

---

**浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金**  
**2009 年年度报告**  
**2009 年 12 月 31 日**

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年三月三十一日

---

## §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。本年度报告已经全体董事签字同意，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 2010 年 3 月 25 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。

本基金《基金合同》自 2009 年 6 月 4 日起生效。

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。

普华永道中天会计师事务所对基金财务会计报告出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2009 年 6 月 4 日起至 12 月 31 日止。

---

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 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 审计报告	14
6.1 管理层对财务报表的责任	14
6.2 注册会计师的责任	14
6.3 审计意见	15
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	35
8.1 期末基金资产组合情况	35
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
8.3 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	37
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	42
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	42
8.9 投资组合报告附注	42

---

§9 基金份额持有人信息.....	43
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	43
§10 开放式基金份额变动.....	44
§11 重大事件揭示.....	44
11.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
11.4 基金投资策略的改变.....	44
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§13 备查文件目录.....	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	293,208,959.88份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在中国经济健康快速的可持续发展过程中,寻找由于经济结构优化、产业结构升级而涌现的那些最能够代表居民生活水平表征的以及满足居民生活需求升级的提供生活产品和服务的上市公司,分享其快速及长期稳定增长,并关注其他金融工具的投资机会,通过灵活配置资产,在严格控制风险的基础上,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金坚持“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略,通过灵活资产配置、行业发展趋势判断、个股精选选择代表居民生活水平表征的以及满足居民生活需求升级要求的快速及长期稳定增长的上市公司。</p> <p>具体来说,在资产配置策略方面,本基金将根据宏观经济、市场政策、估值水平和市场情绪等因素对未来资本市场的发展做出趋势性判断,进而确定大类资产的配置比例。而在行业配置策略方面,本基金是重点关注居民生活的主题基金,因此将从行业覆盖范围和行业精选策略两个方面进行实施。在个股选择策略方面,本基金将采取精选个股的策略,并辅之以公司特有的数量化公司财务研究模型FFM对拟投资的上市公司加以甄别。</p> <p>在债券投资策略方面,在资本市场国际化的背景下,通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势,采取自上而下的策略构造组合。在权证投资策略方面,本基金将按照法律法规相关规定进行权证投资。</p>
业绩比较基准	中信标普A股综合指数×55%+中信标普全债指数×45%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,坚持长期和力争为基金持有人带来稳健回报的投资理念,属于证券投资基金中的中等收益、中等风险品种。一般情形下,其风险和收益低于股票型基金,高于货币型基金、债券型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的安全和增值。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	顾佳	尹东
	联系电话	021-23212812	010-67595003
	电子邮箱	guj@py-axa.com	yindong@ccb.cn
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	郭树清

## 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区金融大街27号投资广场22-23层

## § 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	2009年6月4日（基金合同生效日）至 2009年12月31日	2008年	2007年
本期已实现收益	12,036,009.88	-	-
本期利润	32,755,944.64	-	-
加权平均基金份额本期利	0.0600	-	-

润			
本期加权平均净值利润率	5.95%	-	-
本期基金份额净值增长率	4.20%	-	-
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2009 年末</b>	<b>2008 年末</b>	<b>2007 年末</b>
期末可供分配利润	8,862,395.94	-	-
期末可供分配基金份额利 润	0.0302	-	-
期末基金资产净值	305,580,598.06	-	-
期末基金份额净值	1.042	-	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2009 年末</b>	<b>2008 年末</b>	<b>2007 年末</b>
基金份额累计净值增长率	4.20%	-	-

注：1、 本基金《基金合同》2009年6月4日生效。以上财务指标中“本期”指2009年6月4日（基金成立日）至2009年12月31日止期间。

2、 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。

3、 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。

4、 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

5、 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	11.09%	1.26%	12.42%	0.97%	-1.33%	0.29%
过去六个月	3.68%	1.38%	10.33%	1.16%	-6.65%	0.22%
自基金合同 生效至今	4.20%	1.29%	13.82%	1.09%	-9.62%	0.20%

