

信达澳银稳定价值债券型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:2021 年 08 月 27 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。本中期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2021年8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示及目录..... | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介..... | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告..... | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| §5 托管人报告..... | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 16 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)..... | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 18 |
| 6.3 所有者权益(基金净值)变动表..... | 19 |
| 6.4 报表附注..... | 21 |
| §7 投资组合报告..... | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 44 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 45 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 45 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 45 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 46 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 46 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 46 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 46 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 46 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 47 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 47 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 51 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 51 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 51 |

| | |
|---|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 51 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 52 |
| §10 重大事件揭示..... | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 52 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 52 |
| 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..... | 53 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 53 |
| 10.8 其他重大事件..... | 59 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 60 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 60 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 61 |
| §12 备查文件目录..... | 61 |
| 12.1 备查文件目录..... | 61 |
| 12.2 存放地点..... | 61 |
| 12.3 查阅方式..... | 61 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|---------------|
| 基金名称 | 信达澳银稳定价值债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 信达澳银稳定价值债券 | |
| 基金主代码 | 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 | 600,900,223.56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 | 597,400,051.41份 | 3,500,172.15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 负责人 | 姓名 | 韩宗惊 | 李申 |
| | 联系电话 | 0755-83172666 | 021-60637102 |
| | 电子邮箱 | disclosure@fscinda.com | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-8888-118 | 021-60637111 |
| 传真 | | 0755-83196151 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦N1座第8层和第9层 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | | 广东省深圳市南山区科苑南路2666号中国华润大厦10层 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | | 518063 | 100033 |
| 法定代表人 | | 祝瑞敏 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.fscinda.com |
| 基金中期报告备置地点 | 广东省深圳市南山区科苑南路2666号中国华润大厦10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 | 广东省深圳市南山区科苑南路2666号中国华润大厦10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 (2021年01月01日-2021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 | -15,034,594.16 | -90,067.11 |
| 本期利润 | -19,334,510.52 | -114,948.25 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0324 | -0.0333 |
| 本期加权平均净值利润率 | -3.24% | -3.38% |
| 本期基金份额净值增长率 | -3.12% | -3.36% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2021年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -4,386,702.96 | -72,734.61 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0073 | -0.0208 |
| 期末基金资产净值 | 593,013,348.45 | 3,427,437.54 |
| 期末基金份额净值 | 0.993 | 0.979 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2021年06月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 62.52% | 53.59% |

- 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 | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|--------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| | | | | ④ | | |
| 过去一个月 | -0.10% | 0.16% | 0.08% | 0.07% | -0.18% | 0.09% |
| 过去三个月 | 0.81% | 0.20% | 1.39% | 0.06% | -0.58% | 0.14% |
| 过去六个月 | -3.12% | 0.25% | 2.09% | 0.07% | -5.21% | 0.18% |
| 过去一年 | -2.74% | 0.19% | 2.49% | 0.10% | -5.23% | 0.09% |
| 过去三年 | 0.97% | 0.13% | 14.71% | 0.11% | -13.74% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 62.52% | 0.30% | 57.37% | 0.11% | 5.15% | 0.19% |

信达澳银稳定价值债券B

| 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 | -0.20% | 0.16% | 0.08% | 0.07% | -0.28% | 0.09% |
| 过去三个月 | 0.62% | 0.20% | 1.39% | 0.06% | -0.77% | 0.14% |
| 过去六个月 | -3.36% | 0.26% | 2.09% | 0.07% | -5.45% | 0.19% |
| 过去一年 | -3.17% | 0.19% | 2.49% | 0.10% | -5.66% | 0.09% |
| 过去三年 | -0.56% | 0.13% | 14.71% | 0.11% | -15.27% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 53.59% | 0.30% | 57.37% | 0.11% | -3.78% | 0.19% |

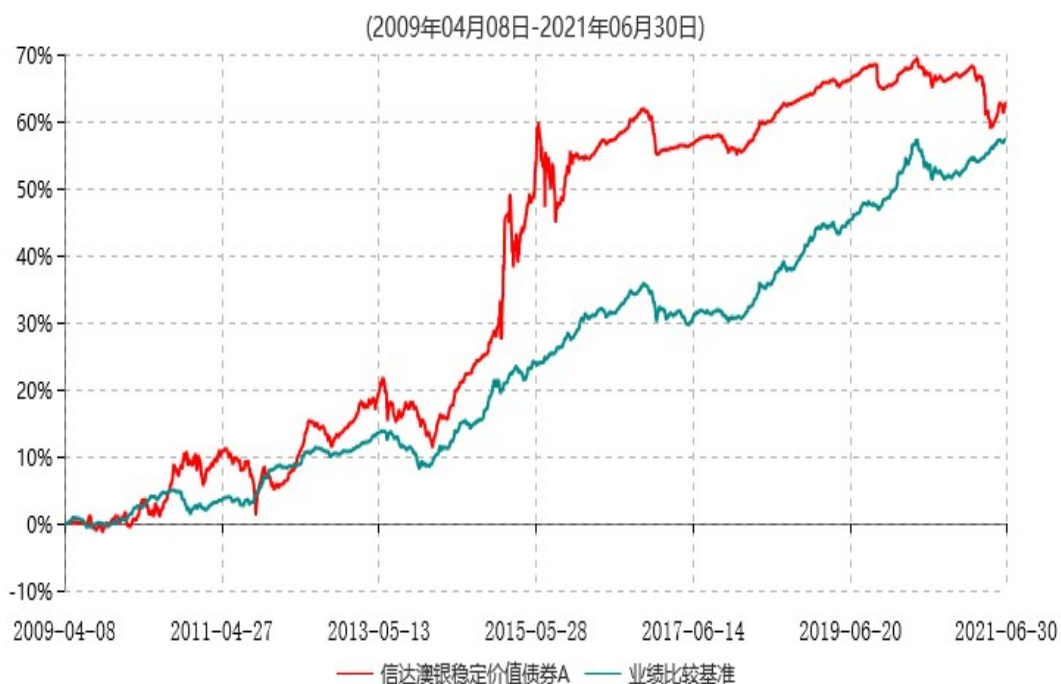
注：本基金的业绩比较基准：中国债券总指数收益率。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数，拥有独立的数据源和自主的编制方法，该指数同时覆盖了国内交易所和银行间两个债券市场，能够反映债券市场总体走势，具有较强的代表性、公正性与权威性，可以较好地衡量固定收益类投资的业绩。指数的详细编制规则敬请参见中央国债登记结算有限责任公司网站：

