安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	安信平稳增长混合发起	
基金主代码	750005	
基金运作方式	契约型开放式发起式	
基金合同生效日	2012年12月18日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,922,969,893.15份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	安信平稳增长A	安信平稳增长C
下属分级基金的交易代码:	750005	002035
报告期末下属分级基金的份额总额	211,447,689.24份	1,711,522,203.91份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过稳健的资产配置策略,将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置,并通过积极主动的股票投资和债券投资,把握中国经济增长和资本市场发展机遇,严格控制下行风险,力争实现基金份额净值的长期平稳增长。
投资策略	1.资产配置策略:研究与跟踪宏观经济运行状况和资本市场变动特征,分析类别资产预期收益和预期风险,根据最优风险投酬比原则确定资产配置比例并进行动态调整。 2.上市公司研究方法:以深入细致的公司研究推动股票的精选与投资。在对上市公司的研究中,采用安信基金三因素分析法,即重点分析上市公司的盈利模式、竞争优势和其所处行业的发展环境。 3.股票投资策略:坚持价值投资理念,以PE/PB等估值指标入手对价值型公司进行评估,在扎实深入的公司研究基础上,重点发掘出价值低估的股票。 4.债券投资策略:采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会。
业绩比较基准	50%×中证800指数收益率+50%×中债总指数收益率(全价)
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江晖	洪渊
	联系电话	0755-82509999	010-66105799
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95588
传真		0755-82799292	010-66105798

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	
	安信平稳增长A	安信平稳增长C	安信平稳增长A	安信平稳增长C	安信平稳增长A	安信平稳增长C
本期已实现收益	124,288,309.42	3,111,898.29	21,750,100.07	-	2,955,951.83	-
本期利润	118,414,396.84	7,374,595.61	28,254,747.84	-	1,969,847.67	-
加权平均基金份额本期利润	0.1017	0.0042	0.0669	-	0.0216	-
本期基金份额净值增长率	0.28%	0.21%	24.98%	-	0.80%	-
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	0.4156	0.4419	0.2415	-	0.0086	-
期末基金资产净值	305,462,441.97	2,472,185,041.46	41,552,475.97	-	51,902,326.46	-
期末基金份额净值	1.445	1.444	1.261	-	1.009	-

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、本基金自2015年11月18日起增加C类份额,C类份额的报告期间为2015年11月18日至2015年12月31日。

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

安信平稳增长A

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	0.42%	0.05%	10.52%	0.85%	-10.10%	-0.80%
过去六个月	0.91%	0.06%	-5.51%	1.37%	6.42%	-1.31%
过去一年	14.51%	0.61%	11.74%	1.25%	2.77%	-0.64%
过去三年	44.26%	0.67%	37.13%	0.89%	7.13%	-0.22%
自基金合同生效起至今	44.40%	0.67%	41.60%	0.89%	2.80%	-0.22%

安信平稳增长C

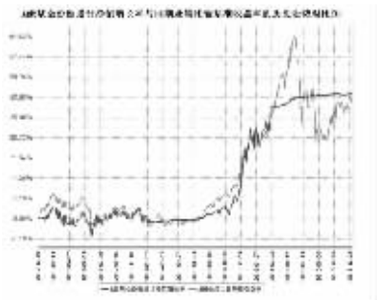
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.21%	1.80%	1.39%	0.81%	-1.18%	0.99%

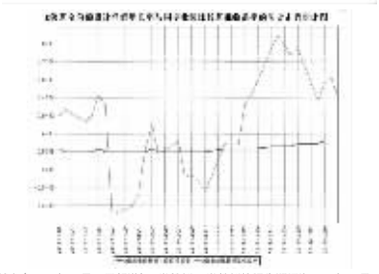
注:1、根据《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:50%*中证800指数收益率+50%*中债总指数(全价)收益率。中证800指数是由中证指数有限公司编制,其成份股是由中证500和沪深300成份股一起构成,中证800指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求,基准指数每日按照50%、50%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

2、本基金基金合同生效日为2012年12月18日。表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为2012年12月18日至2015年12月31日间各自的实际数值。

3、本基金自2015年11月18日起增加C类份额,C类份额的报告期间为2015年11月18日至2015年12月31日。

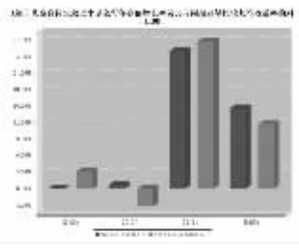
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

