安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2012 年度报告摘要

2012年12月31日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2013年03月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3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2012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2012年6月20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	安信灵活配置混合
基金主代码	750001
交易代码	750001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年06月20日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	177,261,689.05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	本基金采取"自上而下"和"自下而上"相结合的模式，在对中国经济结构和发展趋势进行分析的基础上，以行业运行周期和公司竞争优势分析为根本，结合金融市场行为分析，根据大类资产的收益与风险特征及其变化趋势的判断，动态运用并不断优化资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、权证投资策略等多种策略，实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率
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与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙晓奇	田青
	联系电话	0755-82509999	010-67595096
	电子邮箱	service@essencefund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-088-088	010-67595096
传真		0755-82799292	010-66275853

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	2012年6月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	7,399,819.47
本期利润	17,798,357.43
加权平均基金份额本期利润	0.0365
本期基金份额净值增长率	7.70%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0209
期末基金资产净值	190,996,572.11
期末基金份额净值	1.0770

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、本基金合同于2012年6月20日生效，至2012年12月31日未满1年，故2012年的数据和指标为非完整会计年度数据。

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	7.27%	0.47%	5.90%	0.77%	1.37%	-0.30%
过去六个月	7.59%	0.33%	1.13%	0.74%	6.46%	-0.41%
自基金合同生效日(2012年6月20日)起至今	7.70%	0.32%	-1.06%	0.74%	8.76%	-0.42%

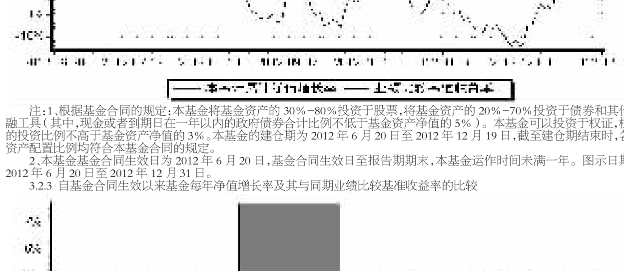
注：1、根据《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率。其中沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映A股市场总体价格走势。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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%、40%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6月20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。表中所列过去一年本基金及业绩比较基准的相关数值为2012年6月20日至2012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

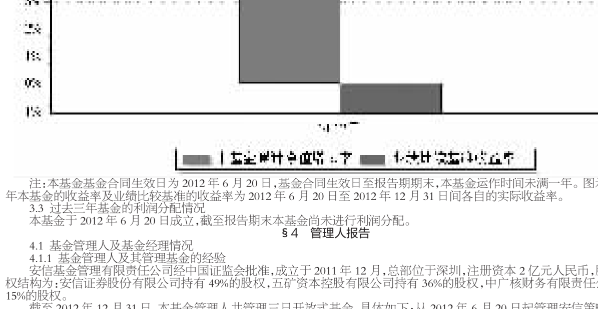
安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2012年6月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日）



注：1、根据基金合同的规定：本基金将基金资产的30%-80%投资于股票，将基金资产的20%-70%投资于债券和其他金融工具（其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的5%）。本基金可以投资于权证，权证的投资比例不高于基金资产净值的3%。本基金的建仓期为2012年6月20日至2012年12月19日，截至建仓期结束时，各项资产配置比例均符合本基金合同的规定。

2、本基金基金合同生效日为2012年6月20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2012年6月20日至2012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2012年6月20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。图示中2012年本基金的收益率及业绩比较基准的收益率为2012年6月20日至2012年12月31日间各自的实际收益率。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2012年6月20日成立，截至报告期末本基金尚未进行利润分配。

§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2亿元人民币，股东及股权结构为：安信证券股份有限公司持有49%的股权，五矿资本控股有限公司持有36%的股权，中广核财务有限责任公司持有15%的股权。

截至2012年12月31日，本基金管理人共管理三只开放式基金，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。

