

安信宝利债券型证券投资基金(LOF)

[2015] 第三季度报告

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:2015年10月26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基金合同约定，于2015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。

本报告附录中财务数据未经审计。

本报告期自2015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
交易代码	167601
基金运作方式	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	3,366,043,974.06份
投资目标	在适度控制风险的情况下，力争实现基金财产长期稳定的超越通胀收益。
投资策略	本基金的主要投资策略为信用投资，通过信用利差定价，获取票息收入、收取利息、回购条款等投资策略，在适度控制风险的基础上，通过分散投资于不同类型的债券品种，力求实现基金财产长期稳定的超越通胀收益。
业绩比较基准	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率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。
风险收益特征	本基金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率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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	50,515,067.19
2.本期利润	71,306,302.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0276
4.期末基金份额净值	3,421,680,411.42
5.期末基金资产净值	1,020

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，计算费用后实际收益水平要低于所示的数字；

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 基金本期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(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)
过去三个月	12.02%	1.34%	1.12%	0.00%

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净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

3.2.3 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

3.2.4 本基金报告期内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

3.2.5 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

3.2.6 本基金报告期内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组合

3.2.7 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

3.2.8 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

3.2.9 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.10 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.11 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.12 本基金报告期内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组合

3.2.13 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.14 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.15 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.16 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.17 本基金报告期内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组合

3.2.18 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.19 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.20 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.21 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.22 本基金报告期内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组合

3.2.23 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.24 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.25 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.26 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.27 本基金报告期内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组合

3.2.28 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.29 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.30 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.31 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.32 本基金报告期内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组合

3.2.33 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.34 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.35 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.36 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.37 本基金报告期内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组合

3.2.38 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.39 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.40 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.41 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.42 本基金报告期内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组合

3.2.43 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.44 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.45 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.46 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.47 本基金报告期内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组合

3.2.48 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.49 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.50 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.51 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.52 本基金报告期内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组合

3.2.53 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.54 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.55 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.56 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.57 本基金报告期内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组合

3.2.58 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.59 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.60 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.61 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.62 本基金报告期内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组合

3.2.63 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.64 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.65 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.66 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.67 本基金报告期内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组合

3.2.68 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.69 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.70 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.71 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.72 本基金报告期内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组合

3.2.73 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.74 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.75 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.76 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.77 本基金报告期内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组合

3.2.78 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.79 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.80 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.81 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.82 本基金报告期内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组合

3.2.83 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.84 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.85 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

3.2.86 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金衍生品投资组合

3.2.87 本基金报告期内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组合

3.2.88 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

3.2.89 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资组合

3.2.90 本基金报告期内按公允价值占基金资产净值