

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资 基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 3 月 27 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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。

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 2018 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	200,841,265.68 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%+中证全债指数×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。
--------	--

注：本基金业绩比较基准名称于 2016 年 7 月 5 日由“中信标普 A 股综合指数×55%+中证全债指数×45%”变更为“标普中国 A 股综合指数×55%+中证全债指数×45%”，详见本管理人于 2016 年 7 月 5 日刊登的《关于浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准名称变更的公告》。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	田青
	联系电话	021-23212888	010-67595096
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	010-67595096
传真		021-23212985	010-66275853

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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-141,058,039.22	-45,234,535.92	-38,476,993.77
本期利润	-144,951,972.32	-3,409,729.23	-130,096,184.20
加权平均基金份额本期利润	-0.7074	-0.0109	-0.3475
本期基金份额净值增长率	-36.60%	-2.67%	-20.37%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.5199	0.1713	0.2685
期末基金资产净值	250,409,526.31	445,252,509.98	751,838,350.51
期末基金份额净值	1.247	1.967	2.021

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。

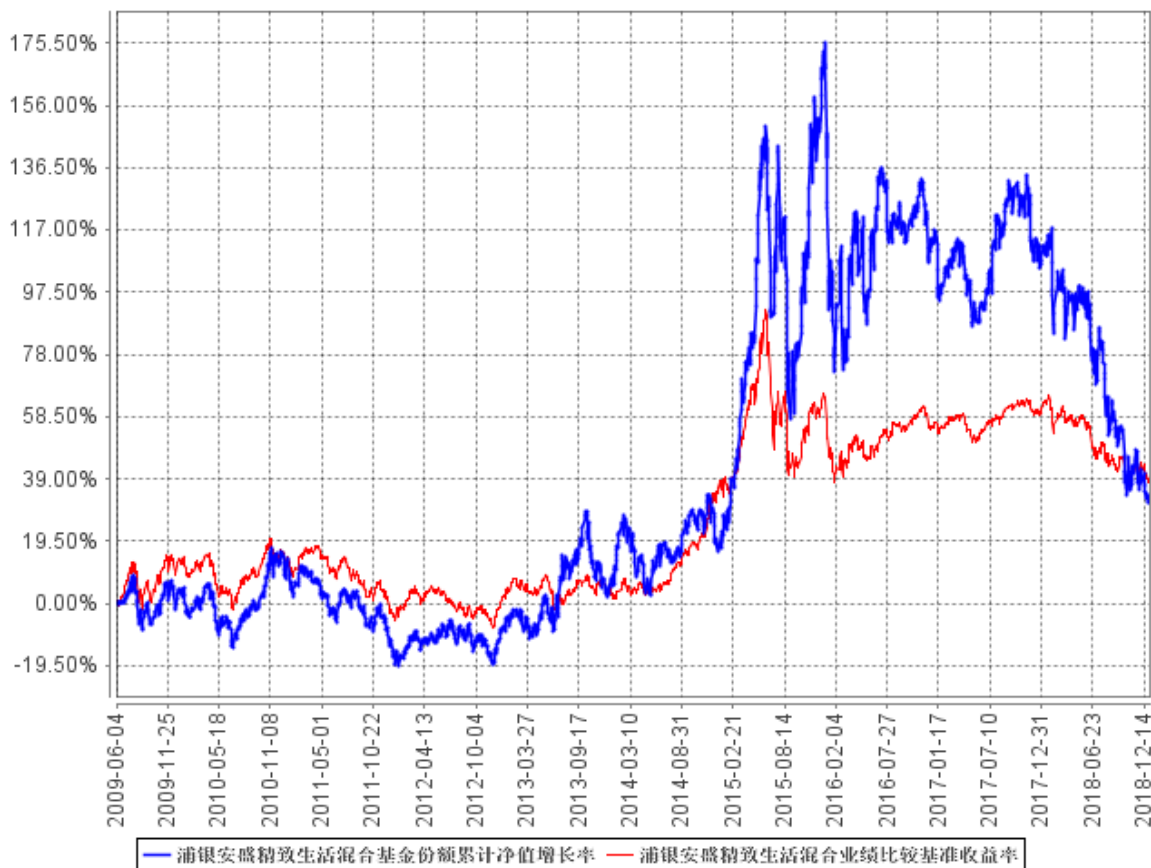
3.2 基金净值表现

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	-14.76%	1.99%	-5.23%	0.91%	-9.53%	1.08%
过去六个月	-26.52%	1.83%	-6.83%	0.80%	-19.69%	1.03%
过去一年	-36.60%	1.81%	-13.52%	0.72%	-23.08%	1.09%
过去三年	-50.87%	1.86%	-15.44%	0.70%	-35.43%	1.16%
过去五年	25.08%	1.99%	32.16%	0.87%	-7.08%	1.12%
自基金合同生效起至今	31.51%	1.68%	38.50%	0.85%	-6.99%	0.83%

