安信平稳增长混合型发起式证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年7月18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7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信平稳增长混合发起
基金主代码	750005
交易代码	750005
基金运作方式	契约型开放式发起式
基金合同生效日	2012年12月18日
报告期末基金份额总额	79,461,747.43份
投资目标	通过稳健的资产配置策略,将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置,并通过积极主动的股票投资和债券投资,把握中国经济增长和资本市场发展机遇,严格控制下行风险,力争实现基金份额净值的长期平稳增长。
投资策略	1.资产配置策略:研究与跟踪宏观经济运行状况和资本市场变动特征,分析类别资产预期收益和预期风险,根据最优风险报酬比原则确定资产配置比例并进行动态调整。 2.上市公司研究方法:以深入细致的公司研究推动股票的精选与投资。在对上市公司的研究中,采用安信基金三因素分析法,即重点分析上市公司的盈利模式、竞争优势和其所处行业的发展环境。 3.股票投资策略:坚持价值投资理念,以PE/PB等估值指标入手对价值型公司进行评估,在扎实深入的公司研究基础上,重点发掘出价值低估的股票。 4.债券投资策略:采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会。
业绩比较基准	50%×中证800指数收益率+50%×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。
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

§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4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,303,749.89
2.本期利润	-1,067,275.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0117
4.期末基金资产净值	76,264,568.21
5.期末基金份额净值	0.960

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。

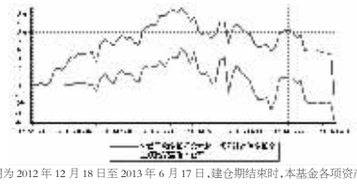
3.2 基金净值表现

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	-2.14%	0.83%	-5.22%	0.74%	3.08%	0.09%

注:业绩比较基准收益率=50%×中证800指数收益率+50%×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12月18日至2013年6月17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12月18日,基金合同生效日至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2012年12月18日至2013年6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		
汪建	本基金的基金经理、公司副总经理	2012年12月18日	-	12	汪建先生,副总经理,经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员,衍生产品部一级研究员、董事总经理,资产委托管理总部副总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理,分管投资、研究业务。
李勇	本基金的基金经理、固定收益部总经理	2012年12月18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年上半年,宏观经济仍处于弱复苏环境中,上市公司业绩逐渐恢复,增速货币政策维持中性,物价基本稳定。随着6月下旬银行间市场资金环境急转直下,股票和债券市场同时出现较大幅度调整。中证800指数大幅下跌,将1季度的反弹尽数抹去并创下数年来的新低。今年上半年股票市场呈现严重的结构性分化格局,以沪深300成分股为代表的大盘蓝筹股票表现惨淡、迭创新低,以创业板为代表的新兴成长公司有强劲的市场表现,二者表现持续严重背离。

管理人在6月初基于市场的中期判断,下调了股票类资产配置比例,一定程度减轻了市场大幅下跌的损失。但由于对新兴成长公司的预期不足,持有比例较低,因此未能获得绝对回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.960元,报告期份额净值增长率为-2.14%,同期业绩比较基准增长率为-5.22%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们预计宏观经济将继续弱复苏的过程直至年末,资金面将处于紧平衡状态,市场广谱利率将维持在偏高位置,这将持续制约市场的估值水平。随着市场二元结构的加剧,高成长公司的业绩风险和估值风险将在下半年有所体现,大盘蓝筹公司则将在较低的估值区间反复筑成中长期的底部。

§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	49,544,074.17	64.42
	其中:股票	49,544,074.17	64.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,648,421.20	21.65
	其中:债券	16,648,421.20	21.65
	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	8,233,385.79	10.71
7	其他各项资产	2,478,330.40	3.22
8	合计	76,904,211.56	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	3,626,608.09	4.76
C	制造业	18,476,407.32	24.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,911,936.00	2.51
E	建筑业	3,651,107.22	4.79
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	12,371,880.60	16.22
K	房地产业	5,781,223.66	7.58
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	3,724,911.28	4.88
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	49,544,074.17	64.96

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	601939	建设银行	1,298,400	5,388,360.00	7.07
2	000848	承德露露	159,147	3,614,228.37	4.74
3	000002	万 科A	354,659	3,493,391.15	4.58
4	601166	兴业银行	200,600	2,962,862.00	3.88
5	600887	伊利股份	90,822	2,840,912.16	3.73
6	601318	中国平安	65,838	2,288,528.88	3.00
7	600048	保利地产	230,861	2,287,832.51	3.00
8	002159	三特索道	155,500	2,214,320.00	2.90
9	002325	洪涛股份	177,000	2,106,300.00	2.76
10	600079	人福医药	79,179	2,064,988.32	2.71

