

信达澳银稳定价值债券型证券投资基金 2011 年半年度报告摘要

2011 年 06 月 30 日

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2011 年 08 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 08 月 22 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 2011 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金简称            | 信达澳银稳定价值债券       |                 |
| 基金主代码           | 610003           |                 |
| 交易代码            | 610003           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2009 年 04 月 08 日 |                 |
| 基金管理人           | 信达澳银基金管理有限公司     |                 |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 102,681,331.04 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 信达澳银稳定价值债券 A     | 信达澳银稳定价值债券 B    |
| 下属分级基金的交易代码:    | 610003           | 610103          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 59,296,585.45 份  | 43,384,745.59 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 从长期来看,在有效控制本金风险的前提下,主要追求债券票息收入的最大化,力争实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略   | 本基金秉承本公司自下而上的价值投资理念,把注意力集中在对个券公允价值的研究上,精选价值相对低估的个券品种进行投资。通过整体资产配置、类属资产配置、期限配置等手段,有效构造投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 中国债券总指数收益率。  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,风险收益水平较低,长期预期风险收益高于货币市场基金、低于股票和混合基金。   |

### 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          |      | 信达澳银基金管理有限公司           | 中国建设银行股份有限公司      |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 黄晖                     | 尹东                |
|             | 联系电话 | 0755-83172666          | 010-67595003      |
|             | 电子邮箱 | disclosure@fscinda.com | yindong.zh@ccb.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-8888-118           | 010-67595096      |
| 传真          |      | 0755-83196151          | 010-66275853      |

### 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.fscinda.com                 |
| 基金半年度报告备置地点          | 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层 |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                 |
|--------|--------------|----------------------|
| 注册登记机构 | 信达澳银基金管理有限公司 | 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号 |

|  |             |
|--|-------------|
|  | 招商银行大厦 24 层 |
|--|-------------|

### § 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（2011 年 01 月 01 日-2011 年 06 月 30 日） |               |
|---------------|--|---------------|
|               | 信达澳银稳定价值债券 A                           | 信达澳银稳定价值债券 B  |
| 本期已实现收益       | 1,436,703.26                           | 1,944,545.82  |
| 本期利润          | 77,087.80                              | 416.39        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0025                                 | 0.0000        |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.37%                                  | 0.18%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2011 年 06 月 30 日）                 |               |
|               | 信达澳银稳定价值债券 A                           | 信达澳银稳定价值债券 B  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0990                                 | 0.0883        |
| 期末基金资产净值      | 65,167,505.61                          | 47,216,314.05 |
| 期末基金份额净值      | 1.099                                  | 1.088         |

注：1. 上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），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. 期末可供分配利润为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

信达澳银稳定价值债券 A

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | -0.18%   | 0.23%       | -0.42%     | 0.10%         | 0.24%  | 0.13% |
| 过去三个月      | 0.73%    | 0.25%       | 0.36%      | 0.07%         | 0.37%  | 0.18% |
| 过去六个月      | 0.37%    | 0.29%       | 1.03%      | 0.08%         | -0.66% | 0.21% |
| 过去一年       | 8.49%    | 0.32%       | -0.44%     | 0.10%         | 8.93%  | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.90%    | 0.27%       | 3.50%      | 0.08%         | 6.40%  | 0.19% |

信达澳银稳定价值债券 B

| 阶段         | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月      | -0.27%       | 0.22%               | -0.42%             | 0.10%                 | 0.15%  | 0.12% |
| 过去三个月      | 0.55%        | 0.26%               | 0.36%              | 0.07%                 | 0.19%  | 0.19% |
| 过去六个月      | 0.18%        | 0.30%               | 1.03%              | 0.08%                 | -0.85% | 0.22% |
| 过去一年       | 7.94%        | 0.32%               | -0.44%             | 0.10%                 | 8.38%  | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.80%        | 0.27%               | 3.50%              | 0.08%                 | 5.30%  | 0.19% |

注：中国债券总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，具有较强的代表性、公正性与权威性，可以较好的衡量固定收益类投资的业绩。

