

安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

[2013] 第二季度报告

基金管理人:安信基金管理有限责任公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告期结束日:2013年7月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 安信策略精选灵活配置混合

交易代码 750005

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2012年6月20日

报告期末基金份额总额 64,537,670.75份

投资目标 深入挖掘和把握市场投资机会,分享中国经济增长和资本市场发展的成果,力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的回报。

投资策略 本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的模式,在对中国经济结构和市场趋势进行分析的基础上,以行业周期和公司竞争优势为分析根本,结合金融市场对公司的分析,根据大类资产的收益与风险特征的判断,动态运用资产不断优化资产配置策略,股票投资策略、债券投资策略,可转债投资策略、现金投资策略等多种策略,实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×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,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

基金管理人 安信基金管理有限责任公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,957,564.25

2.本期利润 2,873,104.80

3.加权平均基金份额本期利润 0.0364

4.期末基金份额净值 69,076,163.30

5.期末基金份额净值 1.070

注:所列业绩指标不包括持有人认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.本期已实现收益指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.3 本报告期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 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.4 本报告期基金份额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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.5 本报告期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 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.6 本报告期基金份额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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.7 本报告期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 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.8 本报告期基金份额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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.9 本报告期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 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.10 本报告期基金份额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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.11 本报告期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 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.12 本报告期基金份额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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.13 本报告期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 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.14 本报告期基金份额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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.15 本报告期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 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.16 本报告期基金份额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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.17 本报告期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 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.18 本报告期基金份额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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.19 本报告期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 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.20 本报告期基金份额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

阶段 净值增 置增率(%) 置增率(%) 基准收益 置增率(%) 基准收益 置增率(%)

① ② ③ ④ ⑤ ⑥ ⑦

过去三个月 2.29% -7.11% 0.89% 9.40% 0.41%

注:注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个月度实现净值。

3.2.21 本报告期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