

安信宝利债券型证券投资基金（LOF）2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§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合规守信情况的说明.....	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的说明.....	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	36
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	36
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.11 投资组合报告附注.....	36
§8 基金份额持有人信息	37

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2 期末上市基金前十名持有人	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	38
§9 开放式基金份额变动.....	39
§10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	40
§11 备查文件目录.....	43
11.1 备查文件目录	43
11.2 存放地点	43
11.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信宝利债券型证券投资基金（LOF）
基金简称	安信宝利（LOF）
场内简称	安信宝利（LOF）
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	942,510,952.47 份
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、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。

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	乔江晖	洪渊
	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莲花	北京市西城区复兴门内大街 55

	街道益田路 6009 号新世界 商务中心 36 层	号
办公地址	广东省深圳市福田区莲花 街道益田路 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	刘入领	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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	www.essencefund.com
基金半年度报告备置地点	安信基金管理有限责任公司 地址：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	64,070,176.64
本期利润	30,139,348.76
加权平均基金份额本期利润	0.0202
本期加权平均净值利润率	1.93%
本期基金份额净值增长率	2.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	165,251,616.49
期末可供分配基金份额利润	0.1753
期末基金资产净值	998,634,362.05
期末基金份额净值	1.060
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.08%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平

要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

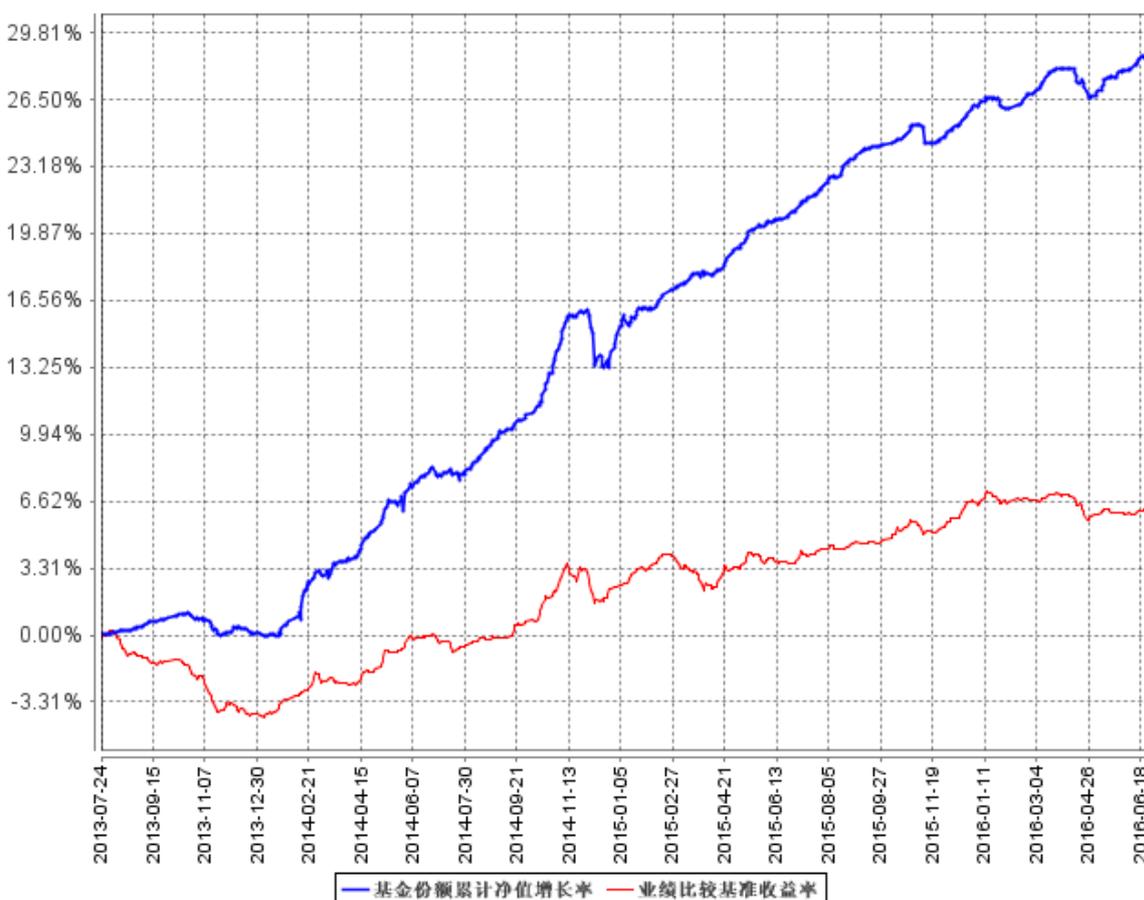
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.93%	0.06%	0.36%	0.04%	0.57%	0.02%
过去三个月	0.81%	0.09%	-0.52%	0.07%	1.33%	0.02%
过去六个月	2.27%	0.07%	-0.21%	0.07%	2.48%	0.00%
过去一年	6.74%	0.07%	2.74%	0.07%	4.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	29.08%	0.12%	6.41%	0.09%	22.67%	0.03%