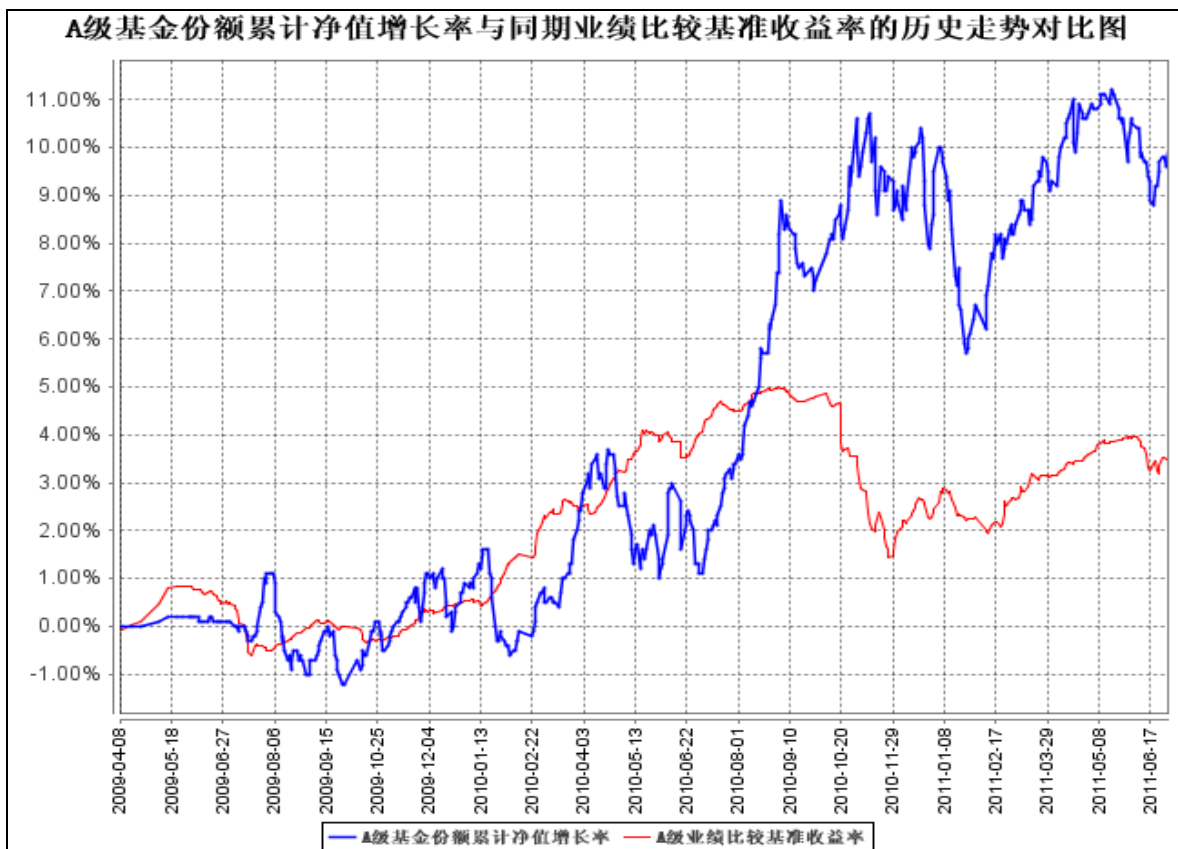
鉴于本基金的投资范围是“固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的 80%，持有股票等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%”，本基金固定收益类投资的比例超过 80%，而权益类投资比例较低且仅限于首发/增发新股和可转换债券/权证的转股，因此本基金的业绩比较基准为固定收益类投资基准。

