安信价值精选股票型证券投资基金

2015 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: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。

基金托管人中国建设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	安信价值精选股票
基金主代码	000577
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月21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	49,082,588.85份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入的基本面研究的基础上,精选股价相对于内在价值明显低估的股票进行投资,注重安全边际,为基金份额持有人实现长期稳定的回报。
投资策略	基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主,重点关注包括GDP增速、投资增速、货币供应、通胀率和利率等宏观和政策指标,同时结合定量分析的方法,对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。本基金的股票资产主要投资于价值型股票,坚持深入的基本面分析和坚持安全边际是本基金精选股票的两条基本原则。本基金的债券投资在宏观经济运行态势分析、经济政策分析的基础上,分析基础利率的走势,研究利率期限结构和中长期收益率走势,在此基础上实现组合增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益水平和预期风险水平高于债券型基金、混合型基金和货币型基金,属于预期风险水平和预期收益水平较高的投资品种。

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	乔江辉	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	2015年	2014年4月21日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	28,482,422.68	6,014,903.22
本期利润	28,279,001.94	13,115,275.10
加权平均基金份额本期利润	0.8279	0.1992
本期加权平均净值利润率	47.36%	19.10%
本期基金份额净值增长率	48.40%	31.00%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	46,327,329.11	6,353,622.76
期末可供分配基金份额利润	0.9439	0.1770
期末基金资产净值	95,409,917.96	47,000,671.49
期末基金份额净值	1.944	1.310
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	94.40%	31.00%

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

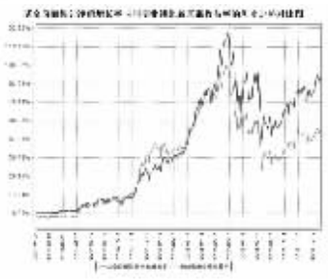
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	20.22%	1.53%	13.67%	1.34%	6.55%	0.19%
过去六个月	-3.52%	2.63%	-12.23%	2.14%	8.71%	0.49%
过去一年	48.40%	2.30%	6.67%	1.99%	41.73%	0.31%
自基金合同生效起至今	94.40%	1.85%	56.37%	1.64%	38.03%	0.21%

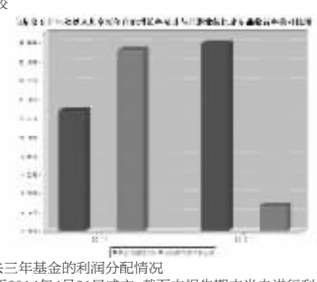
注:根据《安信价值精选股票型证券投资基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数收益率+20%×中债总指数收益率。其中沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票,能够反映A股市场总体价格走势。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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80%、20%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



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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2014年4月21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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈一峰	本基金的基金经理	2014年4月21日	-	7	陈一峰先生,经济学硕士,注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券资产管理总部助理研究员,安信基金管理有限责任公司研究部研究员,特定资产管理部投资经理,现任安信基金基金投资部基金经理。现任安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理。
张明	本基金的基金经理助理	2014年9月22日	2015年1月12日	4	张明先生,管理学硕士。曾任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究规研究员。2011年12月加入安信基金管理有限责任公司研究部,现任特定资产管理部投资经理。
庄园	本基金的基金经理助理	2015年3月24日	-	11	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。2012年5月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾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、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理;现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、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)、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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年市场大幅波动。上半年,市场大幅上扬;年中,市场出现了比较明显的下跌;年末,市场又出现了较为明显的反弹。风格方面,相对于大股票,小股票相对占优;主题类股票也比较活跃。全年,我们时刻坚持寻找风险报酬比合适的股票,上半年上涨时和年末反弹时基本跟上了市场,下跌时大幅跑赢市场,综合来看取得了较好的业绩表现。

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1.944元,本报告期份额净值增长率为48.40%,同期业绩比较基准增长率为6.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为无论是流动性方面,还是经济增长的总量和结构方面仍有不少可期待的地方。结合现在市场整体的估值水平,虽然波动会加大,但我们并不悲观。

从微观上来看,由于经济潜在增速降低、各产业发展阶段差异极大,我们认为未来会看到更为明显的行业间景气的异步性,以及行业内公司表现的分化。我们认为,无论是传统产业,还是新兴产业,许多真正具有竞争优势的公司并没有在估值水平上和所谓的同类公司区分开来。我们认为逻辑明确、估值合理的成长型股票,以及由于市场周期或投资者情绪导致的估值偏低的蓝筹股仍能跑赢市场。

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,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。

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)审计了安信价值精选股票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4月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日的利润表和所有者权益(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:安信价值精选股票型证券投资基金

