

**安信平稳增长混合型发起式证券投资基金2013年半年度报告**

**2013年6月30日**

**基金管理人：安信基金管理有限责任公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

**送出日期：2013年8月29日**

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

### 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§2 基金简介	3
2.1 基金基本情况	3
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12

§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 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	43
7.7 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	44
7.8 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	44
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.10 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.3 发起式基金发起资金持有份额情况	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录	49
11.2 存放地点	49
11.3 查阅方式	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信平稳增长混合型发起式证券投资基金
基金简称	安信平稳增长混合发起
基金主代码	750005
交易代码	750005
基金运作方式	契约型开放式发起式

基金合同生效日	2012年12月18日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	79,461,747.43份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	通过稳健的资产配置策略,将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置,并通过积极主动的股票投资和债券投资,把握中国经济增长和资本市场发展机遇,严格控制下行风险,力争实现基金份额净值的长期平稳增长。
投资策略	<p>1、资产配置策略:研究与跟踪宏观经济运行状况和资本市场变动特征,分析类别资产预期收益和预期风险,根据最优风险报酬比原则确定资产配置比例并进行动态调整。</p> <p>2、上市公司研究方法:以深入细致的公司研究推动股票的精选与投资。在对上市公司的研究中,采用安信基金三因素分析法,即重点分析上市公司的盈利模式、竞争优势和其所处行业的发展环境。</p> <p>3、股票投资策略:坚持价值投资理念,以PE/PB等估值指标入手对价值型公司进行评估,在扎实深入的公司研究基础上,重点发掘出价值低估的股票。</p> <p>4、债券投资策略:采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会。</p>
业绩比较基准	$50\% \times \text{中证800指数收益率} + 50\% \times \text{中债总指数收益率}$
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

## 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	安信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙晓奇
	联系电话	0755-82509908
	电子邮箱	sunxq@essencefund.com
		赵会军
		010-66105799
		custody@icbc.com.cn

客户服务电话	4008-088-088	95588
传真	0755-82799292	010-66105798
注册地址	广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518026	100140
法定代表人	牛冠兴	姜建清

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	安信基金管理有限责任公司 地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013年1月1日至2013年6月30日）
本期已实现收益	1,786,000.71
本期利润	-2,002,844.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0169
本期加权平均净值利润率	-1.69%
本期基金份额净值增长率	-4.10%

<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	-3,197,179.22
期末可供分配基金份额利润	-0.0402
期末基金资产净值	76,264,568.21
期末基金份额净值	0.960
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-4.00%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

## 3.2 基金净值表现

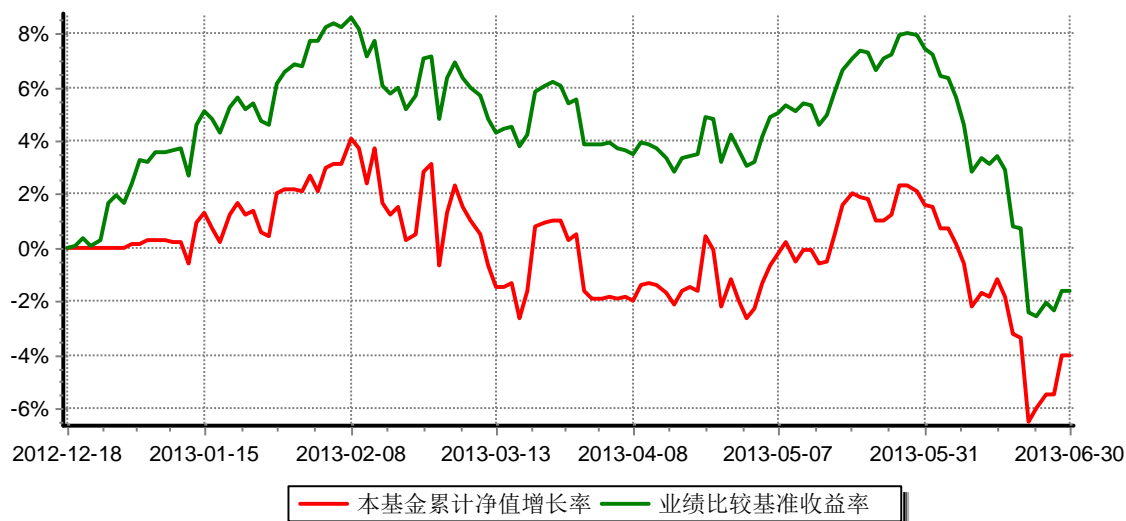
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.51%	1.05%	-8.38%	0.97%	2.87%	0.08%
过去三个月	-2.14%	0.83%	-5.22%	0.74%	3.08%	0.09%
过去六个月	-4.10%	0.94%	-4.70%	0.74%	0.60%	0.20%
自基金合同生效日起至今（2012年12月18日-2013年06月30日）	-4.00%	0.90%	-1.60%	0.73%	-2.40%	0.17%