本基金的业绩比较基准将根据中国债券总指数的编制规则进行每日再平衡，详细的编制规则敬请参见中央国债登记结算有限责任公司网站：

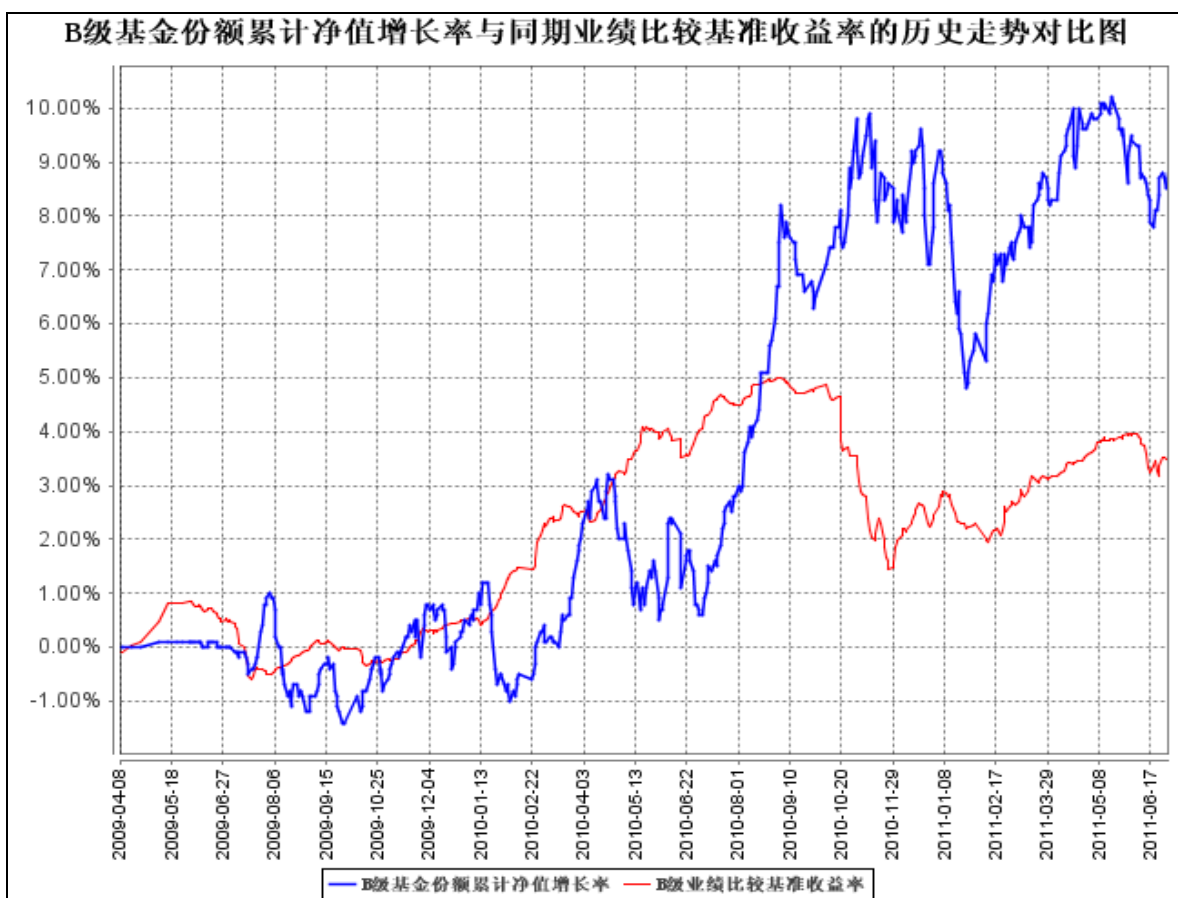
<http://www.chinabond.com.cn>

### 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

信达澳银稳定价值债券 A



信达澳银稳定价值债券 B



注：1. 本基金基金合同于 2009 年 04 月 08 日生效，2009 年 06 月 01 日开始办理申购、赎回业务。

2. 本基金的投资组合比例为：固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的 80%，持有股票等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

## § 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

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，由中国信达资产管理股份有限公司（原中国信达资产管理公司）和澳洲联邦银行全资附属公司康联首域集团有限公司共同发起，是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司，也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设在深圳，在北京设有分公司。公司中方股东中国信达资产管理股份有限公司出资比例为 54%，外方股东康联首域集团有限公司出资比例为 46%。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和监事。股东会层面设立公司咨询委员会，董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司总经理负责公司的日常运作，并由经营管理委员会、投资审议委员会和风险管理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立监察稽核部、投资研究部、市场开发部、运营保障部、行政人事部、财务会计部，2011 年 2 月新组建销售管理部，分工协作，职责明确。

截至 2011 年 06 月 30 日，公司管理信达澳银领先增长股票型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银中小盘股票型证券投资基金、信达澳银红利回报股票型证券投资基金和信达澳银产业升级股票型证券投资基金六只基金。

#### 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 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--------------------|-----------------|------|--------|---|
|     |                    | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 昌志华 | 本基金的基金经理，投资总监助理，投资 | 2009-04-08      | -    | 13 年   | 武汉大学理学博士，历任华南理工大学应用数学系经济数学专业副教授、大鹏证券综合研究所金融工程部经理、融通基金管理有限公司高级研究 |

|     |   |            |   |     |  |
|-----|---|------------|---|-----|--|
|     | 研究部下<br>宏观策略<br>部总经理                        |            |   |     | 员。2006 年 6 月加入信达澳银基金公司。  |
| 陈绪新 | 本基金的<br>基金经理，<br>投资研究<br>部下固定<br>收益部总<br>经理 | 2009-07-01 | - | 9 年 | 北京大学理学士，对外经济贸易大学经济学硕士，CFA, FRM。1995 年 10 月至 1999 年 7 月任国家地震局地震研究所助理研究员、长江水利水电开发总公司三峡移民工程监理工程师。2002 年 7 月至 2008 年 9 月就职于北京银行总行国际业务部、资金交易部，历任交易员、自营投资主管。2008 年 10 月加入信达澳银基金公司。 |

注：1. 基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

## 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《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》、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，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。本报告期内，本基金网下申购的九牧王（601566）流通受限股票公允价值占基金资产净值的比例超过托管协议之投资流通受限证券风险控制补充协议所规定的 3%，但未对基金的流动性造成负面影响。

## 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

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，基金管理人未管理其他与本基金投资风格相似的投资组合。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 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



2011 年一季度国内 GDP 同比增长 9.7%，二季度同比增长 9.5%，显示上半年国内经济增长回落；但 6 月 CPI 达 6.4%，创本轮通胀以来的新高，显示物价水平继续维持高位。另外，中东、北非部分国家因通胀及失业等问题出现政治动荡，国际油价攀升，在此背景下，国内将防通胀作为宏观调控的重要任务，货币政策延续了 2010 年底的紧缩态势。

货币市场收益率波动加大。一季度，货币市场收益率波动较大，随着春节因素淡化，货币市场利率逐渐回落，显示尽管经历数量及价格手段紧缩，但由于公开市场到期量大、资金贷款投放受限等因素，银行间资金依然较为充裕；二季度，随着基准存贷款利率、存款准备金比率继续提升，加上年中银行存款规模考核、日均存贷比考核等因素，资金市场收益率大幅波动，资金成本不断抬升。债券市场方面，债券收益率在 2 月随加息达到高点，此后逐步下降，但整体略呈小幅上升；进入二季度，受资金市场影响，短端大幅上行，长端上行幅度较小，收益率曲线整体震荡上行并趋向平坦化。资金面紧张、融资平台债务清理、预期未来供应量增加导致信用市场出现调整，信用利差有所扩大。期间，本基金保持中性偏短的久期，重点投资于信用债券，同时参与了部分转债的投资。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.099 元，份额累计净值为 1.099 元，本报告期份额净值增长率为 0.37%，同期业绩比较基准收益率为 1.03%；

