安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31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
送出日期:2016年3月25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2016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。

本报告中财务资料已经审计。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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	安信永利信用债券	
基金主代码	000310	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2013年11月8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	666,237,110.51份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C
下属分级基金的交易代码:	000310	000335
报告期末下属分级基金的份额总额	475,538,391.40份	190,698,719.11份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制信用风险的前提下,通过稳健的投资策略,为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	封闭期内,在久期配置上,预测利率和收益率的变动,合理匹配投资组合久期和封闭期;在品种配置上,基于宏观基本面研究,分析多种因素,合理配置不同债券的构成比例;在信用投资上,依据内外评级结果,建立信用债券的投资库,并进行动态调整和维护;在可转债投资上,合理估值,投资价值低估的可转债;在资产支持证券的投资上,重点关注基础资产的类型、发行条款、提前偿还率和市场流动性等因素,综合评估。开放期内,主要投资于高流动性的投资品种以保持较高的流动性,减小净值的波动。
业绩比较基准	1.5×1年期银行定期存款基准利率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	乔江晖	林葛
	联系电话	0755-82509999	010-66060069
	电子邮箱	service@essencefund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008-088-088	95599
传真		0755-82799292	010-68121816

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	2015年		2014年		2013年11月8日(基金合同生效日)-2013年12月31日	
	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C
本期已实现收益	28,852,263.87	11,548,464.72	23,801,343.62	7,704,649.38	1,428,042.60	424,175.88
本期利润	30,368,948.66	12,160,902.09	24,936,566.99	7,909,316.16	1,789,417.11	540,500.71
加权平均基金份额本期利润	0.1334	0.1290	0.1311	0.1236	0.0094	0.0088
本期基金份额净值增长率	13.78%	13.37%	13.20%	12.70%	0.90%	0.90%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0301	0.0198	0.0423	0.0374	0.0075	0.0069
期末基金资产净值	497,062,493.12	197,353,487.43	218,382,692.49	90,297,884.32	192,102,191.92	61,846,140.82
期末基金份额净值	1.045	1.035	1.051	1.046	1.009	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。

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

安信永利信用债券A

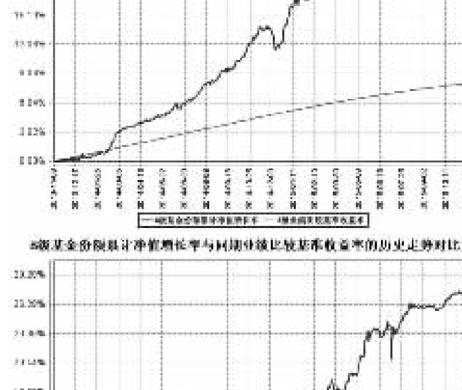
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.56%	0.11%	0.55%	0.01%	2.01%	0.10%
过去六个月	3.81%	0.28%	1.22%	0.01%	2.59%	0.27%
过去一年	13.78%	0.26%	3.02%	0.01%	10.76%	0.25%
自基金合同生效起至今	29.97%	0.21%	8.30%	0.01%	21.67%	0.20%

安信永利信用债券C

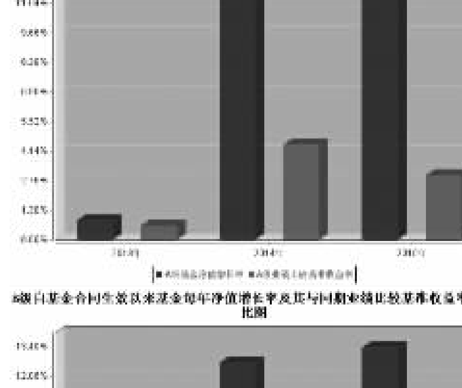
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.50%	0.12%	0.55%	0.01%	1.95%	0.11%
过去六个月	3.57%	0.28%	1.22%	0.01%	2.35%	0.27%
过去一年	13.37%	0.27%	3.02%	0.01%	10.35%	0.26%
自基金合同生效起至今	28.92%	0.21%	8.30%	0.01%	20.62%	0.20%

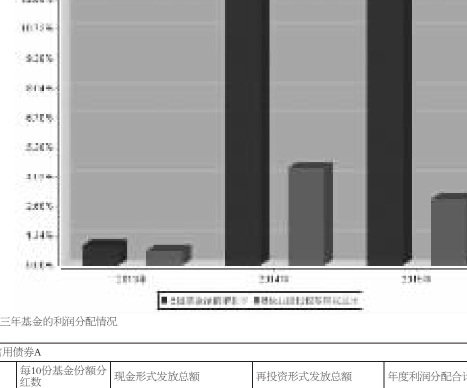
注:1、根据《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》的约定,本基金的业绩比较基准为:1.5×1年期银行定期存款基准利率。

