安信宝利分级债券型证券投资基金

【2013】第三季度报告

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
报告送出日期：2013年10月23日

§1 重要提示

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。

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2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月24日（基金合同生效日）起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信宝利分级债券	
基金主代码	167501	
基金运作方式	契约型。本基金基金合同生效之日起2年内，宝利A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次，宝利B封闭运作并上市交易；本基金基金合同生效后2年期届满，本基金转换为上市开放式基金(LOF)。	
基金合同生效日	2013年7月24日	
报告期末基金份额总额	2,923,915,682.14份	
投资目标	在适度承担信用风险的情况下，力争实现基金财产当期稳定的超越基准的投资收益。	
投资策略	本基金的债券投资主要将采用信用策略，同时辅以利率策略、收益率策略、回购策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、新股投资策略等积极投资策略，在适度控制风险的基础上，通过信用分析和对信用利差趋势的判断，为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本产品属于中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险水平和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	宝利A	宝利B
下属两级基金的交易代码	167502	150137
报告期末下属两级基金的份额总额	1,923,767,949.20份	1,000,147,732.94份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年7月24日-2013年9月30日）
1.本期已实现收益	24,245,226.11
2.本期利润	24,565,220.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084
4.期末基金资产净值	2,948,480,902.89
5.期末基金份额净值	1.008

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认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。

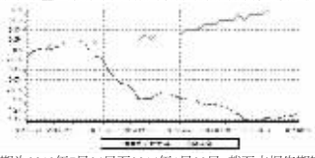
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
自基金合同生效日起至今（2013年07月24日-2013年09月30日）	0.80%	0.05%	-1.29%	0.07%	2.09%	-0.02%

注：业绩比较基准收益率=中债综合指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2013年7月24日至2014年1月23日，截至本报告期期末，本基金尚在建仓期。

2、本基金基金合同生效日为2013年7月24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2013年7月24日至2013年9月30日。

3.3 其他指标

金额单位：人民币元

其他指标	报告期末
宝利A与宝利B基金份额配比	1.92348379:1
期末宝利A参考净值	1.009
期末宝利A累计参考净值	1.009
期末宝利B参考净值	1.008
期末宝利B累计参考净值	1.008
宝利A年收益率(单利)	4.50%

注：1、根据本《基金合同》的规定，宝利A的年收益率将在每次开放日设定一次并公告。截至本报告期期末，宝利A年收益率为4.50%。

2、本报告期内2013年7月24日至2013年9月30日期间，宝利A年收益率为4.50%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
庄园	本基金的基金经理	2013年7月24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，安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。

注：1.此处的任职日期为本基金合同生效日。

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 公平交易专项说明

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。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年9月30日，本基金净值1.008元，自成立日至9月30日收益率为0.80%，同期业绩比较基准收益率为-1.29%，超过同期业绩比较基准2.09%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年4季度，虽然宏观经济较脆弱，复苏进程缓慢且存在不确定性；但CPI预计将出现小幅反弹，甚至可能阶段性达到3以上。流动性预计将维持中性偏紧的状态，资金成本至少没有明显的下行空间。认为4季度主要是配置行情，而获取资本利得则较困难。在投资策略上，我们将做好市场的研究工作，继续以谨慎的态度为主，灵活调整组合，注意防范风险，为投资者创造更为平稳和较快增长的业绩回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,924,373,266.54	49.52
	其中：债券	1,924,373,266.54	49.52
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,922,755,281.72	49.47
7	其他各项资产	39,309,971.63	1.01
8	合计	3,886,438,519.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,398,361,515.40	47.43
5	企业短期融资券	180,041,000.00	6.11
6	中期票据	301,159,000.00	10.21
7	可转债	44,811,751.14	1.52
8	其他	-	-
9	合计	1,924,373,266.54	65.27

5.5 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122266	13中信03	1,300,000	129,740,000.00	4.40
2	124342	13黔南资	800,000	79,975,802.74	2.71
3	122830	11沈国资	695,140	71,390,878.00	2.42
4	1380238	13娄堰发展债	600,000	60,042,000.00	2.04
5	122522	12兴城建	572,000	58,858,800.00	2.00

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为债券型基金，不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库，本基金管理人从制度和流程上要求证券必须先入库再买入。

