

# 安信宝利债券型证券投资基金（LOF）2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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

报告送出日期：2016 年 10 月 24 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 2016 年 10 月 20 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	安信宝利（LOF）
场内简称	安信宝利（LOF）
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,386,145,272.02 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
-------	--------------

### § 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（2016 年 7 月 1 日 — 2016 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	26,848,606.37
2. 本期利润	45,505,492.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0405
4. 期末基金资产净值	1,524,789,355.79
5. 期末基金份额净值	1.100

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

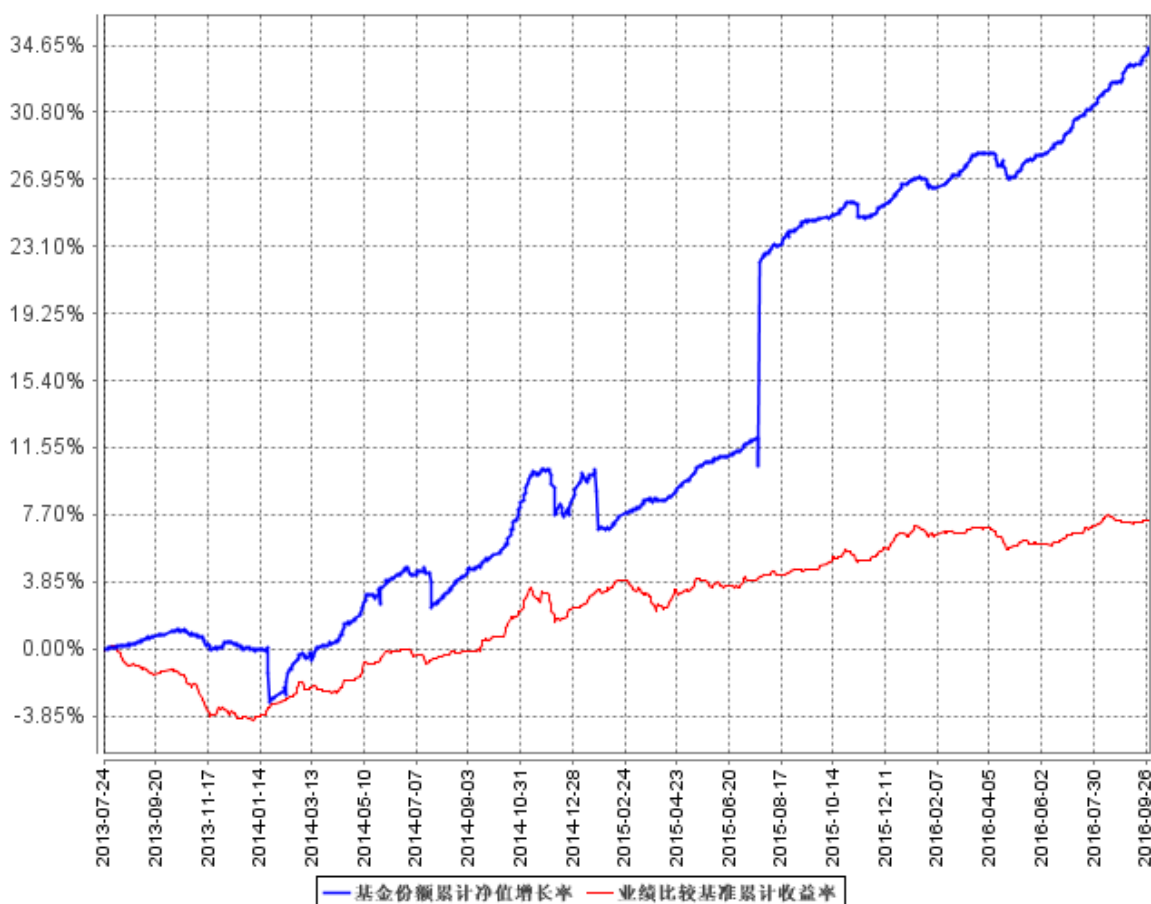
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.77%	0.07%	0.91%	0.05%	2.86%	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

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



注：1、本基金的建仓期为2013年7月24日至2014年1月23日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

2、本基金基金合同生效日为2013年7月24日。图示日期为2013年7月24日至2016年9月30日。

## § 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	-	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。

				<p>2012 年 5 月加入安信基金管理有限责任公司固定收益部。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、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置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、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、此处的“任职日期”、“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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

过去的三个月，债市整体呈现先下后上的“V”字型走势，近期又开始震荡下行。具体看 7

月份债市持续下行，8 月上旬也延续了下行的趋势，创下新低。8 月中旬以来，央行开启了 14 天逆回购操作引发市场去杠杆的担忧，同时前期交易盘获利回吐，收益率开始缓慢上行。8 月份的经济数据略超市场预期，不过由于机构配置需求依然较大，加上市场投资者预期经济平稳较难持续，整体利率债市买盘活跃，收益率下行。信用利差方面，进入三季度以来先下后上，高等级、短期限品种反弹上行较多。8 月份基准利率上行，信用利差也开始反弹，其中高等级、短期限受流动性因素制约反弹较多，而低等级、中长期债券反弹较少，产能过剩行业债券行情趋势尚未逆转。

宝利三季度在维持基本仓位的基础上进行了利率债的波段操作，根据申购情况增加了短期和长期高评级债券的配置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.100 元，本报告期份额净值增长率为 3.77%，同期业绩比较基准增长率为 0.91%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,664,983,551.56	80.01
	其中：债券	1,664,983,551.56	80.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	180,000,510.00	8.65
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	164,607,113.66	7.91
8	其他资产	71,256,248.39	3.42
9	合计	2,080,847,423.61	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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。

### 5.2.2 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。

## 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	5,952,947.00	0.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	245,534,100.00	16.10
	其中：政策性金融债	245,534,100.00	16.10
4	企业债券	1,191,956,535.76	78.17
5	企业短期融资券	20,009,000.00	1.31
6	中期票据	52,914,000.00	3.47
7	可转债（可交换债）	796,968.80	0.05
8	同业存单	147,820,000.00	9.69
9	其他	-	-
10	合计	1,664,983,551.56	109.19

## 5.5 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	111698025	16 南京银行 CD115	1,000,000	98,560,000.00	6.46
2	124408	13 宛城投	800,000	85,616,000.00	5.61
3	160408	16 农发 08	800,000	81,264,000.00	5.33
4	122833	11 赣城债	700,000	73,528,000.00	4.82
5	124342	13 黔南资	800,000	69,336,000.00	4.55

## 5.6 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 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。

### 5.9.3 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。

## 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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	150,984.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,478,507.48
5	应收申购款	13,103,215.69
6	其他应收款	14,523,540.99
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,256,248.39



#### 5.10.4 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处于转股期的可转换债券。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	942,510,952.47
报告期期间基金总申购份额	606,723,988.18
减：报告期期间基金总赎回份额	163,089,668.63
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	1,386,145,272.02

注：申购含红利再投份额。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

#### 7.2 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，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

### § 8 备查文件目录

#### 8.1 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、《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。

## 8.2 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莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

## 8.3 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 10 月 24 日