

**安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告摘要**

**2015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：上海浦东发展银行股份有限公司**

**送出日期：2015年8月27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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月15日（基金合同生效日）起至6月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	安信动态策略混合
基金主代码	001185
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月15日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,231,778,693.25份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以严格的风险控制为前提，结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘，动态灵活调整投资策略，力争为基金份额持有人获取较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金强调风险控制，审时度势动态运用多元化投资策略，力争实现基金资产的稳健增长。资产配置上，密切跟踪宏观、中观与微观各层面重要因素的变化，动态分配各大类资产配置比例；股票投资上，根据风险管控及收益目标，动态选择价值型、周期型、成长型、主题型、低风险套利型、事件驱动型等多种投资策略；固定收益类投资上，从流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税率、含权等因素分析个券，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。此外，本基金还采用股指期货、权证等衍生品投资策略，以及风险管理策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中国人民银行公布的金融机构1年期人民币定期存款基准利率+3.00%
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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	廖原
	联系电话	0755-82509999	021-61618888
	电子邮箱	service@essencefund.com	liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95528
传真		0755-82799292	021-63602540

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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（2015年4月15日至2015年6月30日）
本期已实现收益	195,684,248.28
本期利润	197,065,745.40
加权平均基金份额本期利润	0.0270
本期基金份额净值增长率	2.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0173
期末基金资产净值	11,456,639,212.75
期末基金份额净值	1.020

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

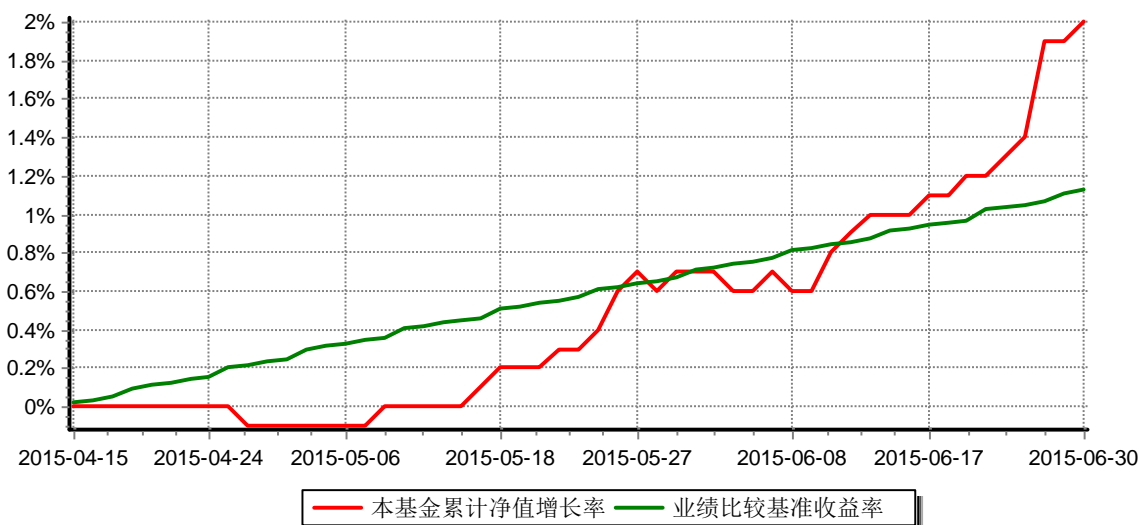
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.29%	0.12%	0.46%	0.01%	0.83%	0.11%
过去三个月	2.00%	0.09%	1.13%	0.01%	0.87%	0.08%
自基金合同生效日起至今（2015年04月15日-2015年06月30日）	2.00%	0.09%	1.13%	0.01%	0.87%	0.08%

注：1、本基金的业绩比较基准为：1年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

2、本基金基金合同生效日为2015年4月15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。表中所示基金及业绩比较基准的相关数值为2015年4月15日至2015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.本基金基金合同生效日为2015年4月15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。图示日期为2015年4月15日至2015年6月30日。

2.本基金的建仓期为2015年4月15日至2015年10月14日。截止本报告期末，本基金仍处于建仓期。

## § 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3.5亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有38.72%的股  
权，安信证券股份有限公司持有33%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有  
19.71%的股权，中广核财务有限责任公司持有8.57%的股权。