截至报告期末，B 类基金份额：基金份额净值为 1.088 元，份额累计净值为 1.088 元，本报告期份额净值增长率为 0.18%，同期业绩比较基准收益率为 1.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在一季度较为严厉的宏观调控下，二季度内外需受压，经济持续回落，但经济减速有限，经济硬着陆的风险已经很小。在工业生产旺盛和投资增速强劲的背景下，经济下半年有望维持平稳增长。另一方面，外围经济环境的恶化可能带来三季度经济的不确定性，国际大宗商品价格的回升可能再次带来国内的输入性通胀风险，三季度通胀水平预计仍在高位徘徊，下半年货币调控仍难言转向，但节奏可能放缓，准备金率调升频率将降低，加息将更为谨慎，以免导致经济出现大的波动。

对于债券市场走势，预计利率产品收益率将维持区间振荡，但整体水平将逐渐抬升；而信用债由于市场对信用问题更加敏感、供给冲击，其利差及收益率水平可能进一步上升。因此，我们对利率品种仍持谨慎态度，但将关注短期交易性机会；经过近期较大幅度调整，信用债收益率出现了明显的上行，配置价值提升，不过信用债市场存在较大的扩容压力，发行主体资质差异性变

强，应审慎选择投资时机及个券，控制信用风险暴露程度。转债市场经过前期的调整，市场风险已经经过较大幅度的释放，密切关注正股价格回升带来的投资机会。

基于以上判断，我们将保持中性组合久期，审慎配置信用债券。同时，我们也将密切关注股票价格走势，通过以合理的安全边际积极参与新股 IPO 申购、可转换债券投资等方式，谨慎追求股市风险暴露，以提高组合收益。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

##### **4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历**

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验，主要来自运营保障部、投资研究部和监察稽核部，其中运营保障部负责组织小组工作的开展。

##### **4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度**

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

##### **4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突**

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

##### **4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度**

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《信达澳银稳定价值债券型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，本基金收益每年最多分配 12 次，每次收益分配比例不低于可分配收益的 20%。截止报告期末，本基金 A 类基金份额可供分配利润为 5,870,920.16 元，B 类基金份额可供分配利润为 3,831,568.46 元。根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

报告期内，本基金未进行利润分配。

## **§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人复核审查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。

## § 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：信达澳银稳定价值债券型证券投资基金

报告截止日：2011 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2011 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 6,982,825.44            | 3,156,754.70             |
| 结算备付金      |         | 1,213,433.34            | 814,000.69               |
| 存出保证金      |         | 21,774.69               | 5,874.63                 |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 113,078,687.79          | 98,183,306.69            |
| 其中：股票投资    |         | 10,649,780.21           | 13,172,643.79            |
| 基金投资       |         | -                       | -                        |
| 债券投资       |         | 102,428,907.58          | 85,010,662.90            |
| 资产支持证券投资   |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | 20,900,151.35           | -                        |
| 应收证券清算款    |         | -                       | 2,729,665.24             |
| 应收利息       | 6.4.7.5 | 1,170,522.28            | 1,130,115.26             |
| 应收股利       |         | -                       | -                        |
| 应收申购款      |         | 2,502,500.00            | -                        |
| 递延所得税资产    |         | -                       | -                        |
| 其他资产       | 6.4.7.6 | -                       | -                        |
| 资产总计       |         | 145,869,894.89          | 106,019,717.21           |

| 负债和所有者权益      | 附注号      | 本期末<br>2011 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------|-------------------------|--------------------------|
| <b>负债：</b>    |          |                         |                          |
| 短期借款          |          | -                       | -                        |
| 交易性金融负债       |          | -                       | -                        |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3  | -                       | -                        |
| 卖出回购金融资产款     |          | 32,099,850.00           | 30,000,000.00            |
| 应付证券清算款       |          | 751,126.78              | -                        |
| 应付赎回款         |          | 303,713.18              | 193,776.01               |
| 应付管理人报酬       |          | 49,022.38               | 39,541.11                |
| 应付托管费         |          | 16,340.81               | 13,180.37                |
| 应付销售服务费       |          | 15,239.47               | 16,447.34                |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 7,234.25                | 10,219.98                |
| 应交税费          |          | 48,793.22               | 48,404.10                |
| 应付利息          |          | 16,185.62               | 13,716.66                |
| 应付利润          |          | -                       | -                        |
| 递延所得税负债       |          | -                       | -                        |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 178,569.52              | 350,387.51               |
| 负债合计          |          | 33,486,075.23           | 30,685,673.08            |
| <b>所有者权益：</b> |          |                         |                          |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 102,681,331.04          | 69,140,451.46            |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 9,702,488.62            | 6,193,592.67             |
| 所有者权益合计       |          | 112,383,819.66          | 75,334,044.13            |
| 负债和所有者权益总计    |          | 145,869,894.89          | 106,019,717.21           |

注：报告截止日 2011 年 06 月 30 日，信达澳银稳定价值债券 A 基金份额净值 1.099 元，信达澳银稳定价值债券 B 基金份额净值 1.088 元；基金份额总额 102,681,331.04 份，其中信达澳银稳定价值债券 A 基金份额为 59,296,585.45 份，信达澳银稳定价值债券 B 基金份额为 43,384,745.59 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信达澳银稳定价值债券型证券投资基金

