

安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 25 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了 2015 年度标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 5 月 25 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	安信稳健增值混合	
基金主代码	001316	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 25 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,269,661,440.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	安信稳健增值 A	安信稳健增值 C
下属分级基金的交易代码:	001316	001338
报告期末下属分级基金的份额总额	52,692,593.10 份	3,216,968,846.99 份

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	资产配置方面，通过宏观基本面定性和定量研究，结合政策因素、市场情绪与估值因素等对比分析大类资产风险收益比，合理分配各大类资产配置比例；固定收益类投资方面，在自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上，灵活采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等投资策略；股票投资上，秉承价值投资理念，深度挖掘符合经济结构转型、契合产业结构升级、发展潜力巨大的行业与公司；此外，本基金合理利用股指期货、国债期货、权证等衍生工具做套保或套利投资，对部分高质量的资产支持证券可以采用买入并持有到期策略，实现基金资产增值增厚。
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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖
	联系电话	0755-82509999
	电子邮箱	service@essencefund.com
		罗菲菲
		010-58560666
		tgbfxjdzx@cmbc.com.cn

客户服务电话	4008-088-088	95568
传真	0755-82799292	010-58560798

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.essencefund.com
基金年度报告备置地点	安信基金管理有限责任公司 地址：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	安信稳健增值 A	安信稳健增值 C
本期已实现收益	3,469,493.20	27,471,267.41
本期利润	3,536,239.36	44,575,790.47
加权平均基金份额本期利润	0.0246	0.0178
本期基金份额净值增长率	3.90%	7.20%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0297	0.0624
期末基金资产净值	54,757,701.87	3,449,320,400.56
期末基金份额净值	1.039	1.072

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

安信稳健增值 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	④		
过去三个月	2.26%	0.08%	1.13%	0.01%	1.13%	0.07%
过去六个月	3.69%	0.10%	2.37%	0.01%	1.32%	0.09%
自基金合同生效起至今	3.90%	0.09%	2.92%	0.01%	0.98%	0.08%

安信稳健增值 C

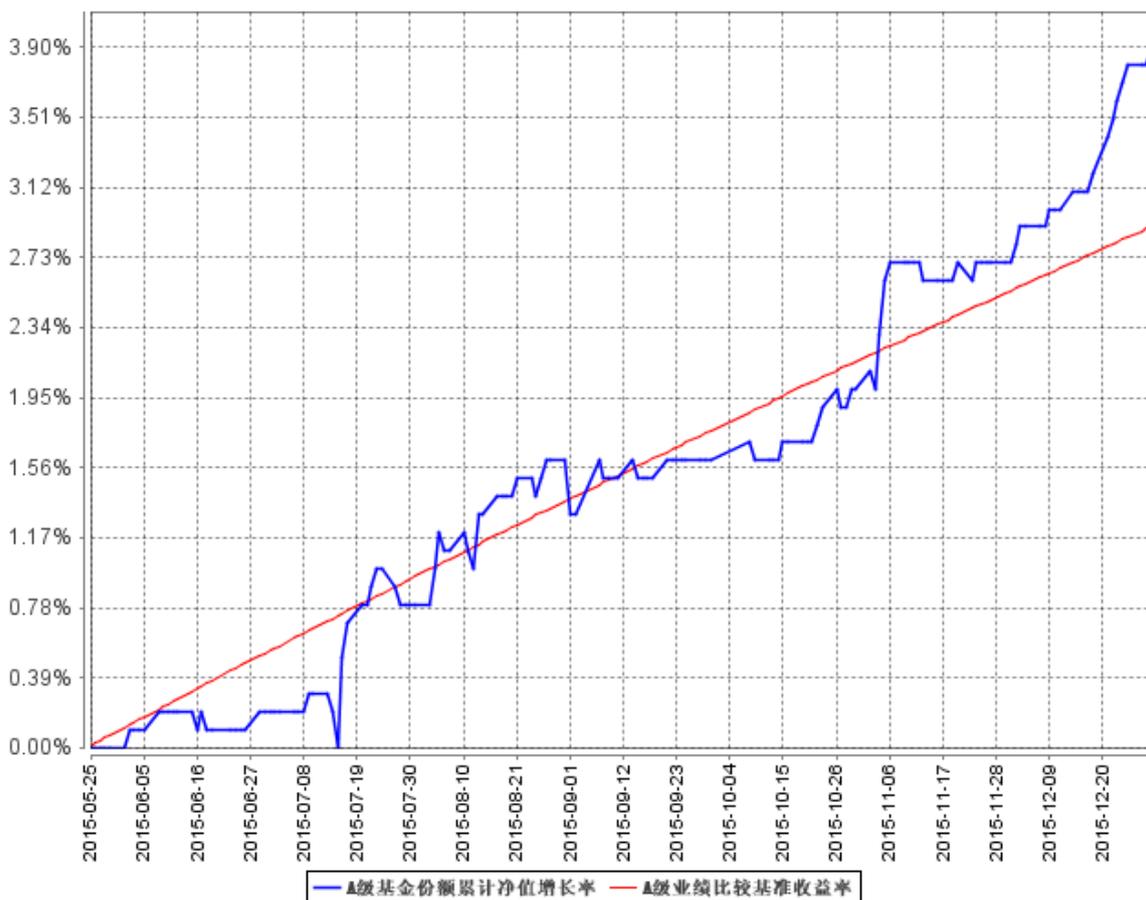
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.10%	0.08%	1.13%	0.01%	0.97%	0.07%
过去六个月	6.99%	0.41%	2.37%	0.01%	4.62%	0.40%
自基金合同生效起至今	7.20%	0.37%	2.92%	0.01%	4.28%	0.36%