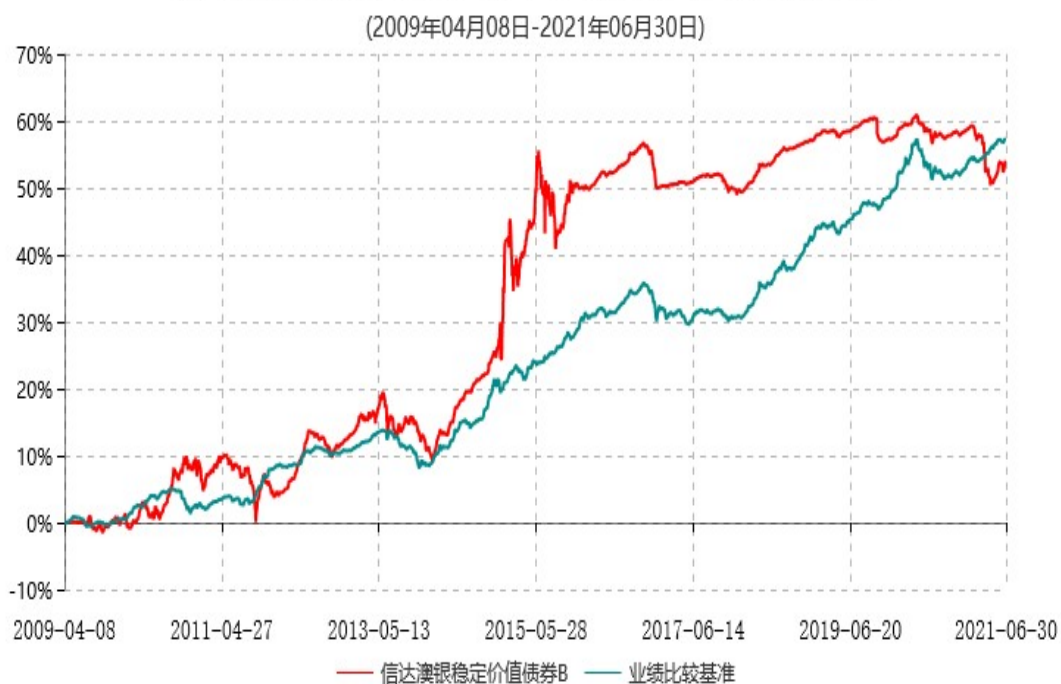
<http://www.chinabond.com.cn>

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累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



信达澳银稳定价值债券B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 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 East Topco Limited（原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。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与 East Topco Limited 共同持有公司股份。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设在深圳，在北京和上海设有分公司。公司中方股东信达证券股份有限公司出资比例为 54%，外方股东 East Topco Limited 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、董事会和执行监事。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。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会、市场销售管理委员会、问责委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、固定收益总部、智能量化与全球资产配置总部、基础设施和不动产投资部、市场销售部、机构销售部、互联网金融部、战略客户部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、信息技术部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 35 只基金：信达澳银蓝筹精选股票型证券投资基金、信达澳银先进智造股票型证券投资基金、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银转型创新股票型证券投资基金、信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银核心科技混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信达澳银量化多因子混合型证券投资基金 (LOF)、信达澳银量化先锋混合型证券投资基金 (LOF)、信达澳银领先增长混合型证券投资基金、信达澳银领先智选混合型证券投资基金、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新能源精选混合型证券投资基金、信达澳银新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银星奕混合型证券投资基金、信达澳银研究优选混合型证券投资基金、信达澳银医药健康混合型证券投资基金、信达澳银至诚精选混合型证

券投资基金、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银周期动力混合型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银安盛纯债债券型证券投资基金、信达澳银安益纯债债券型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银鑫安债券型证券投资基金 (LOF) 和信达澳银信用债债券型证券投资基金。

报告期内，公司第五届董事会独立董事刘治海先生以参加薪酬考核委员会会议、董事会会议、邮件与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事刘颂兴先生以参加薪酬考核委员会会议、董事会会议、与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事张宏先生参加董事会会议、风险控制委员会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

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 | | |
| 杨超 | 本基金的基金经理、信达澳银慧管家货币基金、信达澳银慧理财货币基金、信达澳银新目标混合基金、信达澳银安益纯债基金、信达澳银信用债基金、信达澳银鑫安债券基金 (LOF)、信达澳银安盛纯债基金的基金经理 | 2021-02-03 | - | 9年 | 复旦大学经济学硕士。2012年7月至2015年7月担任中泰证券有限公司研究员。2015年9月加入信达澳银基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理。信达澳银新目标混合型基金基金经理（2019年10月24日起至今）、信达澳银新征程混合型基金基金经理（2019年10月24日起至2021年1月22日）、 |