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。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 19 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；从 2016 年 3 月 9 日起管理安信安盈保本混合型证券投资基金；从 2016 年 5 月 9 日起管理安信新回报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		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	-	12	庄园女士，经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员，工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员，中国国际金融有限公司资产管理部高级经理，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理。2012 年 5 月加入安信基金管理有限公司固定收益部。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理；现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信价值精选股

					票型证券投资基金的基金经理助理，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)、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；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》、《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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年一季度债券市场继续走出了牛市行情，央行继续维持宽松的货币政策，债市资金供给增多，债券配置需求持续上升，收益率小幅下行，信用利差持续缩窄，处于历史较低水平，5 年 AA 的企业债收益率处于 4.5% 以下水平。另外，美联储加息预期减弱，人民币汇率稳定，以及外围宽松的货币政策，均对债券构成利好因素，债市做多热情依旧。但 3 月下旬始，经济基本面数据和金融数据均持续好转，引发市场经济企稳预期，谨慎情绪上升。二季度固定收益市场在针对各类券种的种种利空、后又逐步解除的影响下，总体走出了 V 型走势。

一季度安信宝利基金维持了较高的杠杆，在维持组合总体久期的前提下，着重增加了中长期利率债和同业存单的哑铃型配置。信用债方面精选个券，严格控制风险，根据规模变化增加了公司债的配置。二季度初期净值有一段时间的停滞，随后受到市场调整叠加较大的赎回影响净值有较大幅度的回调，在此期间，在总体对后市乐观的判断下，宝利基金除了必要的减仓之外维持了较高的杠杆，后期市场反弹后净值有较快的恢复并进一步上行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金的基金份额净值为 1.060 元，报告期内收益率为 2.27%，同期业绩比较基准收益率为 -0.21%，超过同期业绩比较基准 2.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度末以来，各类债券品种收益率整体下行，市场情绪有所恢复，但是利率债各期限利差已经处于历史相对低位，利率虽然下行，但是和去年下半年已不能同日而语，每个点位争夺都比较激烈，市场情绪仍然不稳，也反应了现在投资对于未来市场的预期走势的不确定。在目前稳健货币政策的环境下，央行大概率会持续利用逆回购、MLF 等多种手段平复货币市场波动，降准或不可预期。信用债方面，未来 2 个月也是评级下调的密集期，市场对于风险的防范明显提高，下半年还有 2.8 万亿信用债到期，8 月和 11 月是兑付高峰，这也会进一步阻止利率下行的步伐。

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其适用性的情况时，运营部应及时提请估值委员会召开会议修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会会议决议须经全体委员半数以上投票表决同意方能通过，并形成书面文件妥善保管。对于重大事项，应在充分征求监管机构、托管银行、会计师事务所、律师事务所意见的基础上，再行表决。估值政策和程序的修订经估值委员会审批通过后方可实施。

估值委员会中各成员的职责分工如下：运营部凭借专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。研究部凭借丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展及个股状况等因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果建议应采用的估值方法及合理的估值区间。研究部根据估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核部对估值委员会临时会议的全程讨论、做出的决议、提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。投资部门相关人员和基金经理有权列席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人未与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