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	16,648,421.20	21.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	16,648,421.20	21.83

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	1380214	13昌吉国投债	100,000	10,013,000.00	13.13
2	126011	08石化债	50,000	4,865,000.00	6.38
3	124026	12川广元	16,890	1,707,241.20	2.24
4	120483	04中石化	610	61,244.00	0.08
5	126013	08青啤债	20	1,936.00	0.00

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

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股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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股票必须先入库再买入。

5.9.3 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	165,216.59
2	应收证券清算款	1,889,090.60
3	应收股利	311,444.37
4	应收利息	109,426.13
5	应收申购款	3,152.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,478,330.40

5.9.4 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。

5.9.5 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在在流通受限情况。

§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	108,482,500.93
本报告期基金总申购份额	215,592.59
减:本报告期基金总赎回份额	29,236,346.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	79,461,747.43

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 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数(份)	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数(份)	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限(年)
基金管理人固有资金	-	-	-	-	
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	9,999,000.00	12.58%	9,999,000.00	12.58%	3
其他	-	-	-	-	
合计	9,999,000.00	12.58%	9,999,000.00	12.58%	3

注:本报告期内本基金发起资金持有份额未发生变动。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会核准安信平稳增长混合型发起式证券投资基金募集的文件;
2、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金基金合同》;
3、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金托管协议》;
4、《安信平稳增长混合型发起式证券投资基金招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

8.2 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

8.3 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
二〇一三年七月十八日

安信现金管理货币市场基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年07月18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7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信现金管理货币	
基金主代码	750006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年02月05日	
报告期末基金份额总额	197,292,424.25份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资组合,力求为投资者获得超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	1.资产配置策略。通过对宏观经济指标的跟踪和分析,并结合央行公开市场操作等情况,合理预测货币市场利率趋势变化,决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。 2.个券选择策略。考虑安全性因素,优先选择国债等高信用等级债券以规避信用风险。在满足信用评级要求的前提下,根据我公司债券评分标准对信用债券进行评分筛选,重点关注低估值品种。 3.套利策略。在保证安全性和流动性的前提下,本基金将在充分验证套利机会可行性的基础上,适当参与市场的套利,捕捉和把握无风险套利机会。 4.回购策略。密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异,在精确投资收益测算的基础上,积极采取回购杠杆操作,为基金资产增加收益。 5.流动性管理策略。在遵循流动性优先的原则下,建立流动性预警指标,动态调整基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,确保基金资产的变现能力。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
下属两级基金的交易代码	750006	750007
报告期末下属两级基金的份额总额	88,594,561.25份	108,697,863.00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04月01日-2013年06月30日)	
	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
1.本期已实现收益	1,120,752.43	726,627.29
2.本期利润	1,120,752.43	726,627.29
3.期末基金资产净值	88,594,561.25	108,697,863.00

注: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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,所以公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、安信现金管理货币A

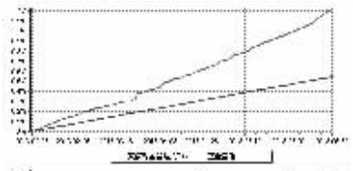
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8261%	0.0045%	0.3366%	0.0000%	0.4895%	0.0045%

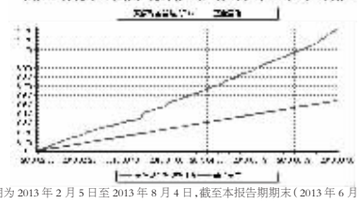
2、安信现金管理货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8871%	0.0045%	0.3366%	0.0000%	0.5505%	0.0045%

注:1、本基金收益分配为按日结转份额;
2、本基金业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2月5日至2013年8月4日,截至本报告期期末(2013年6月30日),本基金尚在建仓期。
2、本基金基金合同生效日为2013年2月5日,基金合同生效日至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2013年2月5日至2013年6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	2013年02月05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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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2季度,前期债券市场流动性充裕,呈迅速上涨态势,中债总财富(总值)指数从季初的144.47上升至4月16日的145.86。4月下旬的债市监管风波引发了二季度第一次明显的波动,指数一度下探至145.09,之后逐步恢复并平稳上升至5月底的146.19的高点。6月起,流动性逐步抽紧,央行推动市场去杠杆的态度逐步明确。至6月20号前后,市场资金异常紧张,隔夜回购一度高达30%,7天回购最高达28%,中债总财富(总值)指数急速下跌至144.36点,之后随着央行逐步释放流动性,市场迅速好转,至6月28号,指数回升至145.66,收复了前期跌幅的2/3以上。

