

**安信宝利分级债券型证券投资基金2013年年度报告**

**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**

**送出日期：2014年03月29日**

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月27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。

本报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2013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2013年7月24日(基金合同生效日)起至12月31日止。

### 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§2 基金简介	3
2.1 基金基本情况	3
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12

5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	13
§6	审计报告	13
6.1	审计报告基本信息	13
6.2	审计报告的基本内容	13
§7	年度财务报表	14
7.1	资产负债表	14
7.2	利润表	16
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4	报表附注	18
§8	投资组合报告	42
8.1	期末基金资产组合情况	42
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	42
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	43
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	43
8.6	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	43
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	44
8.8	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	44
8.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
8.11	投资组合报告附注	44
§9	基金份额持有人信息	45
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
9.2	期末上市基金前十名持有人	46
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
§10	开放式基金份额变动	47
§11	重大事件揭示	47
11.1	基金份额持有人大会决议	47
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	47
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
11.4	基金投资策略的改变	47
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	48
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
11.8	其他重大事件	48
§12	备查文件目录	49
12.1	备查文件目录	49
12.2	存放地点	50
12.3	查阅方式	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信宝利分级债券型证券投资基金
------	-----------------

基金简称	安信宝利分级债券（场内简称：安信宝利）	
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	2,923,915,682.14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年10月21日	
下属分级基金的基金简称	宝利A	宝利B
下属分级基金的交易代码	167502	150137
报告期末下属分级基金的份额总额	1,923,767,949.20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	宝利A具有低风险、预期	宝利B具有风险适中、预

征	收益适中的特征。	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	0755-82509999	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
注册地址		广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518026	100140
法定代表人		牛冠兴	姜建清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普	北京市东城区东长安街1号东方

	通合伙)	广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 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	2013年07月24日-2013年12月31日
本期已实现收益	59,630,055.11
本期利润	2,838,465.80
加权平均基金份额本期利润	0.0010
本期基金加权平均净值利润率	0.10%
本期基金份额净值增长率	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末
期末可供分配利润	2,838,465.80
期末可供分配基金份额利润	0.0010
期末基金资产净值	2,926,754,147.94
期末基金份额净值	1.0010
3.1.3 累计期末指标	2013年末
基金份额累计净值增长率	0.10%

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

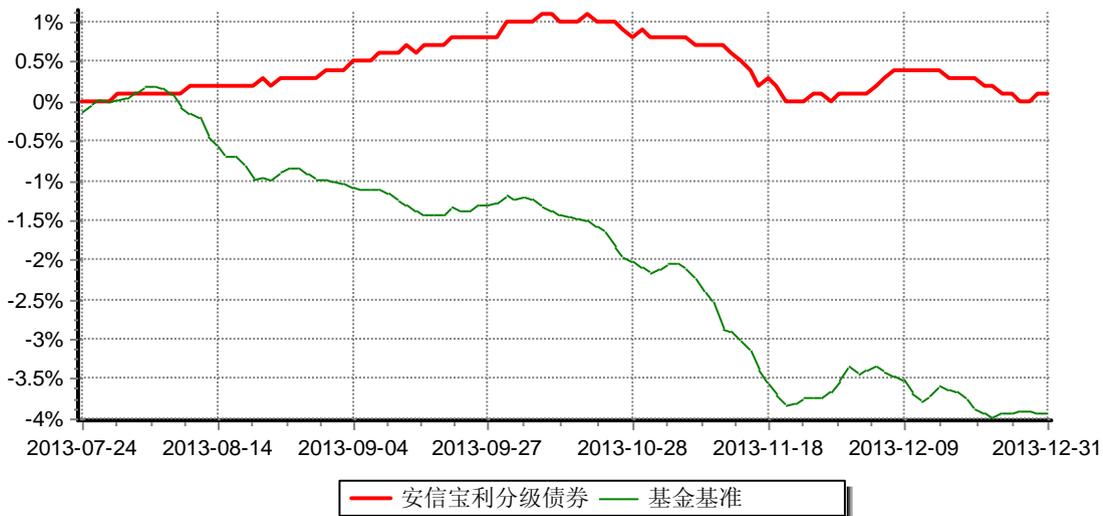
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④

		差②	③	标准差 ④		
过去三个月	-0.69%	0.08%	-2.68%	0.10%	1.99%	-0.02%
自基金合同生效日起 至今（2013年07月24 日-2013年12月31日）	0.10%	0.07%	-3.93%	0.09%	4.03%	-0.02%