本报告期内，本基金托管人在对安信宝利债券型证券投资基金(LOF)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，安信宝利债券型证券投资基金(LOF)的管理人—安信基金管理有限责任公司在安信宝利债券型证券投资基金(LOF)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，安信宝利债券型证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的安信宝利债券型证券投资基金(LOF)2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安信宝利债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,186,484.20	8,687,085.27
结算备付金		72,248,574.15	124,556,566.67
存出保证金		189,388.69	44,411.61
交易性金融资产	6.4.7.2	1,481,770,495.91	2,867,668,299.48
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,481,770,495.91	2,867,668,299.48
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		930,472.98	16,717,901.14
应收利息	6.4.7.5	47,482,239.80	52,017,576.29
应收股利		-	-
应收申购款		71,067.98	80,473.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	14,523,540.99	15,435,836.07
资产总计		1,619,402,264.70	3,085,208,150.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		619,600,000.00	1,259,300,000.00
应付证券清算款		-	16,001,009.53
应付赎回款		216,097.23	3,953,491.59
应付管理人报酬		547,059.35	1,105,419.91
应付托管费		156,302.68	315,834.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,637.50	36,893.38
应交税费		-	-
应付利息		42,821.20	4,751.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	198,984.69	112,950.08
负债合计		620,767,902.65	1,280,830,349.94
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	804,266,033.80	1,486,218,902.47
未分配利润	6.4.7.10	194,368,328.25	318,158,897.92
所有者权益合计		998,634,362.05	1,804,377,800.39
负债和所有者权益总计		1,619,402,264.70	3,085,208,150.33

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.060 元，基金份额总额 942,510,952.47 份。

6.2 利润表

会计主体：安信宝利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		46,093,849.39	164,724,006.60

1.利息收入		62,554,114.20	101,649,634.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,086,149.61	12,863,866.09
债券利息收入		61,380,566.76	88,449,001.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		87,397.83	336,766.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,994,817.21	63,300,944.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	16,994,817.21	63,300,944.13
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-33,930,827.88	-226,571.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	475,745.86	-
减：二、费用		15,954,500.63	32,527,454.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,432,043.92	9,040,867.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,552,012.56	2,583,105.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	6,457,762.72
4. 交易费用	6.4.7.20	17,174.08	20,073.27
5. 利息支出		8,727,681.93	14,169,611.91
其中：卖出回购金融资产支出		8,727,681.93	14,169,611.91
6. 其他费用	6.4.7.21	225,588.14	256,033.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,139,348.76	132,196,552.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,139,348.76	132,196,552.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信宝利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基	1,486,218,902.47	318,158,897.92	1,804,377,800.39

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,139,348.76	30,139,348.76
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）	-681,952,868.67	-153,929,918.43	-835,882,787.10
其中：1.基金申购款	915,065,987.62	206,640,835.04	1,121,706,822.66
2.基金赎回款	-1,597,018,856.29	-360,570,753.47	-1,957,589,609.76
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）	804,266,033.80	194,368,328.25	998,634,362.05
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	132,196,552.11	132,196,552.11
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）	544,800,070.83	41,707,625.01	586,507,695.84
其中：1.基金申购款	984,596,268.31	75,376,590.69	1,059,972,859.00
2.基金赎回款	-439,796,197.48	-33,668,965.68	-473,465,163.16
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）	2,368,783,790.18	384,945,836.38	2,753,729,626.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘入领 _____
_____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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”，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人民币 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。

根据《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》和《安信宝利分级债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金自基金合同生效之日起 2 年内，每满 6 个月的最后一个工作日，基金管理人将对宝利 A 进行基金份额折算，宝利 A 的基金份额净值调整为 1.000 元。基金份额持有人持有的宝利 A 份额数量按折算比例相应增减。自基金合同生效之日起 2 年内，宝利 B 封闭运作，封闭期不接受申购赎回。2014 年 1 月 23 日为宝利 A 的第 1 个基金份额折算基准日，宝利 A 折算前的基金份额总额为 1,923,767,949.20 份，折算比例为 1.02268493，折算后的基金份额总额为 1,967,408,493.36 份。2014 年 7 月 23 日为宝利 A 的第 2 个基金份额折算基准日，宝利 A 折算前的基金份额总额为 294,305,951.71 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 的份额未发生变化，仍为 1,000,147,732.94 份。