| | | | | | |
|-----|---------|------------|------------|----|---|
| | | | | | 信达澳银新财富混合型基金基金经理(2019年10月29日起至2021年1月22日)、信达澳银信用债债券基金基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银鑫安债券基金(LOF)基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银安益纯债债券型基金基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银慧管家货币基金基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银慧理财货币基金基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银稳定价值债券基金基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银安盛纯债债券型基金基金经理(2021年2月3日起至今)。 |
| 尹华龙 | 原本的基金经理 | 2020-07-25 | 2021-02-03 | 9年 | 中山大学经济学硕士。2012年7月至2015年7月任信达澳银基金管理有限公司债券研究员;2015年10月至2017年5月任华润元大基金管理有限公司高级研究员、基金经理;2017年5月加入信达澳银基金管理有限公司。信达澳银信用债债券基金基金经理(2018年5月4日起至2021年2月3日)、信达澳银鑫安债券基金(LOF)基金经理(2018年5月4日起至2021年2 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 月3日)、信达澳银安益纯债债券型基金基金经理(2018年5月4日起至2021年2月3日)、信达澳银安和纯债债券型基金基金经理(2019年3月11日起至2019年9月17日)、信达澳银安盛纯债债券型基金基金经理(2019年12月26日起至2021年2月3日)、信达澳银慧管家货币基金基金经理(2020年7月25日起至2021年2月3日)、信达澳银慧理财货币基金基金经理(2020年7月25日起至2021年2月3日)、信达澳银稳定价值债券型基金基金经理(2020年7月25日起至2021年2月3日)。 |
|--|--|--|--|--|--|

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》、《公开募集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。

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。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的

收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 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。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出现超过该证券当日成交量的5%的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

2021 年上半年，国际层面，全球经济受疫情影响持复苏波折，通胀预期先强后弱，美债收益率先上后下。国内层面，经济复苏态势逐月走弱，PMI 指数连续下行，消费依然较弱，地产投资保持平稳，出口继续较好。流动性层面，央行货币政策较前紧后松，市场流动性合理充裕。利率方面，经济走弱，流动性变松，二季度央行降准，政策放松，利率由一季度的 3.3%下行知二季度末的 2.8%左右。信用层面，继续分化，弱资质企业利差继续扩大，高等级信用利差继续压缩。转债层面，股市在一季度下跌后，二季度走强，风险偏向成长，历经一季度大跌，二季度流动性宽松带动转债市场回暖，低价转债涨幅较多，市场估值逐渐抬升。

报告期内本基金配置相对均衡，纯债方面，适度提高组合久期，以高等级信用债为主，转债方面，主要配置基本面较好的顺周期和成长类类标的，同时适度参与部分标的博弈下修。

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0.993元，份额累计净值为1.606元，本报告期基金份额净值增长率为-3.12%，同期业绩比较基准收益率为2.09%。

截至报告期末，B类基金份额：基金份额净值为0.979元，份额累计净值为1.528元，本报告期基金份额净值增长率为-3.36%，同期业绩比较基准收益率为2.09%。

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 2021 年下半年，国际层面，海外疫情短期难以消除，全球经济复苏进程仍然反复，前期流动性扩张带来比较强的通胀预期，以美联储为代表的全球央行货币政策可能面临转向。而国内经济已经率先回落，出口走弱叠加地产严格调控下，预计基建力度

可能会提升，财政政策趋于扩张，货币政策保持宽松，利率面临的环境相对上半年会更加复杂，大概率会维持低位震荡。信用债方面，打破刚性兑付是大势所趋，对信用风险仍需要高度重视，对低评级和高杠杆行业和企业继续保持警惕。转债方面，当前市场估值已上升至历史中枢以上，配置价值逐渐走弱，银行、公用事业等大部分高评级底仓品种具备较高配置性价比，其他行业适度挖掘部分低价转债，对高价转债保持谨慎。

基于以上判断，本基金将继续以高等级信用债为底，适度控制久期，转债偏向于传统大盘转债，适度降低成长行业的高价转债仓位。

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。本小组设立基金估值小组负责人一名，由分管基金运营的高级管理人员担任；基金估值小组成员若干名，由权益投资总部、固定收益总部、基金运营部及监察稽核部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营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。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

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-4,386,702.96元，B类基金份额可供分配利润为-72,734.61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。

本基金报告期内未进行利润分配。

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，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，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，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 托管人对本中期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 中期财务会计报告(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：2021年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021年06月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 5,421,910.51 | 1,620,797.76 |
| 结算备付金 | | 2,913,845.62 | 89,071.46 |
| 存出保证金 | | 20,168.97 | 2,398.02 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 744,639,262.73 | 620,516,000.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 744,639,262.73 | 620,516,000.00 |
| 资产支持证券 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 投资 | | | |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 10,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 10,783,037.34 | 11,237,774.02 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,053.35 | 5,227.82 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | 9,240,162.72 | 32,964,162.72 |
| 资产总计 | | 783,020,441.24 | 666,435,431.80 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021年06月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 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 | | 182,099,820.00 | 49,969,725.04 |
| 应付证券清算款 | | 4,024,516.37 | - |
| 应付赎回款 | | 706.27 | 522.87 |
| 应付管理人报酬 | | 146,889.57 | 156,049.76 |
| 应付托管费 | | 48,963.19 | 52,016.60 |
| 应付销售服务费 | | 1,122.30 | 1,232.78 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 5,313.72 | 11,971.83 |
| 应交税费 | | 69,325.87 | 115,905.64 |
| 应付利息 | | 84,437.14 | 13,260.63 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 98,560.82 | 189,000.42 |
| 负债合计 | | 186,579,655.25 | 50,509,685.57 |
| 所有者权益: | | | |

| | | | |
|------------|----------|----------------|----------------|
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 600,900,223.56 | 600,922,150.56 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -4,459,437.57 | 15,003,595.67 |
| 所有者权益合计 | | 596,440,785.99 | 615,925,746.23 |
| 负债和所有者权益总计 | | 783,020,441.24 | 666,435,431.80 |