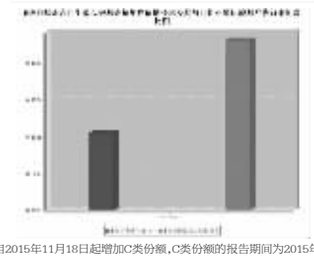




注:本基金自2015年11月18日起增加C类份额,C类份额的报告期间为2015年11月18日至2015年12月31日。

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





注:本基金自2015年11月18日起增加C类份额,C类份额的报告期间为2015年11月18日至2015年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2012年12月18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26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		
姜诚	本基金的基金经理、基金投资部总经理	2014年8月8日	-	9	姜诚先生,经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司资产委托管理总部助理研究员、研究员、投资经理,安信基金管理有限责任公司研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部总经理。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金的基金经理。
黄立华	本基金的基金经理助理	2013年3月1日	2015年12月4日	9	黄立华先生,理学硕士、工商管理硕士,注册金融分析师(CFA)。曾任Lanac Technology(美国)项目经理、Emory Investment Management(美国)公司研究员,Earnest Partners(美国)公司研究员、投资经理,安信证券股份有限公司高级投资经理、安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理。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,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。现任安信策略精选股票型证券投资基金的基金经理助理。
徐立华	本基金的基金经理助理	2015年4月20日	-	4	徐立华先生,理学博士。曾任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员,2011年12月加入安信基金管理有限责任公司研究部任研究员,现任基金投资部基金经理助理。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信消费医药主题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"根据公司决定的公告(生效)日期填写;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》、《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

本基金以追求绝对收益为主要目标,因此在市场风险较高时低仓位运作,四季度的市场反弹我们没有参与。报告期内本基金的大部分资产配置于固定收益类标的,包括银行间债券、交易所债券及银行间逆回购等。除此以外的小部分仓位配置于股票,并根据市场点位的高低进行反向操作,对收益率起到了一定的增厚作用。

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1.445元,本报告期份额净值增长率为14.51%,同期业绩比较基准增长率为11.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前资本市场对国内宏观经济前景偏向于悲观,各方面数据显示,从投资到消费均处于低迷状态。但经历了近期的下跌,不仅市场估值泡沫大幅消化,对经济基本面的悲观预期也反映较为充分。尽管部分概念股和伪成长股估值仍然高企,但以相当一部分债优蓝筹股为代表的品种投资价值已经比较明确,如果说4000点以上的市场是风险大于机遇的话,则当前股价下,从长期视角来看机遇大于风险。本基金聚焦于估值有吸引力的优质公司股票,并且根据股价的高低对投资标的的持仓比例进行反向操作。若市场进一步下探,我们会将适当提升股票类资产的总持仓比例。

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、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,本基金托管人在对安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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,安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的管理人——安信基金管理有限责任公司在安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何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,安信平稳增长混合型发起式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

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信平稳增长混合型发起式证券投资基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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)审计了安信平稳增长混合型发起式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:安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

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	1,717,912,218.47	2,857,924.72
结算备付金	846,460.40	85,000.00
存出保证金	91,708.88	77,041.70
交易性金融资产	1,048,753,712.46	40,691,599.38
其中:股票投资	40,347,850.06	28,381,787.78
基金投资	-	-
债券投资	1,008,405,862.40	12,309,811.60
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	2,722,388.01	2,275,831.12
应收利息	12,208,948.57	261,697.94
应收股利	-	-
应收申购款	91,456.70	1,491.06
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,782,626,893.49	46,250,585.92
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	-	3,000,000.00
应付证券清算款	-	1,236,555.87
应付赎回款	190,131.52	136,860.16
应付管理人报酬	3,661,159.53	68,767.40
应付托管费	610,193.26	11,461.27
应付销售服务费	295,047.62	-
应付交易费用	162,161.61	24,445.11
应交税费	-	-
应付利息	-	9,843.75
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	60,716.52	210,176.39
负债合计	4,979,410.06	4,698,109.95
所有者权益:		
实收基金	1,922,969,893.15	32,959,762.42
未分配利润	854,677,590.28	8,592,713.55
所有者权益合计	2,777,647,483.43	41,552,475.97
负债和所有者权益总计	2,782,626,893.49	46,250,585.92

注:报告截止日为2015年12月31日,安信平稳增长混合型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.445元,安信平稳增长混合型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.444元;基金份额总额1,922,969,893.15份,其中安信平稳增长混合型发起式证券投资基金A类基金份额211,447,689.24份,安信平稳增长混合型发起式证券投资基金C类基金份额1,711,522,203.91份。