根据《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》，本基金于生效后 2 年分级运作期届满，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金 (LOF)。基金名称在份额转换日变更为“安信宝利债券型证券投资基金 (LOF)”。宝利 A 和宝利 B 的基金份额以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金 (LOF) 份额，并办理基金的申购与赎回业务。根据《安信宝利分级债券型证券投资基金分级运作期届满基金份额折算和转换结果的公告》，本基金的基金份额转换日为 2015 年 7 月 24 日，本基金转换成上市开放式基金 (LOF) 后的基金份额净值调整为人民币 1.000 元。在基金份额转换日，宝利 A 折算前的基金份额总额为 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通。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券（含可分离交易的可转换债券）、债券回购和银行存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可参与一级市场新股的申购或增发，以及可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资可分离交易可转债而产生的权证等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产投资比例为：债券的投资比例不低于基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为中债综合指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

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。

6.4.6.3 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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	2,186,484.20
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计：	2,186,484.20
-----	--------------

注：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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,292,164,819.16	1,327,826,495.91
	银行间市场	151,057,610.54	153,944,000.00
	合计	1,443,222,429.70	1,481,770,495.91
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,443,222,429.70	1,481,770,495.91	38,548,066.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,904.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	32,511.80
应收债券利息	47,447,737.92
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	85.20
合计	47,482,239.80

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	14,523,540.99
待摊费用	-
合计	14,523,540.99

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	6,637.50
合计	6,637.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	80.53
预提费用	198,904.16
合计	198,984.69

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,741,475,728.39	1,486,218,902.47
本期申购	1,072,212,860.43	915,065,987.62

本期赎回(以“-”号填列)	-1,871,177,636.35	-1,597,018,856.29
本期末	942,510,952.47	804,266,033.80

6.4.7.10 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
上年度末	220,872,044.76	97,286,853.16	318,158,897.92
本期利润	64,070,176.64	-33,930,827.88	30,139,348.76
本期基金份额交易产生的变动数	-119,690,604.91	-34,239,313.52	-153,929,918.43
其中：基金申购款	154,572,442.41	52,068,392.63	206,640,835.04
基金赎回款	-274,263,047.32	-86,307,706.15	-360,570,753.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	165,251,616.49	29,116,711.76	194,368,328.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	192,791.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	887,998.48
其他	5,360.06
合计	1,086,149.61

注：其他存款利息收入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利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	16,994,817.21
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	16,994,817.21

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,468,347,947.09
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,390,465,208.74
减：应收利息总额	60,887,921.14
买卖债券差价收入	16,994,817.21

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

本基金本期无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-33,952,827.88
——股票投资	-
——债券投资	-33,952,827.88
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	22,000.00

合计	-33,930,827.88
----	----------------

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	475,745.86
合计	475,745.86

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,636.58
银行间市场交易费用	14,537.50
合计	17,174.08

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
银行划款费用	7,883.98
银行间帐户维护费	18,800.00
合计	225,588.14

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 权证交易

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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,432,043.92	9,040,867.86
其中：支付销售机构的客户维护费	168,980.92	2,345,477.04

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

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,552,012.56	2,583,105.13

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

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行	-
安信基金直销	-
安信证券	-
合计	-
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的销售服务费	
中国工商银行	754,194.12
安信基金直销	589,588.61
安信证券	370,882.30
合计	1,714,665.03

注：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。基金合同生效后 2 年期届满自动转换为“安信宝利债券型证券投资基金（LOF）”后，不再收取销售服务费。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
安信证 券股份 有限公 司	28,570,667.33	3.4153%	28,570,667.33	1.8109%

6.4.10.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,186,484.20	192,791.07	166,207,232.05	459,482.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 619,600,000.00 元，分别于 2016 年 7 月 1 日至 2016 年 7 月 12 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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为包括在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、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、可分离债券、回购和银行存款等金融工具，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内。

