

安信鑫发优选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：广发银行股份有限公司

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。

基金托管人广发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 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	安信鑫发优选混合
基金主代码	000433
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 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	广发银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	177,998,349.80 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以风险管理为基础，通过积极主动的资产配置和丰富有效的投资策略，力争为基金份额持有人获得超越业绩基准的绝对回报。
投资策略	在资产配置上，结合政策因素、市场情绪与估值因素等，分析大类资产风险收益比，合理配置；在固定收益类的投资上，采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等策略，选择流动性好、风险溢价合理、到期收益率和信用质量较高的品种；在股票投资上，秉承价值投资理念，灵活运用个股精选、低风险套利投资、事件驱动等策略，把握市场定价偏差带来的投资机会；在衍生品投资上，合理利用权证等做套保或套利投资；在风险管理上，根据市场环境的变化，动态调整仓位和投资品种，并严格执行有关投资流程和操作权限。
业绩比较基准	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	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	李春磊
	联系电话	0755-82509999	010-65169830
	电子邮箱	service@essencefund.com	lichunlei@cgbchina.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95508
传真		0755-82799292	010-65169555

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	2014 年	2013 年 12 月 31 日 (基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	161,891,315.35	49,307,606.78	11,015.87
本期利润	220,693,237.54	48,920,807.34	11,015.87
加权平均基金份额本期利润	0.1357	0.0964	0.0000
本期基金份额净值增长率	28.10%	8.90%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2232	0.0889	0.0000
期末基金资产净值	248,292,089.80	524,293,465.88	550,804,407.35
期末基金份额净值	1.395	1.089	1.000

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

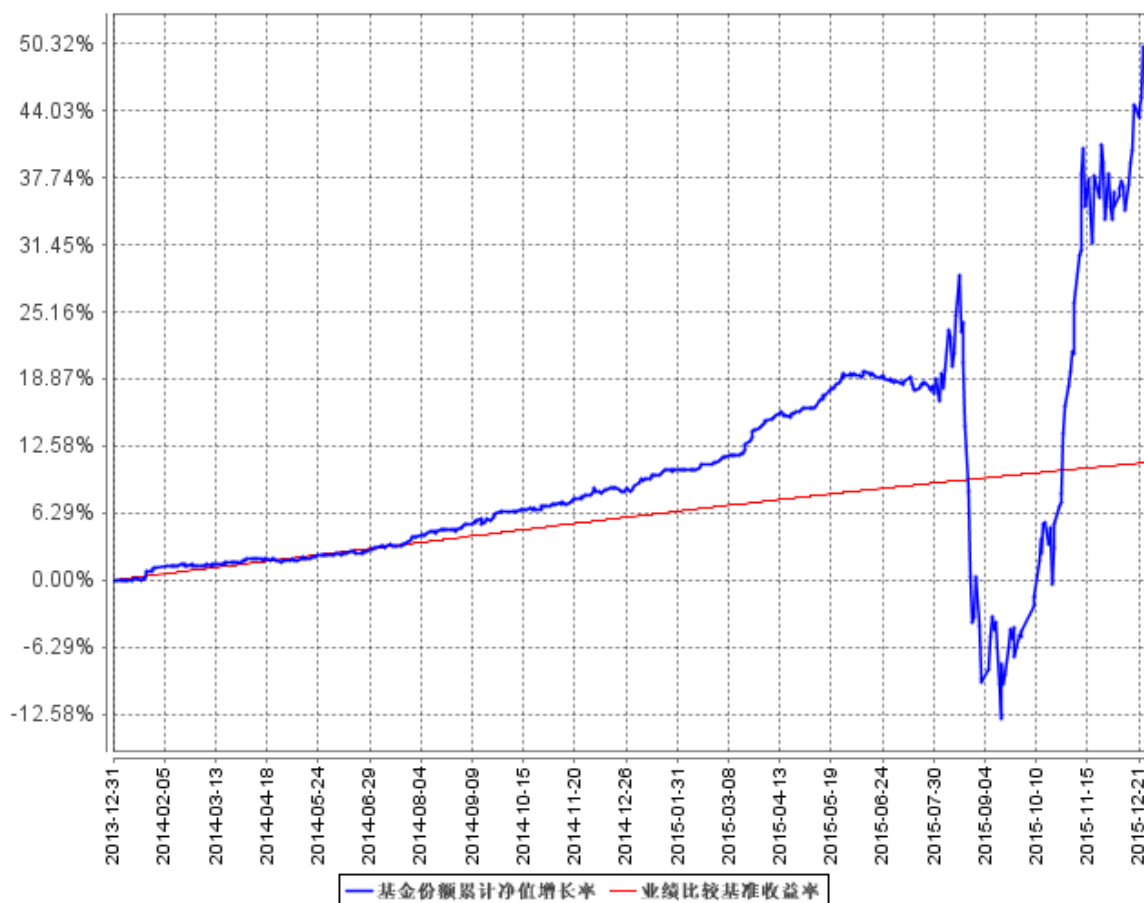
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	46.53%	2.24%	1.05%	0.01%	45.48%	2.23%
过去六个月	17.33%	2.41%	2.19%	0.01%	15.14%	2.40%
过去一年	28.10%	1.72%	4.82%	0.01%	23.28%	1.71%