本基金业绩比较基准为：中信标普 A 股综合指数×55%+中信标普全债指数×45%。

### 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2009年12月31日）



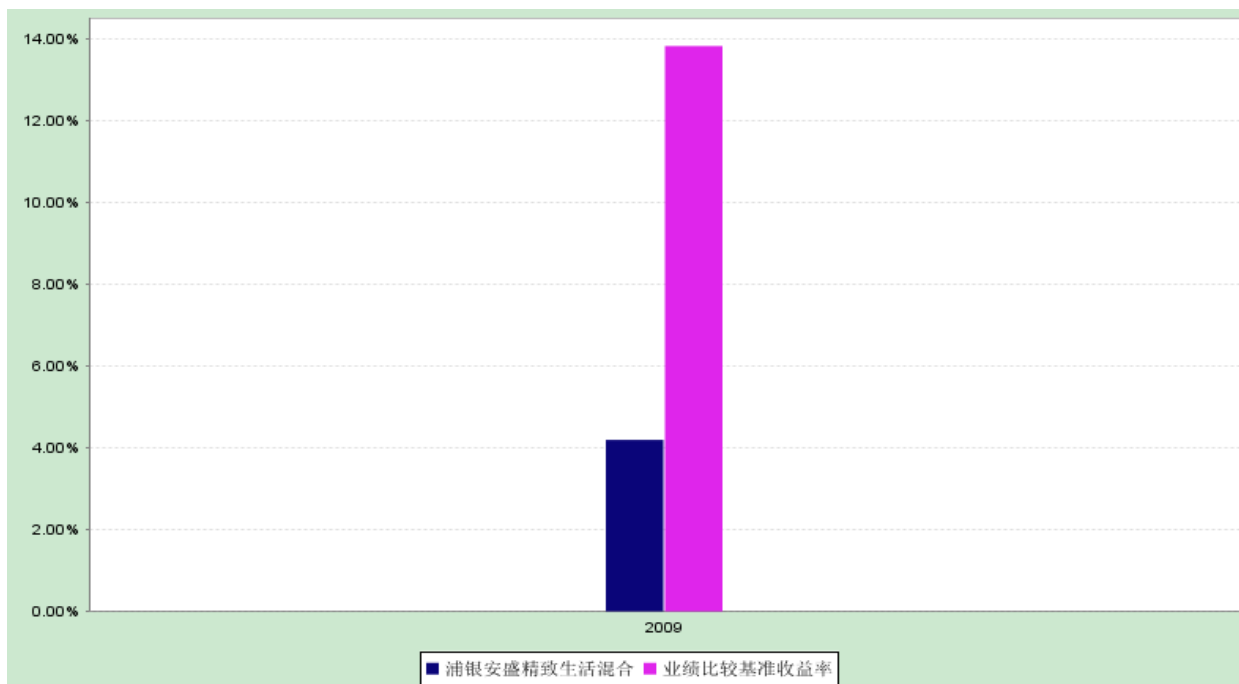
注：1、本基金合同生效日为 2009 年 6 月 4 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同第十二部分第六条规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期自 2009 年 6 月 4 日至 2009 年 12 月 4 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



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

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2009 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下管理 4 只开放式基金，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、和浦银安盛红利精选股票型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
林峰	本基金经理	2009-06-04	-	15	林峰，上海交通大学工商管理硕士。具有 15 年的中国证券业从业经验。1995 年 11 月至 1998 年 3 月，林峰先生在上海多家期货、证券经纪公司先后担任经纪人及投资交易员等职务。1998 年 7 月至 2007 年 3 月，林峰先生在上海东新国际投资管理有限公司资产管理部工作，先后担任研究员、组合投资经理之职。林峰先生于 2007 年 3 月加入浦银安盛基金管理有限公司（筹备组）工作，担任基金经理助理职务。自 2009 年 6 月起，担任本基金经理。
段福印	本基金经理、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金经理	2009-06-04	-	12	段福印，华东师范大学国际金融学硕士；获得 CFA 资格。1998 年 7 月至 2002 年 8 月任职于华夏证券公司，从事债券发行与研究工 作，2002 年 9 月至 2007 年 3 月任职于上海东新国际投资管理有限公司，从事宏观经济研究与固定收益组合管理。2007 年 4 月段福印先生进入浦银安盛基金管理公司（筹备组）投资部担任固定收益投资经理之职，主要负责宏观经济研究和固定收益组合管理，2008 年 12 月起，担任浦银安盛优化收益债券型证券投资基金基金经理。2009 年 6 月起担任本基金经理。
吴勇	本基金经理助理	2009-08-01	-	2	吴勇，上海交通大学工商管理硕士，上海交通大学材料工程系学士，CPA，CFA，中国注册造价师。1993 年 8 月至 2002 年 12 月在上海电力建设有限责任公司任预算主管，2003 年 1 月至 2007 年 8 月在国家开发银行上海市分行任评审经理，2007 年 9 月起加盟浦银安盛基金管理有限公司任职研究员，2009 年 8 月起担任浦银安盛基金精致生活混合型证券投资基金基金经理助理。拥有 6 年金

					融从业经历。
--	--	--	--	--	--------

注 1、林峰、段福印作为本基金的首任基金经理，其任职日期为本基金成立之日，基金经理助理吴勇的“任职日期”指公司决定确定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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，并在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度；在交易执行环节上，详细规定了面对多个基金组合的投资指令的交易执行的流程 and 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（1 日，5 日，10 日）发生的不同基金对同一股票的同向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差是否对相关基金的业绩差异的贡献度；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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人尚无与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本投资组合未发生违反法律法规所界定的异常交易行为。

#### 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

2009 年 A 股市场呈现单边上升后的高位振荡走势，全年涨幅达到 79.98%。相对于 2008

---

年的单边大幅下挫，2009 年的大幅上升行情可以认为是对于 2008 年市场大幅下跌的一种合理修正。

源于 2008 年国内经济形势下滑和美国次贷危机引发的大幅下跌在 2008 年底政府推出的四万亿投资计划后得到了遏制，自 2009 年初起在政府加大投资力度和宽松的信贷环境刺激下，A 股市场开始振荡上行。自 2009 年初起至 2009 年 7 月底市场基本呈现单边上升的态势，而后市场自 2009 年 8 月份开始步入调整，但是由于宏观经济仍然处于逐步复苏的状态，因此市场并没有重现单边跌势，而代之以出现了高位振荡的行情。从 2009 年全年的行业表现来看，表现较好的行业是以汽车、煤炭、有色、化纤、建材、机械和房地产为代表的周期性行业，同时家电、元器件和酒店旅游等非周期类行业也有不错的涨幅。

