

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:2016年3月25日

透出日期;2016年3月25日
基金管理人的董事全,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 和完整性系担个别及连带的注律责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事客字同意,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2016年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、 末期分配情况,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,误判性陈述或者重大遗漏。 基金管理人或形设读定信用、影影尽劳的原则管理和应用基金资产但不停证基金一定置利。 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

本年度报告無要摘自年度报告正文,投资者欲了解消期内容,应阅读年度报告正文。 本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所待殊普通合伙为本基金出具了2015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2015年1月1日起至12月31日止。

41KD701D2013-F1711D102-127131	§ 2 基金简介
2.1 基金基本情况	
基金简称	安信宝利(LOF)
场内简称	安信宝利
基金主代码	167501
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年7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	1,741,475,728.39(/)
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
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。但购策略,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,无选度控制风险的基础上,通过信用分析取付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。

2.3 基金管理人和法	基金托管人	·	
项	E	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
	姓名	乔江晖	洪渊
信息披露负责人	联系电话	0755-82509999	010-66105799
	电子邮箱	service@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		·	

3.1 主要会计数据和财务指标

.1.1 期间数据和指标 2015年 2014年 效日)-2013年12月31日 238,015,681 2,838,465.8

福田区益田路6009号新世界商务中心

3.1.2 期末数据和指标 2015年末 2014年末 2013年末 明末基金资产净值 1,804,377,800 注:1.基金业绩指标不包括特有人认(申)购或交易基金的各项费用,计人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)和除相关费用后的余额,本期和

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数低数

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

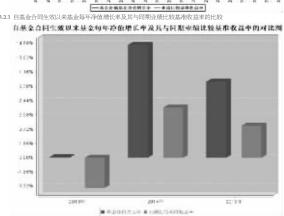
法金年度报告备置地点

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	0-3	2-4
过去三个月	1.58%	0.09%	1.81%	0.08%	-0.23%	0.019
过去六个月	4.37%	0.08%	2.95%	0.07%	1.42%	0.019
过去一年	9.92%	0.08%	4.19%	0.08%	5.73%	0.009
自基金合同生效 起至今	26.21%	0.13%	6.64%	0.10%	19.57%	0.039

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 、本基金基金合同生效日为2013年7月24日,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2015年12月31

公中海海岛並且同主政日为2017年7月2日,後午月为岛並及並須に収益。1817年7月2日 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

基金价值居计净值增长率与问别业绩比较基准收益率的历史走势对比例 337.5 161390 0.01% 自基金合同生效以末基金每年净值增长率及其与回期业损比较基准收益率的对比图



3年7月24日成立,截至本报告期末尚未进行利润分配

\$ 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
安信基金管理有政府任公司经中国证益会批准,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
结场为,五万%在股财和股公前持有38.7%的股权。安信证券股份有限公司持有33%的股权,佛山市颠德区所碧贸易有限公司持有19.71%的股权,中广核财务有限责任公司持有8.57%的股权。