截至2015年6月30日，本基金管理人共管理15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；从2013年7月24日  
起管理安信宝利分级债券型证券投资基金；从2013年11月8日起管理安信永利信用定期  
开放债券型证券投资基金；从2013年12月31日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券  
投资基金；从2014年4月21日起管理安信价值精选股票型证券投资基金；从2014年11月  
24日起管理安信现金增利货币市场基金；从2015年3月19日起管理安信消费医药主题股  
票型证券投资基金；从2015年4月15日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基  
金；从2015年5月14日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金；从2015年5  
月20日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金；从2015年5月25日起管理安  
信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金；从2015年6月5日起管理安信鑫安得利灵活配  
置混合型证券投资基金。

#### 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		
蓝雁书	本基金的 基金 经理	2015年4月 15日	—	8	蓝雁书先生，理学硕士。 历任桂林理工大学（原桂 林工学院）理学院教师， 华西证券有限责任公司证 券研究所研究员，安信证

					券股份有限公司研究中心研究员、证券投资部研究员、安信基金筹备组基金投资部研究员。2011年12月加入安信基金管理有限责任公司基金投资部。曾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；现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王鑫	本基金的基金经理助理	2015年5月11日	—	5	王鑫先生，工学硕士。历任华三通信技术有限公司产品经理、安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员、安信基金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理助理。现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。

注：1、本基金基金经理的“任职日期”按基金合同生效日填写。基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘用日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告（生效）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遵规守信情况的说明

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》、《公开募集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》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，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

2015年上半年，资本市场出现了较大的波动。春节前，大盘股走势强劲，资金大规模入市的迹象明显，杠杆使用越来越活跃。在春节后，场内资金开始向小盘股与成长股转移，风格切换明显。与转型、创新相关的板块及个股表现强势，另外次新股也出现了明显的炒作潮。然而，进入六月份之后，随着资金入市的步伐减缓，监管机构对场内、场外股票投资杠杆的政策收紧以及新股发行规模与节奏的大幅加快，使得股市资金面在边际上趋于紧张。由于大部分个股的估值水平较高，缺乏价值安全边际，资金面的吃紧使得高杠杆投资者的心态发生扭转，进而引发了市场的恐慌和剧烈调整。

考虑到市场估值已经处于较高水平，安信动态策略基金在2015年2季度成立后，在权益品种投资方面较为谨慎，仅持有低估值高分红蓝筹股，以及业绩增长确定且估值合理的少量成长股，取得了一定业绩正贡献；同时，在五月底至六月初这段时间内，我们准确地识别出大盘所面临的系统性风险，进一步降低了股票持仓，较大程度上回避了大盘的调整。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日，本基金份额净值为1.020元，本报告期份额净值增长率为2.00%，同期业绩比较基准增长率为1.13%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

传统经济短期内仍然在继续探底，中长期都缺乏较有力的反弹逻辑。传统投资、出口继续滑坡，消费也较为疲软，中国经济未来的希望仍然在于转型升级、市场化改革以及创新创业。在这一背景之下，对于资本市场而言，整体资金面依然是非常宽松的，但是在经历了前半年的资金牛市、杠杆牛市之后，资本市场出现了一些不理想的局面，例如：个股炒作过头，估值缺乏价值支撑；再如杠杆的使用不合理、不透明等等问题，它们困扰和打击着短期的市场信心。然而，放眼长远，我们仍然坚信资本市场将成为引领中国经济走向新台阶的中坚力量，发展出一个多层次、高效率、多方位服务的资本市场是大势所趋。

因此在策略上，我们既要回避个股的纯概念炒作，耐心等待估值风险的进一步释放，又要对资本市场的做大做强充满信心。等待合适的价格，长期投资那些拥有真价值、具备真成长的好公司将成为我们下一阶段的主要策略。行业方面，我们将继续重点关注与转型升级以及创新创业密切相关的发展方向，诸如：工业4.0、人工智能、精准医疗、互联网金融等领域。

#### 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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**

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告期内，由安信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日
<b>资 产：</b>	
银行存款	11,123,033,076.58
结算备付金	178,401,141.34
存出保证金	518,119.71
交易性金融资产	488,344,387.40
其中：股票投资	78,955,744.80
基金投资	—
债券投资	409,388,642.60
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	79,814,532.60
应收利息	9,150,658.04
应收股利	—
应收申购款	1,521,519.72
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	11,880,783,435.39

负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日
<b>负 债:</b>	
短期借款	—
交易性金融负债	—
衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	402,400,000.00
应付证券清算款	—
应付赎回款	9,115,541.77
应付管理人报酬	9,361,797.89
应付托管费	1,872,359.56
应付销售服务费	—
应付交易费用	1,307,177.84
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	87,345.58
负债合计	424,144,222.64
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	11,231,778,693.25
未分配利润	224,860,519.50
所有者权益合计	11,456,639,212.75
负债和所有者权益总计	11,880,783,435.39

