基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2016年3月25日

安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

§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。

基金托管人中国民生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5月25日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	安信稳健增值混合	
基金主代码	001316	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月25日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,269,661,440.09份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	安信稳健增值A	安信稳健增值C
下属分级基金的交易代码:	001316	001338
报告期末下属分级基金的份额总额	52,692,593.10份	3,216,968,846.99份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以严格的风险控制为前提,结合科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及深入的个股/个券挖掘,动态灵活调整投资策略,力争为基金份额持有人获取较为确定且超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面,通过宏观基本面定性和定量研究,结合政策因素、市场情绪与估值因素等对比分析大类资产风险收益比,合理分配各大类资产配置比例;固定收益类投资方面,在自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上,灵活采用类属配置、久期配置、信用配置、回购等投资策略;股票投资上,秉承价值投资理念,深度挖掘符合经济结构转型、契合产业结构升级、发展潜力巨大的行业与公司;此外,本基金合理利用股指期货、国债期货、权证等衍生工具做套保或套利投资,对部分高质量的资产支持证券可以采用买入并持有到期策略,实现基金资产增值增厚。
业绩比较基准	中国人民银行公布的金融机构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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	乔江辉	罗菲菲
	联系电话	0755-82509999	010-58560666
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgbbxjtzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95568
传真		0755-82799292	010-58560798

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莲花街道益田路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5月25日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	安信稳健增值A	安信稳健增值C
本期已实现收益	3,469,493.20	27,471,267.41
本期利润	3,536,239.36	44,575,790.47
加权平均基金份额本期利润	0.0246	0.0178
本期基金份额净值增长率	3.90%	7.20%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0297	0.0624
期末基金资产净值	54,757,701.87	3,449,320,400.56
期末基金份额净值	1.039	1.072

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

安信稳健增值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	2.26%	0.08%	1.13%	0.01%	1.13%	0.07%
过去六个月	3.69%	0.10%	2.37%	0.01%	1.32%	0.09%
自基金合同生效起至今	3.90%	0.09%	2.92%	0.01%	0.98%	0.08%

安信稳健增值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
过去三个月	2.10%	0.08%	1.13%	0.01%	0.97%	0.07%
过去六个月	6.99%	0.41%	2.37%	0.01%	4.62%	0.40%
自基金合同生效起至今	7.20%	0.37%	2.92%	0.01%	4.28%	0.36%

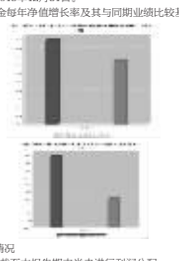
注:1、根据《安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公布的金融机构1年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

2、本基金基金合同生效日为2015年5月25日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年5月25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:本基金基金合同生效日为2015年5月25日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年5月25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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2015年5月25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11月21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		
张翼飞	本基金的基金经理	2015年5月25日	-	4.5	张翼飞先生,经济学硕士,历任摩根机械厂(上海)有限公司财务部会计、财务主管,上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员,秦皇岛耀隆高科实业有限公司财务总监,日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员,现任职于安信基金管理有限责任公司固定收益部,曾任安信现金管理货币市场基金的基金经理助理;现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。
魏晓菲	本基金的基金经理助理	2015年5月25日	2015年7月24日	8	魏晓菲女士,法学硕士。先后在安信证券股份有限公司、安信基金管理有限责任公司工作,现在安信基金管理有限责任公司固定收益部从事固定收益类投资工作。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。
魏晓菲	本基金的基金经理助理	2015年10月26日	-	8	魏晓菲女士,法学硕士。先后在安信证券股份有限公司、安信基金管理有限责任公司工作,现在安信基金管理有限责任公司固定收益部从事固定收益类投资工作。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。
周仁	本基金的基金经理助理	2015年10月26日	-	0.5	周仁先生,金融硕士。曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究助理,现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理,现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合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

回顾2015年,宏观经济受大宗商品市场不景气、上游企业产能过剩、房地产库存问题凸显等因素影响,经济增速延续下行态势;货币政策方面,央行为应对经济下行压力,通过多次降准降息向市场注入流动性,大量资金在银行间体系沉淀,全年资金面整体维持宽松格局。在宏观经济基本面偏弱、多次降准降息及资金配置需求等因素支撑下全年债市整体呈现牛市行情,全年中债总净价(总值)指数上涨接近4%。

本基金成立于2015年5月,成立后除进行基本的权益类和债券配置建仓外,一方面利用打新期间资金间歇性紧张进行同业存款等资金操作,另一方面积极参与新股IPO,整体为产品获取较好收益。此后在三、四季度把握股市连续下跌、汇改、避险资金流入债市、降准降息等时点机会在债券投资方面进行积极配置和波段操作,组合久期灵活适中,同时严控信用风险,为持有人提供了较为丰厚的投资回报,

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日安信稳健增值A 净值为1.039,年化收益率6.56%。安信稳健增值C 净值为1.072,年化收益率12.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先梳理下目前宏观经济的情况。随着经济持续在底部徘徊,现在大家普遍的共识是我国经济经济将在一段时间内处在L型底的环境下,目前是内需不振且外需不稳,亟待过剩产能逐步出清。为了配合政府的供给侧改革,央行在本年度进行了5次降息和5次降准,维持了相对宽松的货币政策。但是市场也存在对资金面有扰动的因素,主要有两个:其一是美元加息带来的资本外流和人民币贬值预期。其二是改革正处在攻坚阶段,政府调低了经济增长的目标以便得过剩产能有逐步出清的空间,而该政策使得央行不能过度放水。所以新的年度里,稳健的货币政策和积极的财政政策将会是主旋律,不能对央行会大量放水有过高期望。在国家调低经济增长预期的同时,我们也要调低债券市场的目标收益。