注：截止 2021 年 06 月 30 日，信达澳银稳定价值债券 A 基金份额净值 0.993 元，信达澳银稳定价值债券 B 基金份额净值 0.979 元。基金份额总额 600,900,223.56 份，其中信达澳银稳定价值债券 A 基金份额 597,400,051.41 份，信达澳银稳定价值债券 B 基金份额 3,500,172.15 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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021年01月01日至 2021年06月30日 | 上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日 |
|-------------------|----------|-----------------------------------|--|
| 一、收入 | | -16,268,987.14 | 8,048,510.95 |
| 1. 利息收入 | | 9,972,583.67 | 15,242,986.40 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 55,459.56 | 9,040.00 |
| 债券利息收入 | | 9,620,532.00 | 14,415,910.94 |
| 资产支持证券利息收入 | | 224,933.76 | 763,346.22 |
| 买入返售金融资产收入 | | 71,658.35 | 54,689.24 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -21,919,213.30 | -58,508.87 |
| 其中：股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 1,804,786.70 | -45,227.70 |

| | | | |
|---------------------------------|----------------|----------------|---------------|
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.12. 3 | -23,724,000.00 | -13,281.17 |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | -4,324,797.50 | -7,149,763.83 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-” 号填列） | 6.4.7.16 | 2,439.99 | 13,797.25 |
| 减：二、费用 | | 3,180,471.63 | 2,121,407.77 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2. 1 | 893,755.64 | 920,892.29 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2. 2 | 297,918.55 | 306,964.09 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2. 3 | 6,749.51 | 8,637.17 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.17 | 14,701.16 | 8,366.92 |
| 5. 利息支出 | | 1,828,101.89 | 732,780.66 |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | 1,828,101.89 | 732,780.66 |
| 6. 税金及附加 | | 22,206.21 | 33,506.88 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.18 | 117,038.67 | 110,259.76 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | -19,449,458.77 | 5,927,103.18 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | -19,449,458.77 | 5,927,103.18 |

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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2021年01月01日至2021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) | 600,922,150.56 | 15,003,595.67 | 615,925,746.23 |
| 二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润) | - | -19,449,458.77 | -19,449,458.77 |
| 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) | -21,927.00 | -13,574.47 | -35,501.47 |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,742,216.44 | 58,175.91 | 3,800,392.35 |
| 2. 基金赎回 款 | -3,764,143.44 | -71,750.38 | -3,835,893.82 |
| 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) | 600,900,223.56 | -4,459,437.57 | 596,440,785.99 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2020年01月01日至2020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) | 602,417,336.77 | 6,765,324.58 | 609,182,661.35 |
| 二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润) | - | 5,927,103.18 | 5,927,103.18 |
| 三、本期基金份额交 | 612,312.60 | 8,949.20 | 621,261.80 |

| | | | |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | | | |
| 其中: 1. 基金申购款 | 5,872,045.14 | 128,230.13 | 6,000,275.27 |
| 2. 基金赎回款 | -5,259,732.54 | -119,280.93 | -5,379,013.47 |
| 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) | 603,029,649.37 | 12,701,376.96 | 615,731,026.33 |

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:

朱永强

鲁力

刘玉兰

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

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,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》(以下简称“基金合同”)于2009年4月8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》、基金合同及招募说明书的有关规定，本基金的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。

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<年度和中期报告>》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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年6月30日的财务状况以及 2021年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税及附加

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》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应

纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[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，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资

基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | |
|--------------|--------------|--|
| | 2021年06月30日 | |
| 活期存款 | 5,421,910.51 | |
| 定期存款 | - | |
| 其中：存款期限1个月以内 | - | |
| 存款期限1-3个月 | - | |
| 存款期限3个月以上 | - | |
| 其他存款 | - | |
| 合计 | 5,421,910.51 | |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | |
|---------------|-------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2021年06月30日 | | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | - | - | - | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 491,882,118.31 | 494,831,262.73 | 2,949,144.42 |
| | 银行间市 | 282,885,946.44 | 249,808,000.00 | -33,077,946.44 |

| | | | | |
|--------|----|----------------|----------------|----------------|
| | 场 | | | |
| | 合计 | 774,768,064.75 | 744,639,262.73 | -30,128,802.02 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 774,768,064.75 | 744,639,262.73 | -30,128,802.02 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年06月30日 | |
|-------|--------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 10,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | - |

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 343.23 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 1,311.20 |
| 应收债券利息 | 10,277,966.29 |
| 应收资产支持证券利息 | 503,407.52 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |

| | |
|------------|---------------|
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 9.10 |
| 合计 | 10,783,037.34 |

注：其他指应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年06月30日 |
|-------|--------------------|
| 其他应收款 | 9,240,162.72 |
| 待摊费用 | - |
| 合计 | 9,240,162.72 |

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 5,313.72 |
| 合计 | 5,313.72 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 0.67 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 98,560.15 |
| 合计 | 98,560.82 |

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 信达澳银稳定价值债券A

金额单位：人民币元

| 项目 (信达澳银稳定价值债券A) | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|---------------------|-------------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 597,330,205.25 | 597,330,205.25 |
| 本期申购 | 3,321,196.01 | 3,321,196.01 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -3,251,349.85 | -3,251,349.85 |
| 本期末 | 597,400,051.41 | 597,400,051.41 |

6.4.7.9.2 信达澳银稳定价值债券B

金额单位：人民币元

| 项目 (信达澳银稳定价值债券B) | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 | |
|---------------------|-------------------------------|--------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,591,945.31 | 3,591,945.31 |
| 本期申购 | 421,020.43 | 421,020.43 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -512,793.59 | -512,793.59 |
| 本期末 | 3,500,172.15 | 3,500,172.15 |

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 信达澳银稳定价值债券A

单位：人民币元

| 项目 (信达澳银稳定价值债券A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 102,301,768.81 | -87,345,549.35 | 14,956,219.46 |
| 本期利润 | -15,034,594.16 | -4,299,916.36 | -19,334,510.52 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 6,140.67 | -14,552.57 | -8,411.90 |

| | | | |
|----------|---------------|----------------|---------------|
| 其中：基金申购款 | 557,535.98 | -494,344.43 | 63,191.55 |
| 基金赎回款 | -551,395.31 | 479,791.86 | -71,603.45 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 87,273,315.32 | -91,660,018.28 | -4,386,702.96 |