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



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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

安信永利信用债券A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	1.5000	26,364,376.42	4,718,275.36	31,082,651.78	
2014	0.9000	17,058,006.59	70,142.40	17,128,148.99	
2013	–	–	–	–	
合计	2.4000	43,422,383.01	4,788,417.76	48,210,800.77	

单位:人民币元

安信永利信用债券C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	1.5000	13,279,865.73	1,090,278.90	14,370,144.63	
2014	0.9000	5,503,013.62	14,494.17	5,517,507.79	
2013	–	–	–	–	
合计	2.4000	18,782,879.35	1,104,773.07	19,887,652.42	

§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:五矿资本控股有限公司持有38.72%的股权,安信证券股份有限公司持有33%的股权,佛山市顺德区新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。

截至2015年12月31日,本基金管理人共管理17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);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;从2014年11月24日起管理安信现金增利货币市场基金;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4月15日起管理安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月14日起管理安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金;从2015年5月20日起管理安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金;从2015年5月25日起管理安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金;从2015年6月5日起管理安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金;从2015年8月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	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李勇	本基金的基金经理、公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理	2013年11月8日	–	9	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投资总监兼固定收益部总经理。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;现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
张翼飞	本基金的基金经理助理	2013年11月11日	–	4.5	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研究员。现任职于安信基金管理有限责任公司固定收益部。曾任安信现金管理货币市场基金的基金经理助理;现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理,安信现金管理货币市场基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
刘献荣	本基金的基金经理助理	2014年11月7日	2015年3月9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	2015年3月9日	2015年7月24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。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。
魏晓菲	本基金的基金经理助理	2015年10月26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。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。
周仁	本基金的基金经理助理	2015年10月26日	–	0.5	周仁先生,金融硕士。曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部研究助理。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。现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。

注:1、基金经理的"任职日期"按基金合同生效日填写;基金经理助理的"任职日期"根据公司决定确定的聘任日期填写。"离任日期"根据公司决定的公告(生效)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》、《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 公平交易制度和控制方法

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 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。

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。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

在上半年,我们加了少量杠杆配置了大量高评级的中票和短融作为底仓,同时配置了适量长久期利率债和少量可转债,由于我们拉长了久期并加了适量杠杆,因此实现了较好的收益。之后随着股票市场的大幅下跌,债市逐渐成为资金的避风港,债券收益率逐渐下行,由于我们配置的多为中长久期的债券,因此享受到了这波行情。8月份开始,我们开始逐渐缩短久期,买入了大量的短融和短久期利率债。总结全年的投资,我们在前半段看准市场走势并迅速加大杠杆和久期,因此取得了优异的成绩。下半年,出于对债市过热可能面临风险的考虑,我们逐渐降杠杆、缩短久期,这也使得我们在下半年并未延续上半年的优异表现。另外值得一提的是我们只选择高评级债券进行投资,在这轮信用事件的爆发中我们很好地规避了信用风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

在报告期内,安信永利信用A的收益率为13.78%,安信永利信用C的收益率为13.37%,为基金持有人带来了良好的投资收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先梳理下目前宏观经济的情况。随着经济持续在底部徘徊,现在大家普遍的共识是我国经济将在一段时间内处在L型底的环境下,目前是内需不振且外需不稳,亟待过剩产能逐步出清。为了配合政府的供给侧改革,央行在本年度进行了5次降息和5次降准,维持了相对宽松的货币政策。但是市场也存在对资金面有扰动的因素,主要有两个:其一是美元加息带来的资本外流和人民币贬值预期。其二是改革正处在攻坚阶段,政府调低了经济增长的目标以使得过剩产能有逐步出清的空间,而该政策使得央行不能过度放水。所以新的年度里,稳健的货币政策和积极的财政政策将会是主旋律,不能对央行会大量放水有过高期望。在国家调低经济增长预期的同时,我们也要调低债券市场的目标收益。