再看债券市场,由于经济持续恶化及股票、大宗等资产价格的大幅下跌,债市在本年度延续了债牛行情。债市在高收益资产缺少的如今正成为各路资金的避风港,与此同时债券的收益率也在逐渐下降,其中具代表性的有十年期国债突破3%的整数关口。期限利差、信用利差都在大幅缩小。在这一轮大的行情中也伴随着少量的回调,但仍不改收益率下行的趋势。但是,在债牛逐渐行进的过程中我们也要注意可能的风险,我们认为风险包括但不限于以下几点:1.美元加息导致资本外流,人民币汇率承压。这点压缩了货币政策的实施空间。2.债券供给增加。随着地方政府债及公司债的大量发行,预测明年的债券供给甚至会超过今年。3.经济可能诱那企稳。随着改革的推进,不排除经济在明年企稳。4.债市的去杠杆风险。由于管理层逐步对债券市场高杠杆问题的担忧,债市的杠杆可能会面临调整的风险。

我们依此判断明年债券市场可能会处在震荡的区间中,而且随着经济持续恶化,信用风险也可能在明年引来集中爆发,因此可以掌握好节奏进行波段操作,同时严格把控风险,尤其在择券时注意信用风险。

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。估值委员会会议由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

本报告期内,本托管人在对安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,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

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金管理人—安信基金管理有限责任公司在安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有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,安信稳健增值灵活配置混合型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

由安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金管理人—安信基金管理有限责任公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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)审计了安信稳健增值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5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日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:安信稳健增值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
资 产:	
银行存款	228,616,527.35
结算备付金	4,179,500.05
存出保证金	746,878.33
交易性金融资产	4,371,719,480.18
其中:股票投资	47,571,273.40
基金投资	-
债券投资	4,324,148,206.78
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	386,925.29
应收利息	58,450,126.60
应收股利	-
应收申购款	115,940.60
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	4,664,215,378.40
负债和所有者权益	本期末 2015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	985,598,456.60
应付证券清算款	169,700,178.71
应付赎回款	523,757.40
应付管理人报酬	1,774,216.98
应付托管费	591,405.68
应付销售服务费	1,454,670.18
应付交易费用	315,504.46
应交税费	-
应付利息	127,926.99
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	51,158.97
负债合计	1,160,137,275.97
所有者权益:	
实收基金	3,269,661,440.09
未分配利润	234,416,662.34
所有者权益合计	3,504,078,102.43
负债和所有者权益总计	4,664,215,378.40

注:1、报告截止日2015年12月31日,安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额净值人民币1.039元,C类基金份额净值人民币1.072元。基金份额总额3,269,661,440.09份,其中A类基金份额52,692,593.10份,C类基金份额3,216,968,846.99份。

2、本基金合同生效日为2015年5月25日,本报告期间为2015年5月25日至2015年12月31日。本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体:安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	72,844,604.07
1.利息收入	42,261,766.29
其中:存款利息收入	24,326,766.73
债券利息收入	17,237,161.28
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	697,838.28
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	12,126,167.24
其中:股票投资收益	1,697,523.40
基金投资收益	-
债券投资收益	9,699,615.64
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	729,028.20
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	17,171,269.22
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,285,401.32
减:二、费用	24,732,574.24
1. 管理人报酬	9,367,061.04
2. 托管费	3,122,353.63
3. 销售服务费	7,380,890.60
4. 交易费用	1,844,837.31
5. 利息支出	2,812,727.20
其中:卖出回购金融资产支出	2,812,727.20
6. 其他费用	204,704.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	48,112,029.83
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	48,112,029.83

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月25日(基金合同生效日)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)	5,346,467,040.07	-	5,346,467,040.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,112,029.83	48,112,029.83
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)	-2,076,805,599.98	186,304,632.51	-1,890,500,967.47
其中:1.基金申购款	4,024,026,059.29	195,423,105.57	4,219,449,164.86
2.基金赎回款	-6,100,831,659.27	-9,118,473.06	-6,109,950,132.33
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)	3,269,661,440.09	234,416,662.34	3,504,078,102.43

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

安信稳健增值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")2015年4月30日下发的证监许可[2015]793号文《关于核准安信稳健增值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《安信稳健增值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2015年5月18日至2015年5月20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(2015)验字60962175_H46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5,346,134,705.28元。经向中国证监会备案,《安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月25日正式生效。截至2015年5月25日止,安信稳健增值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5,346,134,705.28元,折合5,346,134,705.28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332,334.79元,折合332,334.79份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币5,346,467,040.07元,折合5,346,467,040.07份基金份额。其中A类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349,828,346.54元,折合349,828,346.54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106.25元,折合106.25份基金份额。C类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币4,996,306,358.74元,折合4,996,306,358.74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332,228.54元,折合332,228.54份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币5,346,467,040.07元,折合5,346,467,040.07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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、资产支持证券、银行存款、大额存单、回购、其他货币市场工具等固定收益类品种,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)、权证等权益类品种,国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,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0%-95%,持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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:中国人民银行公布的金融机构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>》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5月25日(基金合同生效日)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

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2015年5月25日(基金合同生效日)起至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

?(1)金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:交易性金融资产和应收款项。

本基金目前持有的交易性金融资产主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为交易性金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债,主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债,按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为交易性的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益;应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

交易性金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将交易性金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;应收款项及其他金融负债采用实际利率法,按摊销成本进行后续计量,摊销或减值产生的利得或损失,均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的,应对最近交易的市价进行调整,确定公允价值;

(2)不存在活跃市场的金融工具,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术,优先使用相关可观察输入值,只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值。

(3)如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能适当反映公允价值的价格估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时,金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利是当前可执行的;计划以净额结算,或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日