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		
陈振宇	本基金的基金经理、基金投资部总经理	2012年06月20日	–	18	陈振宇先生，经济学硕士。历任大鹏证券有限责任公司证券投资部经理、资产管理部总经理，招商证券股份有限公司福民路证券营业部总经理，安信证券股份有限公司资产管理部副总经理（主持工作）、证券投资部副总经理（主持工作）。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部总经理。
蓝雁书	本基金的基金经理助理、基金投资部基金经理助理	2012年6月20日	–	6	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。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理助理。
庄园	本基金的基金经理助理，固定收益部投资经理	2012年6月21日	–	9	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。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理。2012年12月28日至今，兼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。

注：1、本基金基金经理陈振宇、基金经理助理蓝雁书，其"任职日期"按基金合同生效日填写；基金经理助理庄园的"任职日期"根据公司决定确定的聘任日期填写。"离任日期"根据公司决定确定的解聘日期填写。

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》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，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

为了保证公司旗下管理的所有基金和投资组合得到公平对待，杜绝各种形式的利益输送，切实保障各类投资者的合法权益，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及公司制度的相关规定，制定了公司公平交易制度。

公平交易制度要求公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露对公平交易过程和结果进行监督。

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。

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，不存在通过利用同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

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。

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

安信灵活配置基金成立时，正值企业大量去库存阶段，资产周转率、净利率下降使得企业盈利水平出现大幅调整，加上同期房地产市场回暖对货币政策放松力度的制约，在这种情况下，安信灵活配置采取了非常谨慎的投资策略，在大类资产配置上主要以固定收益类为主。进入2012年下半年，市场在9月份迎来两次反弹，由于当时跟踪的大部分股票品种价格没有跌到具有安全边际的区间，加上之前宏观判断的逻辑和依据依旧成立，我们得出了市场反弹高度有限的结论，当时权益类品种配置上的比例依然比较低，避过了市场的最后阶段的下跌。2012年11月底，宏观、政策等形势很多情况发生了转折：去库存进入尾声的国内经济逐渐企稳，企业毛利率在出厂价格环比回升下逐渐改善，机制不断完善的A股市场估值优势也逐渐显现，加上改革预期、海外市场的持续强势、QFII资金的持续流入特别是IPO的延后等等利好，我们判断市场走强概率较大，果断提高权益类品种配置，同时发挥资金管理在资产配置中的作用，很好地把握了市场机会并获取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日，本基金份额净值为1.077元，本报告期份额净值增长率为7.70%，同期业绩比较基准增长率为-1.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于2013年宏观经济走向，我们的判断是相对偏正面的。正向作用主要来源于基建、出口和消费。基建投资加速，是源于过往新政治周期后第二年投资加码的历史经验总结，特别是垄断领域的开放与改革将引发民资投资高潮。出口增速自从2012年底以来一直超预期，这种超预期的来源一方面是连续QE操作下海外经济体特别是美国房屋销售、汽车消费的复苏，另一方面是国内对出口政策的扶持力度在加大。而消费方面，2013年刺激消费应该是主要经济政策之一，特别是城镇化率达到一定程度后，城镇化更深远的意义还在于将刺激消费。负面作用主要来源：例如私人部门投资增速下滑、保障房建设高峰已过带来的房地产投资下滑、房地产价格和通胀压力下的货币政策放松有限，地缘冲突等。但是，这些不利因素还不足以改变目前经济整体回升的趋势。

2013年的资金层面，总体来说应该是中性偏乐观的。从2012年四季度的情况来看，我们看到一个比较好的现象，就是在社会总融资规模继续高增长的同时，年底效应并没有抬升市场利率水平，整个票据贴现市场的利率、国债市场的利率基本上是比较稳定的。利率水平的这种变动趋势，主要得益于银行表外资产的快速增长，以及私人投资部门的主动收缩，这种趋势如果没有政策的干扰应该是可以持续的。

