

安信宝利分级债券型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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

报告日期：2015年7月21日

\$1 重要提示

基金管理人和基金份额持有人应根据本报告所载资料不存虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，对本内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人：安信基金管理有限责任公司根据本基金合同规定，于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和基金组合报告内容，保证复核后不存在虚假记载、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。

基金经理过往业绩并不代表其未来表现。投资人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2015年4月1日起至6月30日止。

\$2 基金产品概况

基金简称 安信宝利分级债券

基金代码 167501

基金运作方式 约定型

基金合同生效日 2013年7月24日

报告期末基金份额总额 2,473,560,866.06份

在适度控制风险的情况下，力争实现基金财产当期稳定的回报率为投资目标。

随着股市的不断加大下行，政府措施频频出台，IPO暂缓，巨量的打新资金以及配资、理财等资金短期内会选择观望或进入债市避险，债券收益率上升，收益有望下行。

基金经理：张海峰，具有10年证券从业经验，美国注册会计师，历任基金经理助理、研究员、基金经理等职务，现任基金经理。

基金经理过往业绩：2013年1月1日至2014年12月31日，本基金净值增长率为11.13%，同期业绩比较基准收益率为10.91%，超额收益为1.22%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金的基金份额主要将采用信用策略，从而有利于平衡利率、收益率和信用风险，力争在控制风险的基础上，通过信用分析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收益。

4.6 报告期内基金的净值表现

报告期末，本基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金份额净值低于6000万元人民币的情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着股市的不断加大下行，政府措施频频出台，IPO暂缓，巨量的打新资金以及配资、理财等资金短期内会选择观望或进入债市避险，债券收益率上升，收益有望下行。

基金经理：张海峰，具有10年证券从业经验，美国注册会计师，历任基金经理助理、研究员、基金经理等职务，现任基金经理。

基金经理过往业绩：2013年1月1日至2014年12月31日，本基金净值增长率为11.13%，同期业绩比较基准收益率为10.91%，超额收益为1.22%。

4.8 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.9 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.10 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.11 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.12 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.13 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.14 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.15 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.16 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.17 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.18 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.19 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.20 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.21 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.22 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.23 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.24 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.25 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.26 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.27 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.28 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.29 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.30 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.31 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.32 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.33 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.34 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.35 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.36 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.37 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.38 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.39 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.40 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.41 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.42 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.43 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.44 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.45 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.46 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.47 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.48 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.49 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.50 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.51 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.52 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.53 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.54 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.55 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.56 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.57 报告期内基金的收入情况

本基金的收入主要由利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入等组成。

4.58 报告期内基金的费用情况

本基金的费用主要由管理费、托管费、银行账户服务费、交易佣金、利息支出、卖出回购金融资产款、申购款、赎回款、手续费、交易费、印花税、汇兑损益、其他费用等组成。

4.59 报告期内基金的收入情况