特有19.7%到速权、甲,核则分有限页比公司均有8.2%的速程。 截至2015年1月31日、基准金管理人共营理17月开放式基金,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 混合型证券投资基金;从2012年9月5日起管理安信目标以益债券型证券投资基金;从2012年12月18日高管理安信平稳增长程。 合型发起式证券投资基金;从2013年9月5日起管理安信现金管理货币市场基金;从2013年7月24日起管理安信实有债券型证券投资基金 投资基金(LOF) 原安信宝利分级债券型证券投资基金;从2013年1月8日起管理安信》和信用定期开放债券型证券投资 基金;从2013年12月31日起管理安信愈发优法是活配置混合型证券投资基金;从2014年1月21日起管理安信价值精选股票型证券投资基金;从2014年11月24日起管理安信现金维利货币市场基金;从2015年3月19日起管理安信消费医药主题股票型证券投资基金;从2015年1月5日起管理安信或企策略灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月25日起管理安信 整金余;从2015年1月15日起管理安信态定策略灵活起置混合型证券投资基金;从2015年3月1日起管理公司企业等投资基金;从2015年5月25日起管理安信指数增长灵活也置混合型证券投资基金;从2015年5月25日起管理安信指数计算工资金。 7日起管理安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金;从2015年11月24日起管理安信新动力灵活配置混合型证券投资基金; 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		≥经理(助理)期 艮	证券从业年限	说明
		任职日期	密任日期	PUC	
庄园	本基金的基金经理	2013年7月24日	-	11	国國立土然於學硕士、原在招願基金管理有限公司投資部交易民,工報報告金管實有限公司投資都交易民,工報報告金管實有限公司投資都交易民,研究部等於是、中国国际金融有限公司资产管理高高级经验经理。 安计证多数投资经验理。安计率与加入安心证金的发验的经验,安计等期间或设验的是一个企业,现代证金专用,现任公司固定收益部、曾任安估率能增长混合型,现任安计额障碍形式主题保护的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的
刘献荣	本基金的基金经理助理	2015年3月9日	2015年7月29日	8	刘献荣女士,经济学硕士。历任中国建设银行青岛市分行中山路支行信贷员,联合资信评估有限公司工商企业部分析师,安信基金管理有限责任公司固定收益部研究员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理。
魏晓菲	本基金的基金经理助理	2013年8月9日	2015年3月9日	8	觀察斯女士, 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, 現在 安信基金管理有限责任公司团座位 當場 事間 安收益表投资工作, 現任安信目标收益债券型 信条付信用定期开始信券型证券投资基金。安信第金管理货币市场基金。安 信乘台槽到货币市场基金、安信愈能增值灵活 配置混合型证券投资基金的基金经理助理。

注:1.益遊至連即 计项目别 按查查管间生双口填与:益遊空裡與應的 计项目别 根据公司决定侧定的判址 "高任日期"根据公司决定的态兮。任金门日期境写。 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》、《公开募集证 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 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

4-3.1 公干交易则原料定则力法 本基金管理人果用T值能验等统计方法,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口内、三个交易口内、五个交易口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。

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

交來少的单边交易量未超过该证券当日放定量的9%。
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
4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
总体来看。2015年的债券市场继续走出了牛市行情,主要受基本面,政策面和资金情况等多方面的影响。2015年中国经济
克苏动能整体上较弱,经济在L型底部徘徊;同时头际通货膨胀较低,央行构建利率走廊维护资金面,通过多次降准降息以及
MLF、SLO、公开市场递回购等维持充格的流动性。中国实施投给制成常、出活过剩产能、实体经济盈利效局,银行情发。
金以及配资、理财等资金也进人债市避险,资金持续流入债券市场。
市场方面(债市资金供给增多、导致债券租置需求大幅上升,利率债和信用债需求扩大,收益率大幅下行。10年国开债突
%%。任用总统加限到益长的数据。即周尚差的数据。1000年的统制。2015年

破3%,信用利差和期限利差均缩窄。期间美联储加息、人民币持续贬值,外汇储备下降,IPO重启,债券收益率略微回调,但依旧不改做多热情,维持着债券单边牛市行情。 上半年,安信宝利分级基金择机加杠杆增持了部分短久期信用债,少量参与了一级市场的转债申购,以提高组合收益:7

安信宝利债券型证券投资基金(LOF)

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

截至2015年12月31日,本基金的基金份额净值为1.036元,报告期内收益率为9.92%,同期业绩比较基准收益率为4.19%,超

过同期业绩比较基准5.73%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 4. 百程人以宏观经示、证券印物及了型定势均同安展室中国实施供给衡收革持使数据使不大。同时我们生实施供给衡收革将使得宏观经济短期内触赎回升的概率不大,央行构建利率走廊将会使利率波动幅度不大。同时我们也关注到美国非农数据转杂改善,再次加息预期上升,人民而持续聚造将对债券市场产生影响,央行为稳定汇率而暂停全面宽松的货币政策。国家出台的财政刺激政策可能使经济边际改善,明年利率债和信用债的大幅增发可能对债市形成压力。

