安信宝利分级债券型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014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
送出日期:2014年08月28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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月25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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	安信宝利分级债券	
场内简称	宝利B	
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07月24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	
报告期末基金份额总额	1,294,453,684.65份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2013-10-21	
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	294,305,951.71份	1,000,147,732.94份

2.2 基金产品说明

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。	
下属两级基金的风险收益特征	宝利A具有低风险、预期收益适中的特征。	宝利B具有风险适中、预期收益较高的特征。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙晓奇	赵会军
	联系电话	0755-82509908	010-66105799
	电子邮箱	sunxq@essencefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95588
传真		0755-82799292	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年01月01日-2014年06月30日)
本期已实现收益	43,938,867.81
本期利润	98,067,322.84
加权平均基金份额本期利润	0.0642
本期基金份额净值增长率	5.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0219
期末基金资产净值	1,351,718,929.13
期末基金份额净值	1.0440

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。

3.2 基金净值表现

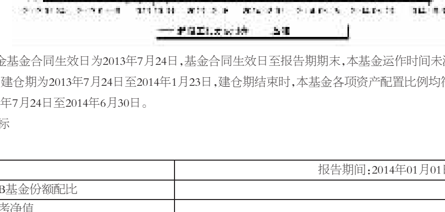
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去一个月	0.87%	0.11%	0.42%	0.07%	0.45%	0.04%
过去三个月	4.19%	0.19%	2.42%	0.09%	1.77%	0.10%
过去六个月	5.85%	0.24%	4.07%	0.08%	1.78%	0.16%
自基金合同生效日起至今(2013年07月24日-2014年06月30日)	5.96%	0.18%	-0.02%	0.09%	5.98%	0.09%

注:1、根据《安信宝利分级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中债综合指数。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。

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。表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为2013年7月24日至2014年6月30日间各自的实际数值。

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、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。

2、本基金的建仓期为2013年7月24日至2014年1月23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。图示日期为2013年7月24日至2014年6月30日。

3.3 其他指标

单位:人民币元

其他指标	报告期间:2014年01月01日-2014年06月30日
宝利A与宝利B基金份额配比	0.29426248:1
期末宝利A参考净值	1.023
期末宝利A累计参考净值	1.046
期末宝利B参考净值	1.051
期末宝利B累计参考净值	1.051
宝利A年收益率(单利)	4.5%(2014.1.1-2014.1.23); 5.20%(2014.1.24-2014.6.30)

注:根据本基金基金合同的规定,宝利A的年收益率将在每次开放日设定一次并公告。

§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3.5亿元人民币,股东及股权结构为:安信证券股份有限公司持有52.71%的股权,五矿资本控股有限公司持有38.72%的股权,中广核财务有限责任公司持有8.57%的股权。

截至2014年6月30日,本基金管理人共管理8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;从2013年2月5日起管理安信现金管理货币市场基金;从2013年7月24日起管理安信宝利分级债券型证券投资基金;从2013年11月8日起管理安信永利信用定期开放债券型证券投资基金;从2013年12月31日起管理安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金;从2014年4月21日起管理安信价值精选股票型证券投资基金。

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07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。2012年5月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理助理;现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,安信宝利分级债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理。
魏晓菲	本基金的基金经理助理	2013年08月09日	—	8	魏晓菲女士,法学硕士。先后在安信证券股份有限公司、安信基金管理有限责任公司工作,现在安信基金管理有限责任公司固定收益部从事固定收益类投资工作。现任安信现金管理货币市场基金的基金经理助理。

注:1、本基金基金经理庄园的"任职日期"按基金合同生效日填写;基金经理助理魏晓菲的"任职日期"根据公司决定确定的聘任日期填写。

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》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定,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。