注：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。

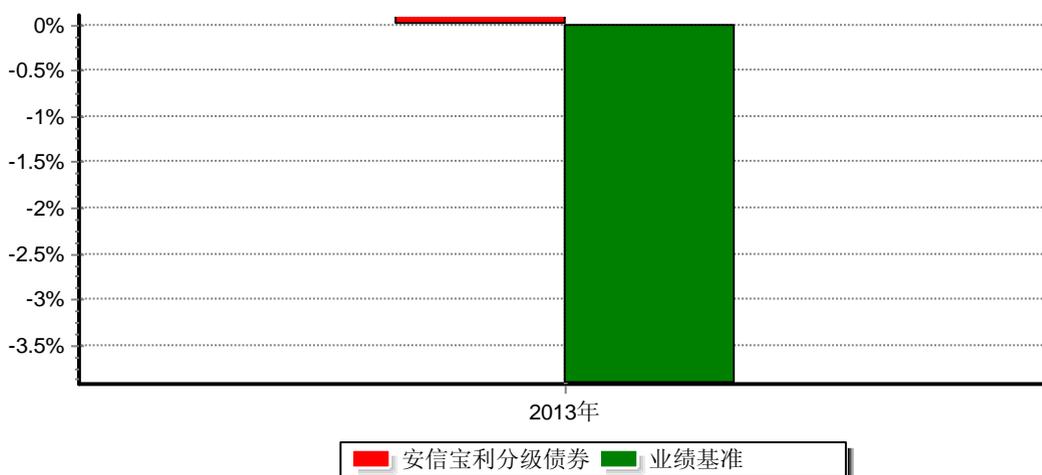
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金的建仓期为2013年7月24日至2014年1月23日，截至本报告期末，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。

### 3.2.3 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



注：本基金基金合同生效日为2013年7月24日，2013年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

金额单位：人民币元

其他指标	报告期间：2013年07月24日至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。截至本报告期末，宝利A年收益率为4.50%。

2、本报告期内2013年7月24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。截至2013年12月31日，本公司注册资本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2013年12月31日，本基金管理人共管理7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。

#### 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，现在安信基金管理有限责任公司固定收益部担任本基金的基金经理。
魏晓菲	本基金的基金经理助理	2013年08月09日	—	7	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。

注：1、本基金基金经理庄园，其“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。“离任日期”根据公司决定确定的解聘日期填写。

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合规守信情况的说明

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 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

为了保证公司旗下管理的所有基金和投资组合得到公平对待，杜绝各种形式的利益输送，切实保障各类投资者的合法权益，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及公司制度的相关规定，制定公司公平交易制度。

公平交易制度要求公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露对公平交易过程和结果进行监督。

### 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。

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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

安信宝利基金2013年7月24日正式成立，成立后为了更有效的利用资金，先进行了比例较大的协议存款，同时在交易所抓住市场减杠杆卖盘放量的时机，有选择的买入了

一定比例的信用债。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以及非标类资产对债券需求的挤压，市场持续下跌。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同业存款的方式来增厚收益。

#### 4.4.2 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0.10%，同期业绩比较基准收益率为-3.93%，超过同期业绩比较基准4.03%。

#### 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，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。宏观经济基本上，通胀压力相对不大，降杠杆背景下经济大概率上难有起色。在"积极的财政政策和稳健的货币政策"基调下，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。有利的因素在于目前债券收益率绝对水平相对较高，非标类资产如果出台相关限制政策将提高债券资产的配置需求。总体来说，我们对2014年的市场持谨慎乐观判断。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。

本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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2013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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2014)审字第60962175_H06号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信宝利分级债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的安信宝利分级债券型证券投资基金财务报表，包括2013年12月31日的资产负债表，自2013年7月24日（基金合同生效日）至2013年12月31日止期间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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人安信基金管理有限责任公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计

	<p>划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了安信宝利分级债券型证券投资基金2013年12月31日的财务状况以及自2013年7月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	张小东、陈立群
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2014-03-25

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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: 2013年12月31日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日
资产:		

银行存款	7.4.7.1	1,064,423,248.85
结算备付金		57,351,994.63
存出保证金		194,463.64
交易性金融资产	7.4.7.2	2,964,707,311.05
其中：股票投资		—
基金投资		—
债券投资		2,964,707,311.05
资产支持证券投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	266,695,550.04
应收证券清算款		3,495,315.60
应收利息	7.4.7.5	60,762,013.02
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		4,417,629,896.83
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		1,482,576,870.60
应付证券清算款		3,864,899.29
应付赎回款		—
应付管理人报酬	7.4.10.2	1,742,451.41
应付托管费	7.4.10.2	497,843.25
应付销售服务费	7.4.10.2	1,244,608.18
应付交易费用	7.4.7.7	12,939.65
应交税费		—