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

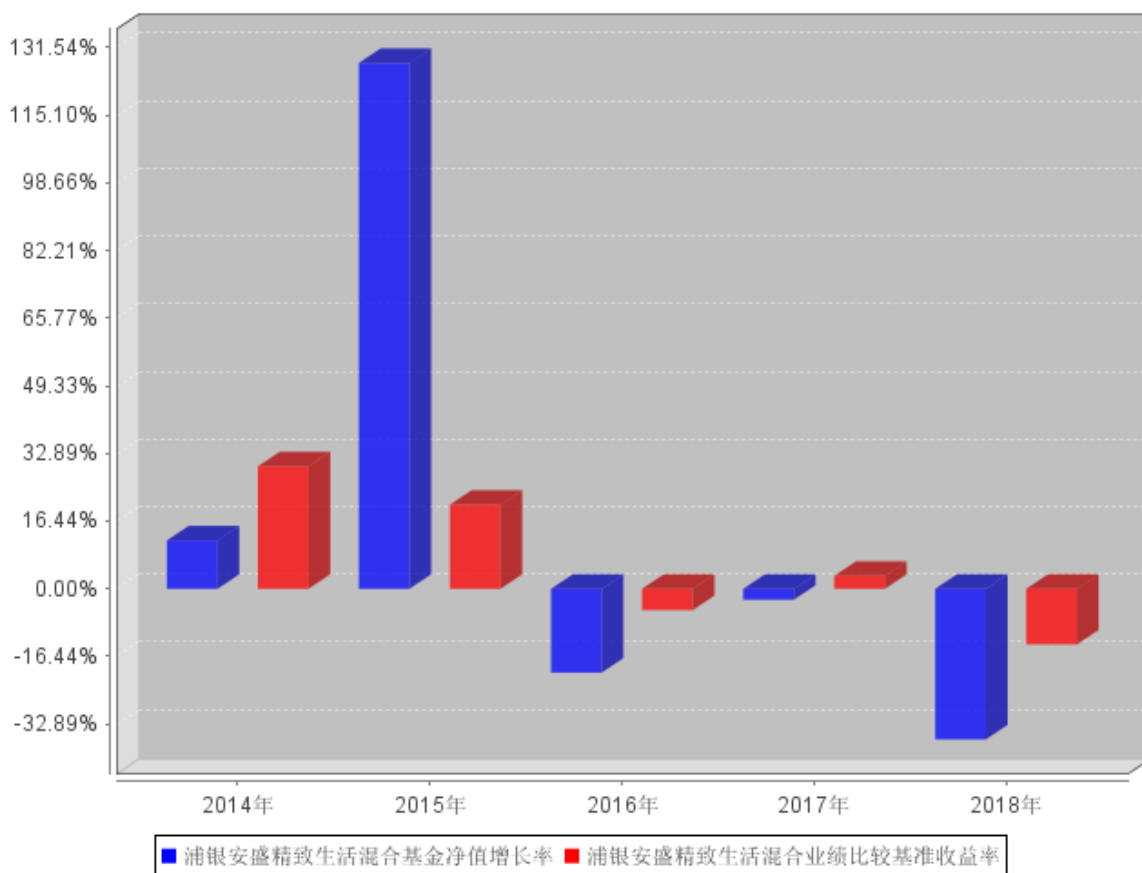
浦银安盛精致生活混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照 2016 年 7 月 5 日披露的《关于浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准名称变更的公告》，比较基准的名称由“中信标普 A 股综合指数”更改为“标普中国 A 股综合指数”。

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

浦银安盛精致生活混合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对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年来未进行过利润分配。

§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有限公司，公司总部设在上海，注册资本为人民币 19.1 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、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2018 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 43 只基金，即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、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、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、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、浦银安盛稳健增利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、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债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	公司首席投资官、权益投资部总监，公司旗下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战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。	2011年5月5日	-	12	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-2016年1月起担任浦银安盛红利精选混合型证券投资基金基金经理。2011年5月起兼任浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2013年3月起，兼任浦银安盛战略新兴产业混合型证券

					<p>投资基金基金经理。 2013 年 12 月至 2018 年 1 月兼任浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 2 月至 2018 年 1 月兼任浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2012 年 11 月起兼任本公司权益投资部总监。2016 年 4 月起兼任本公司首席投资官。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

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组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

2018 年 A 股市场出现估值和业绩的双杀，主要指数年内出现不同程度的持续下行。其中，上证综指较年初下跌 21.33%，深证综指较年初下跌 28.64%，沪深 300、创业板综、中小板综等指数较年初分别下跌 21.14%、26.26%和 30.32%。A 股市场的表现如此之弱是由国内外因素共振

