宝盈增强收益债券型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22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2014年1月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈增强收益债券	
基金主代码	213007	
交易代码	213007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年5月15日	
报告期末基金份额总额	472,794,553.09份	
投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期, 本基金在严格控制投资风险与保持资产流动性的前提下努力保持基金资产持续增值, 并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。	
投资策略	本基金基于对以下因素的判断,进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、新股(含增发)申购以及二级市场股票投资之间的配置: ①基于对利率、信用等因素的分析,预测固定收益品种的风险和收益; ②可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断; ③基于对新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等因素的分析,预测新股申购的风险和收益; ④股票市场走势的预测。	
业绩比较基准	中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险较低收益品种,本基金的风险与预期收益都要低于股票型和混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
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	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	213007	213917
下属两级基金的前端交易代码	213007	-
下属两级基金的后端交易代码	213907	-
报告期末下属两级基金的份额总额	403,262,696.10份	69,531,856.99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10月1日-2013年12月31日)	
	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
1.本期已实现收益	1,942,070.38	89,829.38
2.本期利润	-6,249,601.89	-734,094.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0126	-0.0100
4.期末基金资产净值	445,200,530.31	75,101,249.52
5.期末基金份额净值	1.1040	1.0801

注:1、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。
2、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、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。

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

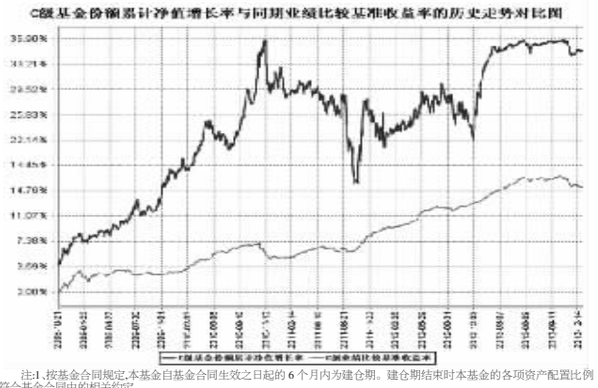
宝盈增强收益债券A/B

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	-0.84%	0.09%	-1.20%	0.06%	0.36%	0.03%

宝盈增强收益债券C

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	-0.94%	0.09%	-1.20%	0.06%	0.26%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

2、本基金于2008年10月20日起增加收取销售服务费的C类收费模式,其对应的基金份额简称"宝盈增强收益债券C"。

§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		
陈岩劲	本基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理兼固定收益部总监	2008年9月2日	-	10年	陈岩劲女士,香港中文大学金融MBA,曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作;2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。现同时担任宝盈货币市场证券投资基金基金经理、固定收益部总监。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

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》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度末,我们认为经济增长将趋弱,而通胀有上行压力,货币政策仍将维持中性,资金价格大概率将高位运行,年末时资金面仍有可能出现阶段性紧张,债券收益率已经有一定配置价值而对于权益市场则更为谨慎。

报告期内,大额可转让同业定期存单(NCD)正式推出,标志着利率市场化再进一步。债券市场方面,收益率继续狂飙,上行速度一度比三季度更甚,不断有券种刷新历史收益率纪录。报告期内,我们结合NCD推出进程和shibor报价的变化情况,继续增持配置价值更高的浮息债券,减持固息品种。

报告期内,权益市场出现小幅调整,中小盘个股相对走势仍然强于大盘蓝筹股。我们认为中小盘个股整体估值过高,风险收益比不大,而大盘股的投资机会尚需等待更好的时间窗口。因此,本报告期内我们没有参与权益投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

增强收益A/B:本基金在本报告期内净值增长率是-0.84%,同期业绩比较基准收益率是-1.20%。

增强收益C:本基金在本报告期内净值增长率是-0.94%,同期业绩比较基准收益率是-1.20%。

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2014年一季度,我们预期经济增速和通胀将小幅回落,地方债务问题、非标资产问题仍将是政策关注的重点。货币政策将维持中性偏紧,利率市场化进程继续深化,货币市场资金价格大概率仍将维持高位。

我们对债券类资产配置谨慎乐观。尽管资金价格和供求关系都将限制债券市场的表现,但是连续飙升后的债券收益率水平已经具有较强的配置价值,我们将在严格防范信用风险的前提下参与投资。结构方面,我们认为利率债优于信用债,浮息债优于固息债。