本基金《基金合同》于 2009 年 6 月 4 日正式生效，本着稳健运作的原则，在建仓期开始之初的一段时间内并未大幅提升股票仓位。同时，由于 2009 年 6 月份和 7 月份市场仍然处于大幅上涨状态，因此损失较大。这其中，有决策的原因也有对市场判断失误的原因。可以说，6、7 月份的策略失误是造成基金业绩表现欠佳的主要原因。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截止至 2009 年年底，浦银精致生活基金的基金收益为 4.2%，同期业绩基准收益为 13.8%。

#### **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 2010 年，宏观经济的持续复苏和刺激政策的退出将贯穿全年始终。首先是宏观经济复苏态势日益明确，除了投资仍将维持在较高水平上以外，出口和消费的增速也值得期待。与此同时，也应该看到的是日趋回温的经济和宽松的流动性将在一定程度上引发 CPI 的回升，因此 2008 年底推出的一系列经济刺激政策将面临退出的前景，其中最具代表性的将是政府为抑制资产价格泡沫而采取的对流动性的收紧措施。可以说，经济的回温和政策的退出将呈现出此进彼退的态势，政策的退出将在更大程度上体现出根据经济形势变化而变化的博弈特征。

基于上述分析，2010 年的 A 股市场很难出现类似于 2008 年和 2009 年的单边行情，而代之以出现振荡行情的可能性大大增加。但基于对经济回温的信心和对政策退出仍会视经济形势变化而定的预期，我们仍然认为市场总体虽然仍是振荡行情，但是振荡向上的概率仍然较大，只是绝对涨幅可能较 2009 年偏小。

行业方面，鉴于 2010 年的宏观形势和市场前景都较为复杂，因此将行业配置和市场策略相结合可能更为有效。具体来说，我们首先看好以消费品为代表的稳定类行业，其中以医药、家电、信息技术和汽车等行业为代表，但与此同时必须关注这其中部分行业可能面临的估值风险。其次，对于

---

以投资品为代表的周期类行业，政策的退出是这些行业面临的首要风险；但从另一个角度出发，政策退出预期的松动将是这些行业投资机会的催化剂，因此在合适的情景下，周期类行业也将面临不错的交易型机会。我们看好的相关周期类行业包括煤炭、化工、建材和钢铁等。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2009 年度，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核管理，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金份额持有人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司基金资产规范运作，主要做了以下工作：

##### 1、进一步完善公司内部管理体系

随着公司业务的逐步推进，2009 年公司从根据业务需要修订和完善内部管理制度流程等方面入手，进一步加强公司内部控制，以确保基金资产规范管理和运作，风险得到有效控制。

##### 2、加强合规检查，强化制度执行

2009 年，公司注重对基金资产管理业务的合规运作，以及执行法规和制度的情况进行多次专项检查。就检查中发现的问题与业务部门进行沟通和反馈，帮助和督促各部门及时完善和改进工作。

##### 3、准确、及时地进行信息披露

公司指定专人负责并协调基金的信息披露工作，确保本基金定期报告及重大事项能够及时、准确、完整、真实地对外披露。

##### 4、确保公司对外宣传推介活动的合法合规性

本基金产品申请材料、基金宣传推介材料、媒体采访提纲、软文、客服材料、网站资料、代销渠道资料等均经监察团队进行合规性审核后方可对外发布，确保公司对外宣传推介活动合法合规。

##### 5、积极进行合规培训、强化员工合规意识

公司监察团队 2009 年全年先后对投资管理人员（部分培训针对全体员工）进行了多次合规培训。培训内容涉及投资管理人员利益冲突、基金分红、反洗钱、公司内控等多方面。通过培训增强员工的合规守法意识，促进基金资产管理业务的合规运作。

##### 6、加强基金风险控制工作

2009 年，公司继续加强对本基金投资风险的事前控制和事后监测，有效地防范和降低投资风险。公司管理层在业务发展中将风险控制置于重要地位，不断提升全公司的风险控制意识和合规文化，确保公司各项业务活动能严格遵循有关法律法规规范有序地进行，未出现重大风险和违法违规问题。

##### 7、积极开展反洗钱工作

---

2009年，公司根据《中华人民共和国反洗钱法》及中国人民银行下发的相关规定的要求，公司认真贯彻落实人行反洗钱工作的要求，不断提高反洗钱工作质量，修订了公司《反洗钱可疑交易报送管理规定》及《客户反洗钱身份识别及风险等级划分管理规定》，完善反洗钱系统，并按时完成了反洗钱可疑交易报送工作。对公司内部反洗钱工作进行了外部宣传、内部培训及内部审计。

#### 4.7 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约定，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副总经理兼首席运营官陈箴先生、风险管理部总监戴刚先生、IT总监刘元平先生、金融工程部总监陈士俊先生、基金会计部经理陈燕女士组成。估值委员会成员三分之二以上具有5年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括有：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。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

#### 4.8 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。

根据《基金合同》的约定，本基金自2009年6月4日至2009年12月31日止期间不需进行收益分配。

---

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20646 号

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：：

我们审计了后附的浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“浦银安盛精致生活基金”)的财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是浦银安盛精致生活基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审

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

### 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员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，在所有重大方面公允反映了浦银安盛精致生活基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 汪 棣 单 峰

