安信新常态沪港深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8月7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	安信新常态股票
基金主代码	001583
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月7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	32,513,371.87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	本基金在经济"新常态"的背景下,动态运用多种策略,实现基金资产长期稳定增值。资产配置上,基于宏观、政策及市场分析,将基金资产动态配置在股票和债券等大类资产之间,股票投资方面,客观分析在"新常态"背景下行业景气度和发展前景、行业竞争结构和盈利模式,充分挖掘传统蓝筹和新兴蓝筹的投资机会;债券投资方面,利用券种配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购杠杆策略等主动投资策略构建组合,并正重信用风险的控制;此外,本基金还将运用可转债投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。

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8月7日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	5,948,505.69
本期利润	6,288,310.32
加权平均基金份额本期利润	0.0655
本期基金份额净值增长率	12.00%
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	0.1148
期末基金资产净值	36,398,831.34
期末基金份额净值	1.120
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	12.00%

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

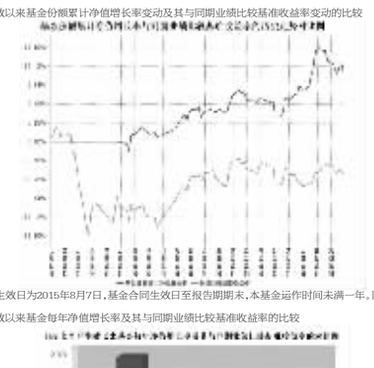
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.89%	0.95%	10.08%	1.17%	0.81%	-0.22%
自基金合同生效起至今	12.00%	0.82%	-5.52%	1.56%	17.52%	-0.74%

注:1.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:沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%。其中沪深300指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

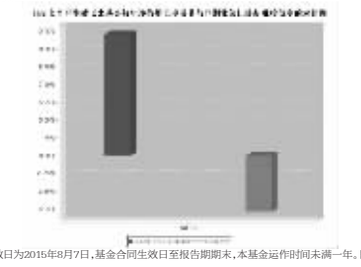
2.本基金基金合同生效日为2015年8月7日。表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为2015年8月7日至2015年12月31日间各自的实际数值。

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



注:本基金基金合同生效日为2015年8月7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8月7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8月7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8月7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2015年8月7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,佛山市顺德区新君贸易有限公司持有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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蓝雁书	本基金的基金经理	2015年11月2日	-	8	蓝雁书先生,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。2011年12月加入安信基金管理有限责任公司基金投资部。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;现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选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	2015年8月7日	2015年12月1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。现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理。
袁玮	本基金的基金经理助理	2015年12月11日	-	5	袁玮先生,理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员、安信基金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司投资部基金经理助理。现任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理。

注:1.基金经理黄立华的"任职日期"按基金合同生效日填写,蓝雁书的"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《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《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

本基金管理人采用了值检验等统计方法,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

本基金成立初期,面对市场的剧烈调整,建立期内投资策略相对谨慎,主要以少量的大盘蓝筹股为主,因此期间净值波动较小,较好的规避了大盘的剧烈调整风险。

进入2015年四季度,考虑到场外配资清理接近尾声,且人民币汇率开始企稳回升,我们认为前述的两个压制当时市场的最重要利空因素得到释放,市场将迎来一轮反弹,因此在10月初的时候我们主动增加A股仓位,最主要的投资方向是与新经济契合度较高、业绩增长保障的领涨板块,例如新能源汽车产业链的上游锂资源类标的,以及产业升级有关标的等,取得了较好投资业绩。

4.4.2 报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1.120元,本报告期份额净值增长率为12.00%,同期业绩比较基准增长率为-5.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年开年,A股市场遭受平见剧烈调整,根本的原因是市场对经济增速进一步下探的担忧。原因是:相对于供给侧改革中减税、放松管制的微效应,更为直接的落后/过剩产能去化成为当前政策主抓点,这很可能引发工业数据剧烈下滑,这在短期内会对市场情绪产生冲击;同时过剩产能淘汰过程中逐渐暴露出来的信用风险,也会对A股风险偏好产生压力。

短期内,这些因素对A股市场的影响不会很快消除,A股大概率延续振荡走势。但是站在上证指数2700点位附近,对未来A股市场不必过于悲观。首先,虽然当前中国经济由衰退与1998年相似的内忧外患环境,但是当前可提落后企业产能占比、银行坏账比例以及政府财政和杠杆水平都好于当时,供给侧改革的对经济基本面影响会小于当时。其次,A股市场仍将受益于持续宽松的货币环境,且中国政府推进的国有企业改革、房地产去库存等措施,都是改善A股整体ROE非常有针对性的举措,ROE的见底回升是可以预期的。未来,我们认为A股比较好的两个投资机会是:其一是新旧动能会有阶段性交替(或者类似信号),叠加两会和十三五规划对改革的政策预期,市场进入可为时期;第二次可能的机会是在16年下半年,供给侧改革慢慢见效,同时人股纳入MSCI指数,为蓝筹股走强提供契机,市场重新进入上行轨道。本基金将及时跟踪相关指标,待市场上涨信号明确时果断提高股票仓位,力争为投资者争取更好回报。

