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03月26日

安信目标收益债券型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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9月25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	
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	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信目标收益债券A	安信目标收益债券C
下属分级基金的交易代码	750002	750003
报告期末下属分级基金的份额总额	141,430,797.23份	244,722,613.56份

2.2 基金产品说明

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。

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
信息披露负责人	姓名	孙晓奇	李芳菲
	联系电话	0755-82509999	010-66060069
	电子邮箱	service@essencefund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95599
传真		0755-82799292	010-63201816

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	8,865,811.28
本期利润	2,763,352.31	7,004,999.23
加权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	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0102	0.0089
期末基金资产净值	142,876,315.50	246,912,802.16
期末基金份额净值	1.010	1.009

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

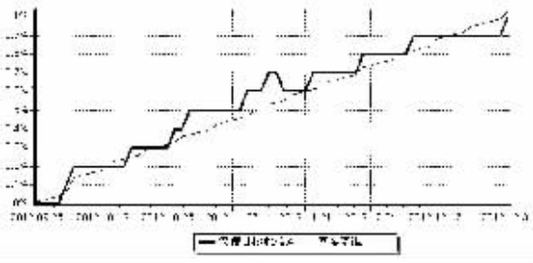
阶段 (安信目标收益债券A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.90%	0.04%	0.96%	0.01%	-0.06%	0.03%
自基金合同生效日(2012年9月25日)起至今	1.00%	0.04%	1.03%	0.01%	-0.03%	0.03%

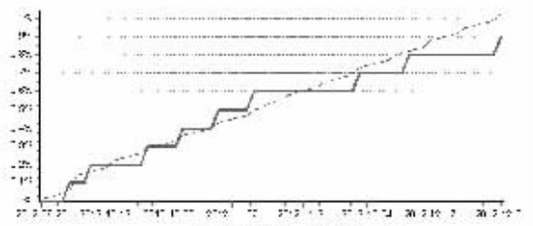
阶段 (安信目标收益债券C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.80%	0.03%	0.96%	0.01%	-0.16%	0.02%
自基金合同生效日(2012年9月25日)起至今	0.90%	0.03%	1.03%	0.01%	-0.13%	0.02%

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个月期上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)。上海银行间同业拆放利率(Shanghai Interbank Offered Rate,简称Shibor),以位于上海的全国银行间同业拆借中心为技术平台计算、发布并命名,是由信用等级较高的银行组成报价团自主报出的人民币同业拆出利率计算确定的算术平均利率,是单利、无担保、批发性利率。中国人民银行成立Shibor工作小组,依据《上海银行间同业拆放利率(Shibor)实施准则》确定和调整报价银行团成员、监督和管理Shibor运行、规范报价行与指定发布人行为。3个月期上海银行间同业拆放利率是Shibor系列品种中具有代表性的利率品种,目前已经成为票据贴现、协议存款、浮息债等产品的定价参照基准。由于同业拆放利率在数值上的恒正属性,本基金以Shibor 3M为业绩比较基准,符合本基金追求绝对收益的投资理念和为基金份额持有人实现超越基准收益的投资目标。

2、本基金基金合同生效日为2012年9月25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9月25日至2012年12月31日间各日的实际数值。

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

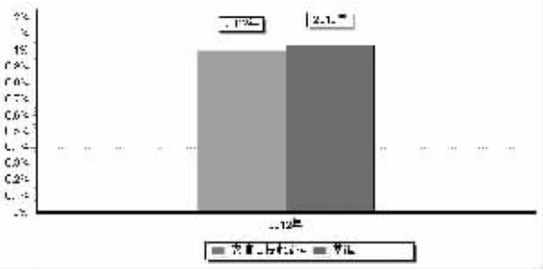


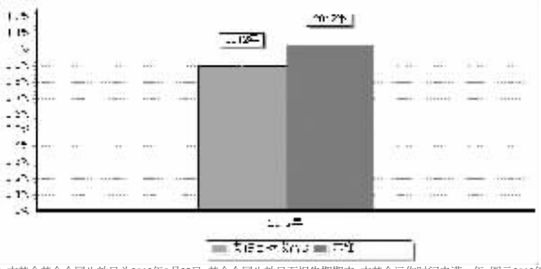


注:1、根据基金合同的规定:本基金将不低于80%的基金资产投资于固定收益类资产,现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的5%。本基金可以投资于权证,权证的投资比例不高于基金资产净值的3%。本基金的建仓期为2012年9月25日至2013年3月24日,截至本报告期期末(2012年12月31日),本基金仍处于建仓期中。

2、本基金基金合同生效日为2012年9月25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9月25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9月25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2012年本基金的收益率及业绩比较基准的收益率为2012年9月25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		
李勇	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2012年9月25日	-	6	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12月18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。
张翼飞	本基金的基金经理助理、固定收益部基金经理助理	2012年11月9日	-	2	张翼飞先生,经济学硕士。历任摩根轧机(上海)有限公司财务部会计、财务主管,上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员,秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监,日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部行业研究员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理助理。

注:1、本基金基金经理李勇的"任职日期"按基金合同生效日填写;基金经理助理张翼飞的"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,不存在通过相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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年9月25日本基金成立以来,债券市场总体呈现震荡走势,中债总全价(总值)指数从9月25日的118.40最高上升至118.55,最低下降至117.91,年末又回升至118.15。