应付利息		804,469.84
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	131,666.67
负债合计		1,490,875,748.89
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	2,923,915,682.14
未分配利润	7.4.7.10	2,838,465.80
所有者权益合计		2,926,754,147.94
负债和所有者权益总计		4,417,629,896.83

注：（1）报告截止日2013年12月31日，安信宝利A基金份额净值人民币1.020元，安信宝利B基金份额净值人民币0.965元，基金份额总额2,923,915,682.14份，其中安信宝利A基金份额1,923,767,949.20份，安信宝利B基金份额1,000,147,732.94份。

（2）本基金合同生效日为2013年7月24日，2013年度实际报告期间为2013年7月24日至2013年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 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：2013年07月24日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年07月24日至2013年12月31日
<b>一、收入</b>		39,630,541.88
1.利息收入		97,803,243.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	44,166,698.07
债券利息收入		48,949,747.85
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		4,686,797.19
其他利息收入		—
2.投资收益(损失以“-”填列)		-1,381,111.92

其中：股票投资收益	7.4.7.12	—
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	-1,381,111.92
资产支持证券投资收 益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	—
股利收益	7.4.7.15	—
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	7.4.7.16	-56,791,589.31
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	7.4.7.17	—
<b>减：二、费用</b>		<b>36,792,076.08</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.	9,014,334.66
2. 托管费	7.4.10.2.	2,575,524.18
3. 销售服务费	7.4.10.2.	6,438,810.55
4. 交易费用	7.4.7.18	10,504.03
5. 利息支出		18,423,206.26
其中：卖出回购金融资产支出		18,423,206.26
6. 其他费用	7.4.7.19	329,696.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）</b>		<b>2,838,465.80</b>
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		<b>2,838,465.80</b>

### 7.3 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：2013年07月24日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	2013年07月24日（合同生效日）至2013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	—	2,923,915,682.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		2,838,465.80	2,838,465.80
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）	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	—	—	—
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）	2,923,915,682.14	2,838,465.80	2,926,754,147.94

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

姜志刚

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999,999,987.63元，折合999,999,987.63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币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。

#### 7.4.2 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>》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。

### 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2013年12月31日的财务状况以及自2013年7月24日（基金合同生效日）至2013年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2013年7月24日（基金合同生效日）起至2013年12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

#### (5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### 1)股票投资

##### (1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

##### (2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

##### C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本

时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

## 2)债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

## 3)权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3)因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

## 4)分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，

上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值。

#### 5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(2)如有新增事项,按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证

- 券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；
- (4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；
- (5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；
- (7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；
- (8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
- (9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提；
- (3) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提；
- (4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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）后，本基金的收益分配原则如下：

- (1) 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12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%；
- (2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。场外转入或申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者在不同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式，如投资者在某一销售机构交易账户不选择

收益分配方式，则按默认的收益分配方式处理；场内转入、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 分部报告**

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **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**

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### **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**

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。

#### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	
	活期存款	4,423,248.85
定期存款	—	
其他存款	1,060,000,000.00	
合计	1,064,423,248.85	

注：1) 其他存款所列金额为基金投资于有存款期限但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

2) 本基金本期末投资于定期存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	—	—	—	
债券	交易所市场	1,919,472,093.91	1,884,373,311.05	-35,098,782.86
	银行间市场	1,102,026,806.45	1,080,334,000.00	-21,692,806.45
	合计	3,021,498,900.36	2,964,707,311.05	-56,791,589.31
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	3,021,498,900.36	2,964,707,311.05	-56,791,589.31	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末

	2013年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	266,695,550.04	—
合计	266,695,550.04	

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日
应收活期存款利息	3,632.90
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	4,314,722.24
应收结算备付金利息	28,389.24
应收债券利息	54,906,873.97
应收买入返售证券利息	1,508,298.42
应收申购款利息	—
其他	96.25
合计	60,762,013.02

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	12,939.65
合计	12,939.65

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
审计费	90,000.00
信息披露费	41,666.67
合计	131,666.67

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目 (宝利A)	本期 2013年07月24日至2013年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,923,767,949.20	1,923,767,949.20
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	1,923,767,949.20	1,923,767,949.20
项目 (宝利B)	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,000,147,732.94	1,000,147,732.94
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	1,000,147,732.94	1,000,147,732.94

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	59,630,055.11	-56,791,589.31	2,838,465.80

本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	59,630,055.11	-56,791,589.31	2,838,465.80