2季度前期,在债券市场持续上涨的趋势下,我们顺势而为,扩大了基金收益。2季度后期,我们预见到6月底的流动性紧张局面,在5月份已经获利丰厚的情况下,进行了降低杠杆和缩减久期的操作,提前做好防御工作,平均仓位显著低于同业,预留了较充裕的流动性。虽然在6月下旬我们仍不可避免的受到一定程度的冲击,但净值回撤较小,在市场最恐慌,债市暴跌的艰难时期,我们依然确保了2季度收益始终为正,并在之后债市回升行情中,我们的净值实现了"V"型修复。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金A类份额净值为1.017元,本基金C类份额净值为1.013元。本报告期本基金A类份额净值增长率为0.77%,本基金C类份额净值增长率为0.67%,同期业绩比较基准增长率为1.05%。基金业绩分别超过同期比较基准-0.28%和-0.38%。

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3季度,宏观经济增速长期放缓趋势日渐明朗,PPI长期负增长的背景下,CPI也将受到一定的抑制,甚至面临一定的通缩风险。虽然短期内,监管层的监管政策将给市场带来一定的不确定性,但我们认为经济基本面将对债市形成较有利的支撑。在投资策略上,我们将做好市场的研究工作,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	固定收益投资	100,087,508.41	45.99
	其中:债券	100,087,508.41	45.99
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	49,600,284.40	22.79
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	66,141,905.53	30.39
4	其他资产	1,790,272.10	0.82
5	合计	217,619,970.44	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.45
	其中:买断式回购融资	0.00%
序号	项目	金额 / 占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	- / -
	其中:买断式回购融资	- / -

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2013年05月08日	20.28	基金赎回	2个交易日
2	2013年05月09日	20.60	基金赎回	1个交易日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	123
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2013年05月03日	123	由于持有的浮动利率债券调息导致该债券剩余期限重新计算	2个交易日
2	2013年05月06日	123	由于持有的浮动利率债券调息导致该债券剩余期限重新计算	1个交易日

注:本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金基金合同的约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	68.90	10.14
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	25.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	15.25	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	15.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	109.40	10.14

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,089,192.38	15.25
	其中:政策性金融债	30,089,192.38	15.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	69,998,316.03	35.48
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	100,087,508.41	50.73
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,089,192.38	15.25

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130211	13国开11	300,000	30,089,192.38	15.25
2	011316002	13华电股SCP002	200,000	20,000,107.17	10.14
3	071314001	13银河CP001	200,000	19,999,442.63	10.14
4	041359025	13三江化工CP001	100,000	10,000,355.38	5.07
5	041359039	13镇城投CP001	100,000	10,000,066.57	5.07
6	041360033	13青国信CP002	100,000	9,998,344.28	5.07

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	6
报告期内偏离度的最高值	0.0663%
报告期内偏离度的最低值	-0.3967%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0727%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例	原因	调整期
1	2013年05月07日	22.19	大额赎回	8个交易日
2	2013年05月30日	20.01	大额赎回	2个交易日
3	2013年06月04日	20.13	大额赎回	10个交易日

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	903,017.93
4	应收申购款	887,254.17
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	1,790,272.10

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	安信现金管理货币A	安信现金管理货币B
报告期期初基金份额总额	224,018,537.48	44,230,324.94
报告期期间基金总申购份额	43,646,860.46	129,257,385.71
报告期期间基金总赎回份额	179,070,836.69	64,789,847.65
报告期期末基金份额总额	88,594,561.25	108,697,863.00

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 备查文件目录

7.1 备查文件目录
1、中国证监会核准安信现金管理货币市场基金募集的文件;
2、《安信现金管理货币市场基金基金合同》;
3、《安信现金管理货币市场基金托管协议》;
4、《安信现金管理货币市场基金招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

7.2 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

7.3 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
二〇一三年七月十八日

安信目标收益债券型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30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
报告送出日期:2013年7月18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7月16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4月1日起至6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	273,754,148.94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	66,244,331.97份	207,509,816.97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4月1日-2013年6月30