注：1、报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.020元，基金份额总额11,231,778,693.25份。

2、本基金合同生效日为2015年4月15日，本报告期间为2015年4月15日至2015年6月30日。本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年4月15日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期2015年4月15日至2015年6月30日
<b>一、收入</b>	218,906,614.92
1.利息收入	24,130,168.53
其中：存款利息收入	18,556,137.29
债券利息收入	511,688.42
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	5,062,342.82
其他利息收入	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	192,681,605.95
其中：股票投资收益	192,416,868.65
基金投资收益	—
债券投资收益	—
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	—
股利收益	264,737.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,381,497.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	713,343.32
<b>减：二、费用</b>	21,840,869.52
1. 管理人报酬	15,682,816.29
2. 托管费	3,136,563.23
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	2,588,775.09

5. 利息支出	354,650.22
其中：卖出回购金融资产支出	354,650.22
6. 其他费用	78,064.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	197,065,745.40
减：所得税费用	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	197,065,745.40

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年4月15日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年4月15日至2015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)	613,282,800.57	—	613,282,800.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	197,065,745.40	197,065,745.40
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)	10,618,495,892.68	27,794,774.10	10,646,290,666.78
其中：1.基金申购款	10,786,641,875.39	28,995,375.51	10,815,637,250.90
2.基金赎回款	-168,145,982.71	-1,200,601.41	-169,346,584.12
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)	11,231,778,693.25	224,860,519.50	11,456,639,212.75

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:

刘入领

廖维坤

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

安信动态策略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")2015年3月25日下发的证监许可[2015]442号文"关于核准安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复"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《安信动态策略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,首次募集期间为2015年4月8日至2015年4月10日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集613,229,558.27元,经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(201)验字第60962175\_H24号验资报告。经向中国证监会备案,《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年4月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为613,282,800.57份基金份额,其中认购资金利息折合53,242.30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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金合同》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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、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资产(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公布的金融机构1年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

### 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3号《半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2015年6月30日的财务状况以及自2015年4月15日（基金合同生效日）至2014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**

本基金财务报表所载财务信息根据企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **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2015年4月15日（基金合同生效日）起至2015年6月30日止。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

人民币

##### **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为债券投资。

###### **(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于成交日结转。

### (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初始取得成本时，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。

已实现损益平准金与未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1.00%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0.20%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、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；

2、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；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 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 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 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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
上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“上海浦发银行”）	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
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东

安信乾盛财富管理（深圳）有限公司

基金管理人的子公司

注：1、本基金管理人于2013年12月2日设立了全资子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司。  
2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。  
3、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金于2015年4月27日投资浦发银行15941540.39元，该投资事先得到基金托管人同意和经公司董事会审议通过，并于4月29日公告，同时向中国证监会进行了报告。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 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。

#### 6.4.8.1.2 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。

#### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.8.1.4 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。

#### 6.4.8.1.5 债券回购交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,682,816.29
其中：支付销售机构的客户维护费	495,990.08



注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年4月15日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,136,563.23

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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。

##### 6.4.8.4.2 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

本基金的其他关联方本期末未持有本基金份额。

#### 6.4.8.5 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	
	2015年4月15日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	1,023,033,076.58	9,727,624.71

注：本基金资金托管账户的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

#### 6.4.10 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.10.1 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。

##### 6.4.10.2 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	期末成本总额	期末估值总额
300467	迅游科技	2015-06-25	重大事项停牌	297.30	2015-07-02	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80

##### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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款余额为0元，无质押债券。

###### 6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为402,400,000.00元，于2015年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 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	78,955,744.80	0.66
	其中：股票	78,955,744.80	0.66
2	固定收益投资	409,388,642.60	3.45
	其中：债券	409,388,642.60	3.45
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	11,301,434,217.92	95.12
7	其他各项资产	91,004,830.07	0.77
8	合计	11,880,783,435.39	100.00

## 7.2 报告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	—	—
C	制造业	40,464,506.00	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
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	4,151,238.80	0.04
J	金融业	34,340,000.00	0.30
K	房地产业	—	—

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	—	—
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	78,955,744.80	0.69

### 7.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601211	国泰君安	1,000,000	34,340,000.00	0.30
2	600198	大唐电信	607,900	21,543,976.00	0.19
3	300016	北陆药业	443,000	18,920,530.00	0.17
4	600406	国电南瑞	147,100	3,043,499.00	0.03
5	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于安信基金管理有限责任公司网站的半年度报告正文。

### 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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601211	国泰君安	96,111,360.54	0.84
2	002230	科大讯飞	41,904,582.93	0.37
3	600198	大唐电信	35,907,542.72	0.31
4	601985	中国核电	32,649,100.17	0.28
5	600519	贵州茅台	31,937,240.19	0.28
6	600835	上海机电	25,986,945.24	0.23