预计明年资本市场将持续震荡,我们对明年债券市场持谨慎乐观态度。

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 时准确对基金资产估值事项进行基金估值。运营都对基金所使用的估值系统进行总体规划所组织实施、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。 保证公司估值业多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信估方法,以保证其特 统适用,估值委员会议决议资经会体委员件数以上投票表决同意介能通过,并成功有工资中差异径。对于重大事项,应在

赛运用。价值委员会会议决议观验全保委员干额处上投票表决问意方能绝过,并形成书面文件夹著除害。对于重大事项。起 充分证果监管机构,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。估值政策和程序的能订签估值委员会审 批通过后方可实施。 估值委员会中总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注规的 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 报分析的结果建议应定用的估值方法及全理的估值区间。研究部根据估值委员会提出的多种估值方法预查。利用金融工程研 按任务互格经过和整理标准等处了里(当社工程的任任法计划、任任被制建设法等数,并任金基金与自地公会的 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 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

条机构态约。 4.7 管理人对报告期内基金和阔分配情况的说明 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。 4.8 报告期内管理人对本基金特有人数或基金资产净值预警情形的说明 +出生地出土。 + 4 年本上组市法检查44个不但工业会价额继续有关了影响负责进金资产净值低于5000万元人民币的情形。 本报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金资产净值低于5000万元人民币的情形。

§ 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、本基金托篮人产业

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

9月77日。 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

5.3 托古人对本年度报告中明务信息等内容的真实,准确机完整发表意见 本托管人依法对安信基金管理有限进任公司编制和披露的安信室利债券型证券投资基金(LOF)2015年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。 5.6 审计报告 安水华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了信室利债券登证券投资基金(LOF)财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表。2015年12月31日的资产负债表。2015年12月31日的资产负债表。2015年12月31日的资产负债表。2015年12月31日的资产负债表。2015年12月31日的资产负债表。2015年12月31日的资产负债表。2015年12月31日的资产有限表现的审计报告全文。 第7年度财务报表

计主体:安信宝利债券型证券投资基金(LOF)

报告截止日: 2015年12月31日

	単
本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:		
银行存款	8,687,085.27	564,674,784.3-
结算备付金	124,556,566.67	111,210,892.3
存出保证金	44,411.61	113,246.78
交易性金融资产	2,867,668,299.48	3,026,083,065.29
其中:股票投资	=	=
基金投资	_	-
债券投资	2,867,668,299.48	3,026,083,065.29
资产支持证券投资	_	-
贵金属投资	_	-
衍生金融资产	_	-
买人返售金融资产	_	246,255,049.39
应收证券清算款	16,717,901.14	-
应收利息	52,017,576.29	59,382,666.88
应收股利	-	-
应收申购款	80,473.80	-
递延所得税资产	_	-
其他资产	15,435,836.07	-
资产总计	3,085,208,150.33	4,007,719,704.99
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	1,259,300,000.00	1,511,027,625.00
应付证券清算款	16,001,009.53	458,894,814.2
应付赎回款	3,953,491.59	-
应付管理人报酬	1,105,419.91	1,203,426.2
应付托管费	315,834.28	343,836.0
应付销售服务费	-	859,590.1
应付交易费用	36,893.38	4,902.8
应交税费	-	-
应付利息	4,751.17	58,465.1
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	112,950.08	301,666.6
负债合计	1,280,830,349.94	1,972,694,326.3
所有者权益:	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
实收基金	1,486,218,902.47	1,823,983,719.3
未分配利润	318,158,897.92	211,041,659.2
所有者权益合计	1,804,377,800.39	2,035,025,378.6
负债和所有者权益总计	3,085,208,150.33	4,007,719,704.9

