

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  
送出日期：2013年3月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事会对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。本基金报告已分别之二上独立董事签字同意，并由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3月22日复核了本报告中的财务数据，保证复核后的情况、财务数据无误，复核组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、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，投资者须自行承担投资风险。

本报告期为2012年9月25日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

基金简称 安信目标收益债券

基金代码 750002

交易代码 750002

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2012年9月25日

基金管理人 安信基金管理有限责任公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 386,153,410.79份

基金份额净值 不适用

基金简称 安信目标收益债券A

基金代码 750002

交易代码 750003

报告期末基金份额总额 141,430,797.23份

报告期末基金资产净值 244,722,613.56元

2.2 基金产品概况

在严格控制风险的前提下，以三个月上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)为收益跟

踪指标，力争在风险调整后的收益方面超越基准。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括但不限于国债、地方政府债、企业债

券、短期融资券、可转换债券、货币市场基金、债券回购、央行票据、资产支持证券、

股票质押式回购、权证、债券逆回购、国债期货等品种。

本基金将为债券型基金，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，属于中风险级别的投资品种。

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 中国农业银行股份有限公司

姓名 孙晓燕 李芳菲

联系电话 0755-82509099

电子邮箱 service@essencefund.com

客户服务电话 4008-088-088

传真 0755-82799292

010-63201816

2.4 信息披露方式

除季度报告外，每年至少发布一次定期报告。

在网站上公告。

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9月25日(基金合同生效日)-2012年12月31日

安信目标收益债券A 安信目标收益债券C

本期已实现收益 3,671,083.17 8,865,818.12

本期利润 2,763,352.31 7,004,999.23

期初平均基金份额本期利润 0.0106 0.0096

本期基金份额净值增长率 1.00% 0.90%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末

0.0102 0.0089

期末基金份额净值 142,876,315.50 246,912,802.16

期末基金份额净值 1.010 1.009

注：1. 投资收益指基金运作期间内因买卖股票、债券、基金等获得的收入，扣除相关的交易费用后即为基金的“已实现收益”。其他收入、不含公允价值变动收益扣减相关费用后的净额。

2. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中分配比例计算的期末可供分配利润。

3. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中分配比例计算的期末可供分配利润。

4. 本基金合同于2012年9月25日生效，至2012年12月31日未满1年，故2012年的数据和指标非完整

会计年度数据。

3.2 基金份额表现

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

3.1.1 期间数据和指标 份额净值增长率(%) 增长率(%)

份额净值增长率 增长率(%)

基准收益率 增长率(%)

①-③ ②-④

过去三个月 0.90% 0.04% 1.03% 0.01% -0.03% 0.03%

自基金合同生效日(2012年9月25日起至今日) 1.00% 0.04% 1.03% 0.01% -0.03% 0.03%

阶段 (安信目标收益债券C)

份额净值增长率 增长率(%)

基准收益率 增长率(%)

①-③ ②-④

过去三个月 0.80% 0.03% 0.96% 0.01% -0.16% 0.02%

自基金合同生效日(2012年9月25日起至今日) 0.90% 0.03% 1.03% 0.01% -0.13% 0.02%

9月25日起至今 0.90% 0.03% 1.03% 0.01% -0.13% 0.02%

注：1. 根据《安信目标收益债券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：3个月上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)。上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)是指在银行间同业拆放市场上具有代表性的利率，是单利、无担保、短期、利率弹性大、流动性强的利率，通常被用作短期融资券、货币市场基金、短期国债等金融产品的定价基准。2. 本基金合同生

效日至报告期末，基金运作时间未满一年，因此无法计算其成立以来的年化收益率。

3.2.2 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

3.2.3 本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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2012年9月25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，股权及股东构成：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，平安信托有限公司持有15%的股权，五矿证券有限公司持有2%的股权。2012年12月18日起完成变更登记手续并获准经营基金销售业务，2012年12月18日起完成变更登记手续并获准经营基金代销业务，2012年12月18日起完成变更登记手续并获准经营基金理财业务。

4.2 基金经理（基金经理）的基本情况

基金经理（基金经理）的简历

李勇，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、高级风险管理经理，现任安信基金管理有限公司总经理助理、固定收益部总经理。

张翼飞，经济学学士。历任鹏润（北京）有限公司财务部会计、财务主管，上海市国泰资产管理有限公司研究员，泰康人寿保险股份有限公司研究员，泰康人寿保险股份有限公司研究员，现任职安信基金管理有限责任公司。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格按照《证券投资基金公平交易制度指引》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，对旗下所有投资组合进行了公平交易制度的执行情况分析，分析结果显示，本报告期内各投资组合之间不存在通过分析同向品种的同向交易进行投资组合的相同操作行为。

4.4 公平交易制度的专项说明

本公司定期对报告期内本基金管理运作遵守公平交易的情况进行说明。

本报告期内，本公司管理人严格遵守《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金评价办法》、《证券投资基金信息报送与披露办法》、《基金合同文本必备条款》及其他有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定，认真履行公平交易制度，严格执行公平交易制度，确保旗下所有投资组合在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均得到公平对待，不存在利益输送、利益冲突。

4.5 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司通过系统化的流程，对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行定期评估，定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本报告期内，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.6 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.7 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.8 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.9 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.10 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.11 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.12 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.13 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.14 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.15 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.16 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.17 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.18 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.19 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.20 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.21 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.22 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.23 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.24 公平交易制度的专项说明

根据《公开募集证券投资基金公平交易制度指引》，本公司定期对旗下所有投资组合的公平交易制度的执行情况进行评估，评估结果显示，本公司旗下所有投资组合均符合公司公平交易制度的执行标准。

4.25 公平交易制度的专项说明