安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2013 年度报告摘要

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
送出日期:2014年3月29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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月27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2013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2013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	安信灵活配置混合
基金主代码	750001
交易代码	750001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月20日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	47,810,485.95份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活运用多种投资策略,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投资回报。
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发展趋势进行分析的基础上,以行业运行周期和公司竞争优势分析为根本,结合金融市场行为分析,根据大类资产的收益与风险特征及其变化趋势的判断,动态运用并不断优化资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、权证投资策略等多种策略,实现基金资产长期稳定增值。
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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙晓奇	田青
	联系电话	0755-82509999	010-67595096
	电子邮箱	service@essencefund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-088-088	010-67595096
传真		0755-82799292	010-66275853

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	2013年	2012年6月20日-2012年12月31日
本期已实现收益	17,046,204.29	7,399,819.47
本期利润	6,661,472.01	17,798,357.43
加权平均基金份额本期利润	0.0877	0.0365
本期基金份额净值增长率	4.83%	7.70%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0875	0.0209
期末基金资产净值	51,993,766.86	190,996,572.11
期末基金份额净值	1.087	1.077

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;

4、本基金合同于2012年6月20日生效,至2012年12月31日未满1年,故2012年的数据和指标为非完整会计年度数据。

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	-1.90%	1.14%	-3.13%	0.68%	1.23%	0.46%
过去六个月	1.59%	1.27%	1.32%	0.78%	0.27%	0.49%
过去一年	4.83%	1.31%	-6.19%	0.84%	11.02%	0.47%
自基金合同生效日起至今(2012年06月20日-2013年12月31日)	12.90%	1.07%	-7.18%	0.80%	20.08%	0.27%

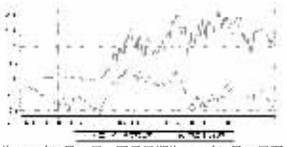
注:根据《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率。

其中沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票,能够反映A股市场总体价格走势。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60%、40%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。

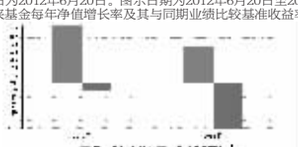
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年6月20日-2013年12月31日)



注:本基金基金合同生效日为2012年6月20日。图示日期为2012年6月20日至2013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



注:本基金基金合同生效日为2012年6月20日,2012年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	0.400	5,408,764.10	414,399.26	5,823,163.36	
合计	0.400	5,408,764.10	414,399.26	5,823,163.36	

§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。截至2013年12月31日,本公司注册资本3.5亿元人民币,股东及股权结构为:安信证券股份有限公司持有52.71%的股权,五矿资本控股有限公司持有38.72%的股权,中广核财务有限责任公司持有8.57%的股权。

截至2013年12月31日,本基金管理人共管理7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。

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		
陈振宇	本基金的基金经理、基金投资部总经理	2012年6月20日	-	19	陈振宇先生,经济学硕士。历任大鹏证券有限责任公司证券投资部经理、资产管理部总经理,招商证券股份有限公司福民路证券营业部总经理,安信证券股份有限公司资产管理部副总经理(主持工作),证券投资部副总经理(主持工作)。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部总经理。
监雁书	本基金的基金经理助理	2012年6月20日	-	7	监雁书先生,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。现在安信基金管理有限责任公司基金投资部负责权益类投资工作。2013年12月31日至今,兼任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
庄园	本基金的基金经理助理	2012年6月21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,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。现在安信基金管理有限责任公司固定收益部负责固定收益类投资工作。2012年12月26日至今,兼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。

注:1、本基金基金经理陈振宇、基金经理助理监雁书,其"任职日期"按基金合同生效日填写;基金经理助理庄园的"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。

3、本基金基金经理陈振宇先生已于2014年2月10日因个人原因离职。

4.2 管理人对投资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》、《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 公平交易制度和控制方法

为了保证公司旗下管理的所有基金和投资组合得到公平对待,杜绝各种形式的利益输送,切实保障各类投资者的合法权益,本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及公司制度的相关规定,制定公司公平交易制度。