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	293,997,239.67	302,159,053.92
1.利息收入	209,108,823.22	195,705,681.47
其中:存款利息收入	20,662,520.46	7,499,289.16
债券利息收入	183,917,668.93	186,066,806.09
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收入	4,528,633.83	2,139,586.22
其他利息收入	_	
2.投资收益(损失以"-"填列)	59,723,820.14	1,947,485.50
其中:股票投资收益	_	1
基金投资收益	_	
债券投资收益	59,723,820.14	1,947,485.50
资产支持证券投资收益	-	
贵金属投资收益	_	
行生工具收益	-	
投利收益	_	
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	24,764,596.45	104,505,886.95
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	=	
5.其他收入(损失以"-"号填列)	399,999.86	
域:二、费用	55,981,558.30	83,140,511.77
1. 管理人报酬	18,344,364.76	11,994,144.77
2. 托管费	5,241,247.14	3,426,898.43
3. 销售服务费	7,471,834.21	8,567,246.28
 交易费用 	33,219.33	16,465.62
5. 利息支出	24,357,716.26	58,540,141.94
其中:卖出回购金融资产支出	24,357,716.26	58,540,141.94
5. 其他费用	533,176.60	595,614.73
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	238,015,681.37	219,018,542.15
咸:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	238,015,681.37	219,018,542.15

会计主体:安信宝利债券型证券投本报告期:2015年1月1日至2015年1	资基金(LOF)		
TIKE 3/1.2013 1/11 E Z2013 1	2/13414		单位:人民
项目	2015	本期 年1月1日至2015年12月31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)	1,823,983,719.35	211,041,659.26	2,035,025,378.61
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期利润)	-	238,015,681.37	238,015,681.37
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)	-337,764,816.88	-130,898,442.71	-468,663,259.59
其中:1.基金申购款	2,762,016,298.31	402,599,207.72	3,164,615,506.03
2.基金赎回款	-3,099,781,115.19	-533,497,650.43	-3,633,278,765.62
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)	1,486,218,902.47	318,158,897.92	1,804,377,800.39
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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)	-	219,018,542.15	219,018,542.15
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)	-1,099,931,962.79	-10,815,348.69	-1,110,747,311.48
其中:1.基金申购款	732,952,590.14	35,893,744.78	768,846,334.92
2.基金赎回款	-1,832,884,552.93	-46,709,093.47	-1,879,593,646.40
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)	1,823,983,719.35	211,041,659.26	2,035,025,378.61
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:

_____刘人领____ 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

问债券型证券投资基金(LOF)(原"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

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。 本基金宝和6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 安长/年明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出县安长/年明(2013验至60962175,1402号验资报告。首庆设立募集不包括的 财资全利息共享集人民币2525.1345888.0万。经向中国证法金各案、《安信市分份领债季型证券投资基金基金合同》于2013年 7月24日正代生效、截至2013年7月24日止,安信至利债券型证券投资基金合业到的首次发售资本等。 后的争认购金额为人民币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

折算基准日,宝利A折算前的基金份额总额为294,305,951.71份份,折算比例为1.02578630,折算后的基金份额总额为301,895 013.68份。2015年1月23日为宝利A的第3个基金份额折算基准日,宝利A折算前的基金份额总额为864,250,243.85份,折算比例为 1.02621370,折算后的基金份额总额为886,905,439.28份。2015年7月23日为宝利A的第4个基金份额折算基准日,宝利A折算前的 基金份额总额为1,473,413,135.12份,折算比例为1.02578630,折算后的基金份额总额为1,511,407,010.26份。宝利B的份额未发生

额为651,050,253.71份,折算比例为1.000142466;宝利B折算前的基金份额总额为1,000,147,733.94份,折算比例为1.264009622。折

算后,宝利(LOF)总份额为1,915,339,364.17份。 安信宝利(LOF)于2015年8月7日经深圳证券交易所深证上[2015]379号文核准同意在深圳证券交易所上市交易,上市交易 份额为657,302,696.00份额。未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流