再看债券市场,由于经济持续恶化及股票、大宗等资产价格的大幅下跌,债市在本年度延续了债牛行情。债市在高收益资产缺少的如今正成为各路资金的避风港,与此同时债券的收益率也在逐渐下降,其中具代表性的有十年期国债突破3%的整数关口。期限利差、信用利差都在大幅缩小。在这一轮大的行情中伴随着少量的回调,但仍不改收益率下行的趋势。但是,在债牛逐渐行进的过程中我们也要注意可能的风险,我们认为风险包括但不限于以下几点:1.美元加息导致资本外流,人民币汇率承压。这点压缩了货币政策的实施空间。2.债券供给增加。随着地方政府债及公司债的大量发行,预测明年的债券供给甚至会超过今年。3.经济可能在底部企稳。随着改革的推进,不排除经济在明年企稳。4.债市的去杠杆风险。由于管理层逐步对债券市场高杠杆问题的担忧,债市的杠杆可能会面临调整的风险。

我们依此判断明年债券市场可能会处在震荡的区间中,而且随着经济持续恶化,信用风险也可能在明年引来集中爆发,因此可以掌握好节奏进行波段操作,同时严格把控风险,尤其在择券时注意信用风险。

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《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》及最新的招募说明书约定:"在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%"。

本基金以2015年11月23日为收益分配基准日,于2015年12月01日对本基金A类和C类份额持有人按每10份基金份额分配人民币1.50元进行分红。其中向A类份额持有人以现金形式发放人民币26,364,376.42元,再投资形式发放人民币4,718,275.36元,实际分配收益为人民币31,082,651.78元;向C类份额持有人以现金形式发放人民币13,279865.73元,再投资形式发放人民币1,090,278.90元,实际分配收益为人民币14,370,144.63元。符合相关法律法规的有关规定以及基金合同、招募说明书的有关约定。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

在托管本基金的过程中,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基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—安信基金管理有限责任公司2015年1月1日至2015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本基金的投资运作、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本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。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了安信永利信用定期开放债券型证券投资基金财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表,2015年度的利润表及所有者权益(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:安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

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	2,006,294.10	7,762,033.71
结算备付金	13,363,679.35	7,987,787.58
存出保证金	148,376.40	109,813.88
交易性金融资产	706,106,694.60	468,515,870.63
其中:股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	706,106,694.60	468,515,870.63
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	12,800,000.00	–
应收证券清算款	58,401.34	–
应收利息	7,140,369.84	11,827,116.76
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	741,623,815.63	496,202,622.56
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	46,600,000.00	181,260,972.10
应付证券清算款	–	5,722,339.14
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	375,936.51	181,020.85
应付托管费	107,410.42	51,720.27
应付销售服务费	61,735.65	30,263.04
应付交易费用	2,752.50	10,220.15
应交税费	–	–
应付利息	–	5,510.20
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	60,000.00	260,000.00
负债合计	47,207,835.08	187,522,045.75
所有者权益:		
实收基金	666,237,110.51	294,083,067.01
未分配利润	28,178,870.04	14,597,509.80
所有者权益合计	694,415,980.55	308,680,576.81
负债和所有者权益总计	741,623,815.63	496,202,622.56

注:报告截止日2015年12月31日,安信永利信用定期开放债券型证券投资基金A类基金份额净值1.045元,安信永利信用定期开放债券型证券投资基金C类基金份额净值1.035元;基金份额总额666,237,110.51份,其中安信永利信用定期开放债券型证券投资基金A类基金份额475,538,391.40份,安信永利信用定期开放债券型证券投资基金C类基金份额190,698,719.11份。

7.2 利润表

会计主体:安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

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	49,263,176.63	44,369,123.33
1.利息收入	22,816,664.57	22,087,104.47
其中:存款利息收入	186,562.42	203,610.61
债券利息收入	22,512,210.25	20,976,149.63
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	117,891.90	907,344.23
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	24,317,024.58	20,941,325.23
其中:股票投资收益	-2,643,751.05	878,335.24
基金投资收益	–	–
债券投资收益	26,960,775.63	20,062,989.99
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)	2,129,122.16	1,339,890.15
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	365.32	803.48
减:二、费用	6,733,325.88	11,523,240.18
1. 管理人报酬	2,492,576.96	1,870,036.72
2. 托管费	712,164.84	534,296.22
3. 销售服务费	415,415.36	267,862.55
4. 交易费用	291,586.34	37,520.07
5. 利息支出	2,413,101.79	8,430,239.17
其中:卖出回购金融资产支出	2,413,101.79	8,430,239.17
6. 其他费用	408,480.59	383,285.45
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	42,529,850.75	32,845,883.15
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	42,529,850.75	32,845,883.15

