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:二〇一二年三月二十六日

浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

§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 2012 年 3 月 23 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 2011 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	112,522,254.57 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	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。 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。 在债券投资策略方面,在资本市场国际化的背景下,通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势,采取自上而下的策略构造组合。在权证投资策略方面,本基金将按照法律法规相关规定进行权证投资。
业绩比较基准	中信标普 A 股综合指数×55%+中信标普全债指数×45%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金, 坚持长期和力争为基金持有人带来稳健回报的投资理念,属于证券投资基金中的中等收益、中等风险品种。一般情形下,其风险和收益低于股票型基金,高于货币型基金、债券型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的安全和增值。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

登载基金年度报告摘要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	2011年	2010年	2009年6月4日至2009年12月31日
本期已实现收益	-9,156,865.31	19,682,221.40	12,036,009.88
本期利润	-30,684,152.67	14,284,820.77	32,755,944.64
加权平均基金份额本期利润	-0.2530	0.0642	0.0600
本期基金份额净值增长率	-24.30%	7.89%	4.2%
3.1.2 期末数据和指标	**2011年末**	**2010年末**	**2009年末**
期末可供分配基金份额利润	-0.1930	0.0656	0.0302
期末基金资产净值	90,809,305.70	147,349,834.79	305,580,598.06
期末基金份额净值	0.807	1.066	1.042

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人申购、赎回基金等各项交易费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入 (不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

5、本基金 (基金合同)生效日为 2009 年 6 月 4 日,因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2009 年 12 月 31 日数据。

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

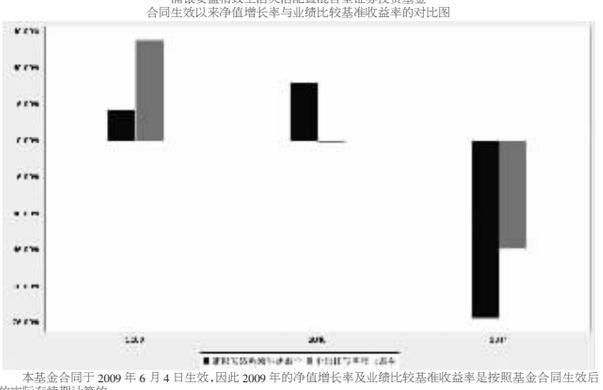
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.81%	1.21%	-5.48%	0.82%	-3.33%	0.39%
过去六个月	-15.14%	1.08%	-13.48%	0.78%	-1.66%	0.30%
过去一年	-24.30%	1.02%	-14.78%	0.74%	-9.52%	0.28%
自基金合同生效起至今	-14.89%	1.14%	-3.30%	0.88%	-11.59%	0.26%

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
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 2011 年 12 月 31 日)

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



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 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011年	-	-	-	-	-
2010年	0.600	7,229,736.29	1,904,783.30	9,134,519.59	-
2009年	-	-	-	-	-
合计	0.600	7,229,736.29	1,904,783.30	9,134,519.59	-

§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 2011 年 12 月 31 日止,浦银安盛旗下共管理 7 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和浦银安盛增利分级债券型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴勇	本基金基金经理、浦银红利基金基金经理	2011-05-05	-	4	吴勇先生, 上海交通大学工商管理硕士,上海交通大学材料工程系学士,CPA、CFA、中国注册造价师。1993 年 8 月至 2002 年 12 月在上海电力建设有限责任公司任预算主管,2003 年 1 月至 2007 年 8 月在国家开发银行上海市分行任评审经理,2007 年 9 月起加盟浦银安盛基金管理有限公司任职研究员,2009 年 8 月起担任浦银安盛精致生活混合型证券投资基金基金经理助理。2010 年 2 月至 4 月,担任浦银安盛红利精选股票基金基金经理助理。2010 年 4 月起,担任浦银安盛红利精选股票基金基金经理。2011 年 5 月起,兼任本基金基金经理之职。
刘佳玮	本基金基金经理助理	2011-07-01	-	4	刘佳玮女士,伦敦大学经济学硕士。2007 年 7 月起先后任职于中投证券、中银证券和上海从容投资管理公司,历任助理研究员、分析师和周期性行业研究员。2010 年 9 月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任行业研究员。2011 年 7 月起,担任本基金基金经理助理以及浦银安盛精致生活混合基金基金经理助理。
林峰	本基金前基金经理	2009-06-04	2011-05-05	16	林峰先生, 上海交通大学工商管理硕士。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 月到 2011 年 5 月 5 日,担任本基金基金经理。

注:1、林峰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。

2、此处吴勇的 "任职日期"和林峰的 "离任日期"均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,以及公司的规章制度,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人修订了《公平交易管理规定》,建立健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

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;另一方面是公司对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

本基金管理人旗下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

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

2011 年 A 股市场呈现单边下跌走势,沪深 300 指数全年下跌 25.01%。从宏观经济角度来看,高通胀和经济增速下滑是贯穿全年的主基调。由于海外经济疲软,国内净出口增速下滑,且从中长期来看外需对国内净出口的拉动作用在持续减弱;受制于房地产政策的持续,投资增速也呈现下滑趋势;持续多年的高速信贷投放造成物价上涨幅度较大。因此 2011 年国内经济总体呈现类滞涨状态。从市场角度来看,以银行为代表的蓝筹股估值较低,但上市公司整体业绩增速呈现下滑状态。