我们对权益类资产配置更加谨慎,经济增长乏力将制约大盘股的表现,而中小盘股估值过高,系统性风险不断积聚,同时优先股和IPO重启将直接分流二级市场的资金。我们将耐心等待市场进一步的调整,择机选择基本面良好、符合国家产业政策的优质公司参与投资。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	620,175,870.80	96.84
	其中:债券	620,175,870.80	96.84
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	8,545,270.66	1.33
6	其他资产	11,716,766.70	1.83
7	合计	640,437,908.16	100.00

5.2 报告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。

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
本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	452,227,000.00	86.92
	其中:政策性金融债	452,227,000.00	86.92
4	企业债券	167,948,870.80	32.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	620,175,870.80	119.20

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100236	10国开36	600,000	59,298,000.00	11.40
2	130212	13国开12	600,000	58,980,000.00	11.34
3	0980147	09中航工债浮	500,000	50,615,000.00	9.73
4	130232	13国开32	500,000	49,675,000.00	9.55
5	130241	13国开41	500,000	49,650,000.00	9.54

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国债期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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投资国债期货。

5.8.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	41,064.86
2	应收证券清算款	5,945,149.46
3	应收股利	-
4	应收利息	5,715,671.13
5	应收申购款	14,881.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,716,766.70

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可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中在在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	宝盈增强收益债券A/B	宝盈增强收益债券C
报告期期初基金份额总额	580,744,235.32	98,129,856.50
报告期期间基金总申购份额	1,910,915.71	1,503,796.43
减:报告期期间基金总赎回份额	179,392,454.93	30,101,795.94
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	403,262,696.10	69,531,856.99

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会关于核准宝盈增强收益债券型证券投资基金募集的文件。
《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金合同》。
《宝盈增强收益债券型证券投资基金基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点
基金管理人办公地址:广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦15层
基金托管人办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

9.3 查阅方式
上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2014年1月22日

安信宝利分级债券型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22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2014年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信宝利分级债券	
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7月24日	
报告期末基金份额总额	2,923,915,682.14份	
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。	
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	
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	1,923,767,949.20份	1,000,147,732.94份
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。

§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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	35,384,829.00
2.本期利润	-21,726,754.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0074
4.期末基金资产净值	2,926,754,147.94
5.期末基金份额净值	1.001

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。

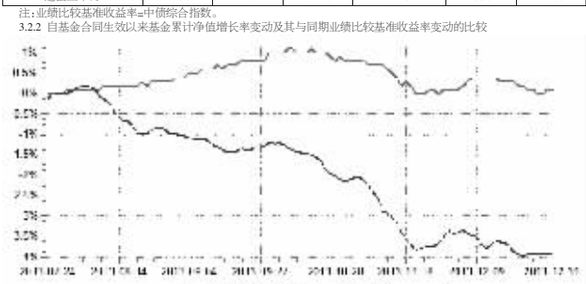
3.2 基金净值表现

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	-0.69%	0.08%	-2.68%	0.10%	1.99%	-0.02%

注:业绩比较基准收益率=中债综合指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2013年7月24日至2014年1月23日,截至本报告期期末,本基金尚在建仓期。
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。图示日期为2013年7月24日至2013年12月31日。

3.3 其他指标

金额单位:人民币元

其他指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
宝利A与宝利B基金份额配比	1.92348379:1
期末宝利A参考净值	1.020
期末宝利A累计参考净值	1.020
期末宝利B参考净值	0.965
期末宝利B累计参考净值	0.965
宝利A年收益率(单利)	4.50%

注:1、根据本《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。截至本报告期期末,宝利A年收益率为4.50%。
2、本报告期内2013年10月1日至2013年12月31日期间,宝利A年收益率为4.50%。

§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		
庄园	本基金的基金经理	2013年7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,安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。

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年四季度,债券市场经历了近年来最大的一次单季下跌幅度。中债总全价(总值)指数从10月8日的115.63点,下跌到12月31日111.90点。

四季度宏观经济和通胀都不是影响债券市场的主要原因,关注的焦点主要是资金面和供求状况。资金面总体维持偏紧状态,一级市场债券供给量的激增,而需求端受到非标类资产的持续挤压,供求失衡,一级市场发行收益率节节攀升,带动二级市场收益率上行。整个季度来看,虽有一次财政存款释放带来的短暂的反弹,但幅度和持续时间都有限,总体来说四季度是一个单边下行的走势。