自基金合同生效起至今	39.50%	1.22%	11.10%	0.02%	28.40%	1.20%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

注：1、根据《安信鑫发优选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：1年期人民币定期存款基准利率+3.00%

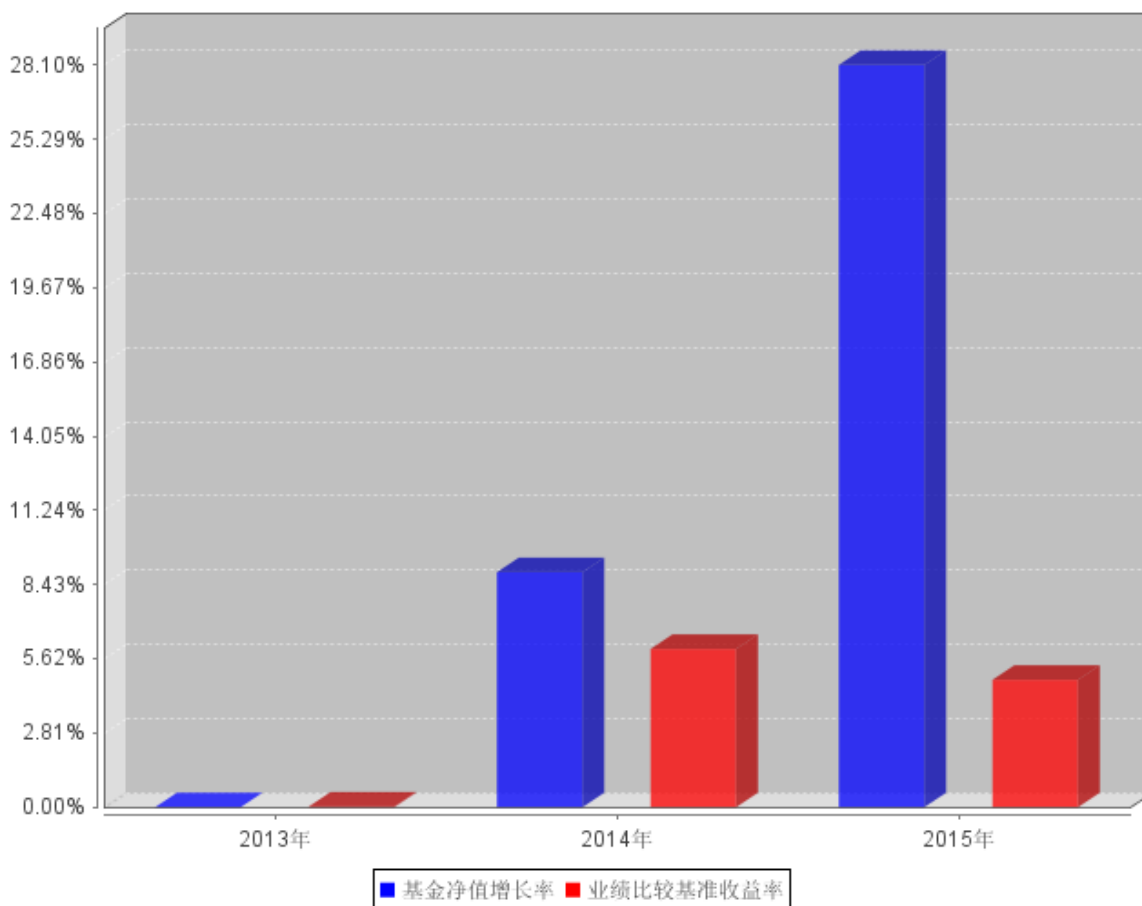
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