7	300016	北陆药业	25,976,103.00	0.23
8	600271	航天信息	21,765,518.59	0.19
9	002121	科陆电子	20,986,404.92	0.18
10	002138	顺络电子	19,926,848.20	0.17
11	300189	神农大丰	16,944,113.45	0.15
12	300244	迪安诊断	16,876,725.08	0.15
13	000063	中兴通讯	15,972,878.81	0.14
14	600900	长江电力	15,948,091.86	0.14
15	600000	浦发银行	15,941,540.39	0.14
16	601988	中国银行	15,832,862.59	0.14
17	000716	黑芝麻	14,996,316.51	0.13
18	600009	上海机场	14,992,323.90	0.13
19	600309	万华化学	14,991,965.42	0.13
20	002184	海得控制	14,990,216.02	0.13

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（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601985	中国核电	134,352,491.85	1.17
2	601211	国泰君安	123,154,401.34	1.07
3	002230	科大讯飞	36,400,688.33	0.32
4	600271	航天信息	33,721,498.10	0.29
5	600519	贵州茅台	31,317,821.00	0.27
6	600835	上海机电	25,805,801.35	0.23
7	002121	科陆电子	21,024,335.98	0.18
8	300189	神农大丰	18,346,386.44	0.16
9	002751	易尚展示	17,291,273.00	0.15
10	000063	中兴通讯	16,108,572.45	0.14

11	600900	长江电力	16,042,278.85	0.14
12	601988	中国银行	16,016,378.00	0.14
13	300244	迪安诊断	15,843,442.00	0.14
14	000716	黑芝麻	15,248,592.66	0.13
15	601166	兴业银行	15,174,758.62	0.13
16	600000	浦发银行	15,135,626.38	0.13
17	000568	泸州老窖	15,128,312.23	0.13
18	002184	海得控制	14,991,209.37	0.13
19	601318	DR中国平	14,972,420.00	0.13
20	600309	万华化学	14,709,042.60	0.13

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（成交单价乘以成交数量）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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	957,569,641.83
卖出股票的收入（成交）总额	1,074,450,139.60

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	388,894,642.60	3.39
2	央行票据	—	—
3	金融债券	20,494,000.00	0.18
	其中：政策性金融债	20,494,000.00	0.18
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—

6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	409,388,642.60	3.57

## 7.6 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

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	020077	15贴债03	1,000,000	99,030,000.00	0.86
2	019509	15国债09	800,000	80,672,000.00	0.70
3	020076	15贴债02	600,000	59,040,000.00	0.52
4	020075	15贴债01	500,000	49,395,000.00	0.43
5	019321	13国债21	400,000	40,228,000.00	0.35

## 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	518,119.71
2	应收证券清算款	79,814,532.60
3	应收股利	—
4	应收利息	9,150,658.04
5	应收申购款	1,521,519.72
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	91,004,830.07

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明



1	300467	迅游科技	1,107,739.80	0.01	重大事项停牌
---	--------	------	--------------	------	--------

## § 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
4,599	2,442,221.94	10,672,668,507. 30	95.02%	559,110,185.95	4.98%

### 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	—	—

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年4月15日)基金份额总额	613,282,800.57
基金合同生效日基金份额总额	613,282,800.57
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,786,641,875.39
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	168,145,982.71
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额 减少以“-”填列)	—
本报告期期末基金份额总额	11,231,778,693.25

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

本基金管理人于2015年1月9日发布公告，聘任乔江晖女士为安信基金管理有限责任公司督察长，孙晓奇先生不再担任安信基金管理有限责任公司督察长；聘任孙晓奇先生为安信基金管理有限责任公司副总经理，汪建先生不再担任安信基金管理有限责任公司副总经理。

经上海浦东发展银行决定，邓从国同志自2015年4月1日起担任资产托管与养老金业务部总经理职务。

### 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

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

### 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 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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
中信建投	2	712,023,458.72	37.63%	490,853.09	37.55%	—
华创证券	2	602,889,173.99	31.86%	416,059.11	31.83%	—
广发证券	2	577,472,959.85	30.52%	400,265.64	30.62%	—

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。

### 10.7.2 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	成交金额	占当期权证成交总额比例
中信建投	—	—	12,044,600,000	27.31%	—	—
华创证券	—	—	30,552,000,000	69.27%	—	—
广发证券	411,426,519.40	100%	1,507,800,000	3.42%	—	—

安信基金管理有限责任公司

二〇一五年八月二十七日