6.4.7.10.2 信达澳银稳定价值债券B

单位：人民币元

| 项目 (信达澳银稳定价值债券B) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---------------------|------------|-------------|-------------|
| 上年度末 | 556,312.74 | -508,936.53 | 47,376.21 |
| 本期利润 | -90,067.11 | -24,881.14 | -114,948.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -18,095.21 | 12,932.64 | -5,162.57 |
| 其中：基金申购款 | 59,031.33 | -64,046.97 | -5,015.64 |
| 基金赎回款 | -77,126.54 | 76,979.61 | -146.93 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 448,150.42 | -520,885.03 | -72,734.61 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 14,023.93 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 41,349.54 |
| 其他 | 86.09 |
| 合计 | 55,459.56 |

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,804,786.70 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 1,804,786.70 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 619,212,359.58 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 609,039,690.02 |
| 减：应收利息总额 | 8,367,882.86 |
| 买卖债券差价收入 | 1,804,786.70 |

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | -23,724,000.00 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | - |
| 减：应收利息总额 | - |
| 资产支持证券投资收益 | -23,724,000.00 |

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|-------------------------|
| | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -4,324,797.50 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -4,324,797.50 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -4,324,797.50 |

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 2,418.40 |
| 转换费收入 | 21.59 |
| 合计 | 2,439.99 |

注：1. 本基金A类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产即为基金赎回费收入。本基金B类基金份额不收取赎回费，故无赎回费收入。

2. 本基金A类基金份额的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产即为基金转换费收入。本基金B类基金份额不收取赎回费，故无转换费收入。

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 9,551.16 |
| 银行间市场交易费用 | 5,150.00 |
| 合计 | 14,701.16 |

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 帐户维护费 | 19,260.00 |
| 银行结算费用 | 8,518.52 |
| 合计 | 117,038.67 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本期无需要说明的资产负债表日后事项。

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（“信达澳银基金公司”） | 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 |
| 信达证券股份有限公司（“信达证券”） | 基金管理人的控股股东 |

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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行交易。

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 2021年01月01日至2021年06月30日 | 上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 893,755.64 | 920,892.29 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,546.58 | 8,875.69 |

注：1、支付基金管理人信达澳银基金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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

2、2019年3月29日起支付基金管理人信达澳银基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 | 上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日 |
|----|-------------------------------|------------------------------------|
|----|-------------------------------|------------------------------------|

| | | |
|----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 297,918.55 | 306,964.09 |
|----------------|------------|------------|

注：1、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：日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

2、2019年3月29日起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0.10%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：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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 2021年1月1日至2021年6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 |
| 中国建设银行 | - | 6,393.00 | 6,393.00 |
| 信达澳银基金管理有限公司 | - | 20.19 | 20.19 |
| 信达证券 | - | - | - |
| 合计 | - | 6,413.19 | 6,413.19 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6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 |
| 中国建设银行 | - | 7,864.01 | 7,864.01 |
| 信达澳银基金管理有限公司 | - | 21.21 | 21.21 |
| 信达证券 | - | - | - |
| 合计 | - | 7,885.22 | 7,885.22 |

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0.40%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公司，再由信达澳银基金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×0.40%/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

本基金本报告期及上年度可比期间无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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期无与关联方进行转融通证券出借交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月30日 | | 上年度可比期间 2020年01月01日至2020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 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 5,421,910.51 | 14,023.93 | 385,866.85 | 4,488.78 |

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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：债券 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|------------|------------|----|
| 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：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 113050 | 南银转债 | 2021-06-17 | 2021-07-01 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 1,720 | 172,000.00 | 172,000.00 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无持有的暂时停牌等流通受限股票。

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2021年6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39,999,820.00元，是以如下债券作为抵押：

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 |
|--------|----------|------------|--------|---------|---------------|
| 210001 | 21付息国债01 | 2021-07-07 | 100.08 | 400,000 | 40,032,000.00 |
| 合计 | | | | 400,000 | 40,032,000.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本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为142,100,000.00元。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截止本报告期末，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年06月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | 50,633,805.16 | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 50,040,000.00 | 179,228,000.00 |
| 合计 | 100,673,805.16 | 179,228,000.00 |

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年06月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 377,221,053.75 | 324,901,000.00 |
| AAA以下 | 195,166,403.82 | 14,108,000.00 |
| 未评级 | 71,578,000.00 | 102,279,000.00 |
| 合计 | 643,965,457.57 | 441,288,000.00 |

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流

动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021年0 6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|----------------|----------------|------------|------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 5,421,910.51 | - | - | - | 5,421,910.51 |
| 结算备付金 | 2,913,845.62 | - | - | - | 2,913,845.62 |
| 存出保证金 | 20,168.97 | - | - | - | 20,168.97 |
| 交易性 | 197,779,602.20 | 249,219,562.86 | 291,416,09 | 6,224,000. | 744,639,262.73 |