公平交易制度要求公司以科学、制衡的投资决策体系,通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段,保证公平交易原则的实现。同时,公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露对公平交易过程和结果进行监督。

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。

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。

4.3.3 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。

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,在投资和出口增速总体下滑的背景下,经济增长放缓、经济调整结构成为市场的主要关注点,A股市场的小盘股和大盘股都出现了较大幅度的反复波动,整体表现为较强的结构性行情,下游行业相对上游行业表现较强,而代表经济结构转型方向的TMT、传媒等板块同样表现较好,自贸区、土地流转等主题概念股表现也相对较好。本基金在上半年基本上以投资成长股为主,适度参与蓝筹股的阶段性反弹行情,进入下半年以后,出于对于整体创业板估值泡沫积累的担忧,逐渐降低了高估值品种的配置比例。本基金认为低估值、业绩确定蓝筹股的风险收益比将会好于高估的小盘股,因此本基金下半年逐步增加了低估值、业绩确定个股的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为1.087元,本报告期份额净值增长率为4.83%,同期业绩比较基准增长率为-6.19%。

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2014年,海外发达国家经济延续复苏,尤其是美国经济复苏较为强劲,美国消费者信心指数、失业率等指标继续好转。QE缩减幅度虽然较小,但全年退出节奏可能超出市场预期,全球货币环境有望从2013年较宽松状态逐步向偏紧过渡。国内经济总体较为平稳,通胀小幅上升但不构成约束,货币政策保持中性,同时三中全会的改革措施后期具体细则出台,会提高股市长期风险偏好,总体上构成A股整体估值支撑因素。2014年1月初IPO的正式重启,使得投资者短期会更多关注新股投资机会,加上短期资金成本上升,股市存量资金分流,市场整体全年可能不会出现趋势性上升行情,更大概率会是阶段性行情。安信策略精选灵活配置基金在做好大类资产配置同时,将重点关注低估值而盈利前景看好的蓝筹股以及受益于经济结构转型的行业,如非银金融、TMT、大众消费、新能源、节能环保等,同时关注市场化改革相关受益领域和新股的投资机会。

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》进行。

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《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及最新的招募说明书约定:"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6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%"。

本基金以2013年1月4日为收益分配基准日,于2013年1月11日对本基金份额持有人按每10份基金份额分配人民币0.40元进行分红,其中现金形式发放总额人民币5,408,764.10元,再投资形式发放总额人民币414,399.26元,实际分配收益为人民币5,823,163.36元,符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分,将严格按照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,中国建设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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金的利润分配金额为人民币5,823,163.36元。

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。

中国建设银行股份有限公司

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表,自2013年1月1日至2013年12月31日止期间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:安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	3,192,760.89	4,394,777.23
结算备付金	984,706.17	3,872,366.16
存出保证金	71,705.20	1,000,000.00
交易性金融资产	29,324,305.59	163,744,022.52
其中:股票投资	27,631,124.69	133,394,022.52
基金投资		
债券投资	1,693,180.90	30,350,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	20,000,000.00	26,000,150.00
应收证券清算款	-	5,999,045.20
应收利息	4,481.18	298,041.07
应收股利	-	-
应收申购款	83,558.23	43,448.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	53,661,517.26	205,351,850.45
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	1,091,243.97	3,987,359.76
应付赎回款	188,823.30	8,724,293.40
应付管理人报酬	69,615.36	284,438.43
应付托管费	11,602.56	47,406.42
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	155,753.60	168,900.02
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,711.61	1,142,880.31
负债合计	1,667,750.40	14,355,278.34
所有者权益:		
实收基金	47,810,485.95	177,261,689.05
未分配利润	4,183,280.91	13,734,883.06
所有者权益合计	51,993,766.86	190,996,572.11
负债和所有者权益总计	53,661,517.26	205,351,850.45

注:(1)报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.087元,基金份额总额47,810,485.95份。