导致的。国际上，中美贸易摩擦持续升温，短期内难以缓解；国内，金融去杠杆导致市场流动性快速下滑，虽然央行进行了几次降准操作，导致无风险利率下降，但以一般贷款加权利率和信托利率为代表的广谱利率并未明显下降，实体经济融资成本没有明显改善，企业盈利的预期也自然无法改善。在资本市场方面，股权质押风险的累积导致市场风险偏好大幅下降。基建投资增速在 2018 年快速下滑，社会消费零售数据表现也较为疲软。总体来看，在持续了多年的高增长以后，中国经济不可避免进入了增速逐步放缓的通道。

2018 年，基金组合在医药、通信、化工、食品等方面进行了超配，但由于仓位持续较高，表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.247 元；本报告期基金份额净值增长率为-36.60%，业绩比较基准收益率为-13.52%。

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 2019 年，我们对 A 股市场谨慎乐观。首先，A 股经过 2018 年的调整以后，整体市场估值已经处于较低的位置，向下空间有限；其次，政府也释放了保持流动性合理、支持民营经济发展等信号，增强了市场信心；最后，中国经济虽然面临增速下滑的挑战，但位居世界第二的经济总量具有较强的韧性，具有较强的纠偏能力。当然，由于经济中的一些中长期问题和疑虑依然存在，市场可能上涨的高度有限。基于对 2019 年 A 股市场估值修复以及弱周期行业盈利确定性较高的预期，我们看好金融、大众消费品、公用事业、竞争格局较好的低估值蓝筹等板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。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以及中债金融估值中心有限公司签订了《中债信息产品服务三方协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 22210 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了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 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了浦银安盛精致生活基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于浦银安盛精致生活基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	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(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

	<p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估浦银安盛精致生活基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算浦银安盛精致生活基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督浦银安盛精致生活基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对浦银安盛精致生活基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致浦银安盛精致生活基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波 罗佳
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日

§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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	37,060,975.17	25,112,933.43
结算备付金		2,816,198.85	3,218,443.75
存出保证金		244,037.77	312,798.95
交易性金融资产	7.4.7.2	204,983,373.43	414,687,633.34
其中：股票投资		204,983,373.43	414,687,633.34
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		8,302,899.35	5,192,156.97
应收利息	7.4.7.5	6,798.08	6,857.85
应收股利		-	-
应收申购款		58,823.88	326,979.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		253,473,106.53	448,857,804.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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		468,891.63	-
应付赎回款		596,976.81	794,258.71
应付管理人报酬		330,782.02	578,553.38
应付托管费		55,130.36	96,425.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,311,590.14	1,788,950.86
应交税费		0.27	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	300,208.99	347,105.64
负债合计		3,063,580.22	3,605,294.16
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	200,841,265.68	226,405,052.52
未分配利润	7.4.7.10	49,568,260.63	218,847,457.46
所有者权益合计		250,409,526.31	445,252,509.98
负债和所有者权益总计		253,473,106.53	448,857,804.14

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.247 元，基金份额总额为 200,841,265.68 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-127,852,004.80	24,200,539.37
1. 利息收入		234,919.24	395,532.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	234,882.57	394,983.02
债券利息收入		36.67	549.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-124,259,938.34	-18,468,551.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-127,968,547.69	-24,519,987.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,215.72	260,038.80
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,705,393.63	5,791,397.29
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,893,933.10	41,824,806.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	66,947.40	448,750.80
减：二、费用		17,099,967.52	27,610,268.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,107,962.42	9,303,092.06

2. 托管费	7.4.10.2.2	851,327.17	1,550,515.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	10,790,937.13	16,357,362.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.14	-
7. 其他费用	7.4.7.20	349,740.66	399,299.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-144,951,972.32	-3,409,729.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-144,951,972.32	-3,409,729.23

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	226,405,052.52	218,847,457.46	445,252,509.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-144,951,972.32	-144,951,972.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-25,563,786.84	-24,327,224.51	-49,891,011.35
其中：1. 基金申购款	31,538,877.13	21,763,495.27	53,302,372.40
2. 基金赎回款	-57,102,663.97	-46,090,719.78	-103,193,383.75
五、期末所有者权益（基金净值）	200,841,265.68	49,568,260.63	250,409,526.31
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	371,987,320.20	379,851,030.31	751,838,350.51

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,409,729.23	-3,409,729.23
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)	-145,582,267.68	-157,593,843.62	-303,176,111.30
其中: 1. 基金申购款	91,675,157.08	87,876,955.22	179,552,112.30
2. 基金赎回款	-237,257,424.76	-245,470,798.84	-482,728,223.60
五、期末所有者权益(基金净值)	226,405,052.52	218,847,457.46	445,252,509.98

