# 安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

## 【2014】半年度报告摘要

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:2014年8月28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。本半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2014年8月25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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30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 |
| 交易代码 | 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 | 879,341,385.65份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

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,根据最优风险报酬比原则确定资产配置比例并进行动态调整。<br>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。<br>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。<br>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 | 孙晓奇 | 赵会军 |
| | 联系电话 | 0755-82509908 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | sunxq@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

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.essencefund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 安信基金管理有限责任公司<br>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 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 8,348,547.95 |
| 本期利润 | 9,373,557.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0131 |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.19% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0033 |
| 期末基金资产净值 | 876,433,840.51 |
| 期末基金份额净值 | 0.997 |

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

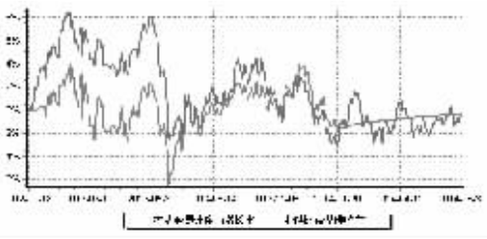
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.20% | 0.04% | 0.66% | 0.41% | -0.46% | -0.37% |
| 过去三个月 | 0.50% | 0.03% | 1.98% | 0.45% | -1.48% | -0.42% |
| 过去六个月 | -1.19% | 0.14% | -0.10% | 0.53% | -1.09% | -0.39% |
| 过去一年 | 3.85% | 0.47% | 1.49% | 0.59% | 2.36% | -0.12% |
| 自基金合同生效日起至今(2012年12月18日-2014年06月30日) | -0.30% | 0.65% | -0.13% | 0.64% | -0.17% | 0.01% |

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60%、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2014年6月30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:1、本基金的建仓期为2012年12月18日至2013年6月17日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为2012年12月18日。图示日期为2012年12月18日至2014年6月30日。

§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: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2014年6月30日,本基金管理人共管理8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;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。

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期限 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 汪建 | 本基金的基金经理、公司副总经理 | 2012年12月18日 | - | 13 | 汪建先生,副总经理,经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员,衍生产品部一级研究员、董事总经理,资产委托管理总部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理,分管投资、研究业务。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理。 |
| 李勇 | 本基金的基金经理、公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理 | 2012年12月18日 | 2014年5月29日 | 8 | 李勇先生,经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。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;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的基金经理。 |
| 庄园 | 本基金的基金经理 | 2014年5月29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。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;现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,安信宝利分级债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式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12月28日 | 2014年5月29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。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;现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,安信宝利分级债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式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 | - | 8 | 黄立华先生,理学硕士、工商管理硕士,注册金融分析师(CFA)。历任Lanac Technology(美国)项目经理,Emory Investment Management(美国)公司研究员,Eamest 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。2013年2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,安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

注:1、本基金经理汪建、李勇的"任职日期"按基金合同生效日填写;基金经理庄园的"任职日期"根据公司决定的公告(生效)日期填写;基金经理助理庄园、黄立华的"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》、《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。

4.3.2 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

2014年上半年,中国宏观经济面临了较大的增长回调压力,一季度各项指标均有不同程度的恶化迹象,特别是房地产价量齐跌引起了社会各方的关注。在二季度稳增长、微刺激等政策措施干预背景下,宏观经济有走稳回升迹象。资金面趋于宽松,资金价格走向合理,但企业经济效益指标仍不乐观。

管理人基于去年年末的市场判断,上半年维持了较低的权益资产配置比例,以固定收益品种配置为主,在上半年较为低迷震荡的市场中保持了净值稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为0.997元,本报告期份额净值增长率为-1.19%,同期业绩比较基准增长率为-0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们预计宏观经济将维持较为微弱的复苏力度,各种危机爆发的概率显著降低。但随着政府平台、房地产、过剩产能几个重要问题的递延和叠加,未来经济调整和下行的压力仍将较大。从另一个方面看,信息技术、医疗、教育、娱乐等新兴产业逆势增长,成为未来引领中国经济新一轮增长的引擎,但从上市公司层面分析,在目前高估值的压力下、标的选择并不容易。

基于中国经济转型和结构调整的大格局,我们对股票市场的长期表现仍有相对乐观的判断。但从上半年分析,政策面、资金面和估值的博弈形势下,下半年市场将延续弱势震荡的格局,难有趋势性机会。今年下半年,管理人将继续审慎管理基金资产,积极把握市场调整带来的机遇。