7.2 利润表

会计主体:安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	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	160,707,223.85	36,587,326.94
1.利息收入	41,166,798.69	17,895,379.79
其中:存款利息收入	18,937,178.71	5,695,984.00
债券利息收入	10,255,251.96	2,888,815.18
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,974,368.02	9,310,580.61
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	112,589,083.53	11,122,925.01
其中:股票投资收益	111,506,026.90	8,876,562.45
基金投资收益	-	-
债券投资收益	576,326.53	1,966,630.40
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	506,730.10	279,732.16
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,609,215.26	6,504,647.77
4.汇兑收益(损失以"-"号填	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填	8,560,556.89	1,064,374.37
减:二、费用	34,918,231.40	8,332,579.10
1. 管理人报酬	28,517,590.09	6,333,357.65
2. 托管费	4,752,931.69	1,055,559.74
3. 销售服务费	295,047.62	-
4. 交易费用	541,744.70	436,142.64
5. 利息支出	368,858.94	178,169.61
其中:卖出回购金融资产支出	368,858.94	178,169.61
6. 其他费用	442,058.36	329,349.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	125,788,992.45	28,254,747.84
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填	125,788,992.45	28,254,747.84

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

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)	32,959,762.42	8,592,713.55	41,552,475.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	125,788,992.45	125,788,992.45
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)	1,890,010,130.73	720,295,884.28	2,610,306,015.01
其中:1.基金申购款	6,768,742,555.14	2,832,850,494.65	9,601,593,049.79
2.基金赎回款	-4,878,732,424.41	-2,112,554,610.37	-6,991,287,034.78
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)	1,922,969,893.15	854,677,590.28	2,777,647,483.43
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)	51,459,851.05	442,475.41	51,902,326.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,254,747.84	28,254,747.84
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)	-18,500,088.63	-20,104,509.70	-38,604,598.33
其中:1.基金申购款	841,948,728.48	-12,602,728.47	829,346,000.01
2.基金赎回款	-860,448,817.11	-7,501,781.23	-867,950,598.34
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)	32,959,762.42	8,592,713.55	41,552,475.97

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

安信平稳增长混合型发起式证券投资基金(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11月2日下发的证监许可[2012]1447号文"关于核准安信平稳增长混合型发起式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《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金合同》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11月19日至2012年12月14日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币206,444,921.59元,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(2012)验字第60962175_H07号验资报告。经向中国证监会备案,《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金基金合同》于2012年12月18日正式生效,截至2012年12月18日止,安信平稳增长混合型发起式证券投资基金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206,444,921.59元,折合206,444,921.59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31,707.85元,折合31,707.85份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币206,476,629.44元,折合206,476,629.44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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同的有关规定,经基金管理人安信基金管理有限责任公司与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,本基金自2015年11月18日起增加C类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金合同》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,包括国内依法公开发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、债券、中期票据、资产支持证券、银行存款等货币市场工具,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票投资占基金资产的比例为80%-95%,权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为:50%×中证800指数收益率+50%×中债总指数(全价)收益率。

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,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。

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。

§2 投资组合报告

2.1 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	40,347,850.06	1.45
	其中:股票	40,347,850.06	1.45
2	固定收益投资	1,008,405,862.40	36.24
	其中:债券	1,008,405,862.40	36.24
	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	1,718,758,678.87	61.77
7	其他各项资产	15,114,502.16	0.54
8	合计	2,782,626,893.49	100.00

2.2 期末按行业分类的股票投资组合

2.2.1 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	619,368.78	0.02
C	制造业	24,178,658.73	0.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	735,549.32	0.03
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	0.09
J	金融业	10,982,000.00	0.40
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	0.04
S	综合	-	-
	合计	40,347,850.06	1.45

2.2.2 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。

2.3 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	000725	京东方A	6,437,200	19,118,484.00	0.69
2	601939	建设银行	1,900,000	10,982,000.00	0.40
3	002250	联化科技	85,565	1,614,611.55	0.06
4	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04
5	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.04
6	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03
7	601088	中国神华	41,374	619,368.78	0.02
8	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.02
9	000338	潍柴动力	47,800	461,748.00	0.02
10	600585	海螺水泥	21,900	374,490.00	0.01

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。

2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

2.4.1 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	601939	建设银行	20,889,479.38	50.27
2	000725	京东方A	19,993,670.00	48.12
3	601288	农业银行	17,999,409.00	43.32
4	601088	中国神华	10,893,688.00	26.22
5	601988	中国银行	9,999,716.00	24.07
6	000651	格力电器	9,998,247.80	24.06
7	000333	美的集团	9,997,819.32	24.06
8	000338	潍柴动力	5,892,561.00	14.18
9	600585	海螺水泥	5,887,518.07	14.17
10	600959	江苏有线	3,628,431.51	8.73
11	002250	联化科技	2,742,338.71	6.60
12