信达澳银稳定价值债券型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

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 报告送出日期:2011年03月30日

	§ 1 重要提示
	基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整
生	承担个别及连带的法律责任。本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03月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润
6	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。
	大位帝担在按照按白位帝担生工力 机次率等了每洋细由水 白细油位帝担生工力

本报告中的财务资料经审计,普华永道中	有畝」解详细內容,应阅读年度报音正义 天会计师事务所有限公司为本基金出具	。 了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意		
阅读。 本报告期自 2010 年 01 月 01 日起至 2010)年 12 月 31 日止。 § 2 基金简介			
2.1 基金基本情况	3			
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	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	69,140,451.46 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	25,791,514.86 份	43,348,936.60 (f)		

报告期末下属分级差			25,791,514.86 份		43,348,936.60 份				
2.2 基金产品说明	2.2 基金产品说明								
投资目标									
投资策略	投资策略 本基金乘承本公司自下而上的价值投资理念,把注意力集中在对个寿公允价值的研究上,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									
				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				

	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	
	姓名	黄晖	尹东	
信息披露负责	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 传真		400-8888-118	010-67595096	
		0755-83196151	010-66275853	
2.4 信息披露	方式	•		
登载基金年度报	告正文的管理人互联	₩ ₩ fscinda com		

基金年度报告备置地点	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层
§ 3 主要财务指标、3 3.1 主要会计数据和财务指标	基金净值表现及利润分配情况
5.1 土安云 计数据相别 为信标	AMBR IPI

	201	0年	2009年 04 月 08 日-	2009年12月31日	
3.1.1 期间数据和指标	信达澳银稳定价值 债券 A	信达澳银稳定价值 债券 B	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	2,902,182.09	4,856,703.66	355,216.29	-1,145,838.36	
本期利润	3,418,848.10	5,670,871.56	913,172.26	464,928.12	
加权平均基金份额本期利润	0.0795	0.0699	0.0065	0.0012	
本期基金份额净值增长率	8.52%	8.06%	0.90%	0.50%	
	2010	年末	2009年末		
3.1.2 期末数据和指标	信达澳银稳定价值 债券 A	信达澳银稳定价值 债券 B	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	0.0826	0.0743	0.0059	0.0025	
期末基金资产净值	28,237,440.60	47,096,603.53	75,827,673.95	159,052,532.75	
期末基金份额净值	1.095	1.086	1.009	1.00:	

用后实际收益水平要低于所列数字。
 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。
 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。
4.本基金基金合同于 2009 年 04 月 08 日生效,至 2009 年末未満一年。

	5同于 2009 年 04 月			中已实现部分的孰低数 。	٠	
	净值增长率及其与	同期业绩比较基准	<u></u> 单收益率的比较			
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
过去三个月	2.15%	0.42%	-2.25%	0.16%	4.40%	0.26%
过去六个月	8.09%	0.34%	-1.45%	0.12%	9.54%	0.229
过去一年	8.52%	0.31%	1.92%	0.10%	6.60%	0.219
自基金合同生效 起至今	9.50%	0.27%	2.45%	0.09%	7.05%	0.189
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
过去三个月	1.97%	0.41%	-2.25%	0.16%	4.22%	0.259
过去六个月	7.74%	0.34%	-1.45%	0.12%	9.19%	0.229
过去一年	8.06%	0.31%	1.92%	0.10%	6.14%	0.219
自基金合同生效 起至今	8.60%	0.26%	2.45%	0.09%	6.15%	0.179

責。 基金合股保查国是"固定收益率资产"(会可转换债券)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 等的 20%"。工基金固定收益类形塔的比例超过 80%,而权益类投资比例较低且仅限于省发/增发新股和可转换债券/权证的 本金合业增加收益债为超灾收益类较基础 企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费

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 信达限限稳定价值债券 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2004,持有股票等权益类证券的比例不超过基金资产的2004,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3%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上选规的投资比例。 3.23 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 信达澳保稳定价值债券 A

