安信宝利分级债券型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

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

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计,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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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。

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	安信基金管理有限责任公司 地址:广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	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

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。

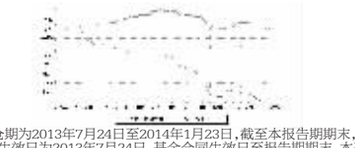
3.2 基金净值表现

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: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、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。宏观经济基本面上,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"彩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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《安信基金管理有限责任公司估值管理制度》开展。

公司基金的日常估值业务由运营部负责,运营部在日常估值管理中,必须严格遵循各项法律法规及基金合同的规定,及时准确对基金资产估值事项进行基金估值。运营部对基金所使用的估值系统进行总体规划和组织实施,建立并不断完善基金资产估值系统。另外,公司成立基金估值委员会,主任委员由公司总经理担任,成员由副总经理、运营部、研究部、监察稽核部人员组成,投资部门相关人员列席。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度,建立健全估值决策体系,确定不同基金产品及投资品种的估值方法,保证公司估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会采取临时会议的方式召开会议,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时,运营部应及时提请估值委员会召开会议修订估值方法,以保证其持续适用。估值委员会会议决议须经全体委员半数以上投票表决同意方能通过,并形成书面文件妥善保管。对于重大事项,应在充分征求监管机构、托管银行、会计师事务所、律师事务所意见的基础上,再行表决。估值政策和程序的修订经估值委员会审批通过后方可实施。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据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、基金费用开支及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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

7.4.9 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

7.4.10 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 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。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 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。

7.4.10.3.2 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。

§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前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

份额级别	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

项目	宝利A	宝利B
	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,聘任刘人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	占当期佣金总额的比例		
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。

安信基金管理有限责任公司
二〇一四年三月二十九日