6.4.13.2 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 2016 年 6 月 30 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 148.37%（2015 年 12 月 31 日为 156.11%）。

6.4.13.2.1 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	上年度末
--------	-----	------

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
A-1	-	71,485,024.04
A-1 以下	-	-
未评级	-	214,038,484.12
合计	-	285,523,508.16

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	57,507,471.68	700,676,875.40
AAA 以下	1,471,710,762.00	1,881,074,932.22
未评级	-	52,341,325.14
合计	1,529,218,233.68	2,634,093,132.76

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,186,484.20	-	-	-	2,186,484.20
结算备付金	72,248,574.15	-	-	-	72,248,574.15
存出保证金	189,388.69	-	-	-	189,388.69
交易性金融资产	103,794,083.20	190,813,811.80	1,187,162,600.91	-	1,481,770,495.91
应收证券清算款	-	-	-	930,472.98	930,472.98
应收利息	-	-	-	-47,482,239.80	47,482,239.80
应收申购款	-	-	-	71,067.98	71,067.98
其他资产	-	-	-	-14,523,540.99	14,523,540.99
资产总计	178,418,530.24	190,813,811.80	1,187,162,600.91	63,007,321.75	1,619,402,264.70
负债					
卖出回购金融资产款	619,600,000.00	-	-	-	619,600,000.00
应付赎回款	-	-	-	216,097.23	216,097.23
应付管理人	-	-	-	547,059.35	547,059.35

报酬					
应付托管费	-	-	-	156,302.68	156,302.68
应付交易费用	-	-	-	6,637.50	6,637.50
应付利息	-	-	-	42,821.20	42,821.20
其他负债	-	-	-	198,984.69	198,984.69
负债总计	619,600,000.00	-	-	1,167,902.65	620,767,902.65
利率敏感度缺口	-441,181,469.76	190,813,811.80	1,187,162,600.91	61,839,419.10	998,634,362.05
上年度末 2015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	8,687,085.27	-	-	-	8,687,085.27
结算备付金	124,556,566.67	-	-	-	124,556,566.67
存出保证金	44,411.61	-	-	-	44,411.61
交易性金融资产	1,006,961,642.00	1,853,941,475.80	6,765,181.68	-	2,867,668,299.48
应收证券清算款	-	-	-	-16,717,901.14	16,717,901.14
应收利息	-	-	-	-52,017,576.29	52,017,576.29
应收申购款	-	-	-	80,473.80	80,473.80
其他资产	-	-	-	-15,435,836.07	15,435,836.07
资产总计	1,140,249,705.55	1,853,941,475.80	6,765,181.68	84,251,787.30	3,085,208,150.33
负债					
卖出回购金融资产款	1,259,300,000.00	-	-	-	1,259,300,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-16,001,009.53	16,001,009.53
应付赎回款	-	-	-	-3,953,491.59	3,953,491.59
应付管理人报酬	-	-	-	-1,105,419.91	1,105,419.91
应付托管费	-	-	-	-315,834.28	315,834.28
应付交易费用	-	-	-	-36,893.38	36,893.38
应付利息	-	-	-	-4,751.17	4,751.17
其他负债	-	-	-	-112,950.08	112,950.08
负债总计	1,259,300,000.00	-	-	-21,530,349.94	1,280,830,349.94
利率敏感度缺口	-119,050,294.45	1,853,941,475.80	6,765,181.68	62,721,437.36	1,804,377,800.39

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率意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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1、市场利率下降 25 个基点	8,146,540.92	14,220,145.32
	2、市场利率上升 25 个基点	-8,064,129.57	-14,139,827.25

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他价格风险。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,481,770,495.91	91.50
	其中：债券	1,481,770,495.91	91.50
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	74,435,058.35	4.60
7	其他各项资产	63,196,710.44	3.90
8	合计	1,619,402,264.70	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,327,347,537.90	132.92
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	153,944,000.00	15.42
7	可转债（可交换债）	478,958.01	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,481,770,495.91	148.38