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安信永利信用定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015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)	294,083,067.01	14,597,509.80	308,680,576.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	42,529,850.75	42,529,850.75
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)	372,154,043.50	16,504,305.90	388,658,349.40
其中:1.基金申购款	528,209,578.60	44,007,438.53	572,217,017.13
2.基金赎回款	-156,055,535.10	-27,503,132.63	-183,558,667.73
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)	–	-45,452,796.41	-45,452,796.41
五、期末所有者权益(基金净值)	666,237,110.51	28,178,870.04	694,415,980.55

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)	251,618,414.92	2,329,917.82	253,948,332.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	32,845,883.15	32,845,883.15
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)	42,464,652.09	2,067,365.61	44,532,017.70
其中:1.基金申购款	214,977,144.55	9,307,549.74	224,284,694.29
2.基金赎回款	-172,512,492.46	-7,240,184.13	-179,752,676.59
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)	–	-22,645,656.78	-22,645,656.78
五、期末所有者权益(基金净值)	294,083,067.01	14,597,509.80	308,680,576.81

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:

刘入领 廖维坤 尚尔航

基金管理人负责人 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

安信永利信用定期开放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8月6日下发的证监许可[2013]1058号文"关于核准安信永利信用定期开放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《安信永利信用定期开放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,以定期开放方式运作,存续期限不定。

本基金募集期间为2013年10月16日至2013年11月5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_H06号验资报告。首次设立募集不包括认购资金利息共募集251,530,884.25元。经向中国证监会备案,《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月8日正式生效。截至2013年11月7日止,安信永利信用定期开放债券型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251,530,884.25元,折合251,530,884.25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87,530.67元,折合87,530.67份基金份额。其中永利信用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190,246,484.23元,折合190,246,484.23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66,290.58元,折合66,290.58份基金份额;永利信用C已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币61,284,400.02元,折合61,284,400.02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21,240.09元,折合21,240.09份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币251,618,414.92元,折合251,618,414.92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。

本基金投资范围包括国债、中期票据、央行票据、可转换债券(含可分离交易的可转换债券)、金融债、企业债券、公司债券、短期融资券、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)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,但须符合中国证监会的相关规定。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股的首发或增发,但可持有因可转债债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资可分离交易的可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产,基金将在其可交易之日起的3个月内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:债券资产占基金资产的比例不低于80%,信用债资产占非现金基金资产的比例不低于80%,本基金在开放期、封闭期前3个月和最后3个月不受上述投资比例限制。在开放期,本基金持有现金或到期日在1年以内的政府债券的投资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1.5×1年期银行定期存款基准利率。

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>》,其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2015年12月31日的财务状况以及2015年1月1日至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证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 税项

7.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为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,暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

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,免征营业税。

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。

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。

7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为20%。

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个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得,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,减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,减按25%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2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")	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
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	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
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司
安信乾正股权投资管理(深圳)有限公司	基金管理人子公司的子公司

注:1、本基金管理人于2013年12月2日设立了全资子公司安信乾盛财富管理(深圳)有限公司。

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管理(深圳)有限公司。

3、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

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
安信证券	151,774,821.84	100.00%	12,013,200.91	100.00%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
安信证券	2,836,966,211.79	100.00%	3,540,190,177.57	100.00%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
安信证券	16,102,055,000.00	100.00%	23,734,288,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
安信证券	99,141.37	100.00%	–	–
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
安信证券	7,958.15	100.00%	7,958.15	100.00%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

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	2,492,576.96	1,870,036.72
其中:支付销售机构的客户维护费	1,058,704.62	858,581.10

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率逐日计提。计算方法如下:

H=E×0.7%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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托管费	712,164.84	534,296.22

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.3 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 2015年1月1日至2015年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 安信永利信用债券A	安信永利信用债券C	合计
中国农业银行	–	303,085.79	303,085.79
安信证券	–	109,637.18	109,637.18
安信基金直销	–	274.04	274.04
合计	–	412,997.01	412,997.01

获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费 安信永利信用债券A	安信永利信用债券C	合计
中国农业银行	–	252,644.37	252,644.37
安信证券	–	15,166.99	15,166.99
安信基金直销	–	–	–
合计	–	267,811.36	267,811.36

注:基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额销售服务费年费率为0.40%。本基金C类基金份额销售服务费计提的计算方法如下:

H=E×0.40%/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金的其他关联方本期末及上年度末未持有本基金份额。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,006,294.10	56,634.20	7,762,033.71	34,742.30