5.10.3 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	127,478.43
2	应收证券清算款	127,747.16
3	应收股利	-
4	应收利息	39,054,746.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,309,971.63

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	34,846,407.30	1.18
2	113003	重工转债	4,577,040.00	0.16

5.10.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	宝利A	宝利B
基金合同生效日基金份额总额	1,923,767,949.20	1,000,147,732.94
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
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	1,923,767,949.20	1,000,147,732.94

注：1、本基金合同生效日为2013年7月24日。

2、本基金基金合同生效之日起2年内，宝利A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次，宝利B封闭运作并上市交易。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013年8月17日，安信基金管理有限责任公司在中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网上公布了《安信基金管理有限责任公司关于增加注册资本的公告》，公司注册资本由人民币2亿元变更为3.5亿元。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信宝利分级债券型证券投资基金募集的文件；

2、《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》；

3、《安信宝利分级债券型证券投资基金托管协议》；

4、《安信宝利分级债券型证券投资基金招募说明书》；

5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址：中国广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
二〇一三年十月二十三日

安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2013】第三季度报告

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
报告送出日期：2013年10月23日

§1 重要提示

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。

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10月22日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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6月20日
报告期末基金份额总额	52,794,642.82份
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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年7月1日-2013年9月30日）
1.本期已实现收益	3,766,818.27
2.本期利润	2,547,589.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0445
4.期末基金资产净值	58,487,718.68
5.期末基金份额净值	1.108

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认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。

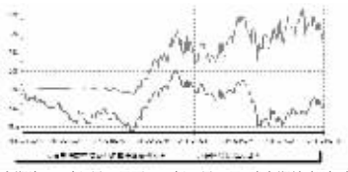
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	3.55%	1.39%	4.60%	0.86%	-1.05%	0.53%

注：业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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6月20日至2012年12月19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6月20日。图示日期为2012年6月20日至2013年9月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、公司总经理助理兼基金投资部总经理	2012年6月20日	-	19	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总经理助理兼基金投资部总经理。

注：1、此处的任职日期为本基金合同生效日。

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 公平交易专项说明

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。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

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 公平交易专项说明

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。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

展望2013年4季度，虽然宏观经济较脆弱，复苏进程缓慢且存在不确定性；但CPI预计将出现小幅反弹，甚至可能阶段性达到3以上。流动性预计将维持中性偏紧的状态，资金成本至少没有明显的下行空间。认为4季度主要是配置行情，而获取资本利得则较困难。在投资策略上，我们将做好市场的研究工作，继续以谨慎的态度为主，灵活调整组合，注意防范风险，为投资者创造更为平稳和较快增长的业绩回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	46,714,555.24	78.77
	其中：股票	46,714,555.24	78.77
2	固定收益投资	8,339,981.46	14.06
	其中：债券	8,339,981.46	14.06
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,462,299.63	5.84
6	其他各项资产	186,314.05	0.31
7	合计	59,303,150.38	100.00

5.2 报告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	采矿业	-	-
C	制造业	12,248,395.59	20.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,155,744.96	3.69
E	建筑业	1,782,217.35	3.05
F	批发和零售业	2,111,833.25	3.61
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	2,966,226.85	5.07
J	金融业	23,510,375.18	40.20
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,571.84	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,928,190.22	3.30
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	46,714,555.24	79.87

5.3 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

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	600837	海通证券	230,318	2,881,278.18	4.93
2	000776	广发证券	233,100	2,762,235.00	4.72
3	601328	交通银行	631,000	2,713,300.00	4.64
4	600030	中信证券	218,200	2,681,678.00	4.59
5	600369	西南证券	237,400	2,141,348.00	3.66
6	002024	苏宁云商	164,345	2,111,833.25	3.61
7	601601	中国太保	106,300	1,867,691.00	3.19
8	600000	浦发银行	179,300	1,809,137.00	3.09
9	000063	中兴通讯	105,210	1,746,486.00	2.99
10	600323	南海发展	223,900	1,741,942.00	2.98

5.4 报告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	-	-
	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	8,339,981.46	14.26
8	其他	-	-
9	合计	8,339,981.46	14.26

