安信宝利债券型证券投资基金（LOF） 2018年半年度报告摘要

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：2018年08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2018年8月28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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	安信宝利（LOF）
场内简称	安信宝利
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	414,681,920.13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	2015年8月7日

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	郭明
	联系电话	0755-82509999	010-66105798
	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	010-66105799

2.4 信息披露方式

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	基金管理人及基金托管人住所

§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(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	15,756,031.62
本期利润	20,327,990.13
加权平均基金份额本期利润	0.0503
本期基金份额净值增长率	4.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.3047
期末基金资产净值	480,924,933.61
期末基金份额净值	1.160

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；

3.2 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	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
过去一个月	0.69%	0.06%	0.34%	0.06%	0.35%	-0.01%
过去三个月	1.58%	0.06%	1.01%	0.10%	0.57%	-0.04%
过去六个月	4.60%	0.06%	2.16%	0.08%	2.44%	-0.02%
过去一年	5.55%	0.07%	0.83%	0.06%	4.72%	0.01%
过去三年	16.81%	0.08%	-0.04%	0.08%	16.85%	0.00%
自基金合同生效起至今	41.26%	0.11%	3.53%	0.09%	37.73%	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。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

注：1、本基金合同生效日为2013年7月24日。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3、本基金自2015年7月24日转为LOF基金。

§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5.0625亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有39.84%的股权，安信证券股份有限公司持有33.95%的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有20.28%的股权，中广核财务有限责任公司持有5.93%的股权。

截至2018年6月30日，本基金管理人共管理42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日至2018年5月28日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；从2016年7月28日起管理安信新优选灵活配置混合型证券投资基金；从2016年8月9日起管理安信新目标灵活配置混合型证券投资基金；从2016年8月19日起管理安信新价值灵活配置混合型证券投资基金；从2016年9月9日起管理安信保证金交易型货币市场基金；从2016年9月29日起管理安信新成长灵活配置混合型证券投资基金；从2016年9月29日起管理安信尊享纯债债券型证券投资基金；从2016年10月10日起管理安信永丰定期开放债券型证券投资基金；从2016年10月12日起管理安信沪深300指数增强型发起式证券投资基金；从2016年10月17日起管理安信活期宝货币市场基金；从2016年12月9日起管理安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金；从2016年12月19日起管理安信新视野灵活配置混合型证券投资基金；从2017年1月13日至2018年6月11日管理安信永鑫定期开放债券型证券投资基金；从2017年3月16日起管理安信新起点灵活配置混合型证券投资基金；从2017年3月16日起管理安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从2017年3月29日起管理安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金；从2017年7月3日起管理安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金；从2017年7月20日起管理安信工业4.0主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金；从2017年12月6日起管理安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金；从2017年12月28日起管理安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金从2018年3月14日起管理安信尊享添益债券型证券投资基金；从2018年3月21日起管理安信比较势灵活配置混合型证券投资基金；从2018年3月30日起管理安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金；从2018年6月1日起管理安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金；2018年6月12日起管理安信永鑫增强债券型证券投资基金；2018年6月21日起管理安信中证复兴发展100主题指数型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
庄园	本基金的基金经理	2013年7月24日	-	14	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、安信安盈保本混合型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、安信新优选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、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
李巍	本基金的基金经理助理	2016年10月25日	-	5	李巍先生，理学硕士。曾任海富通基金管理有限公司交易部债券交易员，富国基金管理有限公司交易部高级债券交易员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部投研助理。现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信宝利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、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置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、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信中国制造2025沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。现任安信永盛定期开放债券型发起式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》、《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

2018年2季度实际GDP同比增速从1季度的6.8%下降至6.7%，宏观数据显示，无论是在投资还是消费方面，内需增速均有所放缓。央行推出了一系列货币政策，以实现稳增长，防风险的权衡。定向降准由普惠金融变为置换中期借贷便利，直至债转股，由去杠杆变为稳杠杆；收回棚户区改审批权限，避免货币性安置使得PSL资金导致房地产价格大幅变动；不跟随美国加息，保持货币政策独立性。

利率债方面，截止6月底，上半年10年期国债收益率从3.90%震荡下行至3.47%，跌幅约40bp，10年期国开债收益率则从4.87%回落至4.25%，跌幅约60bp；信用债方面，主要受信用违约风险影响，相对于利率债而言信用债交投总体较为清淡，不同评级品种估值收益率曲线分化明显，AAA企业债下行幅度明显大于AA企业债。