注：1、根据《安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，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%。

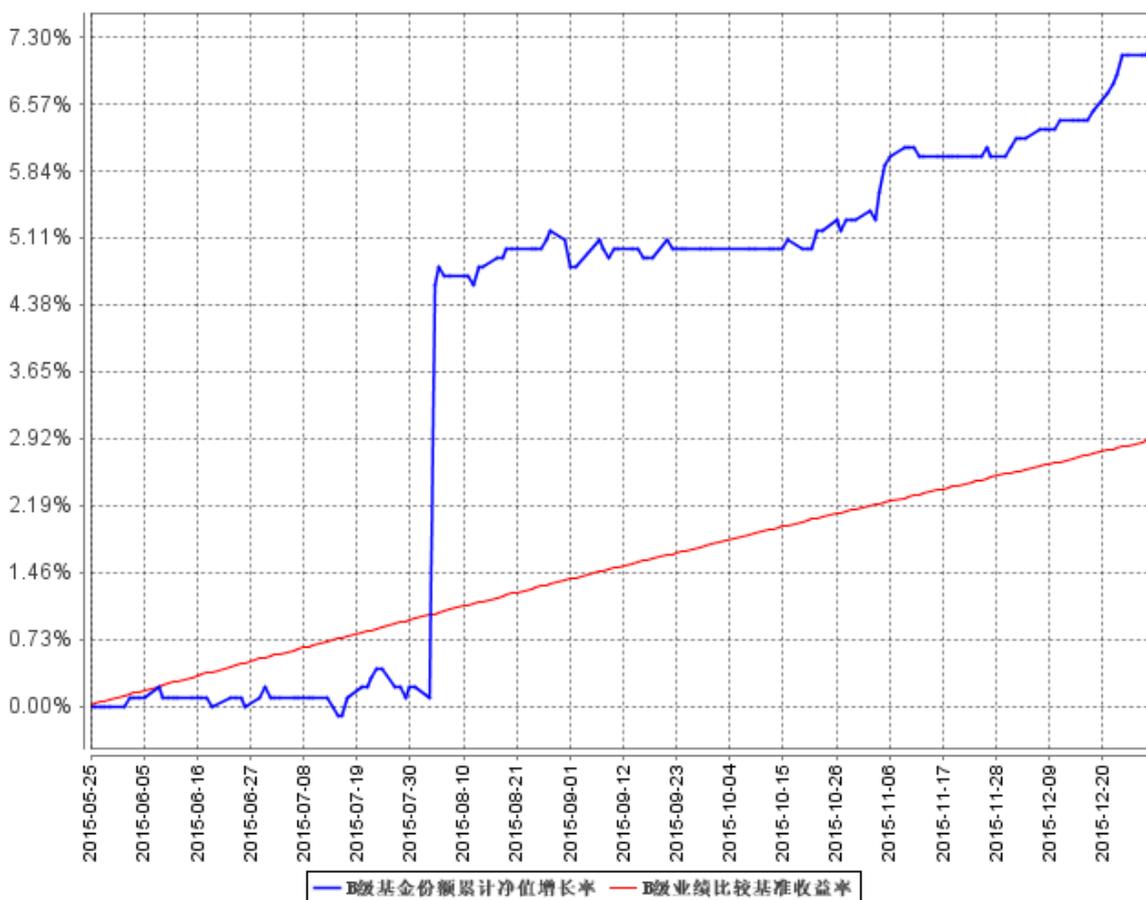
2、本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 25 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为 2015 年 5 月 25 日至 2015 年 12 月 31 日期间各自的实际数值。