4.3.2 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。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年安信宝利分级基金经历了A类的第一次开放,由于开放日在春节前期,市场资金利率维持高位,虽然下一期的约定利率较前期有较大幅度的提高,A类仍然赎回巨大。赎回后分级杠杆降低,回购杠杆提高,上半年我们对债券市场判断比较乐观,操作上也基本保持了组合的较高杠杆。上半年资金成本相比去年大幅降低,在资金面宽松的环境下维持的杠杆比例获得了一定的增厚收益,再加上收益率下行带来的资本利得,上半年宝利母基金净值增长了5.85%,宝利B净值增长了8.91%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金的基金份额净值为1.047元,报告期内收益率为5.85%,同期业绩比较基准收益率为4.07%,超过同期业绩比较基准1.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年债券市场将受到几个重要因素的影响:目前宏观经济的一些先行指数已经出现向好的趋势,未来基本面是否探底回升进而货币政策是否会有所收紧,将直接影响债市的走势;相关监管机构对市场规则的调整节奏和力度也会继续对债券细分市场产生很关键但不确定性较大的影响;股票市场IPO再次重启,对资金面的影响已经显现,资金利率的波动性以及价格中枢均会高于上半年。在不确定因素增多的情况下市场机构的心态也会发生变化,落袋为安锁定收益的情绪会抬升,进一步弱化买盘力量。安信宝利分级基金将在三季度迎来A类的第二次开放,此次开放后A类的最新规模将对产品杠杆有直接的影响,基金的投资策略也将根据最新规模进行相应的调整,优化组合结构。

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》开展。

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,投资部门相关人员列席。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全程讨论、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。投资部门相关人员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

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况,本基金本报告期无需进行利润分配。在符合分红条件的前提下,本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分,将严格按照本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

本报告期内,本基金托管人在对安信宝利分级债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,安信宝利分级债券型证券投资基金的管理人--安信基金管理有限责任公司在安信宝利分级债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,安信宝利分级债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信宝利分级债券型证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:安信宝利分级债券型证券投资基金

报告截止日:2014年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年06月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	2,327,882.93	1,064,423,248.85
结算备付金	70,492,993.00	57,351,994.63
存出保证金	11,645.52	194,463.64
交易性金融资产	2,768,809,026.83	2,964,707,311.05
其中:股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	2,768,809,026.83	2,964,707,311.05
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	266,695,550.04
应收证券清算款	7,743,615.04	3,495,315.60
应收利息	91,086,155.27	60,762,013.02
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	2,940,471,318.59	4,417,629,896.83
负债和所有者权益	本期末 2014年06月30日	上年度末 2013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	1,578,600,901.50	1,482,576,870.60
应付证券清算款	8,003,536.52	3,864,899.29
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	775,850.02	1,742,451.41
应付托管费	221,671.43	497,843.25
应付销售服务费	554,178.61	1,244,608.18
应付交易费用	3,715.38	12,939.65
应交税费	—	—
应付利息	318,131.29	804,469.84
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	274,404.71	131,666.67
负债合计	1,588,752,389.46	1,490,875,748.89
所有者权益:		
实收基金	1,287,925,466.48	2,923,915,682.14
未分配利润	63,793,462.65	2,838,465.80
所有者权益合计	1,351,718,929.13	2,926,754,147.94
负债和所有者权益总计	2,940,471,318.59	4,417,629,896.83

注:报告截止日2014年6月30日,安信宝利A基金份额净值人民币1.023元,安信宝利B基金份额净值人民币1.051元,基金份额总额1,294,453,684.65份,其中安信宝利A基金份额294,305,951.71份,安信宝利B基金份额1,000,147,732.94份。

6.2 利润表

会计主体:安信宝利分级债券型证券投资基金

本报告期:2014年01月01日-2014年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期2014年01月01日-2014年06月30日
一、收入	138,557,814.46
1.利息收入	86,227,882.74
其中:存款利息收入	6,117,071.54
债券利息收入	78,442,327.60
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	1,668,483.60
其他利息收入	—
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,798,523.31
其中:股票投资收益	—
基金投资收益	—
债券投资收益	-1,798,523.31
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
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)	54,128,455.03
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	—
5.其他收入(损失以"-"号填列)	—
减:二、费用	40,490,491.62
1. 管理人报酬	5,284,729.79
2. 托管费	1,509,922.81
3. 销售服务费	3,774,806.96
4. 交易费用	7,639.25
5. 利息支出	29,612,181.49
其中:卖出回购金融资产支出	29,612,181.49
6. 其他费用	301,211.32
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	98,067,322.84
减:所得税费用	—
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	98,067,322.84