注：1、根据《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：50%\*中证800指数收益率+50%\*中债总指数（全价）收益率。中证800指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是由中证500和沪深300成份股一起构成，中证800指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

2、本基金基金合同生效日为2012年12月18日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。表中所列自基金合同生效起至今基金及业绩比较基准的相关数值为2012年12月18日至2013年6月30日间各自的实际数值。

### 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



注：1、本基金的建仓期为2012年12月18日至2013年6月17日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为2012年12月18日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2012年12月18日至2013年6月30日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于2011年12月，总部位于深圳，注册资本2亿元人民币，股东及股权结构为：安信证券股份有限公司持有49%的股权，五矿资本控股有限公司持有36%的股权，中广核财务有限责任公司持有15%的股权。

截至2013年6月30日，本基金管理人共管理4只开放式基金，具体如下：从2012年6月20日起管理安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金；从2012年9月25日起管理安信目标收益债券型证券投资基金；从2012年12月18日起管理安信平稳增长混合型发起式证券投资基金；从2013年2月5日起管理安信现金管理货币市场基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪建	本基金的基金经理、公司副总经理	2012年12月18日	—	12	汪建先生，副总经理，经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，衍生产品部一级研究员、董事总经理，资产委托管理总部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，分管投资、研究业务。2012年12月18日至今，任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理。
李勇	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2012年12月18日	—	7	李勇先生，经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。2012年9月25日至今，任安信目标收益债券型证券投资基金的基金经理；2012年12月18日至今，任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理；2013年2月5日至今，任安信现金管理货币市场基金的基金经理。
庄园	本基金的基金经理助理	2012年12月28日	—	10	庄园女士，经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员，工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员，



					<p>中国国际金融有限公司资产管理部高级经理，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012年5月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。2012年6月21日至今，任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；2012年12月28日至今，任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理助理。</p>
黄立华	本基金的基金经理助理	2013年3月1日	—	9	<p>黄立华先生，理学硕士、工商管理硕士，注册金融分析师(CFA)。历任中国科学院上海天文台射电天文实验室研究助理，Motorola（美国）软件开发部软件工程师，Lanac Technology（美国）软件开发部项目经理，Emory Investment Management（美国）股票投资部研究员，Earnest Partners(美国)股票投资部股票研究员、投资经理，安信证券股份有限公司证券投资部高级投资经理。2013年2月加入安信基金管理有限责任公司基金投资部。2013年3月1日至今，任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理助理。</p>

注：1、本基金基金经理汪建、李勇的“任职日期”按基金合同生效日填写；基金经理助理庄园、黄立华的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定确定的解聘日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

本基金管理人采用T值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，本公司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未超过该证券当日成交量的5%。

#### 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

2013年上半年，宏观经济仍处于弱复苏环境中，上市公司业绩逐渐恢复，增速货币政策维持中性，物价基本稳定。随着6月下旬银行间市场资金环境急转直下，股票和债券市场同时出现较大幅度调整。中证800指数大幅下跌，将1季度的反弹尽数抹去并创下数年来的新低。今年上半年股票市场呈现严重的结构性分化格局，以沪深300成份股为代表的大盘蓝筹股票表现惨淡、迭创新低，以创业板为代表的新兴成长公司有强劲的市场表现，二者表现持续严重背离。

管理人在6月初基于市场的中期判断，下调了股票类资产配置比例，一定程度减轻了市场大幅下跌的损失。但由于对新兴成长公司的预期不足，持有比例较低，因此未能获得绝对回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，本基金份额净值为0.960元，报告期末份额净值增长率-4.10%，同期业绩比较基准增长率为-4.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们预计宏观经济将继续弱复苏的过程直至年末，资金面将处于紧平衡状态，市场广谱利率将维持在偏高位置，这将持续制约市场的估值水平。随着市场二元结构的加剧，高成长公司的业绩风险和估值风险将在下半年有所体现，大盘蓝筹公司则将在较低的估值区间反复筑成中长期的底部。