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

A级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



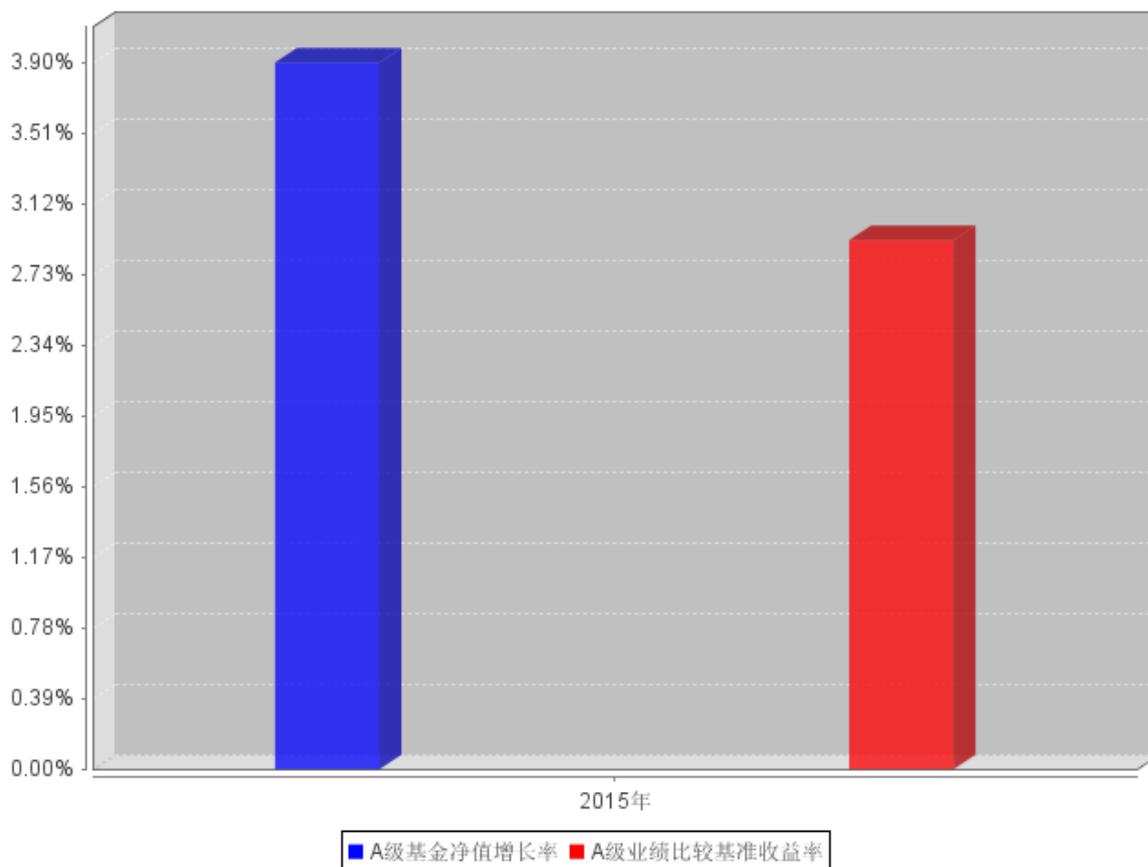
B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