| | | | | | |
|-----------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 金融资产 | | | 7.67 | 00 | |
| 买入返售金融资产 | 10,000,000.00 | - | - | - | 10,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 10,783,037.34 | 10,783,037.34 |
| 应收申购款 | - | - | - | 2,053.35 | 2,053.35 |
| 其他资产 | - | - | - | 9,240,162.72 | 9,240,162.72 |
| 资产总计 | 216,135,527.30 | 249,219,562.86 | 291,416,097.67 | 26,249,253.41 | 783,020,441.24 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 182,099,820.00 | - | - | - | 182,099,820.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 4,024,516.37 | 4,024,516.37 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 706.27 | 706.27 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 146,889.57 | 146,889.57 |
| 应付托管费 | - | - | - | 48,963.19 | 48,963.19 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,122.30 | 1,122.30 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 5,313.72 | 5,313.72 |
| 应交税费 | - | - | - | 69,325.87 | 69,325.87 |
| 应付利息 | - | - | - | 84,437.14 | 84,437.14 |
| 其他负债 | - | - | - | 98,560.82 | 98,560.82 |
| 负债总计 | 182,099,820.00 | - | - | 4,479,835.25 | 186,579,655.25 |
| 利率敏感度缺口 | 34,035,707.30 | 249,219,562.86 | 291,416,097.67 | 不适用 | 不适用 |
| 上年度末 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | |
|-------------------|----------------|----------------|-------------------|-------------------|----------------|
| 2020年1 2月31日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,620,797.76 | - | - | - | 1,620,797.76 |
| 结算备 付金 | 89,071.46 | - | - | - | 89,071.46 |
| 存出保 证金 | 2,398.02 | - | - | - | 2,398.02 |
| 交易性 金融资 产 | 294,334,000.00 | 245,083,000.00 | 81,099,00 0.00 | - | 620,516,000.00 |
| 应收利 息 | - | - | - | 11,237,77 4.02 | 11,237,774.02 |
| 应收申 购款 | - | - | - | 5,227.82 | 5,227.82 |
| 其他资 产 | 29,796,162.72 | - | - | 3,168,000. 00 | 32,964,162.72 |
| 资产总 计 | 325,842,429.96 | 245,083,000.00 | 81,099,00 0.00 | 14,411,00 1.84 | 666,435,431.80 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回 购金融 资产款 | 49,969,725.04 | - | - | - | 49,969,725.04 |
| 应付赎 回款 | - | - | - | 522.87 | 522.87 |
| 应付管 理人报 酬 | - | - | - | 156,049.76 | 156,049.76 |
| 应付托 管费 | - | - | - | 52,016.60 | 52,016.60 |
| 应付销 售服务 费 | - | - | - | 1,232.78 | 1,232.78 |
| 应付交 易费用 | - | - | - | 11,971.83 | 11,971.83 |
| 应交税 费 | - | - | - | 115,905.64 | 115,905.64 |
| 应付利 息 | - | - | - | 13,260.63 | 13,260.63 |
| 其他负 债 | - | - | - | 189,000.42 | 189,000.42 |
| 负债总 计 | 49,969,725.04 | - | - | 539,960.53 | 50,509,685.57 |

| | | | | | |
|---------|----------------|----------------|---------------|-----|-----|
| 利率敏感度缺口 | 275,872,704.92 | 245,083,000.00 | 81,099,000.00 | 不适用 | 不适用 |
|---------|----------------|----------------|---------------|-----|-----|

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|----------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币万元) | |
| | | 本期末 2021年06月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| | 1. 市场利率下降25个基点 | 上升约161 | 上升约306 |
| | 2. 市场利率上升25个基点 | 下降约159 | 下降约302 |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金秉承本基金的基金管理人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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合中固定收益类资产(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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于2021年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资（上年度末：同），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年06月30日 | | 上年度末 2020年12月31日 | |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 744,639,262.73 | 124.85 | 620,516,000.00 | 100.75 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 744,639,262.73 | 124.85 | 620,516,000.00 | 100.75 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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贷款及应收款项和其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6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次的余额为329,777,960.53元，属于第二层次的余额为414,861,302.20元，无属于第三层次的余额；(2020年12月31日：属于第二层次的余额为人民币620,516,000.00元，无属于第一层次、第三层次余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2021年8月26日经本基金的基金管理人批准。

§ 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 744,639,262.73 | 95.10 |
| | 其中：债券 | 744,639,262.73 | 95.10 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 10,000,000.00 | 1.28 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 8,335,756.13 | 1.06 |

| | | | |
|---|--------|----------------|--------|
| 8 | 其他各项资产 | 20,045,422.38 | 2.56 |
| 9 | 合计 | 783,020,441.24 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未买入股票。

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

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票投资收入。

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 | 50,040,000.00 | 8.39 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 71,578,000.00 | 12.00 |
| | 其中：政策性金融债 | 71,578,000.00 | 12.00 |
| 4 | 企业债券 | 100,264,000.00 | 16.81 |
| 5 | 企业短期融资券 | 50,140,000.00 | 8.41 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| 6 | 中期票据 | 78,050,000.00 | 13.09 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 394,567,262.73 | 66.15 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 744,639,262.73 | 124.85 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 | 190210 | 19国开10 | 500,000 | 50,500,000.00 | 8.47 |
| 2 | 210001 | 21付息国债01 | 500,000 | 50,040,000.00 | 8.39 |
| 3 | 131800014 | 18武汉地铁GNO01 | 400,000 | 41,424,000.00 | 6.95 |
| 4 | 143721 | 18建材07 | 400,000 | 40,024,000.00 | 6.71 |
| 5 | 102001642 | 20兆润投资MTN001 | 300,000 | 30,402,000.00 | 5.10 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未参与投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未参与投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未参与投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

19广发03（112857）：

发行人广发证券 2020 年 7 月 11 日、7 月 21 日收到广东证监局的行政处罚，主要内容为“在康美药业股份有限公司 2014 年非公开发行优先股项目、2015 年公司债券项目、2016 年非公开发行股票项目、2018 年公司债券项目、康美实业投资控股有限公司 2017 年可交换公司债券项目中未勤勉尽责，尽职调查环节基本程序缺失，缺乏应有的执业审慎，内部控制流于形式，未按规定履行持续督导与受托管理义务。采取责令改正、暂停保荐机构资格 6 个月、暂不受理债券承销业务有关文件 12 个月、责令限制高级管理人员权利的监管措施，其中责令限制高级管理人员权利的监管措施具体为：限制时任分管相关投行业务的副总经理欧阳西领取 2014 年度、2015 年度、2016 年度基本工资以外薪酬的权利，限制时任分管相关投行业务的副总经理秦力领取 2017 年度、2018 年度基本工资以外薪酬的权利，已领取部分应全部退回公司”。2020 年 12 月 22 日收到深圳证监局出具警示函措施的决定，主要内容为“未按规定对员工行为进行监测，存在个别员工手机号未备案也未纳入监测范围的情形”。

基金管理人分析认为，广发证券作为国内头部券商公司，基本面整体稳健，资金实力雄厚，抗风险能力较强，作为康美药业的承销，公司在收到《调查通知书》后，认识到了在信息披露方面存在的问题，在立案调查期间，积极配合中国证券监督管理委员会的调查工作并进行整改落实。截至目前，立案调查事宜没有最终结论但进展良好。基金管理人经审慎分析，认为该立案调查对公司经营和价值应不会构成重大影响。