基于中国经济转型和结构调整的大格局，我们对股票市场的长期表现有相对乐观的判断，市场的调整将有利于更长期的表现。2013年下半年，管理人将继续审慎管理基金资产，积极把握市场调整带来的阶段性投资机会，降低持仓成本，等待布局更佳的投资机遇。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《安信基金管理有限责任公司估值管理制度》开展。

公司基金的日常估值业务由运营部负责，运营部在日常估值管理中，必须严格遵循各项法律法规及基金合同的规定，及时准确对基金资产估值事项进行基金估值。运营部对基金所使用的估值系统进行总体规划和组织实施，建立并不断完善基金资产估值系统。另外，公司成立基金估值委员会，主任委员由公司总经理担任，成员由副总经理、运营部、研究部、监察稽核部人员组成，投资部门相关人员列席。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证公司估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会采取临时会议的方式召开会议，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营部应及时提请估值委员会召开会议修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会会议决议须经全体委员半数以上投票表决同意方能通过，并形成书面文件妥善保管。对于重大事项，应在充分征求监管机构、托管银行、会计师事务所、律师事务所意见的基础上，再行表决。估值政策和程序的修订经估值委员会审批通过后方可实施。

估值委员会中各成员的职责分工如下：运营部凭借专业技能和对市场产品长期丰富

的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。研究部凭借丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展及个股状况等因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果建议应采用的估值方法及合理的估值区间。研究部根据估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核部对估值委员会临时会议的全程讨论、做出的决议、提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。投资部门相关人员和基金经理有权列席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期无需进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照本基金合同的约定适时向投资者予以分配。

## **§ 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**

本报告期内，本基金托管人在对安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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**

本报告期内，安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的管理人——安信基金管理有限公司在安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，安信平稳增长混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对安信基金管理有限公司编制和披露的安信平稳增长混合型发起式证券投资基金2013年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,889,395.88	2,002,249.65
结算备付金		2,343,989.91	—
存出保证金		165,216.59	—
交易性金融资产	6.4.7.2	66,192,495.37	32,575,165.67
其中：股票投资		49,544,074.17	32,575,165.67
基金投资		—	—
债券投资		16,648,421.20	—
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	150,060,000.10
应收证券清算款		1,889,090.60	22,289,181.78
应收利息	6.4.7.5	109,426.13	12,740.15
应收股利		311,444.37	—
应收申购款		3,152.71	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		76,904,211.56	206,939,337.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年6月30日</b>	<b>上年度末 2012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	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		225,185.04	—
应付管理人报酬		97,769.20	110,036.94
应付托管费		16,294.86	18,339.49
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	125,984.67	28,600.95
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	174,409.58	—
负债合计		639,643.35	156,977.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	79,461,747.43	206,476,629.44
未分配利润	6.4.7.10	-3,197,179.22	305,730.53
所有者权益合计		76,264,568.21	206,782,359.97
负债和所有者权益总计		76,904,211.56	206,939,337.35

注：报告截止日为2013年6月30日，基金份额净值0.960元，基金份额总额79,461,747.43份。

## 6.2 利润表

会计主体：安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-109,354.34
1.利息收入		599,634.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,856.71

债券利息收入		94,203.16
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		455,575.02
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,876,377.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,092,094.93
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	-22,828.32
资产支持证券投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	807,110.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,788,845.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	203,478.60
<b>减：二、费用</b>		1,893,490.29
1. 管理人报酬		892,209.83
2. 托管费		148,701.65
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	673,464.52
5. 利息支出		582.37
其中：卖出回购金融资产支出		582.37
6. 其他费用	6.4.7.19	178,531.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-2,002,844.63
减：所得税费用		—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,002,844.63
-------------------	--	---------------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	206,476,629.44	305,730.53	206,782,359.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-2,002,844.63	-2,002,844.63
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)	-127,014,882.01	-1,500,065.12	-128,514,947.13
其中：1.基金申购款	34,408,833.71	-142,955.36	34,265,878.35
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-161,423,715.72	-1,357,109.76	-162,780,825.48
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）	79,461,747.43	-3,197,179.22	76,264,568.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王连志