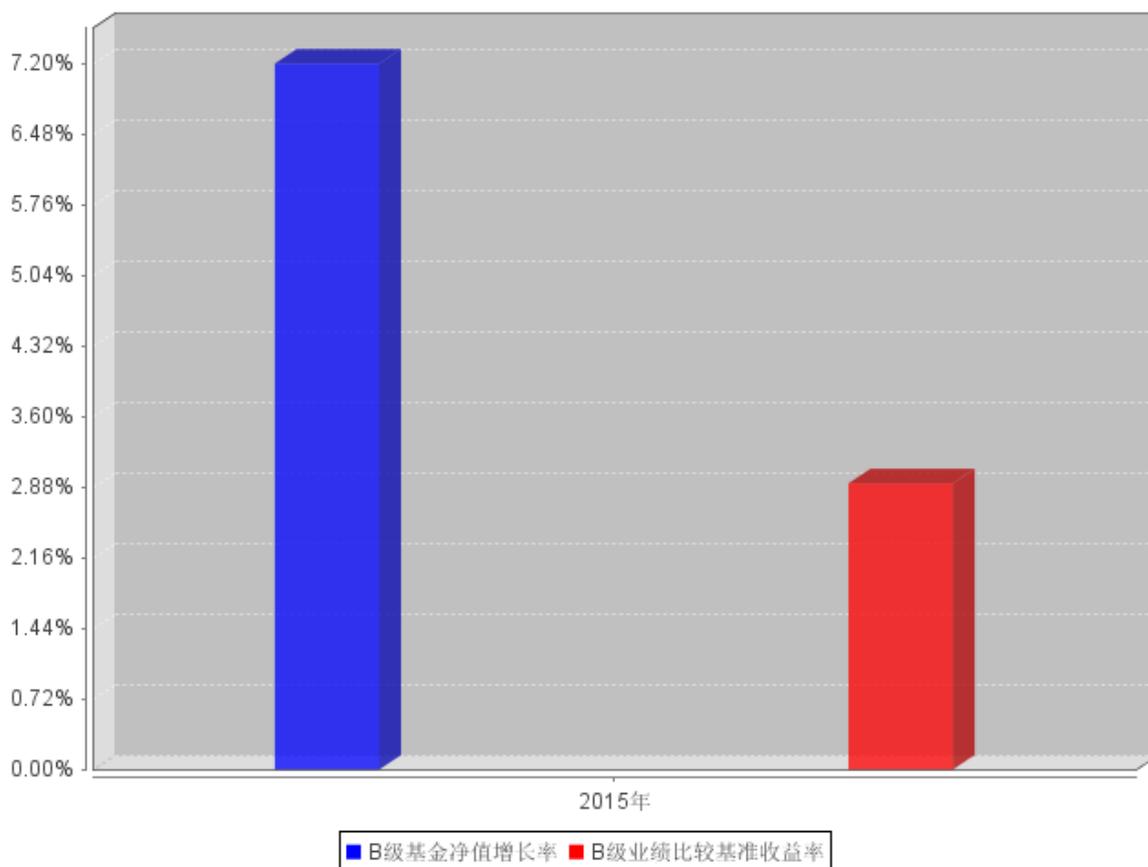
注：本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 25 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2015 年 5 月 25 日至 2015 年 12 月 31 日。

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

A级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对比图



B级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对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2015年5月25日成立，截至本报告期末尚未进行利润分配。

§ 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

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12月31日，本基金管理人共管理17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 日起管理安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原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；从 2015 年 8 月 7 日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金；从 2015 年 11 月 24 日起管理安信新动力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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张翼飞	本基金的基金经理	2015 年 5 月 25 日	-	4.5	张翼飞先生, 经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部会计、财务主管, 上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员, 秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监, 日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任职于安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾任安信现金管理货币市场基金的基金经理助理；现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理, 安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

魏晓菲	本基金的基金经理助理	2015 年 5 月 25 日	2015 年 7 月 24 日	8	魏晓菲女士，法学硕士。先后在安信证券股份有限公司、安信基金管理有限责任公司工作，现在安信基金管理有限责任公司固定收益部从事固定收益类投资工作。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。
魏晓菲	本基金的基金经理助理	2015 年 10 月 26 日	-	8	魏晓菲女士，法学硕士。先后在安信证券股份有限公司、安信基金管理有限责任公司工作，现在安信基金管理有限责任公司固定收益部从事固定收益类投资工作。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。
周仁	本基金的基金经理助理	2015 年 10 月 26 日	-	0.5	周仁先生，金融硕士。曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究助理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。