注,本基金基金合同于2009年04月08日生效,因此2009年的净值增长率是按照基金合同生效后的实际存储期计算的。 3.3过去三年基金的利润分量研究 - 基金公人2009年04月08日(基金合同生效日)至本报告期期末未求施利润分配。

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
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城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
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
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%,外方股东康联首城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
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:

	管理委员会、投资官							
公司建立	了完善的组织架构	勾,设立监察稽村	亥部、投资研究部	、市场开发	:部、运营保障:	8、行政人事部、则	· 务会计部,2011年2月	新组
	3,分工协作,职责日							
							民合型证券投资基金、信	
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	和信达澳银红利	可回报股票型证券	科资基金五只基金,资	{产管
理规模超过7								
4.1.2 基金	≥经理(或基金经理	[小组)及基金经	理助理简介					
		Arrahade Adams	i A for you and you					$\overline{}$

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理) 期限		证券从	说明
灶石	职分	任职日期	高任日 期	业年限	06.91
昌志华	本基金的基金 经理,投资研究 部下宏观策略 部总经理	2009-04-08	-	12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员。2006年6月加入信达澳银基金公司。
陈绪新	本基金的基金 经理,投资研究 部下固定收益 部总经理	2009-07-01	-	8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月任国家建康局地震研究 所助理研究员,长江本州水生开发总公司三峡移民工程监 周工程师。2002年7月至2008年9月故职于北京银行总 行国际业务部、资金交易部、历任交易员、自普投资主管。 2008年10月加入信达廣限基金公司。

2010年,我只揭报市场等势。上年年在债券配置上保持了中性偏长的久期,下半年则发封按照了入期。根据利率不是与信用产品 的相对价值,分析用产品种者被抗性例的危置。整体上,债务部分为基金资料了海皮收益。同时,来销结合投市者参,积极多有 合政策等均。增长投快、定价合组的新股申购。取得了较好的收益。此外,我们密切关注可转债市场动向。在可转债方面的投资也为组 合政帐了业份的企会创业债券现 44.2程告期内监会创业债券现 核配理经营制。44.2程告期内监会创业债券

报公前或提供和宣傳規則、报告期內、本為金剛用人內監查轉載上作業点完成了以下几个方面:
(2)实付這位基金投資所,為香養學用人內医查轉數之分割成。
(2)实付這位基金投資所,為香料度。
(2)实付這位基金投資所,為香料度。
(3)监督的公主要多分金。機能已有,通知资金的主义系统。 (8)行反而致支多。
(3)监督的公主要多分金。機能已有,通知资金的主义系统。 (8)行反而致支多。
(5)加强制工 (2)结束的重要多分金。機能已,通知资金的主义系统。 (8)行反而致支多。
(5)加强制工 (2)结束的重要多分金。機能以用,是有一种人方面比较 (3) 有一种人方面比较 (3) 有一种人方面比较 (3) 有一种人方面比较 (3) 有一种人方面比较 (3) 加强制度 (4) 加强制度 (4

报告期内、本基金未进行利润的配。

5.1程步期内本基金未进行利润的配。

5.1程步期内本基金长型人通路写信格记用期

5.1程步期内本基金长型人通路写信格记用期

5.1程步期内本基金长型人通路写信格记用期

5.1程步期内本基金长型人通路写信格记用期

2.不存在相常基金份配价有公司在本基金的托贷过程中,严格遵守了(证券径号基金法)、基金合同、托管协议和其他有关规定、不存在相常基金份配价有公司在本基金分配,还是不限决定的义务。

5.1年管则人对报告期内本基金投资化准据更有、溶色计算,从间分配等情况的证明

据告期,本托管从按照国家有关规定,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扩行认其负线或对本基金的的投资化方面进行了国营,决定基金管理人有销售基金的额持有人利息的行为。