上海市卢湾区湖滨路 202 号企业

天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2010-03-23

## §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：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	89,679,626.27	-
结算备付金		453,749.60	-
存出保证金		831,668.09	-
交易性金融资产	7.4.7.2	214,652,541.58	-
其中：股票投资		214,652,541.58	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,880,718.97	-
应收利息	7.4.7.5	14,851.74	-
应收股利		-	-

应收申购款		197.63	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		308,513,353.88	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2009年12月31日</b>	<b>上年度末 2008年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,733,550.49	-
应付管理人报酬		410,174.52	-
应付托管费		68,362.43	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	384,134.85	-
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	336,533.53	-
负债合计		2,932,755.82	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	293,208,959.88	-
未分配利润	7.4.7.10	12,371,638.18	-
所有者权益合计		305,580,598.06	-
负债和所有者权益总计		308,513,353.88	-

注：1、本基金《基金合同》生效日为 2009 年 6 月 4 日，至报告期末，合同成立未满一年，实际报告期间为 2009 年 6 月 4 日至 2009 年 12 月 31 日。

2、报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值为 1.042 元，基金份额总额为 293,208,959.88 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：2009 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009年6月4日（基金合同生	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12
-----	-----	-----------------------	------------------------------

		效日)至2009年12月31日	月31日
<b>一、收入</b>		<b>41,678,940.94</b>	-
1. 利息收入		1,866,700.16	-
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	880,966.36	-
债券利息收入		833,752.80	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		151,981.00	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		18,371,132.97	-
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	21,403,108.72	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-4,051,294.96	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.14	1,019,319.21	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.15	20,719,934.76	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	721,173.05	-
<b>减: 二、费用</b>		<b>8,922,996.30</b>	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,716,136.55	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	786,022.83	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.17	3,045,505.08	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.18	375,331.84	-
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>32,755,944.64</b>	-
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>32,755,944.64</b>	-

注: 本基金《基金合同》生效日为2009年6月4日, 至报告期末, 合同成立未满一年。

### 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: 2009年6月4日(基金合同生效日)至2009年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效日）至2009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）	836,989,022.73	-	836,989,022.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,755,944.64	32,755,944.64
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）	-543,780,062.85	-20,384,306.46	-564,164,369.31
其中：1. 基金申购款	12,407,856.98	357,112.51	12,764,969.49
2. 基金赎回款	-556,187,919.83	-20,741,418.97	-576,929,338.80
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）	293,208,959.88	12,371,638.18	305,580,598.06
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金《基金合同》生效日为2009年6月4日，至报告期末，合同成立未满一年。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：刘斐，主管会计工作负责人：陈箴，会计机构负责人：陈燕

## 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]第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(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中信标普 A 股综合指数 X55% + 中信标普全债指数 X45%。

本财务报表由本基金的基金管理人于 2010 年 3 月 31 日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 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 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2009 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2009 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

---

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参

---

考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

---

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

##### **(1) 计量属性**

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

##### **(2) 重要会计估计及其关键假设**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### **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**

无。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
活期存款	89,679,626.27	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	89,679,626.27	-

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	193,932,606.82	214,652,541.58	20,719,934.76
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	193,932,606.82	214,652,541.58	20,719,934.76
项目	上年度末 2008 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	-	-	-

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应收活期存款利息	14,692.94	-
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	158.80	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	14,851.74	-

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
交易所市场应付交易费用	383,709.85	-
银行间市场应付交易费用	425.00	-
合计	384,134.85	-

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	-
应付赎回费	6,533.53	-
预提审计费	80,000.00	-
合计	336,533.53	-

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效日）至2009年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	836,989,022.73	836,989,022.73
本期申购	12,407,856.98	12,407,856.98
本期赎回（以“-”号填列）	-556,187,919.83	-556,187,919.83
本期末	293,208,959.88	293,208,959.88

注：1、 本基金自 2009 年 4 月 27 日至 2009 年 5 月 27 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 836,466,510.59 元。根据《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》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 522,512.14 元在本基金成立后，折算为 522,512.14 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、 根据《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》的相关规定，本基金于 2009 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2009 年 6 月 29 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

3、 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	12,036,009.88	20,719,934.76	32,755,944.64
本期基金份额交易产生的变动数	-3,173,613.94	-17,210,692.52	-20,384,306.46
其中：基金申购款	146,397.77	210,714.74	357,112.51
基金赎回款	-3,320,011.71	-17,421,407.26	-20,741,418.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,862,395.94	3,509,242.24	12,371,638.18

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31

	日)至2009年12月31日	日
活期存款利息收入	866,097.73	-
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	14,868.21	-
其他	0.42	-
合计	880,966.36	-

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效日） 至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	941,843,789.79	-
减：卖出股票成本总额	920,440,681.07	-
买卖股票差价收入	21,403,108.72	-

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效日） 至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	123,742,058.58	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑 付）成本总额	126,734,107.03	-
减：应收利息总额	1,059,246.51	-
债券投资收益	-4,051,294.96	-

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效 日）至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
股票投资产生的股利收益	1,019,319.21	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,019,319.21	-

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年6月4日（基金合同生效	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31
------	------------------------	---------------------------------

	日)至2009年12月31日	日
1. 交易性金融资产	20,719,934.76	-
——股票投资	20,719,934.76	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	20,719,934.76	-

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效日） 至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
基金赎回费收入	721,161.48	-
其他	11.57	-
合计	721,173.05	-