本报告期：2011 年 01 月 01 日至 2011 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目          | 附注号      | 本期<br>2011 年 01 月 01 日至<br>2011 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 01 月 01 日至<br>2010 年 06 月 30 日 |
|-------------|----------|---|--|
| <b>一、收入</b> |          | 1,053,679.65                                | 2,844,008.22                                     |
| 1.利息收入      |          | 1,829,653.90                                | 1,950,305.02                                     |
| 其中：存款利息收入   | 6.4.7.11 | 38,506.96                                   | 102,919.52                                       |
| 债券利息收入      |          | 1,749,521.19                                | 1,836,068.84                                     |
| 资产支持证券利息收入  |          | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入  |          | 41,625.75                                   | 11,316.66  |

|                            |          |               |               |
|----------------------------|----------|---------------|---------------|
| 其他利息收入                     |          | -             | -             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 2,517,493.88  | 2,865,497.12  |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | 2,149,296.77  | 4,375,655.95  |
| 基金投资收益                     |          | -             | -             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | 336,435.93    | -1,524,964.46 |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -             | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -             | -             |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 31,761.18     | 14,805.63     |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | -3,303,744.89 | -1,980,614.69 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -             | -             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 10,276.76     | 8,820.77      |
| <b>减：二、费用</b>              |          | 976,175.46    | 1,470,920.54  |
| 1. 管理人报酬                   |          | 232,333.16    | 485,585.28    |
| 2. 托管费                     |          | 77,444.46     | 161,861.75    |
| 3. 销售服务费                   |          | 88,120.93     | 215,735.27    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 32,943.12     | 56,416.22     |
| 5. 利息支出                    |          | 350,228.74    | 360,187.38    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 350,228.74    | 360,187.38    |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 195,105.05    | 191,134.64    |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |          | 77,504.19     | 1,373,087.68  |
| 减：所得税费用                    |          | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | 77,504.19     | 1,373,087.68  |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银稳定价值债券型证券投资基金

本报告期：2011 年 01 月 01 日至 2011 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期                                 |               |                |
|--|------------------------------------|---------------|----------------|
|  | 2011 年 01 月 01 日至 2011 年 06 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）                        | 69,140,451.46                      | 6,193,592.67  | 75,334,044.13  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                  | 77,504.19     | 77,504.19      |
| 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）      | 33,540,879.58                      | 3,431,391.76  | 36,972,271.34  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 81,923,774.41                      | 7,966,841.48  | 89,890,615.89  |
| 2. 基金赎回款                               | -48,382,894.83                     | -4,535,449.72 | -52,918,344.55 |
| 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）                        | 102,681,331.04          | 9,702,488.62  | 112,383,819.66  |
|--|-------------------------|---------------|-----------------|
| 项目                                     | 上年度可比期间                 |               |                 |
|  | 2010年01月01日至2010年06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）                        | 233,416,438.14          | 1,463,768.56  | 234,880,206.70  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                       | 1,373,087.68  | 1,373,087.68    |
| 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）      | -124,565,648.50         | -1,777,523.05 | -126,343,171.55 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 15,121,307.55           | 168,601.27    | 15,289,908.82   |
| 2. 基金赎回款                               | -139,686,956.05         | -1,946,124.32 | -141,633,080.37 |
| 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）                        | 108,850,789.64          | 1,059,333.19  | 109,910,122.83  |

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：

基金管理人负责人：何加武      主管会计工作负责人：王学明      会计机构负责人：刘玉兰

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

信达澳银稳定价值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”)证监许可[2009]第102号《关于核准信达澳银稳定价值债券型证券投资基金募集的批复》核准,由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银稳定价值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,自2009年3月9日至2009年4月2日止期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,140,081,703.58元(其中A类份额为228,558,298.93元,B类份额为911,523,404.65元),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第061号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银稳定价值债券型证券投资基金基金合同》于2009年04月08日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,140,725,231.47份基金份额(其中A类份额为228,678,770.62份,B类份额为912,046,460.85份),其中认购资金利息折合643,527.89份基金份额(其中A类份额为120,471.69份,B类份额为523,056.20份)。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《信达澳银稳定价值债券型证券投资基金基金合同》和《信达澳银稳定价值债券型证券

投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用的，称为 A 类；不收取前端申购费用、赎回费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 B 类。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银稳定价值债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的债券（包括国债、央票、金融债、企业债、公司债、可转换债券、资产支持证券等）、货币市场工具、股票（仅限于首发/增发新股和可转换债券/权证的转股）、权证（仅限于参与可分离转债申购所获得的权证）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。本基金不主动在二级市场购买股票或权证等权益类金融工具。本基金的投资组合比例为：固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，持有股票等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人信达澳银基金管理有限公司于 2011 年 8 月 22 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信达澳银稳定价值债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年半年度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 2011 年 06 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金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一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 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             |
|------------------------|---------------------|
| 信达澳银基金管理有限公司           | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金代销机构        |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。



### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票/权证交易，不存在应支付关联方佣金的情况。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
|                 | 2011年01月01日至2011年06月30日 | 2010年01月01日至2010年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 232,333.16              | 485,585.28              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 50,338.63               | 113,206.92              |