报表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:

_____ 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招募说明书》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。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：本基金的股票投资比例为基金资产的 0%-95%；现金、债券资产、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-100%；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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；投资于权证的比例范围占基金资产净值的 0% - 3%。

自基金合同生效日至 2015 年 9 月 16 日，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%。根据本基金管理人于 2015 年 9 月 17 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于变更旗下基金业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 9 月 17 日，本基金业绩比较基准变更为：中信标普 A 股综合指数 X55%+ 中证全债指数 X45%。根据本基金管理人于 2016 年 7 月 5 日发布的《关于浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准名称变更的公告》，“中信标普 A 股综合指数”更名为“标普中国 A 股综合指数”，指数编制方法、计算发布时间、指数历史均无变化，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2016 年 7 月 5 日，本基金业绩比较基准变更为：标普中国 A 股综合指数 X55%+ 中证全债指数 X45%。

本财务报表由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2019 年 3 月 26 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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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，股票的股息、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。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，暂免征收个人所得税。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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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、基金销售机构
浦银安盛基金管理有限公司（“浦银安盛”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海国盛集团资产管理有限公司	基金管理人的股东
法国安盛投资管理有限公司	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,107,962.42	9,303,092.06
其中：支付销售机构的客户维护费	2,110,926.55	4,094,812.44

注：支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月
----	--------------------------	-------------------------------

	月 31 日	31 日
当期发生的基金应支付的托管费	851,327.17	1,550,515.35

注：支付基金托管人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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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

注：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

注：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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
建设银行	37,060,975.17	182,613.96	25,112,933.43	321,261.31

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内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（2018 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**

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
601860	紫金银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
601138	工业富联	2018 年 6 月 8 日	2019 年 6 月 7 日	新股锁定	13.77	10.97	250,760	3,452,965.20	2,750,837.20	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间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

本基金本报告期末无从事交易所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 2018 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 202,182,390.43 元，属于第二层次的余额为 2,800,983.00 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 406,549,062.36 元，第二层次 8,138,570.98 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

交易性金融资产

股票投资

2018 年 1 月 1 日-

购买-

出售-

转入第三层次 5,072,000.00

转出第三层次 5,072,000.00

当期利得或损失总额-

计入损益的利得或损失-

2018 年 12 月 31 日-

-

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入

2018 年度损益的未实现利得或损失的变动(从年初起算)

——公允价值变动损益

交易性金融资产

股票投资

2017 年 01 月 01 日 -

购买-

出售-

转入第三层次-

转出第三层次-

当期利得或损失总额-

计入损益的利得或损失-

2017 年 12 月 31 日-

-

2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入

2017 年度损益的未实现利得或损失的变动(从年初起算)

——公允价值变动损益

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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(2017 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) 其他

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	204,983,373.43	80.87
	其中：股票	204,983,373.43	80.87
7	银行存款和结算备付金合计	39,877,174.02	15.73
8	其他各项资产	8,612,559.08	3.40
9	合计	253,473,106.53	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	8,686,662.12	3.47
C	制造业	116,408,545.43	46.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,631,215.00	4.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,993,789.45	3.99
J	金融业	18,278,545.80	7.30
K	房地产业	28,629,190.18	11.43
M	科学研究和技术服务业	12,355,425.45	4.93
	合计	204,983,373.43	81.86

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	000063	中兴通讯	910,602	17,838,693.18	7.12
2	002007	华兰生物	285,000	9,348,000.00	3.73
3	600340	华夏幸福	360,000	9,162,000.00	3.66
4	000002	万科 A	360,408	8,584,918.56	3.43

5	600048	保利地产	725,800	8,557,182.00	3.42
6	601877	正泰电器	347,767	8,429,872.08	3.37
7	002299	圣农发展	461,878	7,639,462.12	3.05
8	600025	华能水电	2,270,000	7,150,500.00	2.86
9	300457	赢合科技	242,000	6,739,700.00	2.69
10	600031	三一重工	748,900	6,245,826.00	2.49