姜志刚

尚尔航

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况



安信平稳增长混合型发起式证券投资基金（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”）2012年11月2日下发的证监许可[2012]1447号文“关于核准安信平稳增长混合型发起式证券投资基金募集的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为2012年11月19日至2012年12月14日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集206,444,921.59元，经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第60962175\_H07号验资报告。经向中国证监会备案，《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金基金合同》于2012年12月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为206,476,629.44份基金份额，其中认购资金利息折合31,707.85份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金合同》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，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、债券、中期票据、资产支持证券、银行存款等货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，现金或者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： $50\% \times \text{中证800指数收益率} + 50\% \times \text{中债总指数收益率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2013年6月30日的财务状况以及自2013年1月1日至2013年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）。

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

#### (5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### (1)股票投资

##### 1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

##### 2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

##### C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的首次取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

## (2) 债券投资

1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

## (3) 权证投资

1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

## (4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日

起，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中的相关原则进行估值。

(5)其他

1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

2)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)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4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；



根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
活期存款	5,889,395.88
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—

合计	5,889,395.88
----	--------------

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2013年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		53,176,327.26	49,544,074.17	-3,632,253.09
债券	交易所市场	6,693,783.19	6,635,421.20	-58,361.99
	银行间市场	9,997,369.86	10,013,000.00	15,630.14
	合计	16,691,153.05	16,648,421.20	-42,731.85
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		69,867,480.31	66,192,495.37	-3,674,984.94

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融工具。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	963.83
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	1,054.80
应收债券利息	107,333.20

应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	74.30
合计	109,426.13

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	125,984.67
银行间市场应付交易费用	—
合计	125,984.67

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	848.68
审计费	24,795.19
信息披露费	148,765.71
合计	174,409.58

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,476,629.44	206,476,629.44
本期申购	34,408,833.71	34,408,833.71

本期赎回（以“-”号填列）	-161,423,715.72	-161,423,715.72
本期末	79,461,747.43	79,461,747.43

注：(1)根据《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》，本基金于2012年12月18日（基金合同生效日）至2013年1月7日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回、转换和定期定额投资业务自2013年1月8日起开始办理。

(2)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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	191,870.13	113,860.40	305,730.53
本期利润	—	-2,002,844.63	-2,002,844.63
本期基金份额交易产生的变动数	-1,549,333.73	49,268.61	-1,500,065.12
其中：基金申购款	91,000.25	-233,955.61	-142,955.36
基金赎回款	-1,640,333.98	283,224.22	-1,357,109.76
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-1,357,463.60	-1,839,715.62	-3,197,179.22

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	21,427.91
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	27,157.94
其他	1,270.86
合计	49,856.71

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期

	2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	235,589,110.92
减：卖出股票成本总额	233,497,015.99
买卖股票差价收入	2,092,094.93

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	30,301,571.34
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	30,097,696.68
减：应收利息总额	226,702.98
债券投资收益	-22,828.32

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	807,110.90
基金投资产生的股利收益	—
合计	807,110.90

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1.交易性金融资产	-3,788,845.34

——股票投资	-3,746,113.49
——债券投资	-42,731.85
——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	-3,788,845.34

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	203,429.01
基金转换费收入	49.59
合计	203,478.60

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	673,464.52
银行间市场交易费用	—
合计	673,464.52

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
场外基金交易费用	—

银行划款费用	4,971.02
银行间帐户维护费	—
其他	—
合计	178,531.92

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司(以下简称"安信基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司(以下简称"安信证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.0.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 6.4.10.0.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.0.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.0.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.0.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.1 关联方报酬

#### 6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	892,209.83
其中：支付销售机构的客户维护费	429,300.41

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	148,701.65

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易



本基金本期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

### 6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

#### 6.4.10.3.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
安信证券	9,999,000.00	12.58%	9,999,000.00	4.84%

注：2012年12月14日，安信证券股份有限公司认购本基金人民币10,000,000.00元，确认份额为9,999,000.00份，作为发起式资金锁定三年。

#### 6.4.10.4 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 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	5,889,395.88	21,427.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2013年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额为0元，无抵押债券。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2013年6月30日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额为0元，无抵押债券。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金管理人坚持"风险管理创造价值"、"风险管理人人有责"、"合规风险零容忍"的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资及权证投资等，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