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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,无质押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本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46,600,000.00元,于2016年1月4日、2016年1月8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。

7.4.10 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

(1)公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的交易性金融资产中无划分为第一层级余额,划分为第二层级的余额为人民币706,106,694.60元,无划分为第三层级余额。(于2014年12月31日,本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层级的余额为人民币201,612,895.63元,划分为第二层级的余额为人民币266,902,975.00元,无划分为第三层级余额。)

公允价值所属层级间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的债券,若出现交易不活跃或未上市等情况,于本报告期内将相关债券的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。如上述影响因素消失,债券公允价值所属层次则从第二层次转入第一层次。

根据中国证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,自2015年3月30日起,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,相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层级转入第二层级。

第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具,本基金本报告期末未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月22日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	706,106,694.60	95.21
	其中:债券	706,106,694.60	95.21
	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	12,800,000.00	1.73
	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	15,369,973.45	2.07
7	其他各项资产	7,347,147.58	0.99
8	合计	741,623,815.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	66,456,928.95	21.53
2	600016	民生银行	29,112,878.07	9.43
3	600028	中国石化	22,613,480.91	7.33
4	601398	工商银行	21,743,113.20	7.04
5	600219	南山铝业	14,345,851.32	4.65
6	600875	东方电气	146,320.44	0.05

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票;

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的,本项的"累计买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	65,587,105.38	21.25
2	600016	民生银行	27,732,941.44	8.98
3	600028	中国石化	21,971,261.75	7.12
4	601398	工商银行	21,595,498.58	7.00
5	600219	南山铝业	14,725,166.62	4.77
6	600875	东方电气	162,848.07	0.05

注:1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票;

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的,本项的"累计卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	154,418,572.89
卖出股票收入(成交)总额	151,774,821.84

注:1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票;

2、"买入股票成本(成交)总额"、"卖出股票收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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	64,173,652.20	9.24
2	央行票据	–	–
3	金融债券	13,301,330.00	1.92
	其中:政策性金融债	13,301,330.00	1.92
4	企业债券	121,488,324.20	17.50
5	企业短期融资券	300,736,000.00	43.31
6	中期票据	162,565,000.00	23.41
7	可转债(可交换债)	43,842,388.20	6.31
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	706,106,694.60	101.68

8.6 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	011537013	15中建材SCP013	1,000,000	100,250,000.00	14.44
2	101553046	15苏交通MTN002	900,000	91,089,000.00	13.12
3	011599983	15龙源电力SCP014	500,000	50,085,000.00	7.21
4	011599974	15皖交控SCP006	500,000	50,060,000.00	7.21
5	113008	电气转债	318,460	43,842,388.20	6.31

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

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。

8.10.3 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

8.11.1

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。

8.11.2

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证券必须先入库再买入。

8.11.3 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	148,376.40
2	应收证券清算款	58,401.34
3	应收股利	–
4	应收利息	7,140,369.84
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	7,347,147.58

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	43,842,388.20	6.31

8.11.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
安信永利信用债券A	2,154	220,769.91	113,128,401.39	23.79%	362,409,990.01	76.21%
安信永利信用债券C	1,201	90,765.69	20,243,850.86	10.62%	170,454,868.25	89.38%
合计	3,355	198,580.36	133,372,252.25	20.02%	532,864,858.26	79.98%

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)。

9.2 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	安信永利信用债券A	667,756.06	0.1404%
	安信永利信用债券C	–	–
	合计	667,756.06	0.1002%

注:管理人的从业人员持有基金占基金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)。

9.3 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的情况

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	安信永利信用债券A	0
	安信永利信用债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信永利信用债券A	50~100
	安信永利信用债券C	0
	合计	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安信永利信用债券A	安信永利信用债券C
基金合同生效日(2013年11月8日)基金份额总额	190,312,774.81	61,305,640.11
本报告期期初基金份额总额	207,766,752.10	86,316,314.91
本报告期基金总申购份额	374,585,150.35	153,624,428.25
减:本报告期基金总赎回份额	106,813,511.05	49,242,024.05
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
本报告期期末基金份额总额	475,538,391.40	190,698,719.11

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

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,聘任乔江晖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责任公司副总经理。

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安信基金管理有限责任公司董事长。

因中国农业银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要,任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

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年,本报告期应支付的报酬为人民币60,000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
安信证券	2	151,774,821.84	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。

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

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	2,836,966,211.79	100.00%	16,102,055,000.00	100.00%	–	–

安信基金管理有限责任公司

2016年3月25日