	3,490,980.62	3.81
94	002282	博深工具	3,472,960.36	3.79
95	002117	东港股份	3,437,603.33	3.75
96	002502	骅威股份	3,428,608.67	3.74
97	600816	安信信托	3,412,396.88	3.72
98	600061	中纺投资	3,409,679.96	3.72
99	002231	奥维通信	3,401,724.26	3.71
100	600487	亨通光电	3,399,830.59	3.71
101	300170	汉得信息	3,376,206.10	3.68
102	600016	民生银行	3,322,900.00	3.62
103	000766	通化金马	3,311,490.69	3.61
104	000558	莱茵置业	3,293,168.42	3.59
105	300366	创意信息	3,291,517.63	3.59
106	600129	太极集团	3,281,337.34	3.58
107	300090	盛运股份	3,216,168.82	3.51
108	600990	四创电子	3,214,792.27	3.50

109	603308	应流股份	3,126,904.26	3.41
110	300357	我武生物	3,122,805.42	3.40
111	002017	东信和平	3,099,052.08	3.38
112	600210	紫江企业	3,096,387.11	3.38
113	002555	顺荣股份	3,065,993.20	3.34
114	300359	全通教育	3,062,242.90	3.34
115	002511	中顺洁柔	3,046,367.18	3.32
116	300071	华谊嘉信	2,990,012.33	3.26
117	002654	万润科技	2,982,482.44	3.25
118	300353	东土科技	2,963,489.20	3.23
119	300025	华星创业	2,942,560.49	3.21
120	002185	华天科技	2,932,673.76	3.20
121	300181	佐力药业	2,929,500.36	3.19
122	300252	金信诺	2,925,960.62	3.19
123	002663	普邦园林	2,852,099.79	3.11
124	002410	广联达	2,817,015.34	3.07
125	600702	沱牌舍得	2,784,228.59	3.04
126	002570	贝因美	2,782,178.85	3.03
127	300079	数码视讯	2,773,788.69	3.02
128	002281	光迅科技	2,766,614.44	3.02
129	300113	顺网科技	2,740,216.34	2.99
130	300301	长方照明	2,684,534.35	2.93
131	600185	格力地产	2,683,866.78	2.93
132	002148	北纬通信	2,664,238.55	2.90
133	300077	国民技术	2,650,863.97	2.89
134	002181	粤传媒	2,649,121.22	2.89
135	300177	中海达	2,641,697.36	2.88
136	300032	金龙机电	2,635,215.04	2.87
137	300016	北陆药业	2,617,120.21	2.85
138	600643	爱建股份	2,584,069.27	2.82

139	002268	卫 士 通	2,582,945.63	2.82
140	002421	达实智能	2,522,303.28	2.75
141	300222	科大智能	2,495,810.45	2.72
142	300188	美亚柏科	2,466,697.08	2.69
143	300232	洲明科技	2,465,355.97	2.69
144	300026	红日药业	2,458,760.46	2.68
145	000961	中南建设	2,448,027.70	2.67
146	300388	国祯环保	2,422,425.31	2.64
147	600261	阳光照明	2,408,008.18	2.63
148	002368	太极股份	2,396,348.89	2.61
149	000592	平潭发展	2,345,713.94	2.56
150	600246	万通地产	2,321,996.29	2.53
151	300010	立思辰	2,308,902.75	2.52
152	600894	广日股份	2,302,874.38	2.51
153	300101	振芯科技	2,299,505.18	2.51
154	300389	艾比森	2,275,851.56	2.48
155	300036	超图软件	2,258,324.98	2.46
156	000903	云内动力	2,253,786.55	2.46
157	600222	太龙药业	2,207,969.78	2.41
158	600833	第一医药	2,183,582.27	2.38
159	600536	中国软件	2,173,610.63	2.37
160	300345	红宇新材	2,161,690.90	2.36
161	000728	国元证券	2,160,842.95	2.36
162	300315	掌趣科技	2,155,925.17	2.35
163	000673	当代东方	2,107,791.43	2.30
164	002363	隆基机械	2,103,207.76	2.29
165	600563	法拉电子	2,101,674.08	2.29
166	002354	科冕木业	2,101,237.51	2.29
167	300178	腾邦国际	2,098,644.01	2.29
168	300254	仟源医药	2,096,627.46	2.29

