安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2015年第1号)

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商证券股份有限公司

本招募说明书(更新)摘要内容截止日:2015年11月20日

重要提示

安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金的募集申请于2015年4月23日经中国证监会证监许可[2015]728号文注册。本基金基金合同于2015年5月20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11月20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、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,安信乾安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、总裁助理兼管销服务中心总经理、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、五矿经易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、总经理助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,国家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,香港企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董事。

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,中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、市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、基金管理人高级管理人员

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翼理、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副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。

乔江晖女士,督察长,文学学士。历任中华人民共和国公安部科长、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;2015年11月2日至今,任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经理。

5、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

1、基本情况

名称:招商证券股份有限公司

住所:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址:广东省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

成立日期:1993年8月1日

组织形式:股份有限公司

基金托管业务批准文号:证监许可[2014]78号

注册资本:人民币58.0814亿元

存续期间:持续经营

联系人:秦湘

联系电话:0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业,经过二十多年创业发展,已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商,并经中国证券监督管理委员会评定为A类AA级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道,在北京、上海、广州、深圳等城市拥有162家批准设立的证券营业部和11家证券经纪业务管理分公司,,同时在香港设有分支机构,全资拥有招商证券国际有限公司,招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司,参股博时基金管理公司,招商基金管理公司,构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于"全面提升核心竞争力,打造中国最佳投资银行"。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长,推动证券行业进步,立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构,成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

2、主要人员情况

招商证券托管部员工平均具备7年以上的证券基金后台运营或结算托管工作经验,其中多人具备丰富的证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验,以及大型IT公司的软件设计与开发经验,人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域,其中本科以上人员占比100%,硕士研究生占比达到70%,高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

3、基金托管业务经营情况

招商证券托管部是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司,可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施,稳定、高效的托管业务系统,完善的业务管理制度。招商证券托管部本着"诚实信用、谨慎勤勉"的原则,为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外,招商证券于2012年10月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复,成为业内首家可从事私募托管业务的券商,经验丰富,服务优质,业绩突出。截至2015年三季度,招商证券共托管14只公募基金。

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)招商证券股份有限公司

住所:广东省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、400-8888-111

网址:www.newone.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34层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

客户服务电话:400-800-1001

网址:www.essence.com.cn

(4)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

(5)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

联系人:腾艳

客户服务电话:95558

网址:www. citics.com

(6)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

联系人:吴忠超

客户服务电话:96577

网址:www.zxwt.com.cn

(7)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

(8)东海证券股份有限公司

住所:上海浦东新区世纪大道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

(9)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

(10)中信期货有限公司

住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层

法人代表:张皓

客户服务电话:400-9908-826

网址: www.citiesf.com

(11)中国国际金融股份有限公司

住址:中国北京建国门外大街1号国贸写字楼2座28层

法人代表:丁学东

客户服务电话:400-910-1166

网站:www.cicc.com

(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

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

(17)中经北证(北京)资产管理有限公司

住所:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层

法人代表:徐福星

客户服务电话:400-600-0030

网址: www.lxfunds.com

(18)泰信财富投资管理有限公司

住址:北京市海淀区西四环北路69号一层

法人代表:穆宏轩

客户服务电话:400-168-7575

网址:www.taixincaifu.com

(19)上海好买基金销售有限公司

住址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法人代表:杨文斌

客户服务电话:400-700-9665

网址:www.ehowbuy.com

(20)浙江同花顺基金销售有限公司

住址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法人代表:凌顺平

客户服务电话:4008-773-772

网址:www.5ifund.com

(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

电话:0755-82509865

传真:0755-82560289

联系人:宋发根

(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:孙蕾

经办律师:黎明、孙蕾

(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

安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金

五、基金类型

混合型

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、投资目标

本基金将以严谨细致的逻辑和基本面分析为基础,通过自上而下和自下而上结合,把握经济转型发展期具有较高增长潜力的上市公司的投资机会,力争实现基金资产的稳健增值。

八、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。

九、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

本基金的大类资产配置,主要通过对定期公布的GDP、工业增速以及CPI、PPI等总量基本面数据分析和逻辑梳理,把握宏观经济运行状况和特征,结合中国经济转型期实际约束和政策引导,分析比较大类资产的风险收益比,主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例,规避或控制市场风险,提高基金收益率。

除基本面因素以外,本基金还将关注其他可能影响资产预期收益与风险水平的因素,包括市场投资者行为、动量指标等,力争捕捉弱有效市场下其他的投资机会。

2、股票投资策略

本基金股票投资策略可以分为行业配置和个股精选两个层面。

行业配置策略

转型期中的中国经济,无论新兴产业还是传统行业都可能存在投资机会,新兴行业存在投资机会,主要是因为其契合社会经济发展方向,行业景气度高,行业增长短期尚无法触及天花板,同时商业模式在不断优化。传统行业的投资机会,来自于转型期中不可或缺的改革,特别是传统产业中有技术进步能力和创新能力的龙头企业,将发挥利用其在传统产业的优势,加速业务横向纵向拓展和转型,带来持续高增长。