在经济温和回升、企业盈利逐渐改善和现金流好转共振下，2013年股市应该是震荡上行的。在时间节奏上，年初出现补库存需求改善、企业现金流改善，毛利率改善的上涨行情，相对看好银行、证券、地产、建筑建材、汽车、TMT、生物医药等行业，主要是这些行业具有盈利弹性高、过往资本支出较少、库存周期进入尾声的特点，与目前经济温和回升相适应。但长期来看，由于经济潜在增速下移，解决产能过剩问题的时间跨度将被动拉长，企业仍然可能主动进行资产负债表修复，加上资金价格下降空间有限，A股市场估值水平回归和限售股解禁压力，行情的持续性有待进一步的观察。

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》进行。

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体系。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，确定健全估值决策体系，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据依据。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

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期无需进行利润分配。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

中国建设银行股份有限公司

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括2012年12月31日的资产负债表，自2012年6月20日（基金合同生效日）至2012年12月31日止期间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。投资者欲了解审计报告详细内容，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：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日
资 产：	
银行存款	4,394,777.23
结算备付金	3,872,366.16
存出保证金	1,000,000.00
交易性金融资产	163,744,022.52
其中：股票投资	133,394,022.52
基金投资	
债券投资	30,350,000.00
资产支持证券投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	26,000,150.00
应收证券清算款	5,999,045.20
应收利息	298,041.07
应收股利	–
应收申购款	43,448.27
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	205,351,850.45
负债和所有者权益	**本期末 2012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	3,987,359.76
应付赎回款	8,724,293.40
应付管理人报酬	284,438.43
应付托管费	47,406.42
应付销售服务费	–
应付交易费用	168,900.02
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	1,142,880.31
负债合计	14,355,278.34
所有者权益：	
实收基金	177,261,689.05
未分配利润	13,734,883.06
所有者权益合计	190,996,572.11
负债和所有者权益总计	205,351,850.45

注：(1)报告截止日为2012年12月31日，基金份额净值1.077元，基金份额总额177,261,689.05份。

(2)本基金合同于2012年6月20日生效，因此无需披露比较数据。

7.2 利润表

会计主体：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2012年6月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年6月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日
一、收入	22,817,074.00
1.利息收入	9,106,805.32
其中：存款利息收入	6,443,963.38
债券利息收入	667,806.32
资产支持证券利息收入	–
买入返售金融资产收入	1,995,035.62
其他利息收入	–
2.投资收益（损失以"-"填列）	2,581,818.18
其中：股票投资收益	2,032,813.28
基金投资收益	–
债券投资收益	548,644.90
资产支持证券投资收益	–
衍生工具收益	–
股利收益	360.00
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	10,398,537.96
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）	729,912.54
减：二、费用	5,018,716.57
1. 管理人报酬	3,821,246.36
2. 托管费	636,874.42
3. 销售服务费	–
4. 交易费用	312,077.62
5. 利息支出	26,559.23
其中：卖出回购金融资产支出	26,559.23
6. 其他费用	221,958.94
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	17,798,357.43
减：所得税费用	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	17,798,357.43

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2012年6月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年6月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益(基金净值)	743,426,623.31	–	743,426,623.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	17,798,357.43	17,798,357.43
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）	-566,164,934.26	-4,063,474.37	-570,228,408.63
其中：1.基金申购款	1,788,457.71	13,208.07	1,801,665.78
2.基金赎回款	-567,953,391.97	-4,076,682.44	-572,030,074.41
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）	177,261,689.05	13,734,883.06	190,996,572.11

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：

王连志	姜志刚	尚尔航
基金管理公司负责人	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

安信策略精选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"）2012年4月5日下发的证监许可[2012]442号文"关于核准安信策略精选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《安信策略精选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，首次募集期间为2012年5月21日至2012年6月15日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集743,292,609.47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_H04号验资报告。经向中国证监会备案，《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2012年6月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为743,426,623.31份基金份额，其中认购资金利息折合134,013.84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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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，包括国内依法发行上市的股票（含中小板股票、创业板股票，以及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规允许或中国证监会批准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）。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。本基金股票投资占基金资产的比例为30%-80%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，债券及其他金融工具投资占基金资产的比例为20%-70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照中国财政部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>》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。