##### **6.4.13.2 信用风险**

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截止2013年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例仅为21.83%（2012年12月31日为0.00%），因此本基金无重大信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金流动性风险来自于兑付赎回资金的流动性风险和投资品种变现的流动性风险两方面。

兑付赎回资金的流动性风险是指本基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，因而对本基金的投资运作产生额外的流动性风险。针对该类流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。同时本基金的基金合同中设计了巨额赎回条款，约定了在巨额赎回发生时对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。

投资品种变现的流动性风险是指因投资品种不存在活跃的交易市场而难以变现，或因投资品种集中度高而无法在不对市场价格产生重大影响的情况下变现的流动性风险。本基金采用控制流通受限证券比例、监控投资品种的成交活跃度和分散投资等方式防范投资品种变现的流动性风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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。期末本基金持有的所有证券均能及时变现。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时

出现下降的风险。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，采用久期、凸度、VAR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2013年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	5,889,395.88	—	—	—	5,889,395.88
结算备付金	2,343,989.91	—	—	—	2,343,989.91
存出保证金	—	—	—	165,216.59	165,216.59
交易性金融资产	4,928,180.00	—	11,720,241.20	49,544,074.17	66,192,495.37
应收证券清算款	—	—	—	1,889,090.60	1,889,090.60
应收利息	—	—	—	109,426.13	109,426.13
应收股利	—	—	—	311,444.37	311,444.37
应收申购款	—	—	—	3,152.71	3,152.71
<b>资产总计</b>	<b>13,161,565.79</b>	<b>—</b>	<b>11,720,241.20</b>	<b>52,022,404.57</b>	<b>76,904,211.56</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	—	—	—	225,185.04	225,185.04
应付管理人报酬	—	—	—	97,769.20	97,769.20
应付托管费	—	—	—	16,294.86	16,294.86
应付交易费用	—	—	—	125,984.67	125,984.67
其他负债	—	—	—	174,409.58	174,409.58
<b>负债总计</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>639,643.35</b>	<b>639,643.35</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>13,161,565.79</b>	<b>—</b>	<b>11,720,241.20</b>	<b>51,382,761.22</b>	<b>76,264,568.21</b>
上年度末 2012年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	2,002,249.65	—	—	—	2,002,249.65
交易性金融资产	—	—	—	32,575,165.67	32,575,165.67
买入返售金融资产	150,060,000.10	—	—	—	150,060,000.10
应收证券清算款	—	—	—	22,289,181.78	22,289,181.78
应收利息	—	—	—	12,740.15	12,740.15

资产总计	152,062,249.75	—	—	54,877,087.60	206,939,337.35
负债					
应付管理人报酬	—	—	—	110,036.94	110,036.94
应付托管费	—	—	—	18,339.49	18,339.49
应付交易费用	—	—	—	28,600.95	28,600.95
负债总计	—	—	—	156,977.38	156,977.38
利率敏感度缺口	152,062,249.75	—	—	54,720,110.22	206,782,359.97

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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：人民币万元）	
		本期末	上年度末
	1、市场利率下降25个基点	11.70	—
	2、市场利率上升25个基点	-11.56	—

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资金占基金资产的比例0%-96%。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（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012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	49,544,074.17	64.96	32,575,165.67	15.75
交易性金融资产-债券投资	16,648,421.20	21.83	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	66,192,495.37	86.79	32,575,165.67	15.75

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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：人民币万元）	
		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	1、业绩比较基准上升5%	446.91	301.90
	2、业绩比较基准下降5%	-446.91	-301.90

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	49,544,074.17	64.42
	其中：股票	49,544,074.17	64.42
2	固定收益投资	16,648,421.20	21.65
	其中：债券	16,648,421.20	21.65
	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	8,233,385.79	10.71
6	其他资产	2,478,330.40	3.22
7	合计	76,904,211.56	100.00

## 7.2 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	3,626,608.09	4.76
C	制造业	18,476,407.32	24.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,911,936.00	2.51
E	建筑业	3,651,107.22	4.79
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	12,371,880.60	16.22
K	房地产业	5,781,223.66	7.58
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	3,724,911.28	4.88
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—