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。

§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 托管人对本半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2014年半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2014年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 2,142,628.37 | 4,479,986.89 |
| 结算备付金 | 10,356,155.33 | 115,187.39 |
| 存出保证金 | 27,859.48 | 72,548.42 |
| 交易性金融资产 | 147,196,567.84 | 47,002,296.77 |
| 其中:股票投资 | 40,179,102.62 | 25,651,343.97 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 107,017,465.22 | 21,350,952.80 |
| 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 | 700,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | 15,078,777.79 | - |
| 应收利息 | 3,187,576.54 | 570,072.88 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 1,379.31 | 1,182.26 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 877,990,944.66 | 52,241,274.61 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013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 | - | 61,729.82 |
| 应付赎回款 | 61,860.69 | 13,868.53 |
| 应付管理人报酬 | 1,022,164.47 | 69,529.28 |
| 应付托管费 | 170,360.76 | 11,588.22 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 129,035.48 | 32,204.40 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 173,682.75 | 150,027.90 |
| 负债合计 | 1,557,104.15 | 338,948.15 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 879,341,385.65 | 51,459,851.05 |
| 未分配利润 | -2,907,545.14 | 442,475.41 |
| 所有者权益合计 | 876,433,840.51 | 51,902,326.46 |
| 负债和所有者权益总计 | 877,990,944.66 | 52,241,274.61 |

注:报告截止日为2014年6月30日,基金份额净值0.997元,基金份额总额879,341,385.65份。

6.2 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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 16,010,284.71 | -109,354.34 |
| 1.利息收入 | 15,315,123.00 | 599,634.89 |
| 其中:存款利息收入 | 5,589,623.16 | 49,856.71 |
| 债券利息收入 | 2,026,319.37 | 94,203.16 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 7,699,180.47 | 455,575.02 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -338,361.73 | 2,876,377.51 |
| 其中:股票投资收益 | -954,701.92 | 2,092,094.93 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 410,259.66 | -22,828.32 |
| 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 | 206,080.53 | 807,110.90 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 1,025,009.05 | -3,788,845.34 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列 | 8,514.39 | 203,478.60 |
| 减:二、费用 | 6,636,727.71 | 1,893,490.29 |
| 1.管理人报酬 | 5,255,274.71 | 892,209.83 |
| 2.托管费 | 875,879.18 | 148,701.65 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 263,078.89 | 673,464.52 |
| 5.利息支出 | 51,651.96 | 582.37 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 51,651.96 | 582.37 |
| 6.其他费用 | 190,842.97 | 178,531.92 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 9,373,557.00 | -2,002,844.63 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 9,373,557.00 | -2,002,844.63 |

6.3 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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30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) | - | 9,373,557.00 | 9,373,557.00 |
| 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) | 827,881,534.60 | -12,723,577.55 | 815,157,957.05 |
| 其中:1.基金申购款 | 839,773,105.53 | -12,844,814.65 | 826,928,290.88 |
| 2.基金赎回款(以"-"号填列) | -11,891,570.93 | 121,237.10 | -11,770,333.83 |
| 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) | 879,341,385.65 | -2,907,545.14 | 876,433,840.51 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30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) | 206,476,629.44 | 305,730.53 | 206,782,359.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -2,002,844.63 | -2,002,844.63 |
| 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) | -127,014,882.01 | -1,500,065.12 | -128,514,947.13 |
| 其中:1.基金申购款 | 34,408,833.71 | -142,955.36 | 34,265,878.35 |
| 2.基金赎回款(以"-"号填列) | -161,423,715.72 | -1,357,109.76 | -162,780,825.48 |
| 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) | 79,461,747.43 | -3,197,179.22 | 76,264,568.21 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

| 项 目 | 娄志刚 主管会计工作负责人 | 尚尔航 会计机构负责人 |
|---|---|---|

6.4 报表附注

6.4.1 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206,444,921.59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_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,基金合同生效日的基金份额总额为206,476,629.44份基金份额,其中认购资金利息折合31,707.85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0%-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%×中债总指数收益率(全价)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部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3号《半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。

6.4.3 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2014年6月30日的财务状况以及自2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行") | 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:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.1.4 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.5 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,255,274.71 | 892,209.83 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 124,782.89 | 429,300.41 |

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提。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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 875,879.18 | 148,701.65 |

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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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 2014年6月30日 | | 上年度末 2013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 |
| 安信证券 | 9,999,000.00 | 1.14% | 9,999,000.00 | 19.43% |

注:2012年12月14日,安信证券股份有限公司认购本基金人民币10,000,000.00元,确认份额为9,999,000.00份,作为发起式资金锁定三年。

6.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 2,142,628.37 | 196,842.98 | 5,889,395.88 | 21,427.91 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

6.4.10 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
| 002727 | 一心堂 | 2014-06-25 | 2014-07-02 | 新股认购 | 12.20 | 12.20 | 34,975 | 426,695.00 | 426,695.00 |

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额为0元,无抵押债券。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余