安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
本招募说明书(更新)摘要内容截止日:2015年10月15日

重要提示

安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的募集申请于2015年3月25日经中国证监会证监许可[2015]442号文注册。本基金基金合同于2015年4月15日正式生效。

投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年10月15日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:安信基金管理有限责任公司
住所:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人:牛冠兴
成立时间:2011年12月6日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监许可(2011)1895号
组织形式:有限责任公司
注册资本:35,000万元人民币
存续期间:永续经营
联系人:王阳
联系电话:0755-82509999
公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
五矿资本控股有限公司	38.72%
安信证券股份有限公司	33%
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	19.71%
中广核财务有限责任公司	8.57%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

牛冠兴先生,董事长,经济学硕士。历任武汉市人民银行硚口支行信贷员,武汉市工商银行古田办事处主任,武汉市工商银行江岸支行行长,武汉市工商银行副行长,招商银行总行信贷部总经理,招商证券股份有限公司总经理,招商基金管理有限公司董事长,南方证券行政接管组及广东证券托管组组长,安信证券股份有限公司董事长,前海股权交易中心(深圳)有限公司监事会主席。现任中证信用增进股份有限公司董事长、安信基金管理有限责任公司董事长、安信国际金融控股有限公司董事、中国证券业协会副会长。

李军先生,董事,经济学硕士。历任深圳市罗湖工业研究所经理,深圳证券电脑公司经理,深圳证券交易所人事部助理总监、西南中心主任、上市审查部副总监、市场监察部副总监、会员管理部副总监,中国科技证券有限责任公司托管组组长。现任安信证券股份有限公司副总裁,安信乾宏投资有限公司董事长。

刘入领先生,董事,经济学博士。历任国通证券股份有限公司(现招商证券股份有限公司)研究发展中心总经理助理、人力资源部总经理助理;招商证券股份有限公司战略部副总经理(主持工作)、总裁办公室主任、理财客户部总经理;安信证券股份有限公司人力资源部总经理兼办公室主任、总裁助理兼营销服务中心总经理、总裁助理兼安信期货有限责任公司董事长、总裁助理兼资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司董事长。

任珠峰先生,董事,经济学博士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员、有色部经理、上海公司副总经理,英国金属矿产有限公司小有色、铁合金及矿产部经理,五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、五矿投资发展有限责任公司副总经理。现任中国五矿集团公司总经理助理、中国五矿集团公司金融业务中心总经理、五矿资本控股有限公司董事、总经理和党委书记、五矿集团财务有限责任公司董事长、五矿资本(香港)有限公司董事长、五矿国际信托有限公司董事长、五矿证券有限公司董事长、五矿期货有限公司董事长、隆茂投资有限公司副董事长、中国外贸金融租赁有限公司副董事长、工银安盛人寿保险有限公司副董事长、中国五金制品有限公司董事、青海中地矿资源开发有限公司执行董事。

王晓东先生,董事,经济学硕士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员,日本五金矿产株式会社财务部科员,中国外贸金融租赁有限公司副总经理,中国五矿集团公司财务总部副总经理。现任五矿资本控股有限公司副总经理及资本运营部总经理、五矿鑫扬(上海)投资管理有限公司董事长、五矿国际信托有限公司董事、五矿证券有限公司董事、五矿经易期货有限公司董事、五矿金牛进出口贸易(上海)有限公司执行董事。

李宏雷先生,董事,会计硕士。历任深圳华强集团有限公司财务结算中心投融资经理,中广核财务有限责任公司信贷业务高级经理、总经理部秘书和投资银行业务高级经理,中国广核集团有限公司资本运营与产权管理部资本运营主任。现任中广核财务有限责任公司投资银行部副总经理(主持工作)。

徐景安先生,独立董事,1964年毕业于复旦大学新闻学专业。历任中央马列主义研究院干部,中共中央政策研究室干部,北京军区炮兵政治部教员,深圳计划委员会研究室科长,国务院经济体制改革办公室科长,国家经济体制改革委员会处长,中国经济体制改革研究会副所长,深圳市经济体制改革委员会主任,深圳市土必达国际投资公司董事长,深圳市徐景安投资顾问公司董事长。现任深圳市景安文化传播公司董事长。