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 2013 年 12 月 31 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		
蓝雁书	本基金的基金经理	2013 年 12 月 31 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、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理。
王鑫	本基金的基金经理助理	2014年9月22日	2015年7月10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、基金投资部基金经理助理。
袁玮	本基金的基金经理助理	2015 年 7 月 10 日	-	5	袁玮先生，理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员、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、

					安信新常态沪港深价值精选股票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

2015 年上半年，本基金执行的是绝对收益策略，大部分头寸以低风险、绝对收益类投资策略为主，取得了领先市场同类产品的收益。另外，上半年权益类市场表现抢眼，我们在做好风险控制的前提下，也适当配置了少量 A 股股票资产，其中精选个股均取得了不错的表现。

2015 年中期，考虑到监管层严打股市非法杠杆资金，加上大量个股的价值泡沫较重，我们在 5 月底 6 月初的时间段内大比例减少了股票持仓，除停牌股与限售股外，这个阶段我们卖出了至少 80% 的其余可流通股票。从而躲过了三季度 A 股市场的第一轮暴跌。但 A 股剧烈调整引发了保守型投资者巨额赎回，本基金规模在三季度出现了大幅缩水，造成限售股占比被动提高，进而使得本基金承受了较大的系统性风险，在第二轮市场暴跌中，本基金净值出现了大幅下跌。

进入 2015 年四季度，考虑到场外配资清理接近尾声，且人民币汇率开始企稳回升，我们认为前述的两个压制当时市场的最重要利空因素得到释放，市场将迎来一轮反弹，因此在 10 月初的时候我们主动增加 A 股仓位，最主要的投资方向是新能源汽车产业链的上游锂资源类标的，以及产业升级有关标的，取得了较好投资业绩，净值大幅反弹并创出了新高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.395 元，本报告期份额净值增长率为 28.10%，同期业绩比较基准增长率为 4.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年开年，A 股市场遭受罕见剧烈调整，根本的原因是市场对经济增速进一步下探的担忧。原因是：相对于供给侧改革中减税、放松管制的慢效应，更为直接的落后/过剩产能去化成为当前政策主抓点，这很可能引发工业数据顿挫，经济总量数据表现必然欠佳；同时过剩产能去化过程中逐渐暴露出来的信用风险，也会对 A 股风险偏好产生压力。

短期内，这些因素对 A 股市场的影响不会很快消除，A 股大概率延续振荡走势。但是站在上证指数 2700 点位附近，对未来 A 股市场不必过于悲观。首先，虽然当前中国经济也面临着与 1998 年相似的内忧外患环境，但是当前亏损落后企业产能占比、银行坏账比例以及政府财政和杠杆水平都好于当时，供给侧改革的对经济基本面影响会小于当时。其次，A 股市场仍将受益于持续宽松的货币环境，且中国政府推进的国有企业改革、房地产去库存等措施，都是改善 A 股整体 ROE 非常有针对性的举措，ROE 的见底回升是可以预期的。未来，我们认为 A 股比较好的两个投资时点是：其一是春节前后可能会有降息降准（或者类似信号），叠加两会和十三五规划对改革的政策

预期，市场进入可为时期；第二次可能的机会是在 16 年下半年，供给侧改革慢慢见效，同时 A 股纳入 MSCI 指数，为蓝筹股走强提供契机，市场重新进入上行轨道。本基金将及时跟踪相关指标，待市场上涨信号明确时果断提高股票仓位，力争为投资者争取更好回报。

行业板块方面，主要考虑三个方面：（1）环保 PPP 领域，按照 GDP 年均 6.5% 的增速底线，基建投资增速要达到 25% 以上才能弥补房地产投资可能出现的负增长，其中环保 PPP 将扮演重要角色。（2）新能源汽车产业链，未来补贴减少幅度有限，且部分地方政府 16 年规划新能源汽车量仍将保持较快增长。（3）医疗服务，是少数可以以供给创造需求的行业，且符合未来经济结构转型和成长方向，市场空间巨大。