注：1、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

决定确定的聘任日期填写。“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》、《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 公平交易制度和控制方法

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 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。

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

回顾 2015 年，宏观经济受大宗商品市场不景气、上游企业产能过剩、房地产库存问题凸显等因素影响，经济增速延续下行态势；货币政策方面，央行为应对经济下行压力，通过多次降准降息向市场注入流动性，大量资金在银行间体系沉淀，全年资金面整体维持宽松格局。在宏观经济基本面偏弱、多次降准降息及资金配置需求等因素支撑下全年债市整体呈现牛市行情，全年中债

总净价（总值）指数上涨接近 4%。

本基金成立于 2015 年 5 月，成立后除进行基本的权益类和债券配置建仓外，一方面利用打新期间资金间歇性紧张进行同业存款等资金操作，另一方面积极参与新股 IPO，整体为产品获取较好收益。此后在三、四季度把握股市连续下跌、汇改、避嫌资金流入债市、降准降息等时点机会在债券投资方面进行积极配置和波段操作，组合久期灵活适中，同时严控信用风险，为持有人提供了较为丰厚的投资回报，

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日安信稳健增值 A 净值为 1.039，年化收益率 6.56%。安信稳健增值 C 净值为 1.072，年化收益率 12.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先梳理下目前宏观经济的情况。随着经济持续在底部徘徊，现在大家普遍的共识是我国经济将在一段时间内处在 L 型底的环境下，目前是内需不振且外需不稳，亟待过剩产能逐步出清。为了配合政府的供给侧改革，央行在本年度进行了 5 次降息和 5 次降准，维持了相对宽松的货币政策。但是市场也存在对资金面有扰动的因素，主要有两个：其一是美元加息带来的资本外流和人民币贬值预期。其二是改革正处在攻坚阶段，政府调低了经济增长的目标以使得过剩产能有逐步出清的空间，而该政策使得央行不能过度放水。所以新的年度里，稳健的货币政策和积极的财政政策将会是主旋律，不能对央行会大量放水有过高期望。在国家调低经济增长预期的同时，我们也要调低债券市场的目标收益。

再看债券市场，由于经济持续恶化及股票、大宗等资产价格的大幅下跌，债市在本年度延续了债牛行情。债市在高收益资产缺少的如今正成为各路资金的避风港，与此同时债券的收益率也在逐渐下降，其中代表性的有十年期国债突破 3% 的整数关口。期限利差、信用利差都在大幅缩小。在这一轮大的行情中也伴随着少量的回调，但仍不改收益率下行的趋势。但是，在债牛逐渐行进的过程中我们也要注意可能的风险，我们认为风险包括但不限于以下几点：1. 美元加息导致资本外流，人民币汇率承压。这点压缩了货币政策的实施空间。2. 债券供给增加。随着地方政府债及公司债的大量发行，预测明年的债券供给甚至会超过今年。3. 经济可能底部企稳。随着改革的推进，不排除经济在明年企稳。4. 债市的去杠杆风险。由于管理层逐步对债券市场高杠杆问题的担忧，债市的杠杆可能会面临调整的风险。

我们依此判断明年债券市场可能会处在震荡的区间中，而且随着经济持续恶化，信用风险也可能在明年引来集中爆发，因此可以掌握好节奏进行波段操作，同时严格把控风险，尤其在择券

时注意信用风险。

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其适用性的情况时，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。

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

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元人民币的情形。

§ 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

本报告期内，本托管人在对安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人—安信基金管理有限责任公司在安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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，安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