注：支付基金管理人信达澳银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
|                | 2011年01月01日至2011年06月30日 | 2010年01月01日至2010年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 77,444.46               | 161,861.75              |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                      |              |           |
|----------------|-------------------------|--------------|-----------|
|                | 2011年01月01日至2011年06月30日 |              |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |              |           |
|                | 信达澳银稳定价值债券 A            | 信达澳银稳定价值债券 B | 合计        |
| 信达澳银基金管理有限公司   | -                       | 2,537.10     | 2,537.10  |
| 中国建设银行         | -                       | 82,178.97    | 82,178.97 |
| 合计             | -                       | 84,716.07    | 84,716.07 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                 |              |           |
|                | 2010年01月01日至2010年06月30日 |              |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |              |           |

|              | 信达澳银稳定价值<br>债券 A | 信达澳银稳定价值<br>债券 B | 合计         |
|--------------|------------------|------------------|------------|
| 信达澳银基金管理有限公司 | -                | 214.82           | 214.82     |
| 中国建设银行       | -                | 214,006.27       | 214,006.27 |
| 合计           | -                | 214,221.09       | 214,221.09 |

注：信达澳银稳定价值债券 A 不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日信达澳银稳定价值债券 B 基金份额对应的基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给信达澳银基金管理有限公司，再由信达澳银基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日信达澳银稳定价值债券 B 基金份额对应的基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期与上年度可比期间均未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

注：本报告期末与上年度末均未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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<br>名称 | 本期<br>2011 年 01 月 01 日至 2011 年 06 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2010 年 01 月 01 日至 2010 年 06 月 30 日 |            |
|-----------|--|-----------|---|------------|
|           | 期末余额                                     | 当期利息收入    | 期末余额  | 当期利息收入     |
| 中国建设银行    | 6,982,825.44                             | 31,139.33 | 5,683,658.53                                  | 100,255.43 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期与上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期与上年度可比期间均未发生其他关联交易事项。

#### 6.4.12 期末（2011 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |       |            |            |        |       |        |          |              |              |      |
|----------------------|-------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|--------------|--------------|------|
| 证券代码                 | 证券名称  | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注   |
| 601566               | 九牧王   | 2011-05-23 | 2011-08-30 | 新股网下申购 | 22.00 | 21.61  | 334,261  | 7,353,742.00 | 7,223,380.21 | -    |
| 000026               | 飞亚达 A | 2010-12-29 | 2011-12-30 | 非公开发行  | 16.01 | 13.41  | 100,000  | 1,601,000.00 | 1,341,000.00 | -    |
| 000026               | 飞亚达 A | -          | 2011-12-30 | 非公开发行  | -     | 13.41  | 40,000   | -            | 536,400.00   | 见注 2 |
| 000713               | 丰乐种业  | 2010-12-27 | 2011-12-28 | 非公开发行  | 15.48 | 15.29  | 100,000  | 1,548,000.00 | 1,529,000.00 | -    |
| 300240               | 飞力达   | 2011-06-29 | 2011-07-06 | 新股网上申购 | 20.00 | 20.00  | 1,000    | 20,000.00    | 20,000.00    | -    |

注：1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 飞亚达 A 于 2011 年 04 月 20 日宣告进行 2010 年度权益分配，每 10 股派 1.00 元，每 10 股以资本公积转增 4 股，除权除息日为 2011 年 04 月 27 日。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 06 月 30 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 19,999,850.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码    | 债券名称    | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|---------|---------|------------|--------|---------|---------------|
| 1180075 | 11 鄂城投债 | 2011-07-04 | 101.78 | 200,000 | 20,356,000.00 |
| 合计      |         |            |        | 200,000 | 20,356,000.00 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 06 月 30 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 12,100,000.00 元，于 2011 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允

价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2011 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 69,772,287.79 元，第二层级的余额为 43,306,400.00 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 65,253,306.69 元，第二层级 32,930,000.00 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2010 年度：同)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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              | 10,649,780.21  | 7.30          |
|    | 其中：股票             | 10,649,780.21  | 7.30          |
| 2  | 固定收益投资            | 102,428,907.58 | 70.22         |
|    | 其中：债券             | 102,428,907.58 | 70.22         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 3  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 4  | 买入返售金融资产          | 20,900,151.35  | 14.33         |
|    | 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      | 8,196,258.78   | 5.62          |
| 6  | 其他各项资产            | 3,694,796.97   | 2.53          |
| 7  | 合计                | 145,869,894.89 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值 |
|----|------|------|---------|
|----|------|------|---------|

|     |                |               | 比例 (%) |
|-----|----------------|---------------|--------|
| A   | 农、林、牧、渔业       | 1,529,000.00  | 1.36   |
| B   | 采掘业            | -             | -      |
| C   | 制造业            | 7,223,380.21  | 6.43   |
| C0  | 食品、饮料          | -             | -      |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 7,223,380.21  | 6.43   |
| C2  | 木材、家具          | -             | -      |
| C3  | 造纸、印刷          | -             | -      |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | -             | -      |
| C5  | 电子             | -             | -      |
| C6  | 金属、非金属         | -             | -      |
| C7  | 机械、设备、仪表       | -             | -      |
| C8  | 医药、生物制品        | -             | -      |
| C99 | 其他制造业          | -             | -      |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -             | -      |
| E   | 建筑业            | -             | -      |
| F   | 交通运输、仓储业       | 20,000.00     | 0.02   |
| G   | 信息技术业          | -             | -      |
| H   | 批发和零售贸易        | 1,877,400.00  | 1.67   |
| I   | 金融、保险业         | -             | -      |
| J   | 房地产业           | -             | -      |
| K   | 社会服务业          | -             | -      |
| L   | 传播与文化产业        | -             | -      |
| M   | 综合类            | -             | -      |
|     | 合计             | 10,649,780.21 | 9.48   |