上银转债（113042）：

发行人上海银行 2020 年 7 月 18 日收到外管局北京管理部、天津市分局的行政处罚，主要内容为：“未按照规定进行国际收支统计申报；未按照规定报送财务会计报告、统

计报表等资料；违反规定办理结汇、售汇业务；违反对外担保管理规定；办理经常项目资金收付未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查。”2020年7月18日上海银行杭州城西支行收到浙江省地方税务局直属稽查分局的行政处罚，主要内容为“未按规定代扣代缴“工资薪金所得”个人所得税；未按规定代扣代缴“其他所得”个人所得税”。

基金管理人经审慎分析，认为上述行政处罚对公司经营和价值应不会构成重大影响。

除以上证券外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 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 | 20,168.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,783,037.34 |
| 5 | 应收申购款 | 2,053.35 |
| 6 | 其他应收款 | 9,240,162.72 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 20,045,422.38 |

7.12.4 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 | 110053 | 苏银转债 | 18,299,874.40 | 3.07 |
| 2 | 113037 | 紫银转债 | 17,177,805.00 | 2.88 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 3 | 132015 | 18中油EB | 15,337,500.00 | 2.57 |
| 4 | 132009 | 17中油EB | 13,377,000.00 | 2.24 |
| 5 | 110059 | 浦发转债 | 12,600,938.60 | 2.11 |
| 6 | 113044 | 大秦转债 | 12,349,200.00 | 2.07 |
| 7 | 132008 | 17山高EB | 8,370,646.20 | 1.40 |
| 8 | 132004 | 15国盛EB | 8,158,425.00 | 1.37 |
| 9 | 132011 | 17浙报EB | 7,537,500.00 | 1.26 |
| 10 | 132007 | 16凤凰EB | 6,484,731.00 | 1.09 |
| 11 | 128023 | 亚太转债 | 6,353,964.54 | 1.07 |
| 12 | 110073 | 国投转债 | 6,005,909.60 | 1.01 |
| 13 | 113026 | 核能转债 | 5,838,410.60 | 0.98 |
| 14 | 113024 | 核建转债 | 5,635,850.00 | 0.94 |
| 15 | 132021 | 19中电EB | 5,351,500.00 | 0.90 |
| 16 | 128114 | 正邦转债 | 4,528,916.40 | 0.76 |
| 17 | 113009 | 广汽转债 | 4,390,800.00 | 0.74 |
| 18 | 128073 | 哈尔转债 | 4,298,000.00 | 0.72 |
| 19 | 113505 | 杭电转债 | 4,170,400.00 | 0.70 |
| 20 | 110045 | 海澜转债 | 4,099,053.60 | 0.69 |
| 21 | 113013 | 国君转债 | 4,082,593.90 | 0.68 |
| 22 | 127027 | 靖远转债 | 4,001,600.00 | 0.67 |
| 23 | 128032 | 双环转债 | 3,918,250.00 | 0.66 |
| 24 | 128037 | 岩土转债 | 3,752,315.04 | 0.63 |
| 25 | 127022 | 恒逸转债 | 3,684,000.00 | 0.62 |
| 26 | 128135 | 洽洽转债 | 3,426,000.00 | 0.57 |
| 27 | 128035 | 大族转债 | 3,318,000.00 | 0.56 |
| 28 | 123066 | 赛意转债 | 3,095,000.00 | 0.52 |
| 29 | 110075 | 南航转债 | 3,072,250.00 | 0.52 |
| 30 | 113502 | 嘉澳转债 | 3,000,307.80 | 0.50 |
| 31 | 127007 | 湖广转债 | 2,970,422.70 | 0.50 |
| 32 | 123024 | 岱勒转债 | 2,876,447.70 | 0.48 |
| 33 | 128018 | 时达转债 | 2,656,946.40 | 0.45 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 34 | 113612 | 永冠转债 | 2,572,201.00 | 0.43 |
| 35 | 128015 | 久其转债 | 2,539,293.50 | 0.43 |
| 36 | 110068 | 龙净转债 | 2,516,000.00 | 0.42 |
| 37 | 128064 | 司尔转债 | 2,357,931.60 | 0.40 |
| 38 | 128136 | 立讯转债 | 2,339,000.00 | 0.39 |
| 39 | 113568 | 新春转债 | 2,277,600.00 | 0.38 |
| 40 | 128081 | 海亮转债 | 2,274,200.00 | 0.38 |
| 41 | 110052 | 贵广转债 | 2,273,176.60 | 0.38 |
| 42 | 127020 | 中金转债 | 2,194,000.00 | 0.37 |
| 43 | 128042 | 凯中转债 | 2,146,600.00 | 0.36 |
| 44 | 113604 | 多伦转债 | 2,122,892.50 | 0.36 |
| 45 | 128039 | 三力转债 | 2,116,200.00 | 0.35 |
| 46 | 123011 | 德尔转债 | 2,099,959.68 | 0.35 |
| 47 | 128083 | 新北转债 | 2,067,800.00 | 0.35 |
| 48 | 113535 | 大业转债 | 2,020,000.00 | 0.34 |
| 49 | 128139 | 祥鑫转债 | 2,001,499.23 | 0.34 |
| 50 | 113600 | 新星转债 | 1,977,800.00 | 0.33 |
| 51 | 113584 | 家悦转债 | 1,970,200.00 | 0.33 |
| 52 | 113017 | 吉视转债 | 1,952,400.00 | 0.33 |
| 53 | 128132 | 交建转债 | 1,920,600.00 | 0.32 |
| 54 | 113589 | 天创转债 | 1,899,200.00 | 0.32 |
| 55 | 113596 | 城地转债 | 1,824,400.00 | 0.31 |
| 56 | 128142 | 新乳转债 | 1,816,622.08 | 0.30 |
| 57 | 128141 | 旺能转债 | 1,664,905.20 | 0.28 |
| 58 | 123053 | 宝通转债 | 1,557,405.90 | 0.26 |
| 59 | 128125 | 华阳转债 | 1,536,162.00 | 0.26 |
| 60 | 113594 | 淳中转债 | 1,433,984.00 | 0.24 |
| 61 | 123086 | 海兰转债 | 1,386,662.00 | 0.23 |
| 62 | 123039 | 开润转债 | 1,363,770.50 | 0.23 |
| 63 | 127019 | 国城转债 | 1,250,166.40 | 0.21 |
| 64 | 123063 | 大禹转债 | 898,808.40 | 0.15 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 65 | 128137 | 洁美转债 | 879,195.20 | 0.15 |
| 66 | 123084 | 高澜转债 | 493,805.16 | 0.08 |
| 67 | 113606 | 荣泰转债 | 300,480.00 | 0.05 |
| 68 | 113519 | 长久转债 | 234,633.40 | 0.04 |