债券市场多空因素交织,有利的方面主要是市场流动性较为充裕,3季度债券市场调整较为充分,当前债券的配置收益较好。不利的方面主要是中国经济在库存周期和基建投资刺激的双重作用下形成了弱复苏的格局,股市触底反弹,影响了资金流向,抬升了债券的资金成本。

2012年9月25日至年底,我们准确预测了市场形势和把握了债券波动的节奏,投资策略上一方面抓住收益率抬升的时机进行底仓配置,另一方面随着市场波动进行波段操作以提高组合收益。同时利用股市反弹的时机,参与了可转债的反弹行情,博取了价差收益。

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A类份额净值为1.010元,C类份额净值为1.009元。本报告期本基金A类份额净值增长率为1.00%,C类份额净值增长率为0.90%,同期业绩比较基准增长率为1.03%。基金业绩分别落后同期比较基准0.03%和0.13%,主要原因是本基金2012年9月25日至年底大部分时间处于建仓期。

4.5 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,债券市场面临的多空因素较为平衡,经济继续保持弱势上行,通胀上行可能延续,但空间不大,市场流动性总体宽松,预计债券市场震荡行情仍然延续。

在投资策略上,我们将做好市场的前瞻性和趋势性研究工作,灵活调整组合,为投资者创造更为平稳和较快增长的业绩回报。

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,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。估值委员会会议决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理依据。监察稽核部对估值委员会临时会议的会程讨论、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

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-安信基金管理有限责任公司2012年9月25日至2012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

本托管人认为,安信基金管理有限责任公司在安信目标收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,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按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,安信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《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,基金管理人所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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了安信目标收益债券型证券投资基金的财务报表,包括2012年12月31日的资产负债表,2012年9月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的利润表、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:安信目标收益债券型证券投资基金

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	3,647,683.26
结算备付金	9,030,766.80
存出保证金	250,000.00
交易性金融资产	752,267,621.90
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	752,267,621.90
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	13,664,276.66
应收利息	13,511,176.69
应收股利	-
应收申购款	1,235,484.13
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	793,607,009.44
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	385,046,941.90
应付证券清算款	13,223,283.01
应付赎回款	4,572,191.62
应付管理人报酬	273,418.66
应付托管费	78,119.62
应付销售服务费	101,436.63
应付交易费用	11,776.35
应交税费	-
应付利息	164,329.21
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	346,394.78
负债合计	403,817,891.78
所有者权益:	
实收基金	386,153,410.79
未分配利润	3,635,706.87
所有者权益合计	389,789,117.66
负债和所有者权益总计	793,607,009.44

注:(1)报告截止日为2012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1.010元,安信目标收益债券型证券投资基金C类基金份额净值1.009元,基金份额总额386,153,410.79份,其中安信目标收益债券型证券投资基金A类基金份额141,430,797.23份;安信目标收益债券型证券投资基金C类基金份额244,722,613.56份。

(2)本基金合同于2012年9月25日生效,因此无需披露比较数据。

7.2 利润表

会计主体:安信目标收益债券型证券投资基金

本报告期:2012年9月25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9月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	14,661,073.93
1.利息收入	15,086,618.44
其中:存款利息收入	8,692,319.68
债券利息收入	6,349,137.19
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	45,161.57
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,273,739.53
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	2,273,739.53
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-2,768,542.91
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	69,258.87
减:二、费用	4,892,722.39
1.管理人报酬	1,892,515.97
2.托管费	540,718.84
3.销售服务费	799,899.33
4.交易费用	14,306.94
5.利息支出	1,479,354.89
其中:卖出回购金融资产支出	1,479,354.89
6.其他费用	165,926.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	9,768,351.54
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	9,768,351.54

注:本期财务报表的实际编制期间为2012年9月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

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:2012年9月25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9月25日(基金合同生效日)至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)	1,946,949,191.79	-	1,946,949,191.79
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	9,768,351.54
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)	-1,560,795,781.00	-6,132,644.67	-1,566,928,425.67
其中:1.基金申购款	50,619,085.68	307,242.33	50,926,328.01
2.基金赎回款	-1,611,414,866.68	-6,439,887.00	-1,617,854,753.68
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)	386,153,410.79	3,635,706.87	389,789,117.66

注:本期财务报表的实际编制期间为2012年9月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

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

安信目标收益债券型证券投资基金(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8月7日下发的证监许可[2012]1068号文"关于核准安信目标收益债券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《安信目标收益债券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8月27日至2012年9月21日,募集结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2012)验字60962175_H05号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集743,292,609.47元,经向中国证监会备案,《安信目标收益债券型证券投资基金基金合同》于2012年9月25日正式生效,截至2012年9月25日止,安信目标收益债券型证券投资基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币1,945,633,347.77元,折合1,945,633,347.77份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币1,315,844.02元,折合1,315,844.02份基金份额。其中A类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币407,713,339.07元,折合407,713,339.07份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币320,574.11元,折合320,574.11份基金份额。C类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币1,537,920,008.70元,折合1,537,920,008.70份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币995,269.91元,折合995,269.91份基金份额。以上收到的实收基金共计人民1,946,949,191.79元,折合1,946,949,191.79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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信目标收益债券型证券投资基金合同》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国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、可分离债券、回购和银行存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购或增发新股,仅可持有因可转债转股所形成的股票、因所持有股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金应在其可交易之日起的30个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产投资比例范围为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:3个月期上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部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9月25日(基金合同生效日)起至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9月25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为债券投资。

(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全部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应计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净价估值;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