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	600048	保利地产	48,298,112.40	10.85
2	600426	华鲁恒升	44,872,938.99	10.08
3	600486	扬农化工	43,811,024.50	9.84
4	600298	安琪酵母	43,434,294.10	9.75
5	600690	青岛海尔	41,620,364.32	9.35
6	000063	中兴通讯	39,401,410.97	8.85
7	600183	生益科技	36,105,356.85	8.11
8	600498	烽火通信	34,939,037.53	7.85
9	600585	海螺水泥	34,368,937.40	7.72
10	000830	鲁西化工	32,420,164.00	7.28
11	600340	华夏幸福	32,347,830.22	7.27
12	002146	荣盛发展	30,627,987.61	6.88
13	002727	一心堂	30,395,516.00	6.83
14	600771	广誉远	29,655,633.00	6.66
15	002382	蓝帆医疗	27,915,117.72	6.27
16	300036	超图软件	27,158,927.29	6.10
17	603605	珀莱雅	26,960,168.98	6.06
18	000333	美的集团	26,622,398.98	5.98
19	300618	寒锐钴业	26,506,147.81	5.95
20	300296	利亚德	25,951,635.07	5.83
21	000338	潍柴动力	25,510,189.77	5.73
22	002597	金禾实业	25,451,004.91	5.72
23	601012	隆基股份	25,104,982.20	5.64

24	300168	万达信息	24,548,623.17	5.51
25	600351	亚宝药业	24,545,112.63	5.51
26	600309	万华化学	24,343,814.10	5.47
27	603019	中科曙光	24,293,799.00	5.46
28	600305	恒顺醋业	23,940,433.15	5.38
29	300502	新易盛	23,110,890.00	5.19
30	000661	长春高新	22,856,553.00	5.13
31	000651	格力电器	22,763,922.84	5.11
32	002110	三钢闽光	22,691,909.39	5.10
33	000002	万科 A	22,472,616.48	5.05
34	600702	舍得酒业	22,206,753.20	4.99
35	000895	双汇发展	22,033,142.15	4.95
36	600741	华域汽车	22,007,172.68	4.94
37	300323	华灿光电	21,740,263.00	4.88
38	601318	中国平安	21,324,596.00	4.79
39	300451	创业软件	21,290,512.00	4.78
40	601288	农业银行	21,194,000.00	4.76
41	002258	利尔化学	20,759,778.77	4.66
42	603233	大参林	20,748,277.24	4.66
43	300595	欧普康视	20,732,032.50	4.66
44	603799	华友钴业	20,644,001.80	4.64
45	300232	洲明科技	20,258,428.75	4.55
46	603043	广州酒家	19,858,344.05	4.46
47	002094	青岛金王	19,814,098.27	4.45
48	000858	五粮液	19,714,951.14	4.43
49	600809	山西汾酒	19,551,689.09	4.39
50	002614	奥佳华	19,419,143.00	4.36
51	300409	道氏技术	19,412,299.60	4.36
52	601166	兴业银行	19,318,791.00	4.34
53	002624	完美世界	19,194,970.51	4.31
54	002916	深南电路	18,848,173.64	4.23
55	600519	贵州茅台	18,836,118.00	4.23
56	600260	凯乐科技	18,611,022.27	4.18
57	603367	辰欣药业	18,526,851.17	4.16
58	000910	大亚圣象	18,496,604.00	4.15
59	002281	光迅科技	18,208,118.85	4.09

60	603365	水星家纺	18,157,335.00	4.08
61	600566	济川药业	17,888,909.00	4.02
62	600056	中国医药	17,772,726.72	3.99
63	603589	口子窖	17,285,050.00	3.88
64	600285	羚锐制药	17,244,605.00	3.87
65	002463	沪电股份	17,185,203.60	3.86
66	600596	新安股份	17,002,792.00	3.82
67	603387	基蛋生物	16,967,727.00	3.81
68	300316	晶盛机电	16,760,878.00	3.76
69	600031	三一重工	16,673,056.00	3.74
70	000786	北新建材	16,296,868.00	3.66
71	601233	桐昆股份	16,282,099.18	3.66
72	300474	景嘉微	16,272,570.70	3.65
73	603839	安正时尚	16,270,653.36	3.65
74	600801	华新水泥	15,856,893.00	3.56
75	601222	林洋能源	15,812,506.00	3.55
76	600466	蓝光发展	15,744,482.56	3.54
77	600329	中新药业	15,593,981.59	3.50
78	300732	设研院	15,274,861.80	3.43
79	600176	中国巨石	15,215,040.60	3.42
80	000525	红太阳	15,180,505.00	3.41
81	300482	万孚生物	15,174,940.00	3.41
82	300045	华力创通	15,034,991.10	3.38
83	603886	元祖股份	15,007,523.92	3.37
84	600104	上汽集团	14,942,606.49	3.36
85	300098	高新兴	14,654,352.42	3.29
86	603986	兆易创新	14,644,211.02	3.29
87	000671	阳光城	14,637,132.00	3.29
88	601229	上海银行	14,428,021.80	3.24
89	002304	洋河股份	14,289,432.91	3.21
90	002268	卫士通	13,938,740.80	3.13
91	601636	旗滨集团	13,813,489.50	3.10
92	600197	伊力特	13,710,209.00	3.08
93	600567	山鹰纸业	13,636,052.00	3.06
94	601997	贵阳银行	13,517,959.00	3.04
95	002422	科伦药业	13,480,840.00	3.03