报告期内,本基金未实施利则分配。

第八首的英文、海南和宗整发来意见

本书写人规则由于对外的方式。海南和宗整发来意见

本书写人规则由于对外的方式。海南和宗整发来意见

本书写人规则由于对外的方式。海南和宗整发来意见

本书写人规则由于以下的对外的方式。海南和宗整发来意见

本书写人规则由于以下的对外的方式。为自己的对外的一种对外的方式。

		1 444 1	单位:人民币:
资产	附注号	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	3,156,754.70	103,160,491.3
结算备付金		814,000.69	73,306.50
存出保证金		5,874.63	43,309.5
交易性金融资产	7.4.7.2	98,183,306.69	210,550,417.0
其中:股票投资		13,172,643.79	17,797,126.99
基金投资		-	
债券投资		85,010,662.90	192,753,290.09
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产	7.4.7.3	-	942,669.0
买人返售金融资产	7.4.7.4	-	
应收证券清算款		2,729,665.24	
应收利息	7.4.7.5	1,130,115.26	2,111,982.10
应收股利		-	
应收申购款		-	7,191.3
递延所得税资产		-	
其他资产	7.4.7.6	_	
资产总计		106,019,717.21	316,889,367.0
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009年12月31日
负债:			
短期借款		-	
交易性金融负债		-	
衍生金融负债	7.4.7.3	-	
卖出回购金融资产款		30,000,000.00	78,399,682.4
应付证券清算款		-	
应付赎回款		193,776.01	3,245,283.4
应付管理人报酬		39,541.11	130,305.8
应付托管费		13,180.37	43,435.2
应付销售服务费		16,447.34	58,899.20
应付交易费用	7.4.7.7	10,219.98	28,470.1
应交税费		48,404.10	47,212.2
应付利息		13,716.66	3,587.3
应付利润		_	
递延所得税负债		_	
其他负债	7.4.7.8	350,387.51	52,284.4
负债合计		30,685,673.08	82,009,160.3
所有者权益:			,
实收基金	7.4.7.9	69.140.451.46	233,416,438.1
	7.4.7.9 7.4.7.10	69,140,451.46 6,193,592.67	233,416,438.1

			单位:人民币
项目	附注号	本期 2010年 01 月 01 日至 2010年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 04 月 08 日至 2009年 12 月 31 日
一、收入		11,849,481.38	7,163,159.5
1.利息收入		3,635,260.89	8,696,999.8
其中:存款利息收入	7.4.7.11	179,974.22	571,741.6
债券利息收入		3,443,572.79	6,750,902.4
资产支持证券利息收入		-	
买人返售金融资产收人		11,713.88	1,374,355.7
其他利息收入		-	
2.投资收益(损失以"-"填列)		6,868,503.11	-3,768,459.5
其中:股票投资收益	7.4.7.12	8,175,105.80	5,286,056.8
基金投资收益		-	
债券投资收益	7.4.7.13	-1,711,426.55	-9,087,536.2
资产支持证券投资收益		-	
衍生工具收益	7.4.7.14	388,488.05	
股利收益	7.4.7.15	16,335.81	33,019.9
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	1,330,833.91	2,168,722.4
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	14,883.47	65,896.7
减:二、费用		2,759,761.72	5,785,059.1
1.管理人报酬		774,266.13	2,751,490.9
2.托管费		258,088.66	917,163.7
3.销售服务费		336,644.52	1,387,862.8
4.交易费用	7.4.7.18	96,538.60	69,122.7
5.利息支出		908,970.04	366,008.4
其中:卖出回购金融资产支出		908,970.04	366,008.4
6.其他费用	7.4.7.19	385,253.77	293,410.5
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		9,089,719.66	1,378,100.3
减:所得税费用		-	