#### 7.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效日） 至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	3,044,430.08	-
银行间市场交易费用	1,075.00	-
合计	3,045,505.08	-

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效日） 至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	270,000.00	-
其他费用	1,140.00	-
债券帐户维护费	4,500.00	-
银行汇划费用	19,691.84	-
合计	375,331.84	-

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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	基金托管人、基金代销机构
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
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海盛融投资有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年6月4日（基金合同生效 日）至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理 费	4,716,136.55	-
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,050,675.66	-

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 X 1.5% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年6月4日（基金合同生效日）至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	786,022.83	-

注：支付基金托管人中国建设银行的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：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 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

无。

#### 7.4.10.5 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	
	2009年6月4日（基金合同生效日）至2009年12月31日		2008年1月1日至2008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	89,679,626.27	866,097.73	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002304	洋河股份	2009-10-29	2010-02-08	新股网下申购	60.00	113.99	3,711	222,660.00	423,016.89	-
002308	威创股份	2009-11-18	2010-03-01	新股网下申购	23.80	31.83	10,659	253,684.20	339,275.97	-
002326	永太科技	2009-12-15	2010-03-22	新股网下申购	20.00	31.27	5,649	112,980.00	176,644.23	-
002330	得利斯	2009-12-25	2010-01-06	新股网上申购	13.18	13.18	500	6,590.00	6,590.00	-
601117	中国化学	2009-12-29	2010-01-07	新股网上申购	5.43	5.43	13,000	70,590.00	70,590.00	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 受限证券类别：										
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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	--	-	-	-

#### 7.4.12.2 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
600100	同方股份	2009-12-29	资产重组	18.73	2010-01-04	18.70	100,000	1,623,500.00	1,873,000.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

---

### 7.4.13 金融工具风险及管理

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

本基金管理人下设的各业务部门是公司风险管理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力机构，制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立风险管理部和监察部，独立地监控公司面临的各类风险。风险管理部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估。

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，督察长及内部部负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，并向董事会或其下属的合规及审计委员会报告。

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产生的可能损失。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。

#### 7.4.13.2 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%。

#### **7.4.13.3 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 7.4.12 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。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009年12 月31日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	-	-	-	-	-	89,679,626. 27	-	-	-	89,679,626. 27
结算备付金	-	-	-	-	-	453,749.60	-	-	-	453,749.60
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	831,668.09	831,668.09
证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,880,718.9 7	2,880,718.9 7
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	214,652,541 .58	214,652,541 .58
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	14,851.74	14,851.74
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	197.63	197.63
资产总计	-	-	-	-	-	90,133,375. 87	-	-	218,379,978 .01	308,513,353 .88
负债										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,733,550.4 9	1,733,550.4 9
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	410,174.52	410,174.52
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	68,362.43	68,362.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	384,134.85	384,134.85

其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	336,533.53	336,533.53
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	2,932,755.8 2	2,932,755.8 2
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	90,133,375. 87	-	-	215,447,222 .19	305,580,598 .06
上年度末 2008年12 月31日	1个月 以内	1-3个月	6个月以 内	3个月-1 年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
资产总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
负债										
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2009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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日		上年度末 2008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	214,652,541.58	70.24	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	214,652,541.58	70.24	-	-

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中信标普 A 股综合指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
	中信标普 A 股综合指数 上升 5%	增加 11,269,258.43	-
	中信标普 A 股综合指数 下降 5%	减少 11,269,258.43	-

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	214,652,541.58	69.58

	其中：股票	214,652,541.58	69.58
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	90,133,375.87	29.22
6	其他各项资产	3,727,436.43	1.21
7	合计	308,513,353.88	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	5,303,000.00	1.74
B	采掘业	19,072,300.00	6.24
C	制造业	110,813,675.61	36.26
C0	食品、饮料	4,364,906.89	1.43
C1	纺织、服装、皮毛	4,220,000.00	1.38
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	144,975.88	0.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	21,545,344.23	7.05
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	33,989,412.06	11.12
C7	机械、设备、仪表	36,281,309.51	11.87
C8	医药、生物制品	6,390,000.00	2.09
C99	其他制造业	3,877,727.04	1.27
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,642,500.00	0.54
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	3,319,500.00	1.09
G	信息技术业	2,212,275.97	0.72
H	批发和零售贸易	12,132,700.00	3.97
I	金融、保险业	40,024,300.00	13.10
J	房地产业	12,214,200.00	4.00
K	社会服务业	70,590.00	0.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	7,847,500.00	2.57
	合计	214,652,541.58	70.24