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 本基金投资流域为具有良好流水性的金融上具。包括国内依法按广工市的国域、果订票据、地方政府情、金融帧、公司帧、 企业债、中期课机、规则融资券、资产支持证券。可转换债券、信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人股票、权证等权益类资产,但可参 与一级市场新股约申顺政增发、以及可持有因可转债特股所形成的股票。因前待费票新浓发的权证和即投资可分离交易可转 倾而产生的农业等。如法律法规或监管的执行后允许基金投资性危困,基金管理人履行益量厚斥。可以转从投资范 图,其设计价遵循图时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产设计例为;债券的投资比例不低于基金资产的80%;现 6年2年2月12年,是日比约在海流水分比。例次上7年3年大金企业资产设计例为;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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则,其后颁布的应用指 本财务报表系按照政部颁布的《企业会计准则》—基本准则》以及北后颁布及修订的具体会计准则,其后颁布的应用指 ,解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则"的编制。同时、对于在具体会计核源和信息披露方面。此等了中国证 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 信息披露管理办法》、《证券投资基金指示企业会计准则》后值业多及份额申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等理办法》、《证券投资基金信息披露外客与格式准则》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模较第3号《年度报告和半年度报告》》,其 他中国证监会及中国证券投资基金业协会简布的相关规定。

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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成

7.4.4 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的说明

7.4.4 本格古则所采用的空时效果。会计估计与最近一则中度报告相一致的规则 本据告期所采用的会计数策。会计估计与最近一则中度报告相一致。 7.4.5 会计政策を更短说明 木基企本报告即无需要设则的会计政策变更。 7.4.5.2 会计估计变更的说明 本基企本报告期限用电阻还券投资基金业协会中基协发(2014)24号(关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作 法于2015年(基础限定增长)是每的结合的理论等。40 通知 (6 相信) 小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知)的规定,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5.3 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。

7-4.6.1 印化稅 证券(股票)交易印花稅稅率为1%。由出让方缴纳。 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,暂免征收印花稅。 7-4.6.2 营业稅,企业所得稅 以发行基金方式聚集资金不属于营业稅征收范围,不征收营业稅。 证券投资基金人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 付,那不200%。2004年

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

7.4.6.3 个人所得税

个人所得稅原率为20%。 基金取得的股票的股息, 紅利收入, 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和代缴个人所得税。 基金从上市公司分配取得的股息证利的得, 持赎期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得金额计人应纳税所得额, 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的。减按20%计入应纳税所得额, 持股期限过1年的。减按22%计入应纳税所得额。 根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税(2015)101号文(关于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2018年9月8日起, 证券投资基金从公开发行和转上市场取得的上市公司股票, 持股期限超过1年的, 股息红利

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

日元地水阳和针别小型即得个人即得积息。 根期财政部、国家股务息局财税字[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。 7-47 羊膝 芹羊系

基金管理人、基金销售机构 基金托管人、基金销售机构 基金管理人的股东、基金销售机构
基金管理人的股东、基金销售机构
基金管理人的股东
基金管理人的股东
基金管理人的股东
基金管理人的子公司
基金管理人子公司的子公司

2) 本基金管理人的子公司安信乾盛财富管理(深圳)有限公司于2015年11月3日设立了全资子公司安信乾正股权投资

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1 趙亞天耿·刀×四年·ルム・ル・・・・
7.4.8.1.1 股票交易
本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易 本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易 本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。 本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,344,364.76	11,994,144.77
其中:支付销售机构的客户维护 费	2,907,425.68	3,904,424.46
注:在基金合同生效之日起2年 资产净值的0.70%年费率计提。计算 H=E×0.70%/当年天数 H为每日应计提的基金管理费		开放式基金后,本基金的管理费均按前一日基金

7.4.8.2.2 基金托管费

H为每日应计提的基金托管费

	单位:人民行
获得销售服务费	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费
安信基金直销	1,744,211.99
工商银行	864,749.22
安信证券	410,172.15
合计	3,019,133.36
获得销售服务费	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费
安信基金直销	1,098,386.46
工商银行	2,489,211.92
安信证券	1,602,484.37
合计	5,190,082.75

H为每日应计提的基金销售服务费 日为現日似口境的海站即1800k27以 E为前一日的基金财产净值 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。 本基金的管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金

+h 15h}- 57 5ha	本期末 2015年12月31日	I
关联方名称	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中广核财务有限责任公司	-	-
安信证券	28,570,667.33	1.64%
关联方名称	上年度末 2014年12月31日	I
大联刀石桥	持有的基金份额	持有的基金份額 占基金总份额的比例
中广核财务有限责任公司	30,004,050.00	1.61%
安信证券	100,013,500.00	5.36%