			单位:人民币元
项目	2010年 0	本期 1月01日至2010年12	月 31 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)	-	9,089,719.66	9,089,719.66
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)	-164,275,986.68	-4,359,895.55	-168,635,882.23
其中:1.基金申购款	47,680,607.44	2,532,103.76	50,212,711.20
2.基金赎回款	-211,956,594.12	-6,891,999.31	-218,848,593.43
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)	69,140,451.46	6,193,592.67	75,334,044.13
项目	2009年 0-	上年度可比期间 4月08日至2009年12	月 31 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)	1,140,725,231.47	-	1,140,725,231.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期 利润)	-	1,378,100.38	1,378,100.38
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)	-907,308,793.33	85,668.18	-907,223,125.15
其中:1.基金申购款	134,604,573.61	359,153.63	134,963,727.24
2.基金赎回款	-1,041,913,366.94	-273,485.45	-1,042,186,852.39
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)	233,416,438.14	1,463,768.56	234,880,206.70

报表附注为财务报表的组成部分。 本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署: 基金管理公司负责人: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

家 XBML 機模器 3 号-年度报告和年年度报告),中国证券业协会于 2007年5 月 15 日颁布的(证券投资基金台计模单业务报号)、 达测模型企价值费型证券投资金基金台湾) 本在财务及费用 24 4 5 两河市的中国证金资金布的对关规定及小作的基金行业 7-4.3 通常企业台计准则及其他有关规定的申用 本基金 2010年12 月 31 日的财务状况以及 2010年度 老港金 2010年12 月 31 日的财务状况以及 2010年度 老港企业和基金净值变动物质等有关信息。 本和资则所采用的会计资业。会计估计与最近一期单度报告相一级的说明 本和资则所采用的会计资业。会计估计与最近一期单度报告相一级。 本和资则所采用的会计资业。会计估计与最近一期单度报告相一级。 本和资则所采用的会计资业。会计估计与最近一期单度报告相一级。 本和资则所采用的会计资业。会计估计与最近一期单度报告相一级。 本和资本报价则没有发生会计数策 变更 本基金本报价制没有发生会计估计变更。 7-4.5.2 合计信息更加说明 本基金本报价制没有发生会计估计变更。 7-4.5.2 合计信息可说明 不基金本报价制没有发生会计估计变更。 7-4.6 规划分别没有发生会计估计变更。

2010年12月31日 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,买人股票不征收股票交易印花税。

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
中国信达资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
康联首城集团有限公司(Colonial First State Group Limited)	基金管理人的股东
信达证券股份有限公司("信达证券")	基金管理人的股东的控股公司

7-4.10.1 复聚交易 注:為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。 注:《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。 7-4.10.13 宣文任关联方的调金 注:《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。 7-4.10.2 关联方规则。

7.4.10.2.1 基金官埋贸		单位:人民币元
项目	本期 2010年 01 月 01 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 04 月 08 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	774,266.13	2,751,490.91
其中:支付销售机构的客户维护费	180,288.89	623,789.60
注:支付基金管理人信达澳银基金管理有限公司库 按日支付 其计算公式为 日本全管理人招酬。前二		60%的年费率计提,逐日累计至每月月

7.4.10.2.2 基並代官並		单位:人民币元
项目	本期 2010年 01 月 01 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 04 月 08 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	258,088.66	917,163.73
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	一提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算

7.4.10.2.3 阳台取分页	1	I dhe	单位:人民币元	
	本期 2010年 01 月 01 日至 2010 年 12 月 31 日			
获得销售服务费的 各关联方名称		当期发生的基金应支付的	内销售服务费	
1 X400 440	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	-	976.40	976.40	
中国建设银行	-	330,787.46	330,787.46	
合计	-	331,763.86	331,763.86	
	上年度可比期间 2009年 04 月 08 日至 2009 年 12 月 31 日			
获得销售服务费的 各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
B X400 GW	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	-	26,361.20	26,361.20	
中国建设银行	-	1,357,606.88	1,357,606.88	
合计	-	1,383,968.08	1,383,968.08	
注:信达澳银稳定价值债券 A 不收取销售 対应的基金资产净值 0.4%的年费率计据,逐日		礼构的销售服务费按前一 な付給信法測組基金管理を	日信达澳银稳定价值债券 B 基金份 「關公司 再由信法测知其全管理有	