郑斌先生,独立董事,法学硕士。历任中央组织部干部,国家国有资产管理局综合司副处长,北京市正平律师事务所主任。现任北京市金诚同达律师事务所高级合伙人。

庞继英先生,独立董事,金融学博士,高级经济师。历任中央纪律检查委员会干部,国家外汇管理局副处长、处长、副司长,中国外汇交易中心副总裁、总裁,中国人民银行条法司副司长、金融稳定局巡视员,中国再保险(集团)股份有限公司党委副书记、副董事长。现任国家开发银行股份有限公司董事。

2、基金管理人监事会成员

王晓荷女士,监事会主席,经济学硕士。曾任中国证券监督管理委员会干部。现任安信证券股份有限公司监事会主席。

刘国威先生,监事,工商管理硕士。历任五矿集团财务有限责任公司资金部副经理、经理,香港金荣财务有限公司资金部高级经理,五矿投资发展有限责任公司综合管理部副总经理、规划发展部总经理、资本运营部总经理,中国五矿集团公司金融业务中心资本运营部总经理兼五矿投资发展有限责任公司纪委委员。现任中国五矿集团公司金融业务中心副总经理兼五矿资本控股有限公司副总经理、五矿资本(香港)有限公司董事、隆茂投资有限公司董事、中国外贸金融租赁有限公司董事、五矿证券有限公司董事、工银安盛人寿保险有限公司监事。

廖维坤先生,职工监事,理学学士。历任轻工业部南宁设计院电算站软件工程师,申银万国证券股份有限公司深圳营业部电脑主管,南方证券股份有限公司深圳管理总部电脑工程师、布吉营业部营业部副总经理、稽核总部高级经理、经纪业务总部高级经理,安信证券股份有限公司信息技术部总经理。现任安信基金管理有限责任公司首席信息官兼运营部总经理。

王卫峰先生,职工监事,工商管理学硕士。历任吉林省国际信托公司财务人员,汉唐证券有限责任公司营业部财务经理,摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核主管,浦银安盛基金管理有限公司监察部负责人。现任安信基金管理有限责任公司监察稽核部总经理,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司董事。

张再新先生,职工监事,管理学学士。历任安信证券股份有限公司计划财务部会计、安信基金管理有限责任公司财务部会计。现任安信基金管理有限责任公司工会财务委员、运营部交易主管。

3、公司高管人员

牛冠兴先生,董事长,经济学硕士。简历同上。

刘入领先生,董事,总经理,经济学博士。简历同上。

孙晓奇先生,副总经理,经济学硕士。历任上海石化股份有限公司董事会秘书室高级经理,上海证券交易所交易运行部襄理、市场发展部高级经理、债券基金部执行经理,南方证券行政接管组成员,安信证券股份有限公司安信基金筹备组副组长,安信基金管理有限责任公司督察长。现任安信基金管理有限责任公司副总经理,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司董事、总经理。

李学明先生,副总经理,哲学硕士。历任招商证券股份有限公司总裁办公室高级经理,理财发展部高级经理;安信证券股份有限公司人力资源部总经理助理、副总经理,安信基金筹备组成员;安信基金管理有限责任公司总经理助理兼市场部总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司董事。

乔江辉女士,督察长,文学学士。历任中华人民共和国证券监督委员会干部、副处长,安信证券股份有限公司安信基金筹备组成员,安信基金管理有限责任公司总经理助理兼北京分公司总经理。现任安信基金管理有限责任公司督察长,兼任安信乾盛财富管理(深圳)有限公司董事。

4、本基金基金经理

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,安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理助理。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理。2013年12月31日至今,任安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年4月15日至今,任安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年5月20日至今,任安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

5、基金投资决策委员会成员

主任委员:

刘入领先生,董事,总经理,经济学博士。简历同上。

委员:

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。

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。

龙川先生,统计学博士。历任Susquehanna International Group(美国)量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。

陈一峰先生,经济学硕士,注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券股份有限公司资产管理总部助理研究员,安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员,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。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理。