### 7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量 (股)  | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|---------|--------------|---------------|
| 1  | 601566 | 九牧王   | 334,261 | 7,223,380.21 | 6.43          |
| 2  | 000026 | 飞亚达 A | 140,000 | 1,877,400.00 | 1.67          |
| 3  | 000713 | 丰乐种业  | 100,000 | 1,529,000.00 | 1.36          |
| 4  | 300240 | 飞力达   | 1,000   | 20,000.00    | 0.02          |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.fscinda.com](http://www.fscinda.com) 网站的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 601566 | 九牧王  | 7,353,742.00 | 9.76            |
| 2  | 000630 | 铜陵有色 | 2,723,234.00 | 3.61            |
| 3  | 002233 | 塔牌集团 | 2,059,669.90 | 2.73            |
| 4  | 601233 | 桐昆股份 | 189,000.00   | 0.25            |
| 5  | 601208 | 东材科技 | 120,000.00   | 0.16            |
| 6  | 002595 | 豪迈科技 | 108,000.00   | 0.14            |
| 7  | 002583 | 海能达  | 59,700.00    | 0.08            |
| 8  | 002582 | 好想你  | 46,000.00    | 0.06            |
| 9  | 300217 | 东方电热 | 25,880.00    | 0.03            |
| 10 | 300240 | 飞力达  | 20,000.00    | 0.03            |
| 11 | 300219 | 鸿利光电 | 16,000.00    | 0.02            |
| 12 | 300224 | 正海磁材 | 10,545.00    | 0.01            |
| 13 | 300218 | 安利股份 | 9,000.00     | 0.01            |
| 14 | 601058 | 赛轮股份 | 6,880.00     | 0.01            |

注：本基金本报告期仅上述所列股票发生买入交易。本表中累计买入金额是按照买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 000630 | 铜陵有色 | 2,791,266.80 | 3.71            |
| 2  | 002233 | 塔牌集团 | 2,105,334.72 | 2.79            |
| 3  | 300133 | 华策影视 | 1,395,527.56 | 1.85            |
| 4  | 300109 | 新开源  | 1,066,687.00 | 1.42            |
| 5  | 002486 | 嘉麟杰  | 1,022,455.50 | 1.36            |
| 6  | 002463 | 沪电股份 | 898,950.98   | 1.19            |
| 7  | 300115 | 长盈精密 | 873,022.48   | 1.16            |
| 8  | 002469 | 三维工程 | 742,664.03   | 0.99            |
| 9  | 002505 | 大康牧业 | 585,878.35   | 0.78            |
| 10 | 002460 | 赣锋锂业 | 549,511.50   | 0.73            |
| 11 | 300127 | 银河磁体 | 501,106.80   | 0.67            |
| 12 | 601890 | 亚星锚链 | 416,499.48   | 0.55            |
| 13 | 002466 | 天齐锂业 | 305,306.00   | 0.41            |
| 14 | 601233 | 桐昆股份 | 210,560.00   | 0.28            |
| 15 | 601126 | 四方股份 | 162,607.70   | 0.22            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 16 | 601208 | 东材科技 | 136,213.00 | 0.18 |
| 17 | 002595 | 豪迈科技 | 106,425.00 | 0.14 |
| 18 | 002583 | 海能达  | 51,420.00  | 0.07 |
| 19 | 002582 | 好想你  | 48,020.00  | 0.06 |
| 20 | 300217 | 东方电热 | 30,840.00  | 0.04 |

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 12,747,650.90 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 14,050,586.90 |

注：本表中买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按照买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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      | 75,288,500.00  | 66.99        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债       | 27,140,407.58  | 24.15        |
| 8  | 其他        | -              | -            |
| 9  | 合计        | 102,428,907.58 | 91.14        |

### 7.6 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  | 1180075 | 11 鄂城投债 | 200,000 | 20,356,000.00 | 18.11        |
| 2  | 098095  | 09 潭城建债 | 200,000 | 19,544,000.00 | 17.39        |
| 3  | 113002  | 工行转债    | 116,770 | 13,833,741.90 | 12.31        |
| 4  | 122843  | 11 绥化债  | 130,000 | 13,630,500.00 | 12.13        |
| 5  | 113001  | 中行转债    | 99,300  | 10,484,094.00 | 9.33         |

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 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**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.9 投资组合报告附注**

**7.9.1** 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

**7.9.2** 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

**7.9.3 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   | 21,774.69    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,170,522.28 |
| 5  | 应收申购款   | 2,502,500.00 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,694,796.97 |

**7.9.4 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 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 113002 | 工行转债 | 13,833,741.90 | 12.31        |
| 2  | 113001 | 中行转债 | 10,484,094.00 | 9.33         |
| 3  | 125709 | 唐钢转债 | 1,104,590.00  | 0.98         |
| 4  | 126729 | 燕京转债 | 121,801.68    | 0.11         |