2011 年生活基金保持了高于基准的仓位,在行业方面超配了银行、食品饮料、医药、TMT 等板块,而在煤炭、钢铁、化工等板块保持了低配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 0.807 元。由于超配的医药、TMT 等板块在报告期内表现较差,本年度净值表现低于比较基准,报告期内基金业绩为-24.30%,基准业绩-14.78%。

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 2012 年,国内经济可能保持相对稳定的增长。虽然由于基数原因,CPI 可能比 2011 年较低,但绝对物价还是保持在较高水平,因此货币政策难以大幅放松。在经历了 2011 年的单边下跌以后,市场可能产生估值修复行情,蓝筹股具有估值优势,而中小盘股票则两级分化,业绩确定性较强、符合经济和产业发展方向的公司具有较好的投资价值。

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兼首席运营官、风险管理部负责人、金融工程部负责人、研究部负责人、基金会计部负责人组成。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,当存在异议时,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。

本基金自 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日期间未进行收益分配,符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

§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 (2012)第 20544 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 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 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。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报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:

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会 (以下简称 "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财务报表,并使其实现公允反映;

(2)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。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行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中国注册会计师职业道德守则,计划和执行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。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

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。

6.3 审计意见

我们认为,上述 浦银安盛精致生活基金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监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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度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 王灵
上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
2012-03-21

§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:2011 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	22,308,942.19	41,112,649.11
结算备付金		438,302.59	221,821.85
存出保证金		500,000.00	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	68,115,121.38	104,088,487.72
其中:股票投资		68,115,121.38	100,695,986.32
基金投资		-	-
债券投资		-	3,392,501.40
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		810,670.77	2,513,446.63
应收利息	7.4.7.5	4,494.26	14,647.24
应收股利		-	-
应收申购款		21,872.51	5,338.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		92,199,403.70	148,206,391.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010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		434,960.24	-
应付赎回款		11,499.69	158,737.59
应付管理人报酬		121,517.86	191,883.20
应付托管费		20,252.98	31,980.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	171,866.59	173,655.83
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	630,000.64	300,299.50
负债合计		1,390,098.00	856,556.67
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	112,522,254.57	138,280,061.77
未分配利润	7.4.7.10	-21,712,948.87	9,069,773.02
所有者权益合计		90,809,305.70	147,349,834.79
负债和所有者权益总计		92,199,403.70	148,206,391.46

注:报告截止日 2011 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.807 元,基金份额总额 112,522,254.57 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:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入		-27,292,994.06	20,033,917.10
1.利息收入		258,261.51	569,528.84
其中:存款利息收入	7.4.7.11	240,604.49	502,171.98
债券利息收入		13,863.73	49,606.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,793.29	17,750.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益 (损失以 "-"填列)		-6,040,463.82	24,692,611.57
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-7,077,638.22	23,728,521.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	478,690.35	297,120.07
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	558,484.05	666,970.29
3.公允价值变动收益 (损失以 "-"号填列)	7.4.7.16	-21,527,287.36	-5,397,400.63
4.汇兑收益 (损失以 "-"号填列)		-	-
5.其他收入 (损失以 "-"号填列)	7.4.7.17	16,495.61	169,177.32
减:二、费用		3,391,158.61	5,749,096.33
1.管理人报酬		1,755,909.03	3,342,770.22
2.托管费		292,651.46	557,128.37
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	938,750.58	1,442,941.86
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	403,847.54	406,255.88
三、利润总额 (亏损总额以 "-"号填列)		-30,684,152.67	14,284,820.77
减:所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以 "-"号填列)		-30,684,152.67	14,284,820.77

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:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	138,280,061.77	9,069,773.02	147,349,834.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-30,684,152.67	-30,684,152.67
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)	-25,757,807.20	-98,569.22	-25,856,376.42
其中:1.基金申购款	3,452,109.59	-105,994.18	3,346,115.41
2.基金赎回款	-29,209,916.79	7,424.96	-29,202,491.83
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)	112,522,254.57	-21,712,948.87	90,809,305.70
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	293,208,959.88	12,371,638.18	305,580,598.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	14,284,820.77	14,284,820.77
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)	-154,928,898.11	-8,452,166.34	-163,381,064.45
其中:1.基金申购款	21,279,372.66	-86,645.50	21,192,727.16
2.基金赎回款	-176,208,270.77	-8,365,520.84	-184,573,791.61
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)	-	-9,134,519.59	-9,134,519.59
五、期末所有者权益 (基金净值)	138,280,061.77	9,069,773.02	147,349,834.79

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从 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:钱华,主管会计工作负责人:陈麓,会计机构负责人:赵迎华

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, 已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%。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 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定 (以下合称 "企业会计准则")、中国证监会公告 [2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券协会于 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 2011 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最新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 2010 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 [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 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	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
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

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

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 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,755,909.03	3,342,770.22
其中:支付销售机构的客户维护费	405,183.33	751,704.59

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	292,651.46	557,128.37

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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	22,308,942.19	236,559.73	41,112,649.11	497,998.85

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无其他关联交易事项。

7.4.9 期末 (2011 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

本基金本报告期内未持有因认购新发/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 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300043	星辉车模	2011-10-26	公告重大事项	17.85	2012-01-09	16.07	30,000	423,607.52	535,500.00	-

注:本基金截至 2011 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.