### 8.3 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	600036	招商银行	550,000	9,927,500.00	3.25
2	601318	中国平安	180,000	9,916,200.00	3.25
3	600348	国阳新能	180,000	8,706,600.00	2.85
4	000651	格力电器	300,000	8,682,000.00	2.84
5	000001	深发展 A	350,000	8,529,500.00	2.79
6	600586	金晶科技	500,000	8,125,000.00	2.66
7	000338	潍柴动力	110,000	7,092,800.00	2.32
8	000400	许继电气	300,000	6,840,000.00	2.24
9	000540	中天城投	350,000	6,485,500.00	2.12
10	600016	民生银行	750,000	5,932,500.00	1.94
11	600030	中信证券	180,000	5,718,600.00	1.87
12	002110	三钢闽光	309,901	5,596,812.06	1.83
13	002024	苏宁电器	250,000	5,195,000.00	1.70
14	000024	招商地产	180,000	4,793,400.00	1.57
15	600418	江淮汽车	450,000	4,792,500.00	1.57
16	002208	合肥城建	200,000	4,296,000.00	1.41
17	600884	杉杉股份	250,000	4,220,000.00	1.38
18	000825	太钢不锈	430,000	4,102,200.00	1.34
19	600489	中金黄金	70,000	4,079,600.00	1.34
20	000157	中联重科	150,000	3,901,500.00	1.28
21	600664	哈药股份	200,000	3,694,000.00	1.21
22	000677	山东海龙	400,000	3,516,000.00	1.15
23	002092	中泰化学	150,000	3,274,500.00	1.07
24	000608	阳光股份	280,000	3,124,800.00	1.02
25	000826	合加资源	200,000	3,090,000.00	1.01
26	600590	泰豪科技	199,961	3,085,398.23	1.01
27	600598	北大荒	200,000	3,050,000.00	1.00
28	002088	鲁阳股份	130,000	3,003,000.00	0.98
29	000635	英力特	150,000	2,805,000.00	0.92
30	600616	金枫酒业	150,000	2,688,000.00	0.88
31	600426	华鲁恒升	110,000	2,583,900.00	0.85
32	600525	长园集团	100,000	2,553,000.00	0.84
33	600056	中国医药	90,000	2,506,500.00	0.82
34	600585	海螺水泥	50,000	2,493,000.00	0.82
35	000898	鞍钢股份	150,000	2,400,000.00	0.79
36	000983	西山煤电	60,000	2,393,400.00	0.78

37	600660	福耀玻璃	160,000	2,390,400.00	0.78
38	600779	水井坊	100,000	2,291,000.00	0.75
39	002069	獐子岛	60,000	2,253,000.00	0.74
40	000612	焦作万方	80,000	2,240,000.00	0.73
41	002215	诺普信	70,000	2,169,300.00	0.71
42	600028	中国石化	150,000	2,113,500.00	0.69
43	600230	沧州大化	100,000	1,995,000.00	0.65
44	000039	中集集团	150,000	1,965,000.00	0.64
45	600470	六国化工	150,000	1,935,000.00	0.63
46	600100	同方股份	100,000	1,873,000.00	0.61
47	000762	西藏矿业	80,000	1,779,200.00	0.58
48	002091	江苏国泰	80,000	1,743,200.00	0.57
49	000727	华东科技	200,000	1,720,000.00	0.56
50	000060	中金岭南	60,000	1,674,000.00	0.55
51	601919	中国远洋	120,000	1,668,000.00	0.55
52	600125	铁龙物流	150,000	1,651,500.00	0.54
53	000911	南宁糖业	70,000	1,644,300.00	0.54
54	000601	韶能股份	250,000	1,642,500.00	0.54
55	000952	广济药业	100,000	1,439,000.00	0.47
56	600881	亚泰集团	150,000	1,362,000.00	0.45
57	000969	安泰科技	49,952	1,324,727.04	0.43
58	600557	康缘药业	60,000	1,257,000.00	0.41
59	002304	洋河股份	3,711	423,016.89	0.14
60	002308	威创股份	10,659	339,275.97	0.11
61	002326	永太科技	5,649	176,644.23	0.06
62	002297	博云新材	5,964	167,111.28	0.05
63	002292	奥飞动漫	3,412	144,975.88	0.05
64	601117	中国化学	13,000	70,590.00	0.02
65	002330	得利斯	500	6,590.00	0.00

#### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600266	北京城建	32,447,080.76	10.62
2	601398	工商银行	26,048,212.00	8.52
3	600036	招商银行	24,591,141.39	8.05
4	600015	华夏银行	24,584,262.07	8.05

5	600383	金地集团	24,462,317.29	8.01
6	601318	中国平安	23,724,187.49	7.76
7	600779	水井坊	19,223,292.42	6.29
8	000002	万科A	19,123,561.67	6.26
9	601166	兴业银行	19,108,603.48	6.25
10	000612	焦作万方	17,298,486.67	5.66
11	002092	中泰化学	17,278,476.70	5.65
12	600005	武钢股份	16,496,570.03	5.40
13	000635	英力特	16,045,266.15	5.25
14	601328	交通银行	15,230,728.27	4.98
15	600030	中信证券	14,453,498.50	4.73
16	000983	西山煤电	14,123,341.34	4.62
17	002028	思源电气	13,718,749.95	4.49
18	600862	南通科技	12,887,624.22	4.22
19	600143	金发科技	12,770,124.32	4.18
20	600348	国阳新能	12,619,097.29	4.13
21	000400	许继电气	12,581,897.90	4.12
22	600316	洪都航空	12,049,662.07	3.94
23	000157	中联重科	11,694,754.50	3.83
24	000024	招商地产	11,693,471.37	3.83
25	600391	成发科技	11,645,750.02	3.81
26	600325	华发股份	11,136,933.20	3.64
27	600970	中材国际	10,934,636.12	3.58
28	000758	中色股份	10,893,759.19	3.56
29	600739	辽宁成大	10,890,177.40	3.56
30	002024	苏宁电器	10,630,475.46	3.48
31	000651	格力电器	10,562,742.12	3.46
32	601919	中国远洋	10,464,766.16	3.42
33	600268	国电南自	10,430,482.62	3.41
34	600418	江淮汽车	10,308,624.56	3.37
35	600432	吉恩镍业	9,871,140.30	3.23
36	000001	深发展A	9,760,544.51	3.19
37	600362	江西铜业	9,729,650.03	3.18
38	000540	中天城投	9,635,164.40	3.15
39	000717	韶钢松山	9,586,929.88	3.14
40	600028	中国石化	9,453,273.53	3.09
41	002208	合肥城建	9,428,962.42	3.09
42	600586	金晶科技	9,382,494.09	3.07
43	600499	科达机电	9,381,641.72	3.07
44	000825	太钢不锈	9,231,000.00	3.02
45	000060	中金岭南	9,128,487.33	2.99