169	300289	利德曼	2,091,299.46	2.28
170	300383	光环新网	2,077,854.00	2.27
171	002348	高乐股份	2,075,625.75	2.26
172	000418	小天鹅 A	2,068,069.23	2.25
173	002104	恒宝股份	2,064,858.67	2.25
174	000712	锦龙股份	2,052,140.39	2.24
175	002315	焦点科技	1,990,161.23	2.17
176	002146	荣盛发展	1,987,527.28	2.17
177	600845	宝信软件	1,972,554.20	2.15
178	300263	隆华节能	1,950,076.18	2.13
179	300073	当升科技	1,934,336.60	2.11
180	300395	菲利华	1,917,044.80	2.09
181	300287	飞利信	1,911,369.60	2.08
182	600199	金种子酒	1,891,077.69	2.06
183	300081	恒信移动	1,890,659.52	2.06
184	600647	同达创业	1,883,769.38	2.05
185	002280	新世纪	1,878,499.83	2.05
186	300054	鼎龙股份	1,870,591.26	2.04
187	002649	博彦科技	1,860,584.26	2.03
188	300368	汇金股份	1,849,796.35	2.02
189	601000	唐山港	1,838,205.38	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。

8.4.3 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	887,313,760.10
卖出股票的收入（成交）总额	934,129,075.27

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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,481.58
2	应收证券清算款	653,365.62
3	应收股利	—
4	应收利息	2,846.38

5	应收申购款	23,006.53
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	742,700.11

8.12.4 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债券。

8.12.5 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
2,027	23,640.59	3,530.54	0.01%	47,915,954.10	99.99%

9.2 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	36,055.69	0.07%

9.3 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

§ 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	91,962,726.96
本报告期基金总申购份额	16,327,088.72
减：本报告期基金总赎回份额	60,370,331.04
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	47,919,484.64

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、经基金管理人2014年第二次股东会会议审议通过，选举产生第三届董事会成员，相较第二届董事会成员，新增霍佳震先生、董叶顺先生为基金管理人独立董事，新增汪素南先生为基金管理人董事，原董事林道峰先生、独立董事谢百三先生不再连任。

2、经2014年度第三次股东会会议审议通过，章曦先生不再担任基金管理人董事职务，选举金杰先生接替章曦先生出任基金管理人第三届董事会董事。

3、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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。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(特殊普通合伙)已提供审计服务的连续年限为6年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查，并于报告期后提出相应整改意见及监管措施决定书。公司将以此次现场检查为契机，进一步提

升公司整体内控水平，通过构建完善的风险管理和合规管理体系，推动公司向现代资产管理机构的转型。

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	803,791,568.06	44.13%	731,772.78	44.13%	
国泰君安	1	500,299,109.36	27.47%	455,473.24	27.47%	
东方证券	1	238,749,381.85	13.11%	217,356.59	13.11%	
申银万国	1	145,517,455.20	7.99%	132,478.49	7.99%	
中国中投	1	68,504,623.81	3.76%	62,367.06	3.76%	
长城证券	1	64,373,247.09	3.53%	58,605.65	3.53%	
中金	1	—	—	—	—	
国都证券	1	—	—	—	—	
国联证券	1	—	—	—	—	

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序：

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内停止租用中国中投证券交易单元。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
国金证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—

申银万国	—	—	128,000,000.00	100.00%	—	—
中国中投	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
中金	—	—	—	—	—	—
国都证券	—	—	—	—	—	—
国联证券	—	—	—	—	—	—

§ 12 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。

浦银安盛基金管理有限公司
二〇一五年三月二十六日