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。

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，广发银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计了安信鑫发优选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年度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：安信鑫发优选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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	22,382,608.30	47,294,115.03
结算备付金	2,922,422.14	18,351,736.79
存出保证金	1,129,866.31	1,462,810.94
交易性金融资产	222,246,700.97	59,633,899.70
其中：股票投资	222,246,700.97	37,391,899.70
基金投资	-	-
债券投资	-	22,242,000.00
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	-	439,987,624.98
应收证券清算款	3,165,825.49	-
应收利息	8,234.95	986,146.09
应收股利	-	-
应收申购款	2,253,994.00	99,009.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	254,109,652.16	567,815,343.43
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 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	-	-
应付证券清算款	-	40,000,000.00
应付赎回款	4,903,417.13	2,536,473.09
应付管理人报酬	229,351.49	458,391.10
应付托管费	45,870.31	91,678.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	584,335.31	152,699.68
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	54,588.12	282,635.45
负债合计	5,817,562.36	43,521,877.55
所有者权益：		

实收基金	177,998,349.80	481,510,867.82
未分配利润	70,293,740.00	42,782,598.06
所有者权益合计	248,292,089.80	524,293,465.88
负债和所有者权益总计	254,109,652.16	567,815,343.43

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.395 元，基金份额总额 177,998,349.80 份。

7.2 利润表

会计主体：安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	247,065,990.25	56,577,405.99
1. 利息收入	41,706,997.60	16,709,948.37
其中：存款利息收入	24,957,721.62	3,805,348.75
债券利息收入	4,501,117.82	516,545.66
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	12,248,158.16	12,388,053.96
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	116,423,452.59	38,597,242.18
其中：股票投资收益	111,970,376.71	33,400,711.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,659,527.37	4,954,275.35
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	793,548.51	242,255.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	58,801,922.19	-386,799.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	30,133,617.87	1,657,014.88
减：二、费用	26,372,752.71	7,656,598.65
1. 管理人报酬	18,718,283.56	5,278,238.17
2. 托管费	3,743,656.76	1,055,647.67
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,503,618.22	932,710.70
5. 利息支出	85,294.17	-
其中：卖出回购金融资产支出	85,294.17	-
6. 其他费用	321,900.00	390,002.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	220,693,237.54	48,920,807.34
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	220,693,237.54	48,920,807.34
-------------------	----------------	---------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	481,510,867.82	42,782,598.06	524,293,465.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	220,693,237.54	220,693,237.54
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）	-303,512,518.02	-193,182,095.60	-496,694,613.62
其中：1. 基金申购款	6,802,856,655.71	1,140,269,878.12	7,943,126,533.83
2. 基金赎回款	-7,106,369,173.73	-1,333,451,973.72	-8,439,821,147.45
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）	177,998,349.80	70,293,740.00	248,292,089.80
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	550,793,391.48	11,015.87	550,804,407.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	48,920,807.34	48,920,807.34
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）	-69,282,523.66	-6,149,225.15	-75,431,748.81
其中：1. 基金申购款	530,434,795.63	15,754,651.60	546,189,447.23

2. 基金赎回款	-599,717,319.29	-21,903,876.75	-621,621,196.04
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）	481,510,867.82	42,782,598.06	524,293,465.88

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：

<u>刘入领</u>	<u>廖维坤</u>	<u>尚尔航</u>
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

安信鑫发优选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”）2013 年 11 月 4 日下发的证监许可[2013]1401 号文“关于核准安信鑫发优选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《安信鑫发优选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 2013 年 12 月 11 日至 2013 年 12 月 27 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(2013)验字 60962175_H09 号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 550,664,388.77 元。经向中国证监会备案，《安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 31 日正式生效。截至 2013 年 12 月 31 日止，安信鑫发优选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 550,664,388.77 元，折合 550,664,388.77 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 129,002.71 元，折合 129,002.71 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 550,793,391.48 元，折合 550,793,391.48 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，基金托管人为广发银行股份有限公司。

本基金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、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（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，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，

其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。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%，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：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〉》、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 1 月 1 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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 2015 年 9 月 21 日由于股票分红除权有误，导致基金份额净值计价错误，管理人及时发现并采取措施予以纠正，并于 2015 年 9 月 22 日发布基金份额净值计价错误的公告，未给基金和投资者造成损失。