占冠良先生,管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员,大成基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理,南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司,基本信息如下:

名称:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
成立时间:1992年10月19日
组织形式:股份有限公司
注册资本:186.5347亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人:朱萍
联系电话:(021)61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务,是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快增长,各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行设资产托管与养老金业务部。目前下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、运营管理处五个职能处室。

上海浦东发展银行拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品,形成完备的产品体系,可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名称:安信基金管理有限责任公司
住所:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82509820
传真:0755-82509920
联系人:陈思伶
客户服务电话:4008-088-088
公司网站:www.essencefund.com

2、其他销售机构

(1)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:95528
传真:(021)63604199
网址:www.spdb.com.cn

(2)张家港农村商业银行股份有限公司
住所:张家港市人民中路66号
法定代表人:王自忠
客户服务电话:0512-96065
网站:www.zrcbank.com

(3)安信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:王连志
客户服务电话:400-800-1001
网址:www.essence.com.cn

(4)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
客户服务电话:95565
网址:www.newone.com.cn

(5)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
客户服务电话:95553
网址:www.htsec.com

(6)中信证券股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人:王东明
客户服务电话:95558
网址:www. citics.com

(7)中信证券(浙江)有限责任公司
住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人:沈强
客户服务电话:0571-95698
网址:www.bigsun.com.cn

(8)中信万通证券有限责任公司
住所:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:张智河
客户服务电话:96577
网址:www.zxwt.com.cn

(9)申万宏源证券有限公司
住所:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
客户服务电话:95523或4008895523
网址:www.swhysc.com

(10)东海证券股份有限公司
住所:上海浦东新区东方路1928号东海证券大厦5楼
法定代表人:朱科敏
客户服务电话:4008-888-588
网址:www.longone.com.cn

(11)中山证券有限责任公司
住所:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7、8层
法定代表人:黄扬录
客户服务电话:4001-022-011
网址:www.zszq.com.cn

(12)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
客户服务电话:400-181-8188
网址:www.1234567.com.cn

(13)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢
法定代表人:张跃伟
联系人:王嫚
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com

(14)杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
法定代表人:陈柏青
客户服务电话:400-076-6123
网址:www.fund123.cn

(15)和讯信息科技有限公司
住所:上海市浦东新区东方路18号保利大厦E座18层
法定代表人:王莉
客户服务电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com

(16)北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗细安
客户服务电话:400-001-8811
网站:www.zcvc.com.cn

(二)基金份额登记机构

名称:安信基金管理有限责任公司
住所:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人:牛冠兴
联系人:宋发根
电话:0755-82509865
传真:0755-82560289

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫峰
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人:Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话:(010)58153000,(0755)25028288
传真:(010)85188298,(0755)25026188
签章注册会计师:张小东、陈立群
联系人:李妍明

四、基金名称

安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金

五、基金类型

契约型开放式

六、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。

七、投资范围

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、股指期货、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资产(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:

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。

八、投资策略

本基金强调风险控制,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,审时度势动态运用多元化投资策略,力争实现基金资产的稳健增长。

1、资产配置策略

结合转型期中国经济增长趋势及特征,密切跟踪宏观、中观与微观各层面重要因素的变化,结合监管政策和市场行为分析,对各大类资产的风险收益特征做出系统性、前瞻性的评估,动态分配各大类资产配置比例,力争实现基金资产的稳健增长。

(1)宏观因素

我们将密切跟踪诸如GDP、工业增加值、用电量、信贷额、社会融资总额等数量型指标,以及诸如CPI、PPI、利率、不动产价格等价格型指标,强调宏观数据之间的系统分析和逻辑关系梳理,检验我们过去对宏观经济运行特征的判断,并启发我们作出及时的观点调整与更新。

(2)中观、微观因素

结合中国经济转型期特征,重点关注有巨大改善或强劲增长潜力的行业,对行业格局的演变路径作出合理展望,对具备长期竞争优势的企业保持密切跟踪。

(3)目由市场与政策监管

关注市场预期以及政策监管导向之间的差异,着重分析商业周期与政策监管周期之间的互动过程,权衡市场风险与政策支撑以及市场机会与政策调控之间的矛盾,力争在大类资产的配置中能够抢得先机、回避风险。