7.12.5 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。

7.12.6 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 | 1,322 | 451,891.11 | 594,472,659.87 | 99.51% | 2,927,391.54 | 0.49% |
| 信达澳银稳定价值债券 B | 265 | 13,208.20 | - | 0.00% | 3,500,172.15 | 100.00% |
| 合计 | 1,587 | 378,639.08 | 594,472,659.87 | 98.93% | 6,427,563.69 | 1.07% |

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基金的情况

期末基金管理人的从业人员无持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

期末基金管理人的从业人员无持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 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 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 597,330,205.25 | 3,591,945.31 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,321,196.01 | 421,020.43 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 3,251,349.85 | 512,793.59 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 597,400,051.41 | 3,500,172.15 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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

本报告期内，本基金管理人经第五届董事会第十九次会议决定，自2021年3月29日起，王建华先生担任公司副总经理，分管固定收益部（后更名为混合资产投资部）。

本报告期内，本基金管理人经第五届董事会第二十八次会议决定，自2021年6月18日起，冯明远先生担任公司副总经理，分管权益投资业务以及投资管理部。

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）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

本报告期内，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 | |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 财信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|---------------|---|---|---|---|---|---|----------|
| 证券 | | | | | | | |
| 国金 证券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 国盛 证券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 恒泰 证券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 华创 证券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 金元 证券 | 1 | - | - | - | - | - | 新增1 个 |
| 开源 证券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 民生 证券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 平安 证券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 申港 证券 | 1 | - | - | - | - | - | 新增1 个 |
| 太平 洋证 券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 西部 证券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 新时 代证 券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 兴业 证券 | 1 | - | - | - | - | - | |
| 野村 东方 | 1 | - | - | - | - | - | |

| | | | | | | |
|------------------|---|---|---|---|---|----------|
| 银河 证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商 证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金 财富 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰 证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信 华南 证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信 证券 (山东) | 1 | - | - | - | - | 新增1 个 |
| 安信 证券 | 2 | - | - | - | - | 新增1 个 |
| 长江 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方 财富 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华金 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华西 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|------|
| 证券 | | | | | | |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 2 | - | - | - | - | 新增1个 |
| 粤开证券 | 1 | - | - | - | - | 退租1个 |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 3 | - | - | - | - | - |

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、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后20个工作日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，每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配，并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

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 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 金元证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申港证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | | |
|----------|----------------|--------|------------------|---------|---|---|---|---|---|
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 野村东方 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信华南证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券（山东） | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 418,621,768.70 | 62.89% | 6,052,600,000.00 | 100.00% | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|------|--------------------|------------|---|---|---|---|---|---|
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 246,969,20 3.67 | 37.1 1% | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|----------------------------|------------|
| 1 | 信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告 | 证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年1月1日 |
| 2 | 信达澳银基金管理有限公司关于系统维护对外业务暂停服务的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年1月8日 |
| 3 | 信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统、微信交易系统升级对外业务暂停服务的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年1月19日 |
| 4 | 信达澳银稳定价值债券型证券投资基金 2020 年四季度报告 | 证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年1月21日 |
| 5 | 信达澳银稳定价值债券型证券投资基金基金经理变更公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年2月3日 |
| 6 | 信达澳银稳定价值债券型证券投资基金招募说明书更新 | 证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年2月5日 |
| 7 | 信达澳银稳定价值债券型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年2月5日 |
| 8 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年3月10日 |
| 9 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年3月18日 |
| 10 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年3月18日 |
| 11 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司 | 2021年3月19日 |

| | 公告 | 网站 | |
|----|----------------------------------|----------------------------|------------|
| 12 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年3月24日 |
| 13 | 信达澳银稳定价值债券型证券投资基金 2020 年年度报告 | 证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年3月30日 |
| 14 | 信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年3月30日 |
| 15 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年4月8日 |
| 16 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年4月16日 |
| 17 | 信达澳银稳定价值债券型证券投资基金 2021 年一季度报告 | 证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年4月21日 |
| 18 | 信达澳银基金管理有限公司基金管理人的法定名称、住所发生变更的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年5月6日 |
| 19 | 信达澳银稳定价值债券型证券投资基金招募说明书更新 | 证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年5月26日 |
| 20 | 信达澳银稳定价值债券型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年5月26日 |
| 21 | 信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2021年6月19日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|------------------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2021 年 1 月 1 日 -2021 年 6 月 30 日 | 353,711,609.13 | - | - | 353,711,609.13 | 58.86% |
| | 2 | 2021 年 1 月 1 日 -2021 年 6 月 30 日 | 217,973,770.99 | - | - | 217,973,770.99 | 36.27% |

产品特有风险

- 1、赎回申请延期办理的风险
机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；
- 2、基金净值大幅波动的风险
机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；
- 3、提前终止基金合同的风险
机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；
- 4、基金规模过小导致的风险
机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银稳定价值债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银稳定价值债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询信达澳银基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-8888-118 网址：www.fscinda.com

信达澳银基金管理有限公司

二〇二一年八月二十七日