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2012年12月31日的财务状况以及自2012年6月20日（基金合同生效日）至2012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自2012年6月20日（基金合同生效日）起至2012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)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）。

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

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。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的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，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

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。

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；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；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。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债总公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1)股票投资

1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

(2) 债券投资

1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘价估值；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。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(3) 权证投资

1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2)未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

3)因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4)分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中的相关原则进行估值。

(5)其他

1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

2)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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

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。

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，并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重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摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)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。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.7 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")	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：于本期，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年6月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
安信证券股份有限公司	285,165,200.68	100.00%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年6月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
安信证券股份有限公司	193,633.37	100.00%	166,140.09	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,821,246.36
其中：支付销售机构的客户维护费	951,185.31

注：1）基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5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、休息日等，支付日期顺延。

2）本期末本基金未支付的管理费余额人民币284,438.43元。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	636,874.42

注：1）基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2）2012年末本基金未支付的托管费余额人民币47,406.42元。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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

本基金的其他关联方于本期末未持有本基金份额。

7.4.8.5 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 2012年6月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	4,394,777.23	187,690.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。上述当期利息收入中包含了本基金资金托管账户利息收入和对手方为建行的协议存款利息收入。

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31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额为0元，无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	133,394,022.52	64.96
	其中：股票	133,394,022.52	64.96
2	固定收益投资	30,350,000.00	14.78
	其中：债券	30,350,000.00	14.78
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	26,000,150.00	12.66
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	8,267,143.39	4.03
6	其他各项资产	7,340,534.54	3.57
7	合计	205,351,850.45	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	4,925,002.00	2.58
C	制造业	47,728,943.25	24.99
C0	食品、饮料	984,275.18	0.52
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,208,672.00	2.20
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	19,088,944.44	9.99
C7	机械、设备、仪表	13,089,247.27	6.85
C8	医药、生物制品	10,357,804.36	5.42
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,022,661.98	6.29
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	15,581,884.00	8.16
G	信息技术业	–	–
H	批发和零售贸易	10,512,204.83	5.50
I	金融、保险业	23,506,307.20	12.31
J	房地产业	16,050,433.51	8.40
K	社会服务业	3,066,585.75	1.61
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	133,394,022.52	69.84

8.3 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	601006	大秦铁路	1,536,400	10,386,064.00	5.44
2	600739	辽宁成大	562,300	8,428,877.00	4.41
3	000401	冀东水泥	584,647	8,068,128.60	4.22
4	600030	中信证券	586,400	7,834,304.00	4.10
5	600098	广州发展	877,331	6,650,168.98	3.48
6	600011	华能国际	752,450	5,372,493.00	2.81
7	600009	上海机场	417,000	5,195,820.00	2.72
8	000778	新兴铸管	802,551	5,184,479.46	2.71
9	002007	华兰生物	238,659	5,021,385.36	2.63
10	600837	海通证券	489,500	5,017,375.00	2.63

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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	14,495,509.47	7.59
2	601006	大秦铁路	9,999,642.00	5.24
3	600098	广州发展	9,998,905.40	5.24
4	600900	长江电力	9,997,005.31	5.23
5	600739	辽宁成大	7,997,011.00	4.19
6	000401	冀东水泥	7,697,693.35	4.03
7	600030	中信证券	5,995,701.13	3.14
8	600048	保利地产	5,499,851.50	2.88
9	002007	华兰生物	5,497,057.29	2.88
10	600837	海通证券	4,999,809.00	2.62
11	600009	上海机场	4,999,615.96	2.62
12	000002	万 科A	4,999,428.00	2.62
13	000778	新兴铸管	4,999,344.88	2.62
14	000792	盐湖股份	4,998,434.84	2.62
15	000623	吉林敖东	4,998,419.35	2.62
16	600011	华能国际	4,998,258.71	2.62
17	601808	中海油服	4,997,533.89	2.62
18	000858	五 粮 液	4,996,895.08	2.62
19	601088	中国神华	4,996,318.48	2.62
20	000983	西山煤电	4,498,763.00	2.36
21	601989	中国重工	4,495,230.80	2.35
22	002116	中国海诚	3,994,359.55	2.09