由安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金管理人—安信基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计了安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括2015年12月31日的资产负债表，2015年5月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解详细内容，可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日
资 产：	
银行存款	228,616,527.35
结算备付金	4,179,500.05
存出保证金	746,878.33
交易性金融资产	4,371,719,480.18
其中：股票投资	47,571,273.40
基金投资	-
债券投资	4,324,148,206.78
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	386,925.29
应收利息	58,450,126.60
应收股利	-
应收申购款	115,940.60
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	4,664,215,378.40
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日
负 债：	
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	985,598,456.60
应付证券清算款	169,700,178.71
应付赎回款	523,757.40
应付管理人报酬	1,774,216.98
应付托管费	591,405.68
应付销售服务费	1,454,670.18

应付交易费用	315,504.46
应交税费	-
应付利息	127,926.99
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	51,158.97
负债合计	1,160,137,275.97
所有者权益：	
实收基金	3,269,661,440.09
未分配利润	234,416,662.34
所有者权益合计	3,504,078,102.43
负债和所有者权益总计	4,664,215,378.40

注：1、报告截止日2015年12月31日，安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额净值人民币1.039元，C类基金份额净值人民币1.072元。基金份额总额3,269,661,440.09份，其中A类基金份额52,692,593.10份，C类基金份额3,216,968,846.99份。

2、本基金合同生效日为2015年5月25日，本报告期间为2015年5月25日至2015年12月31日。本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至 2015年12月31日
一、收入	72,844,604.07
1.利息收入	42,261,766.29
其中：存款利息收入	24,326,766.73
债券利息收入	17,237,161.28
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	697,838.28
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	12,126,167.24
其中：股票投资收益	1,697,523.40
基金投资收益	-
债券投资收益	9,699,615.64
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	729,028.20

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	17,171,269.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,285,401.32
减：二、费用	24,732,574.24
1. 管理人报酬	9,367,061.04
2. 托管费	3,122,353.63
3. 销售服务费	7,380,890.60
4. 交易费用	1,844,837.31
5. 利息支出	2,812,727.20
其中：卖出回购金融资产支出	2,812,727.20
6. 其他费用	204,704.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	48,112,029.83
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	48,112,029.83

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 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）	5,346,467,040.07	-	5,346,467,040.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	48,112,029.83	48,112,029.83
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）	-2,076,805,599.98	186,304,632.51	-1,890,500,967.47
其中：1. 基金申购款	4,024,026,059.29	195,423,105.57	4,219,449,164.86
2. 基金赎回款	-6,100,831,659.27	-9,118,473.06	-6,109,950,132.33
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	3,269,661,440.09	234,416,662.34	3,504,078,102.43

金净值)			
------	--	--	--

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：

_____ 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信稳健增值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 4 月 30 日下发的证监许可[2015]793 号文《关于核准安信稳健增值灵活配置混合型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《安信稳健增值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。

本基金募集期间为 2015 年 5 月 18 日至 2015 年 5 月 20 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2015)验字 60962175_H46 号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,346,134,705.28 元。经向中国证监会备案，《安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 25 日正式生效。截至 2015 年 5 月 25 日止，安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 5,346,134,705.28 元，折合 5,346,134,705.28 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币 332,334.79 元，折合 332,334.79 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 5,346,467,040.07 元，折合 5,346,467,040.07 份基金份额。其中 A 类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 349,828,346.54 元，折合 349,828,346.54 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 106.25 元，折合 106.25 份基金份额。C 类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 4,996,306,358.74 元，折合 4,996,306,358.74 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 332,228.54 元，折合 332,228.54 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 5,346,467,040.07 元，折合 5,346,467,040.07 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金

融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、资产支持证券、银行存款、大额存单、回购、其他货币市场工具等固定收益类品种，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）、权证等权益类品种，国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金各类资产投资比例为：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国债期货和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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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〉》其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 25 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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下列依照企业会计准则、《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。

7.4.4.1 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 2015 年 5 月 25 日（基金合同生效日）起至 2015 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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：交易性金融资产和应收款项。

本基金目前持有的交易性金融资产主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为交易性金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为交易性的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

交易性金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类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，本基金将交易性金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

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；

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。

金融资产转移

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；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。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

7.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 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)”。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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 0.60% 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) 基金销售服务费，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率逐日计提；

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配原则如下：

(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) 基金份额持有人可对其持有的 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按权益登记日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则基金登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准；

(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)本基金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。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

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。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

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。

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，免征营业税。

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。

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。

7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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个人所得税。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 关联方关系

