

安信目标收益债券型证券投资基金

2013 年度 报告 摘要

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前提下,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的利益的行为。

4.2 管理人报告期内公平交易情况的专项说明

4.2.1 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,保证公平交易制度的实现。同时,公司通过信息隔离墙、集中监控、事后分析和信息披露来公平交易和风险控制进行监督。

4.2.2 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调查。

本基金管理人采用T检验等方法,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、五个交易日内向交易对手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方向进行交易投资组合利益输送的行为。

4.2.3 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 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年,上半年货币政策宽松,中债总财富(总值)指数从年初的142.52,最高上升至年末28日的146.19,随着其他债市监管风险暴露逐步加深,加上央行货币政策显著转弱,固定收益市场以6月份为标志进入9年来平淡的行情。

4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至2013年12月31日,本基金A类份额净值为0.916元,C类份额净值为1.01元。本报告期末本基金A类份额净值增长率为3.56%,C类份额净值增长率为3.16%,同期业绩比较基准增长率为4.45%。本基金业绩分别落后同期业绩比较基准0.89%和1.29%。

4.5 管理人对外观展情况、证券市场及行业走势的简要展望
展望2014年,基本面的改善并不存在大碍,经济增速将延续疲态,通胀温和, CPI保持低位。但经济存在一定的问题,央行通过利率手段促进经济降杠杆在2014年可能成为主基调。期间虽然或有阶段性的宽松,但总体的利率水平仍将处于高位。

在投资操作上,我们将继续做好市场中的研究工作,灵活调整仓位,科学配置资产,注意防范风险,为投资者创造更为平稳和稳健的业绩回报。

4.6 管理人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办法》进行。

公司的基金估值业务由运营部负责。运营部在日常估值管理中,必须严格遵守各项法律法规及基金合同的约定,及时准确对基金资产估值事项进行基金估值。运营部对基金估值所使用的估值系统进行总体规划和管理,建立并不断完善基金估值系统。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,成员由总经理、运营部、研究部、监察稽核人员组成,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。

估值委员会负责制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负债的公允价值。估值委员会采取例会的方式召开会议,在发生影响估值准确性和估值的有效性及重大的情况时,运营部及时通报估值委员会召开会议讨论估值方法,以保证估值准确。估值委员会会议决议须经估值委员会半数以上投票表决方能通过,并形成书面文件妥善保管。对于重大事项,应充分征求监察稽核、托管银行、会计师事务所、律师事务所意见的基础上,再行实施。估值政策和程序经审计经估值委员会审批后方可实施。

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资产长期系统的估值经验以及对相关法律法规的熟悉掌握,对现有市价的估值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经验对市场价格的长期深入的研究跟踪,对没有市价的估值品种提供专业意见。研究发展和个股投资等因素。从估值技术的角度进行理论分析,并根据分析的结果建议应采用何种估值方法及合理的估值技术工具,针对不同的估值方法及估值理论进行决策。为估值委员会提供公允的、准确的估值估值方法提供理论依据。监察稽核部对估值委员会会议的全过程进行,做出决议,提交的基金估值信息披露文件中进行合理性审查。投资和基金运营部对估值委员会会议,但不参与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环节之间不存在任何重大利益冲突。截止本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 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
根据《安信目标收益债券型证券投资基金基金合同》及最新的招募说明书约定:“在符合有关基金分派的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次分配不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配金额的90%。”

本基金自2013年4月12日为首次分配基准日,于2013年4月22日为首次基金A类和C类份额持有人按每10份基金份额分配人民币0.30元进行分配。其中A类基金份额持有人以现金形式发放人民币719,391.95元,再投资形式发放人民币0.66元,实际分配收益为人民币717,838.56元;而C类份额持有人以现金形式发放人民币966,381.57元,再投资形式发放人民币209,127.36元,实际分配收益为人民币1,165,508.93元。与相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书约定一致。

本基金在实现现金分配时可供分配金额的90%。

5 托管人报告期内基金托管人遵守信托责任的情况
在托管安信目标收益债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人-中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《安信目标收益债券型证券投资基金基金合同》、《安信目标收益债券型证券投资基金托管协议》的约定,对安信目标收益债券型证券投资基金管理人-安信基金管理有限公司报告期内2013年1月1日至2013年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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
托管人认为,安信基金管理有限公司报告期内对安信目标收益债券型证券投资基金的投资运作,基金资产运作合规,基金估值和份额净值计价准确,基金费用开支及利润分配问题,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格执行基金合同的约定。

5.3 托管人对上年度报告内容真实、准确和完整发表意见
托管人认为,安信基金管理有限公司信息披露符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的安信目标收益债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有所损害基金份额持有人利益的行为。