2、股票投资策略

本基金将依据风险管控以及收益目标的要求,结合当时的市场背景,动态选择股票投资策略。

(1)价值型投资策略

未来随着A股注册制的推出,我国资本市场的直接融资比例将大幅提升,市场整体估值水平将逐步向欧美成熟资本市场看齐,企业自由现金流的贴现值将成为股票定价的核心依据,价值投资策略有望获得广泛认可。

坚持深入的基本面分析和坚守安全边际是该策略的两条基本原则。本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方法,综合公开信息(包括财务数据)、第三方研究报告和研究员实地调研的结果,对目标上市公司的经营管理与投资价值进行深入研究。定量分析公司的主营业务收入增速、毛利率、营业利润增速、资产周转率以及经营性现金流量等指标,使用DDM模型和DCF模型等绝对估值法估算上市公司股票的内在价值,挖掘出价值被严重低估的上市公司作为重点投资对象。

(2)周期型投资策略

该投资策略主要依据宏观经济周期的运行特点动态调整股票头寸。我们将密切跟踪政策周期、信贷周期、房地产周期、产能周期以及库存周期的运行状况,在周期景气度向上、运行状况良好、运行空间宽阔的行业或者领域中,适时参与周期性较强的个股投资。

(3)成长型投资策略

在宏观经济前景平稳、货币财政政策中性偏保守的时期,那些依托于自身创新能力以及强大竞争优势依然能够实现快速成长的企业,将是我们重点关注的对象。在这一策略中,我们将重点考察三个方面的问题:1)行业总体是否存在较大的增长空间;2)行业格局是否会逐渐趋于稳定和集中;3)随着商业模式的不断演进,公司在行业中的地位是否能够不断增强。最终我们的目标是挖掘出成长空间大、成长逻辑严密、成长确定性高的个股进行长期投资。

(4)主题型投资策略

基于目前A股市场主题轮动明显的现状,通过对各个行业政策以及行业运行规律的把握,前瞻性地扑捉行业基本面可能出现重大改善的主题性机会,进行阶段性的布局。

(5)低风险套利型投资策略

该投资策略主要是利用市场的短期非理性交易环境,以较低的风险把握市场定价偏差带来的短期机会,主要包括:新股/新可转换债券投资、增发套利、转债转股价套利、转债转股套利、股权激励套利、衍生品套利等。

(6)事件驱动型投资策略

本基金还将运用事件驱动策略进行投资。通过对影响上市公司当前或未来价值的重大事件性因素进行全面的数据统计分析,寻找那些价值未被市场充分认识的股票作为备选投资对象,结合市场热点和指数运行趋势,在事件被市场充分消化之前布局。这些事件主要包括:个股或股指非理性大幅下跌、潜在年报高送转、高管增持、指数成分股调整等。

3、固定收益类投资策略

本基金将根据宏观经济分析、政策分析、资金面动向分析和市场行为分析,判断未来利率期限结构和中长期收益率变化趋势,结合组合流动性管理的实际情况,从流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税率、含权等因素分析个券,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资,实现组合增值。

4、衍生品投资策略

(1)股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,以风险对冲、套期保值为主要目的,将选择流动性好、交易活跃的期货合约,结合股指期货的估值定价模型,与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资,实现基金资产增值保值。

(2)权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,采用权证估值量化模型评估权证/期权的内在合理价值,谨慎参与权证投资。另外,本基金还可利用权证与标的股票之间可能存在的风险对冲机会,获取相对稳定的投资收益。

5、风险管理策略

本基金的目标是追求相对稳定的绝对回报,科学的风险管理是实现本基金目标的重要保障。本基金将参照多因素风险预算模型技术,根据市场环境的变化,动态调整仓位和投资品种,锁定收益、减少损失,并在实际投资操作中严格执行有关投资流程和操作权限,在投资的各个环节持续监测、控制和管理风险。