安信宝利分级基金在四季度前期基本维持原定的建仓计划,在银行间账户开设完成后增加了银行间债券的配置比例。随着资金成本的大幅提高,市场持续走弱。另外考虑到2014年1月底宝利A将迎来第一次开放日,在维持了基本债券仓位后,更多通过放大进行短期的回业存款的方式来增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金的基金份额净值为1.001元,报告期内收益率为-0.69%,同期业绩比较基准收益率为-2.68%,超过同期业绩比较基准1.99%。

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2014年一季度,相比2013年四季度而言,资金面将会相对有所改善,但资金成本也很难大幅降低,除非利率市场化的政策取向有重大改变。宏观经济基本面上,通胀无忧,降杠杆背景下经济大概率上难有起色。目前对债券市场影响比较大的是供给面,在"积极的财政政策和稳健的货币政策"大背景下,利率债的供给将会比较大,信用债将面临信用风险和供给量增大的双重考验。总体来说,我们对2014年一季度的市场持相对谨慎判断。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,964,707,311.05	67.11
	其中:债券	2,964,707,311.05	67.11
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	266,695,550.04	6.04
	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	1,121,775,243.48	25.39
7	其他各项资产	64,451,792.26	1.46
8	合计	4,417,629,896.83	100.00

5.2 报告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。

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
本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,924,457,451.05	65.75
5	企业短期融资券	468,066,000.00	15.99
6	中期票据	532,463,000.00	18.19
7	可转债	39,720,860.00	1.36
8	其他	-	-
9	合计	2,964,707,311.05	101.30

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122266	13中信03	1,300,710	126,168,870.00	4.31
2	101354016	13陕交建MTN002	1,000,000	97,320,000.00	3.33
3	122830	11沈国资	846,710	84,416,987.00	2.88
4	124387	13湛基投	800,000	79,963,546.30	2.73
5	124408	13宛城投	800,000	79,600,000.00	2.72

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
本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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	194,463.64
2	应收证券清算款	3,495,315.60
3	应收股利	-
4	应收利息	60,762,013.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,451,792.26

5.10.4 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	24,132,500.00	0.82
2	110015	石化转债	4,863,360.00	0.17

5.10.5 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存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	宝利A	宝利B
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	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,923,767,949.20	1,000,147,732.94

注:1、本基金合同生效日为2013年7月24日。
2、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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、2013年10月15日,安信基金管理有限责任公司在中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网上公布了《安信基金管理有限责任公司高级管理人员(总经理)变更公告》,公司总经理由王连志先生变更为刘入领先生。

2、2013年12月4日,安信基金管理有限责任公司在中国证券报、证券时报、上海证券报及公司官网上公布了《安信基金管理有限责任公司关于设立子公司的公告》,公司设立全资子公司安信乾盛财富管理(深圳)有限公司,子公司注册地为深圳市,注册资本为人民币2000万元,业务范围为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会核准安信宝利分级债券型证券投资基金募集的文件;
2、《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》;
3、《安信宝利分级债券型证券投资基金托管协议》;
4、《安信宝利分级债券型证券投资基金招募说明书》;
5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 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

9.3 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
二〇一四年一月二十二日

安信现金管理货币市场基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年01月22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2014年1月21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10月1日起至12月31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	777,715,710.75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	343,306,098.67	434,409,612.08

§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10月01日-2013年12月31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	1,499,746.83	3,365,773.50
2.本期利润	1,499,746.83	3,365,773.50
3.期末基金资产净值	343,306,098.67	434,409,612.08

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

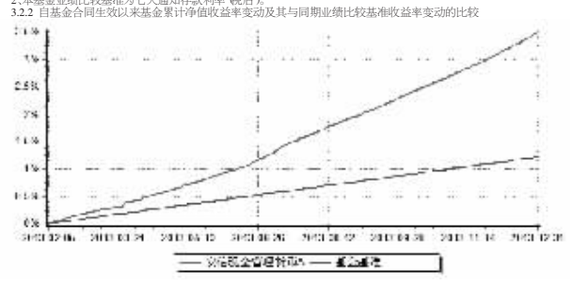
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1608%	0.0022%	0.3403%	0.0000%	0.8205%	0.0022%

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	1.2209%	0.0022%	0.3403%	0.0000%	0.8806%	0.0022%

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



§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