6 审计报告
安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了安信目标收益债券型证券投资基金财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表,自2013年1月1日至2013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。投资者欲了解详细内容,可通通过年度报告全文查看审计报告全文。

7 年度财务报表
会计主体:安信目标收益债券型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
货币资金	1,569,201.62	3,647,683.26
交易性金融资产	2,335,501.69	9,006,760.80
应收款项	260.00	-
应收利息	92,880,202.01	752,267,621.90
基金资产	-	-
货币性金融资产	92,880,202.01	752,267,621.90
非货币性金融资产	-	-
资产支持证券	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	200,191.69	13,664,276.66
其他资产	2,154,000.83	13,511,176.69
流动资产合计	1,769,797.75	13,688,117.66
可供出售金融资产	99,604.00	1,235,484.13
长期股权投资	-	-
其他资产	-	-
资产总计	99,159,900.47	793,607,009.44
负债和所有者权益		
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
应付短期融资款	-	-
应付利息	185,553.44	4,572,191.62
应付管理人报酬	53,087.78	273,418.66
应付托管费	15,167.94	78,119.62
应付销售服务费	187,466.60	101,436.63
应付交易费用	1,647.05	11,776.35
其他负债	-	-
负债合计	338,855.27	4,965,526.25
所有者权益：		
实收基金	8,088.77	164,329.31
未分配利润	-	-
损益前所有者权益	160,187.39	346,994.78
其他综合收益	27,342,475.97	603,817,891.78
所有者权益合计	8,096,666.16	604,441,145.87
负债和所有者权益总计	99,159,900.47	793,607,009.44

注:1)本报告截止日2013年12月31日,安信目标收益债券型证券投资基金A类基金份额净值1.016元,安信目标收益债券型证券投资基金B类基金份额净值1.011元,安信目标收益债券型证券投资基金C类基金份额净值1.12,730.55元。
(2)本基金合同于2012年9月25日生效,上年度可比期间非完整会计年度。

7.2 利润分配
会计主体:安信目标收益债券型证券投资基金
本报告期:2013年01月01日至2013年12月31日

项目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年09月25日至2012年12月31日
一、收入	18,320,279.99	14,661,073.90
1.利息收入	13,093,919.92	10,086,413.64
其中:存款利息收入	1,085,391.73	8,922,619.58
债券利息收入	11,815,411.53	6,349,137.10
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,083,115.66	45,161.57
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	3,378,483.63	2,273,739.53
其中:股息收入	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,378,483.63	2,273,739.53
资产支持证券投资损益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-	-
其他收入	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	99,764.35	-2,768,542.91
4.其他收益(损失以“-”填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	99,266.89	69,258.87
减:二、费用	7,207,869.48	4,892,722.39
1.管理费	1,769,710.57	1,892,515.07
2.托管费	511,345.91	540,718.84
3.销售服务费	1,235,484.13	799,899.33
4.其他费用	92,668.04	14,366.94
5.利息支出	3,746,602.55	1,479,354.89
其中:卖出回购金融资产支出	3,746,602.55	1,479,354.89
其他支出	42,780.31	16,526.42
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	11,124,498.51	9,768,351.54
减:所得税费用	-	-
净利润(净亏损以“-”填列)	11,124,498.51	9,768,351.54

注:本基金合同于2012年9月25日生效,上年度可比期间非完整会计年度。
7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信目标收益债券型证券投资基金
本报告期:2013年01月01日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上期可比期间 2012年09月25日至2012年12月31日
	实收基金	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	386,153,410.79	3,635,706.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	--	9,768,351.54
三、本期基金份额持有人产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-315,277,413.04	-3,839,031.14
其中：基金申购费	418,042,695.58	10,889,774.47
四、本期基金份额持有人产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-733,320,308.62	-14,725,868.64
其中：基金赎回费	--	-9,982,547.49
五、期末所有者权益(基金净值)	70,875,797.75	94,626.75
上年末可比期间		
项目	2012年09月25日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,946,499,191.79	1,946,499,191.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	--	9,768,351.54
三、本期基金份额持有人产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,569,795,781.00	-1,566,028,425.67
其中：基金申购费	504,199,885.68	307,242.33
四、本期基金份额持有人产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,611,414,866.68	-6,439,887.00
其中：基金赎回费	--	-1,617,854,753.68
五、期末所有者权益(基金净值)	386,153,410.79	3,635,706.87

注：本基金合同于2012年9月26日生效，本期可比期间非完整会计年度。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告于7至74财务报表由下列负责人签署：