5.5 报告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	128002	东华转债	19,627	2,439,027.66	4.17
2	113003	重工转债	18,900	2,402,946.00	4.11
3	110023	民生转债	21,680	2,293,960.80	3.92
4	110015	石化转债	12,300	1,204,047.00	2.06

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

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，本基金暂不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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	94,904.27
2	应收证券清算款	71,172.38
3	应收股利	-
4	应收利息	16,688.83
5	应收申购款	3,548.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	186,314.05

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	2,402,946.00	4.11
2	110023	民生转债	2,293,960.80	3.92
3	110015	石化转债	1,204,047.00	2.06

5.10.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	64,537,670.75
本报告期基金总申购份额	1,589,092.63
减：本报告期基金总赎回份额	13,332,120.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	52,794,642.82

注：总申购份额含红利再投和转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013年8月17日，安信基金管理有限责任公司在中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网上公布了《安信基金管理有限责任公司关于增加注册资本的公告》，公司注册资本由人民币2亿元变更为3.5亿元。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；

2、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址：中国广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
二〇一三年十月二十三日

安信目标收益债券型证券投资基金

【2013】第三季度报告

基金管理人：安信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2013年10月23日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信目标收益债券	
基金主代码	750002	
交易代码	750002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年9月25日	
报告期末基金份额总额	126,742,143.25份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，以3个月期上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)为收益跟踪目标，并力争实现超越目标基准的投资回报。	
投资策略	基于货币政策研究、利率研究等宏观基本面研究，根据风险收益特征对普通债券、浮动利息债券、可转换债券和资产支持证券等大类资产进行配置比例。通过研究基准利率类型、利差水平、发行主体等因素，并结合市场预期分析和对市场基准利率走势的判断，制定浮息债的投资策略。密切跟踪债券发行市场的供应状况，深入研究利差变动，在重点研究发行人特征及其信用水平、债券类型、担保情况、发行利率和承销商构成的基础上积极参与债券一级市场投资。可转债的投资采取基本面分析和量化分析相结合的方法，利用期权定价模型等数量化方法对可转债的价值进行估算，选择价值低估的可转换债券进行投资。同时，持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展，对普通的和创新性的资产支持证券品种进行深入分析，制定周密资产支持证券投资策略。普通债券投资策略包括品种配置策略、收益率曲线配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购策略等。	
业绩比较基准	3个月期上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，但高于货币市场基金，属于中低风险和收益水平的投资品种。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	安信目标收益债券A	安信目标收益债券C
下属两级基金的交易代码	750002	750003
报告期末下属两级基金的份额总额	43,180,549.68份	83,561,593.57份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年7月1日-2013年9月30日）	
	安信目标收益债券A	安信目标收益债券C
1.本期已实现收益	96,227.79	32,944.45
2.本期利润	578,344.28	1,325,977.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0105	0.0083
4.期末基金资产净值	44,383,976.06	85,496,995.42
5.期末基金份额净值	1.028	1.023

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

安信目标收益债券A

阶段	净值增长率①	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	1.08%	0.11%	1.16%	0.01%	-0.08%	0.10%

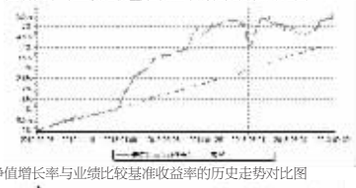
安信目标收益债券C

阶段	净值增长率①	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	0.99%	0.11%	1.16%	0.01%	-0.17%	0.10%

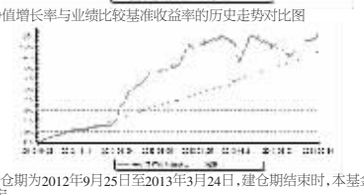
注：业绩比较基准=3个月期上海银行间同业拆放利率（Shibor 3M），业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

本基金A类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金C类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的建仓期为2012年9月25日至2013年3月24日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为2012年9月25日。图示日期为2012年9月25日至2013年9月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李勇	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2012年9月25日		7	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部总经理。2012年9月25日至今，任安信目标收益债券型证券投资基金的基金经理；2012年12月18日至今，任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理；2013年2月5日至今，任安信现金管理货币市场基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期为本基金合同生效日。

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 公平交易专项说明

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未