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	124408	13 宛城投	800,000	84,808,000.00	8.49
2	124342	13 黔南资	800,000	83,824,000.00	8.39
3	122833	11 赣城债	712,000	74,631,840.00	7.47
4	101569028	15 泛海 MTN001	700,000	72,016,000.00	7.21
5	101552039	15 渝兴永 MTN001	700,000	71,960,000.00	7.21

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	189,388.69
2	应收证券清算款	930,472.98
3	应收股利	-
4	应收利息	47,482,239.80
5	应收申购款	71,067.98
6	其他应收款	14,523,540.99
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,196,710.44

7.11.4 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	127003	海印转债	478,958.01	0.05

7.11.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,397	393,204.40	836,551,085.15	88.76%	105,959,867.32	11.24%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	嘉实基金—招商银行—华润信托—华润信托·鑫睿3号单一资金	135,731,137.00	14.40%
2	华泰紫金节假日理财集合资产管理计划	96,060,518.73	10.19%
3	招商财富金利5号保本专项资产管理计划	76,334,923.66	8.10%
4	安信基金博时资本1号资产管理计划	76,189,523.81	8.08%
5	浦银安盛资管-浦发银行-上海浦东发展银行股份有限公司天津分行	76,170,499.93	8.08%
6	招商财富金利4号保本专项资产管理计划	57,250,469.13	6.07%
7	招商财富金利2号保本专项资产管理计划	47,845,933.01	5.08%
8	安信基金-浦发银行-中证信用稳健增长1号资产管理计划	37,842,005.68	4.02%
9	安信证券股份有限公司	28,570,667.33	3.03%
10	宏源证券股债双丰6号集合资产管理计划	17,845,933.01	1.89%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,832,377.84	0.3005%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	50~100

本基金基金经理持有本开放式基金	>100
-----------------	------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年7月24日）基金份额总额	1,000,147,732.94
本报告期期初基金份额总额	1,741,475,728.39
本报告期基金总申购份额	1,072,212,860.43
减：本报告期基金总赎回份额	1,871,177,636.35
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	942,510,952.47

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2016年4月12日发布公告，聘任陈振宇先生为安信基金管理有限责任公司副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	1,770,321,483.88	100.00%	117,576,109,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016年1月6日

2	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持清新环境(002573)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
3	安信基金管理有限责任公司关于公司法定代表人变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 16 日
4	安信宝利债券型证券投资基金（LOF）2015 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 20 日
5	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 28 日
6	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持万科 A（000002）估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 29 日
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持众和股份(002070)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 2 月 4 日
8	安信宝利债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 2 月 25 日
9	安信基金管理有限责任公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 2 月 25 日
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持科大讯飞(002230)估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 3 月 18 日
11	安信宝利债券型证券投资基金（LOF）2015 年度报告摘要	上海证券报、中国证券报、证券时报	2015 年 3 月 25 日
12	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分公募基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 3 月 30 日

	基金申购费率优惠活动的公告		
13	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变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 1 日
14	安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
15	关于新增上海陆家嘴资产管理有 限公司为我司旗下基金代销机构 并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
16	安信宝利债券型证券投资基金 （LOF）2016 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 22 日
17	安信基金管理有限公司关于旗下 部分基金参加上海好买基金销售 有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 28 日
18	关于安信基金管理有限责任公司 新增开放式基金销售代理服务机 构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 11 日
19	安信基金管理有限责任公司关于 旗下基金投资资产支持证券的公 告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 18 日
20	安信基金管理有限责任公司关于 旗下基金所持万家文化估值调整 的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 19 日
21	安信基金管理有限责任公司关于 旗下基金所持苏交科、天通股份 估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 1 日
22	安信基金管理有限责任公司关于 调整开户证件类型的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 18 日
23	安信基金关于变更基金直销账户	上海证券报、中国证券报、证券时报	2016 年 6 月 20 日

	信息的公告	券报、证券时报	
--	-------	---------	--

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信宝利债券型证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《安信宝利债券型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《安信宝利债券型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《安信宝利债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 5、《安信宝利债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

11.2 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莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

11.3 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
2016 年 8 月 25 日