96	600581	八一钢铁	13,430,134.24	3.02
97	603369	今世缘	13,121,298.90	2.95
98	601003	柳钢股份	13,088,164.00	2.94
99	002680	*ST 长生	12,884,545.00	2.89
100	002390	信邦制药	12,606,750.33	2.83
101	000977	浪潮信息	12,523,979.20	2.81
102	600315	上海家化	12,481,518.40	2.80
103	002020	京新药业	12,340,178.96	2.77
104	002327	富安娜	12,228,456.41	2.75
105	000852	石化机械	12,074,884.00	2.71
106	002271	东方雨虹	12,047,210.95	2.71
107	002299	圣农发展	12,038,170.04	2.70
108	600028	中国石化	12,006,000.00	2.70
109	002025	航天电器	11,922,262.65	2.68
110	600606	绿地控股	11,917,111.74	2.68
111	000636	风华高科	11,858,361.00	2.66
112	300602	飞荣达	11,733,245.20	2.64
113	600562	国睿科技	11,455,432.50	2.57
114	300588	熙菱信息	11,388,675.90	2.56
115	002353	杰瑞股份	11,133,884.94	2.50
116	603010	万盛股份	11,057,904.88	2.48
117	603345	安井食品	11,041,030.99	2.48
118	002092	中泰化学	10,984,617.00	2.47
119	603579	荣泰健康	10,793,733.47	2.42
120	300394	天孚通信	10,695,782.78	2.40
121	300659	中孚信息	10,618,887.00	2.38
122	002036	联创电子	10,562,660.30	2.37
123	000650	仁和药业	10,513,684.00	2.36
124	300310	宜通世纪	10,509,588.66	2.36
125	300603	立昂技术	10,395,775.00	2.33
126	002293	罗莱生活	10,386,005.00	2.33
127	002460	赣锋锂业	10,360,670.00	2.33
128	300506	名家汇	10,312,931.40	2.32
129	300369	绿盟科技	10,310,770.98	2.32
130	601111	中国国航	10,288,267.00	2.31
131	002202	金风科技	10,275,517.00	2.31

132	600711	盛屯矿业	10,229,225.00	2.30
133	300550	和仁科技	10,047,734.00	2.26
134	300383	光环新网	10,020,424.20	2.25
135	002234	民和股份	10,012,562.04	2.25
136	002449	国星光电	9,893,635.40	2.22
137	300396	迪瑞医疗	9,695,907.69	2.18
138	300476	胜宏科技	9,643,551.20	2.17
139	002709	天赐材料	9,576,105.00	2.15
140	002384	东山精密	9,524,115.46	2.14
141	002007	华兰生物	9,486,823.94	2.13
142	300457	赢合科技	9,243,041.00	2.08
143	603959	百利科技	9,158,186.77	2.06
144	603808	歌力思	9,157,475.93	2.06
145	603359	东珠生态	9,087,669.00	2.04
146	002229	鸿博股份	8,955,956.00	2.01
147	000933	神火股份	8,946,359.07	2.01
148	002589	瑞康医药	8,939,209.00	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	600498	烽火通信	44,974,748.28	10.10
2	600183	生益科技	44,531,796.94	10.00
3	600426	华鲁恒升	43,122,215.67	9.68
4	600298	安琪酵母	41,772,341.52	9.38
5	600486	扬农化工	40,324,091.21	9.06
6	601318	中国平安	38,987,921.00	8.76
7	600690	青岛海尔	37,669,056.59	8.46
8	600048	保利地产	36,491,062.10	8.20
9	600260	凯乐科技	36,336,091.91	8.16
10	000063	中兴通讯	35,388,063.00	7.95
11	300323	华灿光电	34,450,068.71	7.74
12	600585	海螺水泥	33,349,443.57	7.49
13	300502	新易盛	31,954,172.15	7.18
14	000830	鲁西化工	31,826,349.52	7.15