**7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|--------------|----------|
| 1  | 601566 | 九牧王  | 7,223,380.21 | 6.43         | 新股网下申购   |
| 2  | 000026 | 飞亚达A | 1,877,400.00 | 1.67         | 非公开发行    |
| 3  | 000713 | 丰乐种业 | 1,529,000.00 | 1.36         | 非公开发行    |
| 4  | 300240 | 飞力达  | 20,000.00    | 0.02         | 新股网上申购   |



### 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 |
| 信达澳银稳定价值债券 A | 1,080     | 54,904.25 | 34,572,234.86 | 58.30% | 24,724,350.59 | 41.70% |
| 信达澳银稳定价值债券 B | 1,071     | 40,508.63 | 5,231,560.20  | 12.06% | 38,153,185.39 | 87.94% |
| 合计           | 2,151     | 47,736.56 | 39,803,795.06 | 38.76% | 62,877,535.98 | 61.24% |

注：分级基金机构/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）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目                   | 份额级别         | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|----------------------|--------------|------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 信达澳银稳定价值债券 A | 420,950.77 | 0.71%    |
|                      | 信达澳银稳定价值债券 B | 123,561.37 | 0.28%    |
|                      | 合计           | 544,512.14 | 0.53%    |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                | 信达澳银稳定价值债券 A   | 信达澳银稳定价值债券 B   |
|-----------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2009 年 04 月 08 日) 基金份额总额 | 228,678,770.62 | 912,046,460.85 |
| 本报告期初基金份额总额                       | 25,791,514.86  | 43,348,936.60  |
| 本报告期基金总申购份额                       | 54,148,383.83  | 27,775,390.58  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 20,643,313.24  | 27,739,581.59  |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | -              | -              |
| 本报告期末基金份额总额                       | 59,296,585.45  | 43,384,745.59  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

### 10.2 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 2011 年 5 月 19 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第二届董事会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】685 号文核准，宋三江先生担任信达澳银基金管理有限公司副总经理兼销售总监。

本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作)，其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可(2011)115 号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金的外部审计机构。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中信证券 | 3      | 13,694,276.04 | 97.46%       | 11,148.54 | 97.36%     | -  |

|      |   |            |       |        |       |        |
|------|---|------------|-------|--------|-------|--------|
| 中金公司 | 1 | 346,773.00 | 2.47% | 294.75 | 2.57% | -      |
| 招商证券 | 2 | 9,550.00   | 0.07% | 8.12   | 0.07% | -      |
| 信达证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 宏源证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 华林证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 平安证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 申银万国 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 东方证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 东兴证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 光大证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 国金证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 国泰君安 | 2 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 国信证券 | 2 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 海通证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 广发证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 高华证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 世纪证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 华泰联合 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 兴业证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 银河证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 安信证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 中投证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 中信建投 | 2 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 中信万通 | 1 | -          | -     | -      | -     | -      |
| 长江证券 | 1 | -          | -     | -      | -     | 新增交易单元 |

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由投资研究部提议，经公司投资审议委员会审议后，报经营管理委员会决定。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，投资研究部和产品开发中心于每个季度最后 10 个工作日组织相关人员对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每半年佣金分配排名应与上两个季度研究服务评分排名基本匹配，并确保重点券商研究机构年度佣金排名应与全年合计研究服务评分排名相匹配。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信证券 | 59,742,379.82 | 23.31%       | 114,000,000.00 | 10.49%         | -    | -            |
| 中金公司 | 8,503,400.00  | 3.32%        | 112,000,000.00 | 10.31%         | -    | -            |
| 招商证券 | 27,263,524.25 | 10.64%       | 184,500,000.00 | 16.98%         | -    | -            |
| 信达证券 | 5,621,026.70  | 2.19%        | 21,500,000.00  | 1.98%          | -    | -            |
| 宏源证券 | 17,745,738.90 | 6.92%        | 14,000,000.00  | 1.29%          | -    | -            |
| 华林证券 | 13,213,895.90 | 5.16%        | 70,200,000.00  | 6.46%          | -    | -            |
| 平安证券 | -             | -            | 71,500,000.00  | 6.58%          | -    | -            |
| 申银万国 | 30,780,119.18 | 12.01%       | 61,000,000.00  | 5.62%          | -    | -            |
| 东方证券 | 4,990,181.10  | 1.95%        | 78,500,000.00  | 7.23%          | -    | -            |
| 东兴证券 | 1,669,949.20  | 0.65%        | -              | -              | -    | -            |
| 光大证券 | 11,233,118.70 | 4.38%        | 141,000,000.00 | 12.98%         | -    | -            |
| 国金证券 | 2,137,442.60  | 0.83%        | 73,200,000.00  | 6.74%          | -    | -            |
| 国泰君安 | 42,461,352.95 | 16.57%       | 87,900,000.00  | 8.09%          | -    | -            |
| 国信证券 | 30,928,541.16 | 12.07%       | 57,000,000.00  | 5.25%          | -    | -            |
| 海通证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 高华证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 世纪证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华泰联合 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 银河证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中投证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信万通 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。