合计	49,544,074.17	64.96
----	---------------	-------

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	1,298,400	5,388,360.00	7.07
2	000848	承德露露	159,147	3,614,228.37	4.74
3	000002	万科A	354,659	3,493,391.15	4.58
4	601166	兴业银行	200,600	2,962,862.00	3.88
5	600887	伊利股份	90,822	2,840,912.16	3.73
6	601318	中国平安	65,838	2,288,528.88	3.00
7	600048	保利地产	230,861	2,287,832.51	3.00
8	002159	三特索道	155,500	2,214,320.00	2.90
9	002325	洪涛股份	177,000	2,106,300.00	2.76
10	600079	人福医药	79,179	2,064,988.32	2.71
11	600489	中金黄金	212,895	1,977,794.55	2.59
12	600362	江西铜业	123,338	1,941,340.12	2.55
13	601601	中国太保	108,700	1,731,591.00	2.27
14	600028	中国石化	394,453	1,648,813.54	2.16
15	600085	同仁堂	73,886	1,616,625.68	2.12
16	002501	利源铝业	128,580	1,524,958.80	2.00
17	000069	华侨城A	292,184	1,510,591.28	1.98
18	600642	申能股份	300,000	1,140,000.00	1.49
19	601668	中国建筑	329,922	1,078,844.94	1.41
20	000786	北新建材	60,000	1,057,200.00	1.39
21	002226	江南化工	76,522	896,837.84	1.18
22	600252	中恒集团	60,000	832,800.00	1.09
23	000669	领先科技	20,400	771,936.00	1.01
24	600104	上汽集团	56,730	749,403.30	0.98
25	600309	烟台万华	30,067	481,673.34	0.63



26	002661	克明面业	16,243	450,418.39	0.59
27	002140	东华科技	17,500	434,175.00	0.57
28	000915	山大华特	17,000	385,050.00	0.50
29	601117	中国化学	3,339	31,787.28	0.04
30	002475	立讯精密	951	19,971.00	0.03
31	600016	民生银行	62	531.34	0.00
32	601288	农业银行	3	7.38	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	14,363,773.93	6.95
2	600048	保利地产	10,508,271.55	5.08
3	601939	建设银行	10,377,791.00	5.02
4	000002	万科A	8,695,834.26	4.21
5	600837	海通证券	7,017,981.00	3.39
6	601288	农业银行	6,999,578.00	3.38
7	601601	中国太保	6,690,002.44	3.24
8	601628	中国人寿	6,496,742.49	3.14
9	600028	中国石化	6,348,365.00	3.07
10	600016	民生银行	6,245,075.00	3.02
11	601318	中国平安	6,139,134.32	2.97
12	600036	招商银行	5,998,858.00	2.90
13	600085	同仁堂	5,970,226.06	2.89
14	002271	东方雨虹	4,997,668.49	2.42
15	600030	中信证券	4,896,660.00	2.37
16	601088	中国神华	4,836,107.72	2.34
17	600887	伊利股份	4,754,240.82	2.30
18	600585	海螺水泥	4,695,879.00	2.27

19	600309	烟台万华	4,498,601.61	2.18
20	601117	中国化学	4,084,231.09	1.98

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的"累计买入金额"按买入成交金额（成交价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	11,361,514.83	5.49
2	600048	保利地产	10,191,681.23	4.93
3	600030	中信证券	7,091,168.21	3.43
4	600837	海通证券	6,887,538.36	3.33
5	601939	建设银行	6,809,006.12	3.29
6	601288	农业银行	6,639,016.72	3.21
7	600028	中国石化	6,511,300.25	3.15
8	600016	民生银行	6,349,308.13	3.07
9	600585	海螺水泥	6,042,404.16	2.92
10	600036	招商银行	5,984,225.92	2.89
11	601088	中国神华	5,969,535.89	2.89
12	601628	中国人寿	5,701,726.63	2.76
13	601601	中国太保	5,100,412.63	2.47
14	601318	中国平安	5,079,798.55	2.46
15	300182	捷成股份	4,807,924.02	2.33
16	002275	桂林三金	4,758,239.89	2.30
17	601117	中国化学	4,701,518.00	2.27
18	000002	万科A	4,652,005.92	2.25
19	600085	同仁堂	4,604,428.69	2.23
20	002271	东方雨虹	4,445,535.62	2.15
21	600519	贵州茅台	4,274,199.77	2.07

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的"累计卖出金额"按卖出成交金额（成交价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

价乘以成交数量) 填列, 不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位: 人民币元

买入股票的成本(成交) 总额	254,212,037.98
卖出股票的收入(成交) 总额	235,589,110.92

注: 1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票, 卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票;