6、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

九、业绩比较基准

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%

本基金的投资目标旨在为持有人提供高于定期存款的稳定增值回报,在未来利率市场化带来的资金成本上升中具有优势,而从过往历史数据看,“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%”绝大部分时间都能战胜通货膨胀,市场上同类基金也多采用类似的业绩比较基准。综合本基金的投资目标和市场情况,本基金的业绩比较基准定为“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%”。

如果未来利率市场化推进导致资金成本大幅超过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,或通货膨胀明显上行,或者相关数据编制单位停止编制、公布该基准利率,或有更具权威、更科学的适合用于本基金的业绩比较基准时,基金管理人和基金托管人协商一致并履行相关程序后,可以变更本基金业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、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。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人根据本基金合同规定,复核了本报告中的净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日,来源于《安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金2015年第3季度报告》。本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	24,519,950.66	2.57
	其中:股票	24,519,950.66	2.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,587,289.20	5.83
	其中:债券	55,587,289.20	5.83
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	867,193,422.91	90.98
8	其他资产	5,828,593.49	0.61
9	合计	953,129,256.26	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,735,250.66	0.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,131,072.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	1,742,108.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,911,520.00	1.57
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	24,519,950.66	2.59

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	556,400	14,911,520.00	1.57
2	300124	汇川技术	84,700	3,024,637.00	0.32
3	002466	天齐锂业	32,658	2,071,823.52	0.22
4	600350	山东高速	292,300	1,742,108.00	0.18
5	600382	广东明珠	109,600	1,131,072.00	0.12
6	002364	中恒电气	53,000	982,090.00	0.10
7	002465	海格通信	51,400	656,378.00	0.07
8	600271	航天信息	6	322.14	0.00

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	55,587,289.20	5.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,587,289.20	5.87

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019423	14国债23	249,940	25,013,995.20	2.64
2	019428	14国债28	200,000	20,054,000.00	2.12
3	019501	15国债01	100,000	10,029,000.00	1.06
4	019822	08国债22	4,900	490,294.00	0.05

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,以风险对冲、套期保值为主要目的,将选择流动性好、交易活跃的期货合约,结合股指期货的估值定价模型,与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资,实现基金资产增值保值。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

(3)本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

(1)本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除“广东明珠(600382)”在报告编制日前一年内受到责令整改的情形外,其它没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

广东明珠集团股份有限公司(以下简称“公司”)于2015年7月2日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及上海证券交易所网站上刊登了(临2015-037)《广东明珠集团股份有限公司关于收到广东监管局责令改正措施决定书的公告》。根据中国证监会广东监管局《关于对广东明珠集团股份有限公司采取责令改正措施的决定》(行政监管措施决定书【2015】13号)要求,公司已制定整改措施并于认落实,形成了整改报告,报告内容如下:

经公司与借款方、委托贷款金融机构等相关单位的充分沟通,截至2015年7月16日,公司与广东富兴贸易有限公司已签订了关于将上述土地使用权及房屋产权为我公司向广东云山汽车有限公司发放委托贷款提供抵押的《最高额抵押合同》(编号:GDMZH-FXMY抵20150706-01)。目前,上述土地使用权及房屋产权的抵押登记手续正在办理中,公司将积极跟踪抵押登记手续的办理并督促尽快办妥,切实加强公司委托贷款风险控制的有效性,以维护公司及全体股东的合法权益。

(2)本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	940,430.61
2	应收证券清算款	2,824,759.82
3	应收股利	-
4	应收利息	2,063,303.66
5	应收申购款	99.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,828,593.49

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本基金合同生效日为2015年4月15日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩与同期基准的比较如下表所示:

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
2015.4.15-2015.9.30	2.60%	0.09%	2.36%	0.01%	0.24%	0.08%

十三、基金的费用概览

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券、期货交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的账户开户费用、账户维护费用;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.00%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.20%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3-9项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可按照基金发展情况,并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调低基金管理费率或基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金原招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、对“重要提示”部分进行了更新。
2、“第二部分 释义”部分,更新《基金法》的内容。
3、“第三部分 基金管理人”部分,更新基金管理人概况,董事会成员、监事会成员、本基金基金经理以及投资决策委员会成员信息,本基金基金经理未发生变更。
4、更新“第四部分 基金托管人”部分