注:本基金合同生效日为2013年7月24日,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信宝利分级债券型证券投资基金

本报告期:2014年01月01日-2014年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年01月01日-2014年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,923,915,682.14	2,838,465.80	2,926,754,147.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	98,067,322.84	98,067,322.84
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)	-1,635,990,215.66	-37,112,325.99	-1,673,102,541.65
其中:1.基金申购款	2,355,564.19	53,435.81	2,409,000.00
2.基金赎回款	-1,638,345,779.85	-37,165,761.80	-1,675,511,541.65
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)	1,287,925,466.48	63,793,462.65	1,351,718,929.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

刘入领 基金管理公司负责人	姜志刚 主管会计工作负责人	尚尔航 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

安信宝利分级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")2013年下发的证监许可[2013]673号文"关于核准安信宝利分级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《安信宝利分级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。

本基金宝利B募集期间为2013年6月24日至2013年7月12日,宝利A募集期间为2013年7月8日至2013年7月19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(2013)验字60962175_H02号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,923,134,980.80元。经向中国证监会备案,《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》于2013年7月24日正式生效。截至2013年7月24日止,安信宝利分级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2,923,134,980.80元,折合2,923,134,980.80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780,701.34元,折合780,701.34份基金份额。其中宝利A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1,923,134,993.17元,折合1,923,134,993.17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632,956.03元,折合632,956.03份基金份额;宝利B已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币999,999987.63元,折合999,999987.63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147,745.31元,折合147,745.31份基金份额。以上收到的实收基金共计人民2,923,915,682.14元,折合2,923,915,682.14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,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金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、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券(含可分离交易的可转换债券)、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金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可参与一级市场新股的申购或增发,以及可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资可分离交易可转债而产生的权证等。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为:债券的投资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中债综合指数。

6.4.2 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3号《半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。

6.4.3 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2014年6月30日的财务状况以及自2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税 [2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司(以下简称"安信基金")	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司(以下简称"安信证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.1.4 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.5 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2014年01月01日-2014年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,284,729.79
其中:支付销售机构的客户维护费	2,029,999.17

注:在基金合同生效之日起2年内或基金合同生效后2年期届满转为上市开放式基金后,本基金的管理费均按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.70%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2014年01月01日-2014年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,509,922.81

注:在基金合同生效之日起2 年内或基金合同生效后2年期届满转为上市开放式基金(LOF)后,本基金的托管费均按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金财产净值

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年01月01日-2014年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝利A	宝利B	合计
中国工商银行	1,243,747.92	418,757.92	1,662,505.84
安信基金直销	144.00	524,083.61	524,227.61
安信证券	4,013.40	960,373.36	964,386.76
合计	1,247,905.32	1,903,214.89	3,151,120.21

注:基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。在基金合同生效之日起2年内,本基金的基金销售服务费均按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。基金合同生效后2年期届满自动转换为"安信宝利债券型证券投资基金(LOF)"后,不再收取销售服务费。计算方法如下:

H=E×0.50%/当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日基金财产净值

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人本期末运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称		本期末 2014年06月30日		上年度末 2013年12月31日	
		持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
宝利B	安信证券	100,013,500.00	7.73%	100,013,500.00	3.42%
宝利B	中广核财务有限责任公司	30,004,050.00	2.32%	30,004,050.00	1.03%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年01月01日-2014年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,327,882.93	131,000.53