2、"买入股票成本(成交) 总额"、"卖出股票收入(成交) 总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量) 填列, 不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位: 人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中: 政策性金融债	—	—
4	企业债券	16,648,421.20	21.83
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	16,648,421.20	21.83

### 7.6 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

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1380214	13昌吉国投债	100,000	10,013,000.00	13.13
2	126011	08石化债	50,000	4,865,000.00	6.38
3	124026	12川广元	16,890	1,707,241.20	2.24
4	120483	04中石化	610	61,244.00	0.08

5	126013	08青啤债	20	1,936.00	0.00
---	--------	-------	----	----------	------

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

### 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

#### 7.10.3 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	165,216.59
2	应收证券清算款	1,889,090.60
3	应收股利	311,444.37
4	应收利息	109,426.13
5	应收申购款	3,152.71
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,478,330.40

#### 7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
1,297	61,265.80	17,998,160.00	22.65%	61,463,587.43	77.35%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,846,207.06	3.58%

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为100万份以上；

（2）本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为50万份至100万份（含）。

### 8.3 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份 额占基 金总份 额比例	发起份额总 数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	—	—	—	—	
基金管理人高级管 理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	

基金管理人股东	9,999,000.00	12.58%	9,999,000.00	12.58%	3年
其他	—	—	—	—	
合计	9,999,000.00	12.58%	9,999,000.00	12.58%	

注：本报告期内本基金发起资金持有份额未发生变动。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年12月18日)基金份额总额	206,476,629.44
本报告期期初基金份额总额	206,476,629.44
本报告期基金总申购份额	34,408,833.71
减：本报告期基金总赎回份额	161,423,715.72
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	79,461,747.43

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任

何稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**

**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	2	215,366,957.88	43.97%	190,592.93	50.19%	
国泰君安证券股份有限公司	2	106,729,807.95	21.79%	75,820.90	19.97%	
东兴证券股份有限公司	1	71,959,903.71	14.69%	48,637.40	12.81%	
广发证券股份有限公司	2	59,802,543.44	12.21%	40,202.99	10.59%	
华泰证券股份有限公司	1	35,941,935.92	7.34%	24,459.62	6.44%	
国信证券股份有限公司	1		—	—	—	
华创证券有限责任公司	2		—	—	—	
国金证券股份有限公司	1		—	—	—	
宏源证券股份有限公司	2		—	—	—	
民生证券股份有限公司	1		—	—	—	

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金	占当期权证成交总额比例

				例	额	
中信证券股份有限公司	200,150.69	0.30%	1,359,400,000.00	46.84%	—	—
国泰君安证券股份有限公司	3,058,399.10	4.59%	581,600,000.00	20.04%	—	—
东兴证券股份有限公司	36,652,639.42	55.02%	277,100,000.00	9.55%	—	—
广发证券股份有限公司	17,426,659.23	26.16%	389,300,000.00	13.41%	—	—
华泰证券股份有限公司	9,278,506.85	13.93%	295,000,000.00	10.16%	—	—
国信证券股份有限公司		—		—		—
华创证券有限责任公司		—		—		—
国金证券股份有限公司		—		—		—
宏源证券股份有限公司		—		—		—
民生证券股份有限公司		—		—		—

注：公司制定《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对选择证券公司的标准和程序、以及佣金分配规则进行了规定。

根据上述制度，由公司基金投资部、固定收益部、研究部、特定资产管理部、分管投资的副总经理及交易室于每季度末对券商进行综合评分，评价标准包括研究及投资建议的质量、报告的及时性、服务质量、交易成本等，由公司基金投资决策委员会根据评分结果对下一季度的证券公司名单及佣金分配比例做出决议。首只基金成立后最初半年的券商选择及佣金分配由基金投资决策委员会决定。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露报刊	法定披露日期
1	关于安信基金管理有限责任公司新增和讯信息科技有限公司为基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-04-16
2	安信基金管理有限责任公司关于	中国证券报、证券时报、	2013-03-01



	网上直销易宝支付新增支持银行卡并继续开展费率优惠的公告	上海证券报	
3	安信基金管理有限责任公司关于向易宝支付客户开通基金网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报	2013-01-11

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信平稳增长混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 11.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

### 11.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

二〇一三年八月二十九日