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	19,400,352.95	1,829,160.01
结算备付金	330,820.34	777,725.33
存出保证金	21,675.04	45,960.41
交易性金融资产	81,888,847.04	41,058,851.05
其中:股票投资	81,888,847.04	41,058,851.05
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	3,200,000.00
应收证券清算款	-	201,785.00
应收利息	1,658.98	864.36
应收股利	-	-
应收申购款	8,395,640.55	154,781.16
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	110,038,994.90	47,269,127.32
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	14,412,780.48	-
应付赎回款	44,531.19	59,942.34
应付管理人报酬	51,425.15	37,988.41
应付托管费	12,856.32	9,497.10
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	57,406.89	50,976.99
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	50,076.91	110,050.99
负债合计	14,629,076.94	268,455.83
所有者权益:		
实收基金	49,082,588.85	35,891,215.29
未分配利润	46,327,329.11	11,109,456.20
所有者权益合计	95,409,917.96	47,000,671.49
负债和所有者权益总计	110,038,994.90	47,269,127.32

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.944元,基金份额总额49,082,588.85份。

7.2 利润表

会计主体:安信价值精选股票型证券投资基金

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4月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	29,751,912.40	14,229,857.80
1.利息收入	82,202.44	1,009,073.44
其中:存款利息收入	40,262.12	681,106.53
债券利息收入	-	14,023.05
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	41,940.32	313,943.86
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	29,439,407.57	5,314,111.85
其中:股票投资收益	28,632,330.69	4,728,534.08
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	130,901.65
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	807,076.88	454,676.12
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-203,420.74	7,100,371.88
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	433,723.13	806,300.63
减:二、费用	1,472,910.46	1,114,582.70
1. 管理人报酬	595,151.32	472,327.68
2. 托管费	148,787.84	118,081.90
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	346,796.93	375,526.50
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	382,175.37	148,646.62
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	28,279,001.94	13,115,275.10
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	28,279,001.94	13,115,275.10

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信价值精选股票型证券投资基金

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)	35,891,215.29	11,109,456.20	47,000,671.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,279,001.94	28,279,001.94
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)	13,191,373.56	6,938,870.97	20,130,244.53
其中:1.基金申购款	62,366,940.45	45,303,594.13	107,670,534.58
2.基金赎回款	-49,175,566.89	-38,364,723.16	-87,540,290.05
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)	49,082,588.85	46,327,329.11	95,409,917.96
项目	上年度可比期间 2014年4月21日(基金合同生效日)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)	200,991,230.33	-	200,991,230.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,115,275.10	13,115,275.10
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)	-165,100,015.04	-2,005,818.90	-167,105,833.94
其中:1.基金申购款	45,472,991.73	5,477,032.90	50,950,024.63
2.基金赎回款	-210,573,006.77	-7,482,851.80	-218,055,858.57
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)	35,891,215.29	11,109,456.20	47,000,671.49

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

安信价值精选股票型证券投资基金(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”)2014年1月21日下发的证监许可[2014]114号文“关于核准安信价值精选股票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《安信价值精选股票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2014年3月20日至2014年4月17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(2014)验字60962175_H10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200,942,239.67元。经向中国证监会备案,《安信价值精选股票型证券投资基金基金合同》于2014年4月21日正式生效。截至2014年4月21日止,安信价值精选股票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200,942,239.67元,折合200,942,239.67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48,990.66元,折合48,990.66份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币200,991,230.33元,折合200,991,230.33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《安信价值精选股票型证券投资基金合同》的有关规定,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)。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80%-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:沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%。

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年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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的说明

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
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。

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

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		上期 2014年4月21日(基金合同生效日)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	-	-	37,983,795.66	13.57%

7.4.8.1.2 债券交易

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		上期 2014年4月21日(基金合同生效日)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	-	-	1,757,165.50	16.50%

7.4.8.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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

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	-	-	-	-
关联方名称	上期 2014年4月21日(基金合同生效日)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	26,015.15	11.99%	-	-

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4月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	595,151.32	472,327.68
其中:支付销售机构的客户维护费	57,333.02	145,046.01

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×1.00%/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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年4月21日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	148,787.84	118,081.90

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/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

本基金本报告期内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

本基金的管理人于本期及上期未运用固有资金投资本基金。

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		上期末 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
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	21,160,916.44	43.11%	22,460,916.44	62.58%

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4月21日(基金合同生效日)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
中国建设银行	19,400,352.95	34,033.88	1,829,160.01	24,825.13

注:本基金资金托管账户的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

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

本基金本期未未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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(股