				+111:70-01	
关联方	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
名称	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
中国工商银行	8,687,085.27	897,034.60	464,674,784.34	455,078.93	
7.4.8.6 本基金在 本基金本期及上 7.4.8.7 其他关联	承销期内参与关联	承销期内参与关联方承销证			
		F A. HELT WAS TO THE TOTAL OF			

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

单位:人民币元

		2015年12月	2016年1月						
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通日	流通受 限类型	认购价格	期末估值 单价	数量	期末成本 总额	期末估值 总额

截至本报告期末2015年12月31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,无质押债

(149.22 文列7[117]加州于正巴阿 截至本报告期末2015年12月3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1.259,300,000.00 元,于2016年1月4割期。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人质押库的债券、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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1承诺事项 截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。 7.4.14.2其他事项

8.1 期	末基金资产组合情况		金额单位:人民币
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	2,867,668,299.48	92.95
	其中:债券	2,867,668,299.48	92.95
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	133,243,651.94	4.32
7	其他各项资产	84,296,198.91	2.73

8.2 期未接行业分类的股票投资组合 8.2.1 报告期未接行业分类的境内股票投资组合 本基金本报告期未未持有规则就算。 8.2.2 报告期未按行业分类的沙港通投资股票投资组合 本基金本报告期未未持有股票。 8.3 期未按公允价值占基金资产净值比例大力排序的前十名股票投资明细 本基金本报告期未未持有股票。 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 8.41 累计买人金额纽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。 8.42 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。 8.43 累计类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。 8.43 买入股票的成本仓额及卖出股票的收入总额 本基金本报告期内未持有股票。

本基金本报告期内未持有股票。 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	50,825,000.00	2.8
	其中:政策性金融债	50,825,000.00	2.8
4	企业债券	2,386,380,067.80	132.2
5	企业短期融资券	85,528,000.00	4.7
6	中期票据	137,379,000.00	7.6
7	可转债(可交换债)	9,096,231.68	0.5
8	同业存单	198,460,000.00	11.0
9	其他	-	
10	合计	2,867,668,299.48	158.9

					金额单位:人民币	
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	122392	15恒大02	2,000,000	206,200,000.00	11.43	
2	111507145	15招行CD145	2,000,000	198,460,000.00	11.00	
3	122366	14武钢债	1,500,000	152,850,000.00	8.47	
4	122266	13中信03	1,252,810	127,085,046.40	7.04	
5	101569028	15泛海MTN001	1,200,000	122,064,000.00	6.76	

3 加3900023 13.2.max1.000 1.2.0000 1.2.0000 1.2.0000 13.2.000000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.000000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.00000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.0000 13.2.

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。 8.10.2 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。 8.103 本期国债期货投资评价 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。

8.11 投资组合报告附注 8.11、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。 8112 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证券必须先人

库再买人。 8.11.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

836,652,390 135,731,137 81,392,754 4.679 29,068,798

本基金基金经理持有本开放式基金

11.2 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

本基金管理人于2015年1月9日发布公告,聘任乔江畔女士为安信基金管理有限责任公司督察长、孙晓奇先生不再担任安信基金管理有限责任公司督察长、聘任孙晓奇先生为安信基金管理有限责任公司副总经理,汪建先生不再担任安信基金管理有限 公司副总经理。 本基金管理人于2015年12月31日发布公告,聘任王连志先生为安信基金管理有限责任公司董事长,牛冠兴先生不再担任 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的i 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

11.5 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。目前安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务2.5年,本报告期应支付的报酬为人民币110,000元。

券商名称 备注

注:公司制定《安白基验管理书限页社公司寿间父易甲元选择呼吸及明查方律公允力,初选件证券公司的标准和程序、及佣金分配则则进行了规定。 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受易金了每季度末对 寿商进行综合符分,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、交易效率等。由公司基金投资决策委员 会租期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寿商选择及佣金分配由 基金投资决策委员会决定。 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

安信基金管理有限责任公