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
广发银行股份有限公司（以下简称“广发银行”）	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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	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
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
安信证券	1,310,438,822.79	49.48%	458,704,796.09	65.63%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	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 成交总额的比 例
安信证券	3,185,764.90	25.71%	32,083,652.57	67.48%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
安信证券	27,549,900,000.00	83.42%	29,335,100,000.00	66.40%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
安信证券	913,994.67	48.73%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
安信证券	324,248.87	65.70%	103,303.02	67.93%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	18,718,283.56
其中：支付销售机构的客	686,217.02	816,176.31

户维护费		
------	--	--

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,743,656.76	1,055,647.67

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2013 年 12 月 31 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	37,828,712.12	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	13,439,964.16	-
期末持有的基金份额	24,388,747.96	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.70%	-

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 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
中广核财务有限责任公司	-	-	48,731,968.81	10.12%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行	22,382,608.30	3,291,628.00	47,294,115.03	1,461,189.52

注：本基金资金托管账户的银行存款由基金托管人广发银行保管，按银行同业利率计息。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广发银行的协议存款利息收入。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 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。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002749	国光股份	2015 年 3 月 16 日	2016 年 3 月 20 日	新股流通受限	26.92	100.20	643,999	17,336,453.08	64,528,699.80	-
300394	天孚通信	2015 年 2 月 12 日	2016 年 2 月 17 日	新股流通受限	21.41	115.50	99,337	2,126,805.17	11,473,423.50	-

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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款余额为 0 元, 无质押债券。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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 222, 246, 700. 97 元, 无划分为第二层级、第三层级余额。(于 2014 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 37, 391, 899. 70 元, 划分为第二层级的余额为人民币 22, 242, 000. 00 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,本基金本报告期末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	222,246,700.97	87.46
	其中:股票	222,246,700.97	87.46
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	25,305,030.44	9.96
7	其他各项资产	6,557,920.75	2.58
8	合计	254,109,652.16	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	14,260,532.00	5.74
C	制造业	146,119,833.16	58.85

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	10,146,400.00	4.09
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	34,332,714.81	13.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,714,620.00	1.50
L	租赁和商务服务业	13,672,601.00	5.51
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	222,246,700.97	89.51

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	002749	国光股份	643,999	64,528,699.80	25.99
2	002460	赣锋锂业	243,729	15,337,865.97	6.18
3	002466	天齐锂业	106,976	15,056,872.00	6.06
4	603308	应流股份	478,793	14,995,796.76	6.04
5	002070	众和股份	685,900	14,980,056.00	6.03
6	002230	科大讯飞	391,339	14,499,109.95	5.84
7	000697	炼石有色	512,600	14,260,532.00	5.74
8	000061	农产品	772,900	13,672,601.00	5.51

9	300394	天孚通信	99,337	11,473,423.50	4.62
10	600570	恒生电子	170,288	10,382,459.36	4.18

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	600570	恒生电子	321,542,251.80	61.33
2	002230	科大讯飞	63,741,671.48	12.16
3	600406	国电南瑞	40,898,397.62	7.80
4	600198	大唐电信	30,984,438.00	5.91
5	000697	炼石有色	28,501,865.64	5.44
6	300203	聚光科技	22,180,693.73	4.23
7	002276	万马股份	21,944,838.01	4.19
8	000762	西藏矿业	21,519,377.39	4.10
9	002466	天齐锂业	20,944,235.63	3.99
10	002049	同方国芯	18,946,970.28	3.61
11	600271	航天信息	18,775,119.75	3.58
12	300016	北陆药业	18,664,694.70	3.56
13	002748	世龙实业	18,456,276.84	3.52
14	300189	神农基因	17,971,104.48	3.43
15	603308	应流股份	17,953,659.14	3.42
16	002749	国光股份	17,336,453.08	3.31
17	000911	南宁糖业	16,983,915.48	3.24
18	002465	海格通信	16,714,743.40	3.19
19	002070	众和股份	16,229,806.00	3.10
20	600277	亿利洁能	15,883,522.51	3.03
21	002460	赣锋锂业	15,750,663.81	3.00
22	000061	农产品	15,509,307.54	2.96
23	002171	楚江新材	15,173,207.96	2.89
24	000089	深圳机场	14,390,409.17	2.74
25	002117	东港股份	13,910,284.40	2.65
26	002729	好利来	13,337,981.69	2.54