(2)本基金合同于2012年6月20日生效,上年度可比期间非完整会计年度。

7.2 利润表

会计主体:安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日-2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年6月20日-2012年12月31日
一、收入	10,282,710.67	22,817,074.00
1.利息收入	764,116.55	9,106,805.32
其中:存款利息收入	51,370.54	6,443,963.38
债券利息收入	385,016.91	667,806.32
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	327,729.10	1,995,035.62
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	19,721,291.68	2,581,818.18
其中:股票投资收益	18,935,953.25	2,032,813.28
基金投资收益		
债券投资收益	442,061.73	548,644.90
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	343,276.70	360.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-10,384,732.28	10,398,537.96
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		
5.其他收入(损失以"-"号填列)	182,034.72	729,912.54
减:二、费用	3,621,238.66	5,018,716.57
1.管理人报酬	1,259,229.79	3,821,246.36
2.托管费	209,871.62	636,874.42
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,762,603.38	312,077.62
5.利息支出	1,751.94	26,559.23
其中:卖出回购金融资产支出	1,751.94	26,559.23
6.其他费用	387,781.93	221,958.94
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	6,661,472.01	17,798,357.43
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	6,661,472.01	17,798,357.43

注:本基金合同于2012年6月20日生效,上年度可比期间非完整会计年度。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日-2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日-2013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)	177,261,689.05	13,734,883.06	190,996,572.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,661,472.01	6,661,472.01
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)	-129,451,203.10	-10,389,910.80	-139,841,113.90
其中:1.基金申购款	17,552,700.57	1,577,487.94	19,130,188.51
2.基金赎回款	-147,003,903.67	-11,967,398.74	-158,971,302.41
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)	-	-5,823,163.36	-5,823,163.36
五、期末所有者权益(基金净值)	47,810,485.95	4,183,280.91	51,993,766.86
项 目	上年度可比期间 2012年6月20日-2012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)	743,426,623.31	-	743,426,623.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,798,357.43	17,798,357.43
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)	-566,164,934.26	-4,063,474.37	-570,228,408.63
其中:1.基金申购款	1,788,457.71	13,208.07	1,801,665.78
2.基金赎回款	-567,953,391.97	-4,076,682.44	-572,030,074.41
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)	177,261,689.05	13,734,883.06	190,996,572.11

注:本基金合同于2012年6月20日生效,上年度可比期间非完整会计年度。

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	娄志刚	尚尔航
基金管理公司负责人	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

安信策略精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")2012年4月5日下发的证监许可[2012]442号文"关于核准安信策略精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《安信策略精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,首次募集期间为2012年5月21日至2012年6月15日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集743,292,609.47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_H04号验资报告。经向中国证监会备案,《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2012年6月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为743,426,623.31份基金份额,其中认购资金利息折合134,013.84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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信策略精选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(含中小板股票、创业板股票,以及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规允许或中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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30%-80%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,债券及其他金融工具投资占基金资产的比例为20%-70%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照中国财政部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。

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2013年12月31日的财务状况以及2013年度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 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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、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;

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。

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
中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")	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

注:于本期,开无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

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 2013年1月1日-2013年12月31日		上年度可比期间 2012年6月20日-2012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
安信证券股份有限公司	628,513,048.11	50.62%	285,165,200.68	100.00%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日-2013年12月31日		上年度可比期间 2012年6月20日-2012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
安信证券股份有限公司	2,462,707.10	5.17%	11,223,757.23	100.00%

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 2013年1月1日-2013年12月31日		上年度可比期间 2012年6月20日-2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
安信证券股份有限公司	229,000,000.00	11.11%	6,711,000,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内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 2013年1月1日-2013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
安信证券股份有限公司	430,247.19	45.80%	15,859.89	10.18%
关联方名称	上年度可比期间 2012年6月20日-2012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
安信证券股份有限公司	193,633.37	100.00%	166,140.09	100.00%

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

关联方名称	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年6月20日-2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,259,229.79	3,821,246.36
其中:支付销售机构的客户维护费	335,422.61	951,185.31

注:1)基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金