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013年07月24日至2013年12月31日
活期存款利息收入	268,810.88
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	43,725,883.06
结算备付金利息收入	171,016.63
其他	987.50
合计	44,166,698.07

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本期无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013年07月24日至2013年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	157,051,107.43
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	153,670,580.30
减：应收利息总额	4,761,639.05
债券投资收益	-1,381,111.92

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本期无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

本基金本期无股利收益。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年07月24日至2013年12月31日
1.交易性金融资产	-56,791,589.31
——股票投资	—
——债券投资	-56,791,589.31
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-56,791,589.31

**7.4.7.17 其他收入**

本基金本期无其他收入。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2013年07月24日至2013年12月31日
交易所市场交易费用	2,954.03
银行间市场交易费用	7,550.00
合计	10,504.03

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2013年07月24日至2013年12月31日
审计费用	90,000.00
信息披露费	171,666.67
场外基金交易费用	—
银行划款费用	22,529.73
银行间帐户维护费	—
上市月费	15,000.00
上市初费	30,000.00
其他	500.00
合计	329,696.40

#### 7.4.7.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需披露分部报告。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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、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：于本期，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年07月24日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,014,334.66
其中：支付销售机构的客户维护费	4,744,000.11

注：1) 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：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇

法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2) 基金管理费于2013年末尚未支付的金额为人民币1,742,451.41元。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2013年07月24日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,575,524.18

注：1) 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：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2)基金托管费于2013年末尚未支付的金额为人民币497,843.25元。

#### 7.4.10.2.3 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		
	2013年07月24日至2013年12月31日		
	宝利A	宝利B	合计
安信基金	564.80	122,711.95	123,276.75
中国工商银行	3,222,672.79	302,288.71	3,524,961.50
安信证券	15,877.81	894,440.11	910,317.92
合计	3,239,115.40	1,319,440.77	4,558,556.17

注：1)基金销售服务费用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。计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金财产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，

由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。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。

2)本期末本基金未支付关联方销售服务费余额为人民币539,035.87元，其中安信宝利A未支付关联方销售服务费余额为人民币531,228.24元，其中未支付安信基金人民币122,711.95元，未支付中国工商银行0元，未支付安信证券人民币408,516.29元；安信宝利B未支付关联方销售服务费余额为人民币7,807.63元，其中未支付安信基金人民币268.18元，未支付中国工商银行0元，未支付安信证券人民币7,539.45元。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期末运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期末 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
安信证券股份有限公司	100,013,500.00	3.42%
中广核财务有限责任公司	30,004,050.00	1.03%

注：以上关联方持有宝利B基金份额。

#### 7.4.10.5 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2013年07月24日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,423,248.85	268,810.88

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### **7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本期无其他关联交易事项。

#### **7.4.11 利润分配情况**

##### **7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本期未进行利润分配。

#### **7.4.12 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

##### **7.4.12.1 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。

##### **7.4.12.2 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。

##### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2013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，无抵押债券。

###### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2013年12月31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1,482,576,870.60元，分别于2014年1月1日、2014年1月2日、2014年1月3日、2014年1月6日、2014年1月7日、2014年1月24日、2014年1月27日、2014年2月24日、2014年2月26日、2014年2月27日、2014年2月28日、2014年3月3日、2014年3月28日、2014年3月31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。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金管理人坚持"风险管理创造价值"、"风险管理人人有责"、"合规风险零容忍"的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的

控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资及权证投资等，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围之内。

#### 7.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截止2013年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为101.30%。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末
A-1	475,373,528.77
A-1以下	—
未评级	—

合计	475,373,528.77
----	----------------

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。  
 2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债和央票或超短期融资券。  
 3. 债券投资以全价列示。

#### 7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末
AAA	303,669,299.75
AAA以下	2,240,571,356.50
未评级	—
合计	2,544,240,656.25

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。  
 2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。  
 3. 债券投资以全价列示。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金流动性风险来自于兑付赎回资金的流动性风险和投资品种变现的流动性风险两方面。

兑付赎回资金的流动性风险是指本基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，因而对本基金的投资运作产生额外的流动性风险。针对该类流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。同时本基金的基金合同中设计了巨额赎回条款，约定了在巨额赎回发生时对赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