27	002121	科陆电子	12,991,152.31	2.48
28	600979	广安爱众	12,867,309.33	2.45
29	600009	上海机场	12,752,837.60	2.43
30	600519	贵州茅台	11,962,200.63	2.28
31	002221	东华能源	11,682,502.44	2.23
32	300145	南方泵业	11,588,443.14	2.21
33	000516	国际医学	11,189,284.78	2.13
34	300353	东土科技	11,172,155.54	2.13
35	002184	海得控制	10,996,721.57	2.10
36	002063	远光软件	10,989,483.00	2.10
37	300059	东方财富	10,830,148.00	2.07

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600570	恒生电子	262,568,208.26	50.08
2	002230	科大讯飞	59,715,966.56	11.39
3	002748	世龙实业	40,766,082.92	7.78
4	600406	国电南瑞	36,146,884.74	6.89
5	600271	航天信息	34,389,135.87	6.56
6	002276	万马股份	30,830,060.99	5.88
7	300189	神农基因	27,431,335.32	5.23
8	300203	聚光科技	23,332,006.50	4.45
9	000762	西藏矿业	21,562,617.85	4.11
10	002049	同方国芯	20,414,766.09	3.89
11	000911	南宁糖业	20,046,374.29	3.82
12	600198	大唐电信	19,986,010.70	3.81
13	002117	东港股份	17,945,749.30	3.42
14	600277	亿利洁能	17,872,018.00	3.41
15	002465	海格通信	16,388,586.06	3.13
16	000697	炼石有色	15,513,524.60	2.96
17	002171	楚江新材	15,254,085.97	2.91
18	603012	创力集团	14,477,392.48	2.76

19	000089	深圳机场	14,092,322.38	2.69
20	002063	远光软件	14,086,878.68	2.69
21	300016	北陆药业	13,765,333.55	2.63
22	600979	广安爱众	12,847,874.60	2.45
23	600009	上海机场	11,892,457.49	2.27
24	002121	科陆电子	11,713,544.90	2.23
25	600519	贵州茅台	11,651,715.50	2.22
26	300145	南方泵业	11,551,717.27	2.20
27	600687	刚泰控股	11,095,627.94	2.12
28	002221	东华能源	11,049,779.41	2.11
29	300353	东土科技	10,858,960.46	2.07
30	002477	雏鹰农牧	10,499,323.50	2.00

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。

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	1,369,762,722.32
卖出股票收入（成交）总额	1,355,629,039.95

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

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

本基金为债券型基金，不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金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。

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。

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	1,129,866.31
2	应收证券清算款	3,165,825.49
3	应收股利	-
4	应收利息	8,234.95
5	应收申购款	2,253,994.00

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,557,920.75

8.12.4 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。

8.12.5 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	002749	国光股份	64,528,699.80	25.99	新股锁定
2	300394	天孚通信	11,473,423.50	4.62	新股锁定

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
13,509	13,176.28	24,388,747.96	13.70%	153,609,601.84	86.30%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	17,549.72	0.0100%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

基金合同生效日（2013年12月31日）基金份额总额	550,793,391.48
本报告期期初基金份额总额	481,510,867.82
本报告期基金总申购份额	6,802,856,655.71
减:本报告期基金总赎回份额	7,106,369,173.73
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	177,998,349.80

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。

本报告期内，基金托管人于 2015 年 2 月 10 日发布公告，聘任蒋柯先生担任本行资产托管部副总经理。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会和上海证监局报告。

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发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期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 2 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	
安信证券	2	1,310,438,822.79	49.48%	-	-	-
海通证券	2	1,110,469,301.52	41.93%	572,383.39	100.00%	-
东海证券	2	227,552,186.23	8.59%	-	-	-

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
安信证券	3,185,764.90	25.71%	27,549,900,000.00	83.42%	-	-
海通证券	9,207,719.20	74.29%	3,226,000,000.00	9.77%	-	-
东海证券	-	-	2,248,000,000.00	6.81%	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

截止本报告期末，本基金持有的国光股份（002749）尚处于限售期内，限售期为 2015 年 3 月 20 日至 2016 年 3 月 19 日，因基金规模变动，造成该股票比例被动超过基金净资产的 10%。为保护投资者利益、符合监管要求，我司将会在该股票限售期结束后尽快将持仓比例调整到 10% 以下，特此说明。

安信基金管理有限责任公司
2016 年 3 月 25 日