在具体投资标的上,我们将在AH股市场范围内,主要考虑三个板块领域:(1)环保PPP领域,按照GDP年均6.5%的增速底线,基建投资增速要达到25%以上才能弥补房地产投资可能出现的负增长,其中环保PPP将扮演重要角色。(2)新能源汽车产业链,未来补贴减少幅度有限,且部分地方政府16年规划新能源汽车量仍将保持较快增长。(3)医疗服务,是少数可以以供给创造需求的行业,且符合未来经济结构转型和成长方向,市场空间巨大。

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》执行。

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率项进行基金估值。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,投资部门和交入员例席。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。

估值委员会由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调算,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时间、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,本基金出现了连续20个工作日基金资产净值低于5000万元人民币的情形,时间范围为2015年10月28日至2015年12月31日。

§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新常态沪港深精选股票型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,不存在利用资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,安信新常态沪港深精选股票型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新常态沪港深精选股票型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,在各里要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,安信新常态沪港深精选股票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

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新常态沪港深精选股票型证券投资基金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)审计了安信沪港深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8月7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:安信新常态沪港深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
资 产:	
银行存款	6,219,124.29
结算备付金	593,866.97
存出保证金	44,595.50
交易性金融资产	30,656,233.90
其中:股票投资	30,656,233.90
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	-
应收证券清算款	269,888.90
应收利息	2,245.84
应收股利	57.59
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	37,786,012.99
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	-
应付证券清算款	0.01
应付赎回款	1,097,149.65
应付管理人报酬	49,548.93
应付托管费	8,258.18
应付销售服务费	-
应付交易费用	180,506.33
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	51,718.55
负债合计	1,387,181.65
所有者权益:	
实收基金	32,513,371.87
未分配利润	3,885,459.47
所有者权益合计	36,398,831.34
负债和所有者权益总计	37,786,012.99

注:1.报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.120元,基金份额总额32,513,371.87份。
2.本基金合同生效日为2015年8月7日,本报告期间为2015年8月7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:安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金
本报告期:2015年8月7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8月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	7,570,962.30
1.利息收入	474,225.91
其中:存款利息收入	130,194.00
债券利息收入	89.86
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	343,942.05
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	6,035,001.57
其中:股票投资收益	5,909,601.84
基金投资收益	-
债券投资收益	125,342.14
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	57.59
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	339,804.63
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	721,930.19
减:二、费用	1,282,651.98
1. 管理人报酬	606,700.65
2. 托管费	101,116.76
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	431,588.60
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	143,245.97
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	6,288,310.32
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	6,288,310.32

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金
本报告期:2015年8月7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8月7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)	224,723,362.19	-	224,723,362.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,288,310.32	6,288,310.32
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)	-192,209,990.32	-2,402,850.85	-194,612,841.17
其中:1.基金申购款	2,331,268.21	177,775.25	2,509,043.46
2.基金赎回款	-194,541,258.53	-2,580,626.10	-197,121,884.63
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)	32,513,371.87	3,885,459.47	36,398,831.34

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
安信新常态沪港深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")2015年6月15日下发的证监许可[2015]1248号文《关于核准安信新常态沪港深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《安信新常态沪港深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2015年7月2日至2015年8月3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60062175_H97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224,675,782.53元。经中中国证监会备案,《安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》于2015年8月7日正式生效。截至2015年8月7日止,安信新常态沪港深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224,675,782.53元,折合224,675,782.53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47,579.66元,折合47,579.66份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币224,723,362.19元,折合224,723,362.19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》和《安信常态沪港深精选股票型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围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)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具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相关规定)。本基金各类资产投资比例为:本基金股票投资比例为基金资产的90%-95%(其中投资于香港联合交易所上市股票的投资比例占基金资产的0-95%),基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或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:沪深300指数收益率*45%+恒生指数收益率*45%+中证全债指数收益率*10%
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>估值业务及分期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8月7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。本会计期间为自2015年8月7日(基金合同生效日)起至2015年12月31日止会计期间。
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、贷款和应收款项。
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,按照摊余成本进行后续计量,其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进行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级(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价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;
(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。本基金采用市场参与者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的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。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确认。
未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末金额转入"未分配利润/(累计亏损)"。
7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量
(1) 存款利息收入/存款款项本金与适用的利率逐日计提的利息。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期限新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;
(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;
(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;
(4) 买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在可购期内逐日计提;
(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;
(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;
(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;
(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;
(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;
(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。
7.4.4.9 费用的确认和计量
(1) 基金的固定管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提;
(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提;
(3)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。
7.4.4.10 基金的收益分配政策
本基金的收益分配原则如下:
(1) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红