本基金一季度根据市场情况少量参与了波段操作，在资金面比较宽松的大背景下维持了杠杆，并根据基金规模对持仓结构进行了一些调整。

二季度根据对债券市场的判断，增加了中长期利率债的配置，拉长了组合久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.160元，本报告期基金份额净值增长率为4.60%，同期业绩比较基准收益率为2.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中美贸易冲突、经济数据不及预期等多重外部冲击下，二季度市场流动性出现了脉冲式的改善，虽然当前债市情绪回暖，但我们认为短期在乐观当中还应保持警惕。一方面，流动性缓和的程度还取决于风险事件的进一步演化。另一方面，第三季度外汇占款增长可能出现放缓，市场将更为依赖央行主动操作对流动性的补给。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。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，保证基金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。估值委员会负责人由公司分管投资的副总经理担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、信用研究部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及信用研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。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。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

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，本基金本报告期未进行利润分配。

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

无。

§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，安信宝利分级债券型证券投资基金未进行利润分配。

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)2018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：2018年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	9,124,167.96	6,276,265.67
结算备付金	782,535.57	1,291,872.08
存出保证金	9,682.74	28,514.86
交易性金融资产	480,040,781.70	610,024,263.40
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	480,040,781.70	610,024,263.40
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	59,972,394.96	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	13,708,918.93	9,573,733.15
应收股利	-	-
应收申购款	74,109.93	2,379.50
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	123,540.99
资产总计	563,712,591.79	627,320,569.65
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	77,600,000.00	106,979,553.78
应付证券清算款	3,008,268.49	-
应付赎回款	186,011.62	882,017.58
应付管理人报酬	269,149.04	315,932.45
应付托管费	76,899.76	90,266.40
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,555.63	1,475.46
应交税费	51,744.09	-
应付利息	172,728.44	225,791.74
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,418,301.11	280,658.30
负债合计	82,787,658.18	108,775,695.71
所有者权益：		
实收基金	353,736,887.38	398,799,816.82
未分配利润	127,188,046.23	119,745,057.12
所有者权益合计	480,924,933.61	518,544,873.94
负债和所有者权益总计	563,712,591.79	627,320,569.65

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.160元，基金份额总额414,681,920.13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：2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年1月1日 至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至2017年6月30日
一、收入	24,229,596.47	19,426,553.47
1.利息收入	13,045,011.89	40,668,836.84
其中：存款利息收入	66,920.10	502,628.01
债券利息收入	12,744,137.93	39,371,977.88
资产支持证券利息收入	-	557,589.04
买入返售金融资产收入	233,953.86	236,641.91
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	6,558,889.50	-10,110,536.47
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,558,889.50	-10,276,184.38
资产支持证券投资收益	-	165,647.91
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	4,571,958.51	-11,725,304.95
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	53,736.57	593,558.05
减：二、费用	3,901,606.34	12,766,165.35
1. 管理人报酬	1,595,579.40	4,676,442.60
2. 托管费	455,879.86	1,336,126.39
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,492.27	16,040.80
5. 利息支出	1,563,318.38	6,428,087.53
其中：卖出回购金融资产支出	1,563,318.38	6,428,087.53
6. 税金及附加	41,649.08	-
7. 其他费用	241,687.35	309,468.03
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	20,327,990.13	6,660,388.12
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	20,327,990.13	6,660,388.12

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：2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	398,799,816.82	119,745,057.12	518,544,873.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,327,990.13	20,327,990.13
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）	-45,062,929.44	-12,885,001.02	-57,947,930.46
其中：1.基金申购款	170,511,253.94	59,193,358.33	229,704,612.27
2.基金赎回款	-215,574,183.38	-72,078,359.35	-287,652,542.73
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）	353,736,887.38	127,188,046.23	480,924,933.61
	上年度可比期间 2017年1月1日 至2017年6月30日		
项目	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）	1,269,478,971.38	348,158,636.35	1,617,637,607.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,660,388.12	6,660,388.12
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）	-621,635,093.19	-168,128,159.47	-789,763,252.66
其中：1.基金申购款	1,287,519,153.97	352,774,656.58	1,640,293,810.55
2.基金赎回款	-1,909,154,247.16	-520,902,816.05	-2,430,057,063.21
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）	647,843,878.19	186,690,865.00	834,534,743.19

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	范瑛	苗杨
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747,745.31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，安信宝利(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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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）》及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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间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 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。

6.4.6.2 企业所得税

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。

6.4.6.3增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税（2017）90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

6.4.6.4 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、债券的利息及储蓄利息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，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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“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

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、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,595,579.40	4,676,442.60
其中：支付销售机构的客户维护费	110,096.24	214,789.64

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×0.70%/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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	455,879.86	1,336,126.39

注：在基