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 利润分配情况

本基金本期末进行利润分配。

6.4.10 期末(2014年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于年末流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0元,无抵押债券。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,578,600,901.50元,分别于2014年7月1日、2014年7月2日及2014年7月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§7 投资组合报告

7.1 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	固定收益投资	2,768,809,026.83	94.16
	其中:债券	2,768,809,026.83	94.16
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
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	72,820,875.93	2.48
7	其他各项资产	98,841,415.83	3.36
8	合计	2,940,471,318.59	100.00

7.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 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	20,090,000.00	1.49
	其中:政策性金融债	20,090,000.00	1.49
4	企业债券	2,143,133,757.56	158.55
5	企业短期融资券	60,540,000.00	4.48
6	可转债	9,260,269.27	0.69
7	其他	—	—
8	合计	2,768,809,026.83	204.84

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	122266	13中信03	1,300,820	130,199,073.80	9.63
2	101354016	13陕交建MTN002	1,000,000	101,740,000.00	7.53
3	122033	09富力债	999,480	100,507,708.80	7.44
4	122830	11沈国资	848,210	86,856,704.00	6.43
5	124408	13宛城投	800,000	81,248,000.00	6.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.10.1 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	11,645.52
2	应收证券清算款	7,743,615.04
3	应收股利	—
4	应收利息	91,086,155.27
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	98,841,415.83

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
宝利A	2,588	113,719.46	—	—	294,305,951.71	100.00%
宝利B	3,442	290,571.68	433,238,182.59	43.32%	566,909,550.35	56.68%
合计	6,030	214,668.94	433,238,182.59	33.47%	861,215,502.06	66.53%

注:机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	安信证券股份有限公司	100,013,500.00	10.00%
2	中广核财务有限责任公司	30,004,050.00	3.00%
3	安信证券瑞安债券分级集合资产管理计划	23,905,059.00	2.39%
4	全国社保基金一零零二组合	21,979,806.00	2.20%
5	张洪梅	20,003,110.00	2.00%
6	全国社保基金一零零五组合	19,472,897.00	1.95%
7	海康人寿保险有限公司	18,520,942.00	1.85%
8	光大证券-光大-光大阳光避险增值集合资产管理计划	17,178,553.00	1.72%
9	招商基金-光大银行-瑞泰债券分级1号资产管理计划	16,838,351.00	1.68%
10	江苏汇鸿国际集团中锦控股有限公司	15,936,706.00	1.59%

注:本基金宝利B份额为在场内上市交易的基金份额,宝利B持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	宝利A	—	—
	宝利B	4,227,319.83	0.42%
	合计	4,227,319.83	0.33%

注:从业人员持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	宝利A	0
	宝利B	>=100
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	宝利A	0
	宝利B	>=100
	合计	>=100

§9 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(2013年07月24日)基金份额总额	1,923,767,949.20	1,000,147,732.94
本报告期期初基金份额总额	1,923,767,949.20	1,000,147,732.94
本报告期基金总申购份额	2,409,000.00	—
减:本报告期基金总赎回份额	1,675,511,541.65	—
本报告期基金拆分变动份额	43,640,544.16	—
本报告期期末基金份额总额	294,305,951.71	1,000,147,732.94

注:本基金合同生效日为2013年7月24日,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A级于2014年1月23日首次开放并进行份额拆分。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券有限责任公司	2	—	—	438,231,570.90	100.00%	77,447,435,000.00	100.00%	—	—	—	—	

注:公司制定《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》,对选择证券公司的标准和程序、以及佣金分配规则进行了规定。

根据上述制度,由公司基金投资部、固定收益部、研究部、特定资产管理部、分管投资的副总经理及交易室于每季度末对券商进行综合评分,评价标准包括研究及投资建议的质量、报告的及时性、服务质量、交易成本等,由公司基金投资决策委员会根据评分结果对下一季度的证券公司名单及佣金分配比例做出决议。首只基金成立后最初半年的券商选择及佣金分配由基金投资决策委员会决定。

安信基金管理有限责任公司

二〇一四年八月二十八日