46	600660	福耀玻璃	9,105,383.71	2.98
47	000762	西藏矿业	9,078,988.58	2.97
48	600589	广东榕泰	9,047,959.00	2.96
49	600001	邯郸钢铁	9,025,311.36	2.95
50	600309	烟台万华	8,974,074.40	2.94
51	601899	紫金矿业	8,777,017.00	2.87
52	600820	隧道股份	8,577,285.33	2.81
53	000338	潍柴动力	8,489,195.11	2.78
54	600664	哈药股份	8,378,932.63	2.74
55	600016	民生银行	8,172,500.00	2.67
56	002109	兴化股份	8,137,667.74	2.66
57	600598	北大荒	8,095,683.98	2.65
58	002038	双鹭药业	8,061,290.95	2.64
59	600160	巨化股份	8,003,309.43	2.62
60	600066	宇通客车	7,930,658.96	2.60
61	000677	山东海龙	7,702,624.76	2.52
62	000919	金陵药业	7,685,319.00	2.51
63	600037	歌华有线	7,603,537.78	2.49
64	601699	潞安环能	7,469,151.14	2.44
65	600717	天津港	7,392,400.00	2.42
66	600320	振华重工	7,230,779.42	2.37
67	000527	美的电器	6,942,500.00	2.27
68	000063	中兴通讯	6,935,803.00	2.27
69	000584	友利控股	6,897,961.16	2.26
70	000898	鞍钢股份	6,733,848.34	2.20
71	600489	中金黄金	6,646,977.00	2.18
72	601628	中国人寿	6,612,134.07	2.16
73	000858	五粮液	6,597,565.03	2.16
74	600122	宏图高科	6,315,684.66	2.07
75	002123	荣信股份	6,154,139.38	2.01

注：“买入金额”按成交金额（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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600266	北京城建	29,453,669.17	9.64
2	601398	工商银行	26,490,100.00	8.67
3	600015	华夏银行	25,616,001.75	8.38
4	600383	金地集团	20,847,562.93	6.82
5	601166	兴业银行	18,937,550.26	6.20

6	600779	水井坊	18,831,649.13	6.16
7	000002	万科A	18,749,116.65	6.14
8	000612	焦作万方	18,340,939.06	6.00
9	600005	武钢股份	17,721,489.28	5.80
10	600862	南通科技	16,206,354.19	5.30
11	002092	中泰化学	15,994,068.25	5.23
12	000635	英力特	15,781,420.89	5.16
13	601328	交通银行	13,640,802.67	4.46
14	002028	思源电气	13,372,931.48	4.38
15	600143	金发科技	12,946,577.80	4.24
16	600036	招商银行	12,620,078.00	4.13
17	601318	中国平安	12,266,623.73	4.01
18	600970	中材国际	12,255,196.49	4.01
19	600391	成发科技	12,104,268.34	3.96
20	000983	西山煤电	11,473,746.16	3.75
21	600316	洪都航空	11,346,030.93	3.71
22	600499	科达机电	11,209,637.23	3.67
23	600268	国电南自	11,020,716.79	3.61
24	600030	中信证券	10,297,313.78	3.37
25	600325	华发股份	10,198,261.78	3.34
26	600432	吉恩镍业	10,126,422.22	3.31
27	600739	辽宁成大	10,106,172.59	3.31
28	000758	中色股份	10,001,268.20	3.27
29	600309	烟台万华	9,763,083.95	3.19
30	000717	韶钢松山	9,661,085.47	3.16
31	000157	中联重科	9,651,752.98	3.16
32	600589	广东榕泰	9,526,635.00	3.12
33	000063	中兴通讯	9,367,087.87	3.07
34	600660	福耀玻璃	9,151,918.96	2.99
35	600820	隧道股份	9,128,142.15	2.99
36	601899	紫金矿业	8,819,237.00	2.89
37	600037	歌华有线	8,541,962.71	2.80
38	600066	宇通客车	8,488,659.65	2.78
39	600362	江西铜业	8,471,015.73	2.77
40	002038	双鹭药业	8,445,363.50	2.76
41	000527	美的电器	8,403,906.04	2.75
42	002007	华兰生物	8,075,871.05	2.64
43	600717	天津港	8,063,525.00	2.64
44	600320	振华重工	8,012,925.88	2.62
45	601919	中国远洋	7,924,110.11	2.59
46	002109	兴化股份	7,746,776.40	2.54