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
中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”）	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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	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
安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司	基金管理人子公司的子公司

- 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、本基金管理人的子公司安信乾盛财富管理（深圳）有限公司于2015年11月3日设立了全资子公司安信乾正股权投资管理（深圳）有限公司。
 3、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.7.1.2 债券交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.7.1.3 债券回购交易

本基金本期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.7.1.5 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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,367,061.04
其中：支付销售机构的客户维护费	320,496.25

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,122,353.63

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信稳健增值 A	安信稳健增值 C	合计
民生银行	-	103,566.64	103,566.64
安信基金直销	-	6,820,224.60	6,820,224.60
安信证券	-	-	-
合计	-	6,923,791.24	6,923,791.24

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 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 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入

民生银行	228,616,527.35	3,836,323.90
------	----------------	--------------

注：1、本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业利率计息。

2、上述当期利息收入中包含了本基金资金托管账户利息收入和对手方为民生银行的协议存款利息收入。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

7.4.8 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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
002778	高 科 石化	2015 年 12 月 28 日	2016 年 1 月 6 日	新股流 通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-
123001	蓝 标 转债	2015 年 12 月 23 日	2016 年 1 月 18 日	新债未 上市	100	99.99	2,680	267,982.38	267,982.38	

7.4.8.2 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。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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 875,598,456.60 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
140205	14 国开 05	2016 年 1 月 4 日	118.40	1,800,000	213,120,000.00

140211	14 国开 11	2016 年 1 月 4 日	116.85	500,000	58,425,000.00
140229	14 国开 29	2016 年 1 月 4 日	107.36	600,000	64,416,000.00
150411	15 农发 11	2016 年 1 月 6 日	100.29	1,500,000	150,435,000.00
111507133	15 招行 CD133	2016 年 1 月 5 日	99.23	3,400,000	337,382,000.00
111511303	15 平安 CD303	2016 年 1 月 5 日	99.23	1,000,000	99,230,000.00
合计				8,800,000	923,008,000.00

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止, 本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 110,000,000.00 元, 于 2016 年 1 月 4 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。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币 47,523,673.40 元，划分为第二层级的余额为人民币 4,324,195,806.78 元，无划分为第三层级余额。

公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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级或第三层级。根据中国证券投资基金业协会中根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 30 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层级转入第二层级。

第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 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。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	47,571,273.40	1.02
	其中：股票	47,571,273.40	1.02
2	固定收益投资	4,324,148,206.78	92.71
	其中：债券	4,324,148,206.78	92.71
	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	232,796,027.40	4.99
7	其他各项资产	59,699,870.82	1.28
8	合计	4,664,215,378.40	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	42,974,640.22	1.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	764,359.95	0.02
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	2,517,852.18	0.07
J	金融业	-	-
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	109,392.21	0.00
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	982,724.40	0.03
S	综合	-	-
	合计	47,571,273.40	1.36

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	000651	格力电器	760,000	16,986,000.00	0.48
2	600104	上汽集团	800,028	16,976,594.16	0.48
3	601339	百隆东方	300,000	2,259,000.00	0.06
4	000625	长安汽车	131,000	2,223,070.00	0.06
5	000800	一汽轿车	108,000	1,767,960.00	0.05
6	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.03
7	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.03
8	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03
9	603866	桃李面包	23,133	893,165.13	0.03
10	300495	美尚生态	6,375	569,223.75	0.02

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	600104	上汽集团	30,882,999.43	0.88
2	000651	格力电器	30,595,614.29	0.87

3	000069	华侨城 A	30,165,949.35	0.86
4	600048	保利地产	27,898,931.59	0.80
5	600837	海通证券	21,121,072.41	0.60
6	000333	美的集团	20,700,927.75	0.59
7	000581	威孚高科	16,760,523.35	0.48
8	600027	华电国际	16,690,070.82	0.48
9	000002	万科 A	15,239,585.95	0.43
10	600009	上海机场	13,947,264.96	0.40
11	600694	大商股份	13,723,101.89	0.39
12	000550	江铃汽车	12,960,259.14	0.37
13	000001	平安银行	10,994,436.68	0.31
14	000625	长安汽车	10,628,967.84	0.30
15	600066	宇通客车	10,459,824.10	0.30
16	000897	津滨发展	10,459,014.08	0.30
17	600887	伊利股份	9,970,237.69	0.28
18	601166	兴业银行	9,871,611.24	0.28
19	601318	中国平安	9,729,358.42	0.28
20	601336	新华保险	8,767,838.85	0.25