投资品种变现的流动性风险是指因投资品种不存在活跃的交易市场而难以变现，或因投资品种集中度高而无法在不对市场价格产生重大影响的情况下变现的流动性风险。本基金采用控制流通受限证券比例、监控投资品种的成交活跃度和分散投资等方式防范投资品种变现的流动性风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的10%。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。期末本基金持有的所有证券均能及时变现。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VAR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2013年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,064,423,248.85	—	—	—	1,064,423,248.85
结算备付金	57,351,994.63	—	—	—	57,351,994.63
存出保证金	—	—	—	194,463.64	194,463.64
交易性金融资产	590,489,205.80	1,378,228,847.52	995,989,257.73	—	2,964,707,311.05
买入返售金融资产	266,695,550.04	—	—	—	266,695,550.04
应收证券清算款	—	—	—	3,495,315.60	3,495,315.60
应收利息	—	—	—	60,762,013.02	60,762,013.02
资产总计	1,978,959,999.32	1,378,228,847.52	995,989,257.73	64,451,792.26	4,417,629,896.83
负债					
卖出回购金融资产款	1,482,576,870.60	—	—	—	1,482,576,870.60
应付证券清算款	—	—	—	3,864,899.29	3,864,899.29

应付管理人报酬	—	—	—	1,742,451.41	1,742,451.41
应付托管费	—	—	—	497,843.25	497,843.25
应付销售服务费	—	—	—	1,244,608.18	1,244,608.18
应付交易费用	—	—	—	12,939.65	12,939.65
应付利息	—	—	—	804,469.84	804,469.84
其他负债	—	—	—	131,666.67	131,666.67
负债总计	1,482,576,870.60	—	—	8,298,878.29	1,490,875,748.89
利率敏感度缺口	496,383,128.72	1,378,228,847.52	995,989,257.73	56,152,913.97	2,926,754,147.94

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末
	1、市场利率下降25个基点	18,699,333.9400
	2、市场利率上升25个基点	-18,491,523.6000

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资金占基金

资产的比例0%-96%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末
	1、业绩比较基准上升5%	446.91
	2、业绩比较基准下降5%	-446.91

## § 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	2,964,707,311.05	67.11
	其中：债券	2,964,707,311.05	67.11
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	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	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	1,121,775,243.48	25.39
6	其他各项资产	64,451,792.26	1.46
7	合计	4,417,629,896.83	100.00

### 8.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.4.3 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。

### 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	—	—
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

### 8.6 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	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

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 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。

### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.9.1 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。

#### 8.9.2 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。

### 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。

### 8.11 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。

#### 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	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

#### 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	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	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

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 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		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	11,572	166,243.34	100,098,504.23	5.20%	1,823,669,444.97	94.80%

宝利B	4,286	233,352.25	309,411,994.59	30.94%	690,735,738.35	69.06%
合计	15,858	184,381.11	409,510,498.82	14.01%	2,514,405,183.32	85.99%

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	张洪梅	20,003,110.00	2.00%
5	江苏汇鸿国际集团中锦控股有限公司	15,936,706.00	1.59%
6	张彩艳	15,005,400.00	1.50%
7	招商财富—光大—宸熙3号专项资产管理计划	10,699,972.00	1.07%
8	招商财富—光大—宸熙1号专项资产管理计划	10,231,336.00	1.02%
9	嘉宝莉化工集团股份有限公司	10,000,583.00	1.00%
10	广东省审计厅工会委员会	9,044,406.00	0.90%

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。

## 9.3 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	4,386,686.89	0.44%
	合计	4,386,686.89	0.15%

注：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）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年07月24日)	宝利A	宝利B
基金份额总额	1,923,767,949.20	1,000,147,732.94
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	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。

§ 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2013年10月15日发布公告，聘任刘入领为安信基金管理有限责任公司总经理。

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

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化,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0.5年，本报告期应支付的报酬为人民币90,000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

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	—	—	1,429,684,971.69	100.00%	36,473,828,000.00	100.00%	—	—	—	—	新增

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。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	关于安信基金管理有限责任公司从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报	2013-12-18
2	安信基金管理有限责任公司关于新增东海证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-12-06
3	安信基金管理有限责任公司关于设立子公司的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-12-04

4	安信基金管理有限责任公司关于新增申银万国证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-10-26
5	安信宝利分级债券型证券投资基金2013年第3季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2013-10-23
6	安信宝利分级债券型证券投资基金之宝利B份额上市交易提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2013-10-21
7	安信宝利分级债券型基金之宝利B份额上市交易公告书	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2013-10-16
8	2013年度 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	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-10-15
9	安信基金管理有限责任公司关于增加注册资本的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-08-17
10	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者警惕不法人员假冒安信基金名义实施非法证券活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-08-06
11	安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报	2013-07-25
12	关于安信宝利分级债券型证券投资基金之宝利A份额第一个运作期年约定收益率的公告	中国证券报、上海证券报	2013-07-25

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 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

二〇一四年三月二十九日