15	600309	万华化学	31,169,992.00	7.00
16	600741	华域汽车	29,782,390.50	6.69
17	600056	中国医药	29,617,781.72	6.65
18	002304	洋河股份	29,471,640.28	6.62
19	600771	广誉远	29,399,053.00	6.60
20	603605	珀莱雅	29,161,020.60	6.55
21	002146	荣盛发展	28,944,585.94	6.50
22	603589	口子窖	28,906,468.03	6.49
23	300618	寒锐钴业	27,819,489.40	6.25
24	300036	超图软件	27,287,462.01	6.13
25	002281	光迅科技	26,768,341.81	6.01
26	002597	金禾实业	26,192,811.81	5.88
27	002727	一心堂	26,132,469.35	5.87
28	300168	万达信息	25,916,028.16	5.82
29	603233	大参林	25,607,601.32	5.75
30	000333	美的集团	25,606,549.54	5.75
31	000895	双汇发展	24,950,006.55	5.60
32	000338	潍柴动力	23,885,483.00	5.36
33	300296	利亚德	23,882,161.11	5.36
34	600351	亚宝药业	23,518,491.69	5.28
35	002382	蓝帆医疗	22,901,694.57	5.14
36	000651	格力电器	22,646,567.68	5.09
37	601012	隆基股份	22,590,957.00	5.07
38	002110	三钢闽光	22,000,212.58	4.94
39	300595	欧普康视	21,947,498.60	4.93
40	603019	中科曙光	21,851,869.00	4.91
41	603799	华友钴业	21,444,263.30	4.82
42	000661	长春高新	21,413,867.98	4.81
43	600340	华夏幸福	21,120,987.69	4.74
44	603387	基蛋生物	20,837,892.80	4.68
45	600702	舍得酒业	20,537,299.18	4.61
46	002916	深南电路	20,495,564.13	4.60
47	600487	亨通光电	20,431,162.00	4.59
48	002258	利尔化学	20,384,728.19	4.58
49	000858	五粮液	20,067,694.26	4.51
50	600985	淮北矿业	19,970,366.70	4.49
51	600596	新安股份	19,842,717.57	4.46
52	300232	洲明科技	19,674,262.40	4.42

53	300451	创业软件	19,561,565.00	4.39
54	002463	沪电股份	19,459,495.00	4.37
55	002614	奥佳华	18,835,116.30	4.23
56	600567	山鹰纸业	18,395,650.60	4.13
57	600305	恒顺醋业	18,175,284.10	4.08
58	300409	道氏技术	18,098,851.15	4.06
59	603043	广州酒家	18,035,074.45	4.05
60	300316	晶盛机电	17,960,626.20	4.03
61	600522	中天科技	17,816,195.02	4.00
62	002094	青岛金王	17,814,078.60	4.00
63	000910	大亚圣象	17,128,416.92	3.85
64	600809	山西汾酒	17,086,728.94	3.84
65	002156	通富微电	17,002,097.93	3.82
66	002624	完美世界	16,808,928.30	3.78
67	600104	上汽集团	16,798,215.10	3.77
68	600566	济川药业	16,782,457.00	3.77
69	000488	晨鸣纸业	16,503,052.05	3.71
70	603839	安正时尚	16,235,965.55	3.65
71	603365	水星家纺	16,174,609.56	3.63
72	600519	贵州茅台	16,076,938.80	3.61
73	600801	华新水泥	16,059,415.78	3.61
74	000537	广宇发展	15,989,999.78	3.59
75	600066	宇通客车	15,780,741.90	3.54
76	600285	羚锐制药	15,704,074.23	3.53
77	000786	北新建材	15,223,994.01	3.42
78	601288	农业银行	15,122,571.00	3.40
79	300098	高新兴	15,013,407.36	3.37
80	601222	林洋能源	14,892,410.00	3.34
81	601233	桐昆股份	14,743,524.60	3.31
82	300045	华力创通	14,741,576.99	3.31
83	000671	阳光城	14,495,386.72	3.26
84	601229	上海银行	14,302,596.40	3.21
85	000525	红太阳	14,157,410.00	3.18
86	603986	兆易创新	14,117,131.00	3.17
87	002268	卫士通	14,080,646.58	3.16
88	300482	万孚生物	14,074,993.00	3.16
89	600581	八一钢铁	14,017,125.00	3.15
90	600176	中国巨石	13,999,931.33	3.14