注：1、买入包括基金二级市场上的主动的买入、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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000069	华侨城 A	27,757,263.96	0.79
2	600048	保利地产	27,631,093.42	0.79
3	600837	海通证券	20,534,361.12	0.59
4	000333	美的集团	20,409,125.80	0.58
5	600027	华电国际	17,139,370.86	0.49
6	000581	威孚高科	17,126,180.16	0.49
7	000651	格力电器	16,080,493.13	0.46
8	000002	万科 A	14,543,127.00	0.42
9	600104	上汽集团	14,331,687.90	0.41
10	600009	上海机场	13,832,765.29	0.39

11	600694	大商股份	13,406,308.00	0.38
12	000550	江铃汽车	12,876,850.00	0.37
13	000001	平安银行	10,517,675.26	0.30
14	600066	宇通客车	10,394,997.99	0.30
15	000897	津滨发展	9,862,902.00	0.28
16	601166	兴业银行	9,683,422.00	0.28
17	601318	中国平安	9,615,515.96	0.27
18	600887	伊利股份	9,570,967.58	0.27
19	601336	新华保险	8,675,807.40	0.25
20	000625	长安汽车	8,136,044.01	0.23

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。

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	630,299,019.84
卖出股票收入（成交）总额	591,407,076.73

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

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	44,667,402.50	1.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	692,495,000.00	19.76
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	626,160,614.10	17.87
5	企业短期融资券	140,851,000.00	4.02
6	中期票据	1,774,421,800.00	50.64
7	可转债（可交换债）	540,390.18	0.02
8	同业存单	1,045,012,000.00	29.82
9	其他	-	-
10	合计	4,324,148,206.78	123.40

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

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	111507133	15 招行 CD133	3,400,000	337,382,000.00	9.63
2	140205	14 国开 05	2,300,000	272,320,000.00	7.77
3	111593386	15 包商银行 CD033	1,900,000	189,506,000.00	5.41
4	101559065	15 中航国际 MTN001	1,800,000	179,046,000.00	5.11
5	150411	15 农发 11	1,500,000	150,435,000.00	4.29

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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，以风险对冲、套期保值为主要目的，将选择流动性好、交易活跃的期货合约，结合股指期货的估值定价模型，与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，实现基金资产增值保值。

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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性

和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。

8.11.2 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。

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合约。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

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	746,878.33
2	应收证券清算款	386,925.29
3	应收股利	-
4	应收利息	58,450,126.60
5	应收申购款	115,940.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,699,870.82

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	267,982.38	0.01

8.12.5 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。

§ 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

份额级别	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
安信稳健增值 A	545	96,683.66	-	-	52,692,593.10	100.00%
安信稳健增值 C	418	7,696,097.72	3,188,275,467.02	99.11%	28,693,379.97	0.89%
合计	963	3,395,287.06	3,188,275,467.02	97.51%	81,385,973.07	2.49%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	-	-

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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、基金投资和研究人员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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信稳健增值 A	安信稳健增值 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 25 日）基金份额总额	349,828,452.79	4,996,638,587.28
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,365,022.11	4,014,661,037.18
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	306,500,881.80	5,794,330,777.47
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）	-	-
本报告期末基金份额总额	52,692,593.10	3,216,968,846.99

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

本报告期内本基金未举行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

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。

本基金管理人于 2015 年 12 月 31 日发布公告，聘任王连志先生为安信基金管理有限责任公司董事长，牛冠兴先生不再担任安信基金管理有限责任公司董事长。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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。目前安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 1 年，本报告期应支付的报酬为人民币 50,000 元。

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	1,211,972,154.34	100.00%	1,083,229.31	100.00%	-

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。

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
中信建投	3,953,229,887.86	100.00%	9,994,100,000.00	100.00%	-	-

安信基金管理有限责任公司
2016 年 3 月 25 日