本基金将结合经济发展阶段特征,综合分析比较各行业政策、成长空间、竞争格局、景气程度及整体估值水平等,优先配置风险收益比高的优势成长行业。

个股精选策略

本基金在具体组合构建上将主要采用成长型策略精选个股,通过定量和定性分析,精选具有持续增长能力和竞争优势的上市公司股票。

定量分析:考虑到成长型公司最主要的特征应该体现在收入的快速增长上,同时这种快速增长不是以侵蚀利润率为前提的,因此在定量分析部分,主要以主营业务收入增速和营业利润率为考量指标,横向纵向考察营业收入增速和利润率的变化,结合资产周转率以及经营性现金流量等指标,更有效地把握上市公司增长质量。

定性分析:主要体现在增长持续性的分析上。在我们看来,一家企业成长持续性来源体现在多方面,一是产业前景,二是是否具有稳固的商业模式和可持续经营理念,内部是否有与之匹配的管理运行体系,公司治理结构是否健全等,三是其竞争优势来源于经营许可资制、品牌、资源优势,还是技术创新、应用创新能力,以及这种创新能力的持续性等。

估值分析:针对不同上市公司所处行业阶段、业务模式特点,可灵活采用市盈率法(PE)、市净率法(PB)、市盈率-成长法(PEG)、自由现金流贴现模型(FCFF)或股利贴现模型(DDM)等估值定价模型,横向或纵向比较把握估值波动区间,及时将具有估值优势的上市公司纳入投资组合,将估值偏高的个股调减或调出投资组合。

3、固定收益类投资策略

本基金固定收益类证券投资,追求的是固定收益投资的配置效果与股票权益类投资的配置效果紧密衔接配合,实现基金资产整体最大化收益。

在我们看来,固定收益率证券投资的关键,是对未来利率走势的分析和预测。本基金将根据宏观数据和市场交易情况,对利率中隐含的对经济增长、通货膨胀、违约概率、提前偿付速度等因素的预测,合理判断未来利率期限结构和中长期收益率变化趋势,结合个券相对价值和流动性比较,构建固定收益类债券投资组合。在预期利率上升时降低债券组合久期,降低债券投资风险;在预期利率下降时,适当增大债券投资久期,提高投资收益。

4、衍生品及其他投资策略

(1)股指期货投资策略

本基金的股指期货投资,以风险对冲、套期保值为主要目的,以控制股票投资组合的系统性风险。套期保值主要选择流动性好、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股票现货资产进行匹配,在投资授权审批流程完成后进行股指期货套期保值投资,实现基金资产增值保值。

(2)权证投资策略

本基金根据权证估值量化模型评估权证的内在合理价值,利用权证与标的股票之间可能存在的投资机会,谨慎运用杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等策略获取权证投资收益。

(3)低风险套利型投资策略

本基金将利用市场的短期非理性,捕捉低风险套利机会,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。

5、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。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。

本基金为灵活配置混合型基金,在综合考虑了基金投资组合的构建、投资标的以及市场上各类指数的编制方法后,本基金选择市场认同度较高并且作为股指期货标的的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深300指数成份股选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势。债券组合的业绩基准则采用了中证综合债券指数,中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数,该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,具有较强的市场代表性。如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十一、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。

十二、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《安信优势增长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	7,124,079.90	1.57
	其中:股票	7,124,079.90	1.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	446,154,676.38	98.05
8	其他资产	1,728,348.55	0.38
9	合计	455,007,104.83	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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,124,079.90	1.57
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	7,124,079.90	1.57

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	600900	长江电力	857,290	7,124,079.90	1.57

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金的股指期货投资,以风险对冲、套期保值为主要目的,以控制股票投资组合的系统性风险。套期保值主要选择流动性好、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股票现货资产进行匹配,在投资授权审批流程完成后进行股指期货套期保值投资,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)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。

(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	644,184.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,081,181.55
5	应收申购款	2,982.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,728,348.55

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	7,124,079.90	1.57	重大事项停牌

十三、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5月20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:

安信优势增长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
2015.5.20-2015.9.30	2.90%	0.07%	-15.59%	1.66%	18.49%	-1.59%

十四、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、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券、期货交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金的账户开户费用、账户维护费用;

10、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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日结束之日起3个工作日内支付。

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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人于次月首日起3个工作日内向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

上述"一、基金费用的种类中第4-10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、基金托管费率或C类基金份额销售服务费等相关费率。

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。

十五、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,新增销售服务费、基金份额类别的内容。

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"部分的内容。

5、"第五部分 相关服务机构"部分,更新其他销售机构和登记机构的信息。

6、更新"第六部分 基金的募集"部分的内容。

7、更新"第七部分 基金合同的生效"部分的内容。

8、"第八部分 基金份额的申购与赎回"部分,更新了申购、赎回开放日及业务办理时间、申购费率、赎回费率、申购份额与赎回金额的计算方式、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告、基金转换和定期定额投资计划的内容。

9、"第九部分 基金的