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的"累计买入金额"按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	12,578,573.69	6.59
2	600900	长江电力	10,013,044.99	5.24
3	000983	西山煤电	5,239,642.10	2.74
4	601088	中国神华	5,126,926.65	2.68
5	000002	万 科A	5,087,847.00	2.66
6	601989	中国重工	4,758,299.68	2.49
7	600098	广州发展	4,507,895.22	2.36
8	000858	五 粮 液	3,503,726.03	1.83
9	000623	吉林敖东	3,005,570.55	1.57
10	002146	荣盛发展	3,000,171.83	1.57
11	600157	永泰能源	2,858,769.58	1.50
12	000629	攀钢钒钛	2,698,438.00	1.41
13	600507	方大特钢	2,577,589.00	1.35
14	000630	铜陵有色	2,562,672.46	1.34
15	000878	云南铜业	2,549,957.99	1.34
16	600048	保利地产	2,535,850.00	1.33
17	600479	千金药业	2,518,813.81	1.32
18	000585	海螺水泥	2,486,760.00	1.30
19	000776	广发证券	2,207,127.06	1.16
20	002116	中国海诚	1,000,093.99	0.52

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的"累计卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	203,319,700.98
卖出股票的收入（成交）总额	81,845,499.70

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、"买入股票成本（成交）总额"、"卖出股票收入（成交）总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	9,843,000.00	5.15
	其中：政策性金融债	9,843,000.00	5.15
4	企业债券	20,507,000.00	10.74
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	30,350,000.00	15.89

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122541	12宁上陵	100,000	10,380,000.00	5.43
2	1280350	12兴化债	100,000	10,127,000.00	5.30
3	120320	12进出20	100,000	9,843,000.00	5.15

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	5,999,045.20
3	应收股利	–
4	应收利息	298,041.07
5	应收申购款	43,448.27
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	7,340,534.54

8.9.4 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。

8.9.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,593	49,335.29	4,186,220.59	2.36%	173,075,468.46	97.64%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	10,468,150.54	5.91%

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为100万份以上；

（2）本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为50万份至100万份（含）。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年06月20日)基金份额总额	743,426,623.31
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,788,457.71
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	567,953,391.97
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	177,261,689.05

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2012年11月15日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可[2012]961号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可[2012]1036号）。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务1年，本报告期应支付的报酬为人民币60,000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券股份有限公司	2	285,165,200.68	100.00%	11,223,757.23	100.00%	6,711,000,000.00	100.00%	–	–	193,633.37	100.00%	新增
兴业证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	新增
国泰君安证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	新增
申银万国证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	新增
中信证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	新增
招商证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	新增

注：公司制定《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对选择证券公司的标准和程序，以及佣金分配规则进行了规定。

根据上述制度，由公司基金投资部、固定收益部、研究部、特定资产管理部、分管投资的副总经理及交易室于每季度末对券商进行综合评分，评价标准包括研究及投资建议的质量、报告的及时性、服务质量、交易成本等，由公司基金投资决策委员会根据评分结果对下一季度的证券公司名单及佣金分配比例做出决议。首只基金成立后最初半年的券商选择及佣金分配由基金投资决策委员会决定。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年1月16日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自2012年1月16日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012年11月15日，根据工作需要，中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

安信基金管理有限责任公司
二〇一三年三月二十六日