91	000002	万科 A	13,916,815.00	3.13
92	300474	景嘉微	13,696,297.40	3.08
93	300661	圣邦股份	13,668,449.76	3.07
94	603367	辰欣药业	13,608,093.10	3.06
95	603886	元祖股份	13,510,665.05	3.03
96	600329	中新药业	13,484,553.71	3.03
97	600315	上海家化	13,167,290.07	2.96
98	601003	柳钢股份	13,078,750.05	2.94
99	002180	纳思达	12,955,303.68	2.91
100	000852	石化机械	12,941,959.00	2.91
101	601166	兴业银行	12,940,850.00	2.91
102	601601	中国太保	12,827,720.00	2.88
103	002020	京新药业	12,790,429.00	2.87
104	601997	贵阳银行	12,766,034.00	2.87
105	600966	博汇纸业	12,629,285.48	2.84
106	000977	浪潮信息	12,491,443.92	2.81
107	600466	蓝光发展	12,333,931.00	2.77
108	601636	旗滨集团	12,243,759.00	2.75
109	300588	熙菱信息	11,999,899.00	2.70
110	002680	*ST 长生	11,941,670.19	2.68
111	002422	科伦药业	11,823,055.45	2.66
112	300506	名家汇	11,817,106.00	2.65
113	002390	信邦制药	11,798,323.65	2.65
114	002271	东方雨虹	11,724,360.57	2.63
115	002353	杰瑞股份	11,543,410.35	2.59
116	002491	通鼎互联	11,535,109.90	2.59
117	603010	万盛股份	11,524,831.96	2.59
118	603369	今世缘	11,349,500.57	2.55
119	000650	仁和药业	11,302,371.00	2.54
120	600197	伊力特	11,118,959.06	2.50
121	300394	天孚通信	11,011,455.82	2.47
122	002460	赣锋锂业	10,867,962.00	2.44
123	600562	国睿科技	10,801,579.10	2.43
124	300310	宜通世纪	10,797,800.15	2.43
125	603345	安井食品	10,625,303.24	2.39
126	600606	绿地控股	10,546,841.00	2.37
127	002025	航天电器	10,481,684.08	2.35
128	300369	绿盟科技	10,452,043.69	2.35

129	600031	三一重工	10,435,236.00	2.34
130	000636	风华高科	10,401,818.00	2.34
131	601111	中国国航	10,401,052.25	2.34
132	002327	富安娜	10,256,621.73	2.30
133	600028	中国石化	10,123,608.00	2.27
134	603579	荣泰健康	10,071,940.58	2.26
135	300603	立昂技术	9,931,882.00	2.23
136	002636	金安国纪	9,865,973.35	2.22
137	300659	中孚信息	9,659,372.60	2.17
138	002293	罗莱生活	9,604,400.00	2.16
139	002384	东山精密	9,577,823.56	2.15
140	300602	飞荣达	9,466,089.80	2.13
141	300383	光环新网	9,464,166.93	2.13
142	300550	和仁科技	9,458,118.00	2.12
143	002036	联创电子	9,383,753.32	2.11
144	300476	胜宏科技	9,345,371.25	2.10
145	002234	民和股份	9,337,587.21	2.10
146	002713	东易日盛	9,314,333.00	2.09
147	002449	国星光电	9,281,160.34	2.08
148	002092	中泰化学	9,132,576.20	2.05

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

买入股票成本（成交）总额	3,500,856,266.80
卖出股票收入（成交）总额	3,578,981,911.17

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

注：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序的前五名债券投资明细

注：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序的前十名资产支持证券投资明细

注：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

注：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序的前五名权证投资明细

注：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**

注：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

注：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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	244,037.77
2	应收证券清算款	8,302,899.35
4	应收利息	6,798.08
5	应收申购款	58,823.88
9	合计	8,612,559.08

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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
12,861	15,616.30	1,402,597.59	0.70%	199,438,668.09	99.30%

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	269,372.20	0.13%

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的情况

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§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	226,405,052.52
本报告期期间基金总申购份额	31,538,877.13
减：本报告期期间基金总赎回份额	57,102,663.97
本报告期末基金份额总额	200,841,265.68

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会。

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

报告期内基金管理人、基金托管人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 10 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

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。

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	
东方证券	1	1,349,781,980.68	19.09%	1,257,049.16	19.09%	-
西南证券	1	1,188,264,357.25	16.81%	1,106,632.50	16.81%	-
长江证券	1	1,049,009,575.37	14.84%	976,943.46	14.84%	-
东吴证券	1	907,674,907.24	12.84%	845,313.65	12.84%	-
太平洋证券	1	845,653,090.75	11.96%	787,558.51	11.96%	-
国泰君安	1	718,058,884.65	10.16%	668,729.01	10.16%	-
申万宏源	1	559,897,624.69	7.92%	521,432.61	7.92%	-
中金	1	452,100,324.56	6.39%	421,040.04	6.39%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	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：

本基金本报告期内新增太平洋证券、国盛证券和中山证券交易单元。

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	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	118,453.59	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关规定，经与基金托管人协商一致，浦银安盛基金管理有限公司对旗下所涉及的公开募集证券投资基金的基金合同有关条款进行了修改。详见本基金管理人于 2018 年 3 月 30 日发布的《关于根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改基金合同的公告》。

2、经公司董事会决议通过，浦银安盛基金管理有限公司在上海、北京和深圳设立分公司。相关工商登记注册手续已办理完毕，并取得营业执照。详见基金管理人于 2018 年 6 月 6 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告》和 2019 年 1 月 8 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于设立北京、深圳分公司的公告》。

浦银安盛基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日