47	600418	江淮汽车	7,708,033.87	2.52
48	600001	邯郸钢铁	7,619,572.95	2.49
49	600028	中国石化	7,530,251.92	2.46
50	000060	中金岭南	7,370,623.71	2.41
51	000762	西藏矿业	7,366,608.27	2.41
52	002208	合肥城建	7,346,555.83	2.40
53	002024	苏宁电器	7,158,602.74	2.34
54	000919	金陵药业	7,017,516.50	2.30
55	601111	中国国航	6,890,630.44	2.25
56	000869	张裕A	6,814,418.60	2.23
57	000858	五粮液	6,752,682.00	2.21
58	600664	哈药股份	6,665,804.77	2.18
59	600962	国投中鲁	6,624,146.78	2.17
60	000400	许继电气	6,490,175.00	2.12
61	002123	荣信股份	6,334,133.69	2.07
62	600123	兰花科创	6,319,696.19	2.07
63	601628	中国人寿	6,296,388.00	2.06

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,114,373,287.89
卖出股票的收入（成交）总额	941,843,789.79

注：“买入股票的成本”“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

本报告期末，本基金未持有债券。

#### 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

本报告期末，本基金未持有债券。

#### 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

本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

#### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本报告期末，本基金未持有权证。

#### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	831,668.09
2	应收证券清算款	2,880,718.97
3	应收股利	-
4	应收利息	14,851.74
5	应收申购款	197.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,727,436.43

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末，本基金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
7,365	39,811.13	6,220,475.16	2.12%	286,988,484.72	97.88%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	19,788.05	0.01%

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	836,989,022.73
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,407,856.98
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	556,187,919.83
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	293,208,959.88

## §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

2009年11月13日，本基金管理人发布《浦银安盛基金管理有限公司关于董事长变更的公告》，经浦银安盛基金管理有限公司2009年度第二次股东会会议和一届十四次董事会会议审议通过，同意黄建平先生辞去本公司董事暨董事长职务，并选举姜明生先生继任本公司董事暨董事长。

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

报告期内基金的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，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83000元，截止本报告期末，普华永道中天会计师事务所已提供审计服务的连续年限为1年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金	1	482,351,052.38	23.49%	409,997.05	23.86%	-
国泰君安	1	725,749,935.11	35.34%	589,676.99	34.31%	-
申银万国	1	644,332,863.81	31.37%	547,680.67	31.87%	-
国都证券	1	201,358,638.00	9.80%	171,152.96	9.96%	-

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：

报告期内新增，中国国际金融有限公司、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国都证券有限责任公司的交易单元。共计 4 个。

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金	16,006,000.00	48.74%	640,000,000.00	76.19%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	16,241,400.00	49.45%	200,000,000.00	23.81%	-	-
国都证券	594,312.00	1.81%	-	-	-	-

**11.8 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基金合同生效公告	三大证券报及公司网站	2009-6-5
2	关于浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金参加光大银行网上申购基金费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2009-6-27
3	关于浦银安盛基金管理有限公司旗下基金参加中信建投证券有限责任公司基金网银申购优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2009-6-27
4	关于浦银安盛基金管理有限公司旗下基金开通光大银行基金定投业务并参加基金定投优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2009-6-27
5	关于浦银安盛基金管理有限公司旗下基金在中信建投证券有限责任公司开通基金定投业务并参加基金定投优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2009-6-27
6	关于浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告	三大证券报及公司网站	2009-6-27
7	关于浦银安盛基金管理有限公司在浦发银行开展网上基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2009-6-29
8	浦银安盛基金管理有限公司关于调整旗下基金参加光大银行定期定投起点金额的公告	三大证券报及公司网站	2009-7-9
9	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金参加中国工商银行基金定投业务的公告	三大证券报及公司网站	2009-7-22
10	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下基金参与中信银行网上基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2009-7-30
11	关于浦银安盛精致生活混合型证券投资基金开通网上交易定期定额申购业务的公告	三大证券报及公司网站	2009-8-26
12	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下基金在浦发银行推出定期定额投资业务的公告	三大证券报及公司网站	2009-9-12
13	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下基金在兴业证券推出定期定额投资业务的公告	三大证券报及公司网站	2009-9-18
14	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下基金投资创业板证券及风险提示的公告	三大证券报及公司网站	2009-9-24
15	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	三大证券报及公司网站	2009-10-13
16	浦银安盛精致生活混合型证券投资基金2009年第3季度报告	三大证券报及公司网站	2009-10-27
17	浦银安盛基金管理有限公司关于董事长变更的公告	三大证券报及公司网站	2009-11-13
18	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分	三大证券报及公司网	2009-12-24

	基金在申银万国证券开展基金申购费率优惠活动公告的更正	站	
19	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信建投证券开通基金定投业务并参加基金定投费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2009-12-31
20	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加工商银行“2010 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2009-12-31
21	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在申银万国证券开展基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报及公司网站	2009-12-23

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2010年1月21日，本基金管理人公告张建宏先生辞去公司副总经理兼首席投资官职务，由周文桐先生续任公司副总经理兼首席投资官。

2、2009年1月16日，本基金托管人公告聘请胡哲一先生担任副行长。

3、2009年5月14日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书。

4、2009年5月26日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书。

5、2009年5月26日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书。

6、2009年8月2日，本基金托管人公告，自2009年7月24日起陈佐夫先生就任执行董事。

7、2009年9月27日，本基金托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告。

8、2009年10月11日，本基金托管人发布关于控股股东增持本基金托管人股份的公告。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### **13.2 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。

### **13.3 查阅方式**

投资者可登录基金管理人网站（[www.py-axa.com](http://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

二〇一〇年三月三十一日