对应的基金资产净值0.44的年费非村提,还日累计至每月月底,按月发性给信法需要基金管理有限公司,再由信法测银基金管理有限公司。 公司计算并交付给基金管理的服。共计算公式分工目前管服务费—前一日后达渡银稳定价值债券B基金份额对应的基金资产净值、 0.4%/信年天就 7.4.10.3 均实联方进行银行间回业市场的债券(各国购)交易

						单位:人民币
	本	期 2010 年 01 月	01 日至 2010 年	- 12月31日		
银行间市场交易的各	债券交易	金额	基金逆回购		基金正回购	
关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收人	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
	上年度可	丁比期间 2009 年	04月08日至2	2009年12月31	H	
银行间市场交易的各	债券交易。	债券交易金额		巨购	基金正回购	
关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	66,500,000.00	8,691.
信达证券	20,390,468.77	-	-	-	-	

				单位:人民币
关联方 名称	本期 2010年 01 月 01 日至:		上年度可 2009年 04 月 08 日至	
台称	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	3,156,754.70	172,146.68	103,160,491.38	515,920.
7.4.10.6 本基金在	存款由基金托管人中国建设 承销期内参与关联方承销证 期与上年度可比期间均未发	券的情况		

		联交易事项的i	
3	基金本报告	胡与上年度可比	:期间均未发生其他关联交易事项。
4	4.12 期末(20	10年12月31日	1)本基金持有的流通受限证券
4	4 12 1 因认能	新发/愉发证券	而于期末持有的液通平限证券

				T的流通受限证券 T的流通受限证券					金额单位:人	2.币元
7.4.12.1.	1受限证券	类别:股票							30, 10, 11, 10, 17, 17	
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 成本总額	期末估值总额	备注
300133	华 策 影 视	2010-10-14	2011-01-26	新股网下申购	68.00	116.00	17,357	1,180,276.00	2,013,412.00	-
000026	飞亚达 A	2010-12-29	2011-12-30	非公开发行	16.01	16.03	100,000	1,601,000.00	1,603,000.00	-
000713	非 乐 种业	2010-12-27	2011-12-28	非公开发行	15.48	15.57	100,000	1,548,000.00	1,557,000.00	-
002486	嘉麟杰	2010-09-29	2011-01-17	新股网下申购	10.90	14.90	64,925	707,682.50	967,382.50	-
002505	大康牧业	2010-11-10	2011-02-18	新股网下申购	24.00	27.90	23,295	559,080.00	649,930.50	-
300127	银河磁体	2010-09-27	2011-01-13	新股网下申购	18.00	27.90	20,600	370,800.00	574,740.00	-
601890	亚 星 锚 链	2010-12-17	2011-03-30	新股网下申购	22.50	21.50	21,831	491,197.50	469,366.50	-
601126	四方股	2010-12-28	2011-03-31	新股网下由助	23.00	31.11	7.015	161.345.00	218,236.65	

級)。 对于特有的重大事項傳辨股票,本基金将相关股票公允价值所属居级于停牌期间从第一层级转人第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009年度,同)。 (2)除公允价值外,截至价产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。 §8 投資銀合报告

序号	项目	金額	占基金总资产的比 例(%)
1	权益投资	13,172,643.79	12.42
	其中:股票	13,172,643.79	12.42
2	固定收益投资	85,010,662.90	80.18
	其中:债券	85,010,662.90	80.18
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,970,755.39	3.75
6	其他各项资产	3,865,655.13	3.65
7	合计	106,019,717.21	100.00

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	2,206,930.50	2.93
В	采掘业	-	-
С	制造业	6,452,223.29	8.56
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	967,382.50	1.28
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,549,590.64	2.06
C5	电子	2,661,656.00	3.53
C6	金属、非金属	585,991.00	0.78
C7	机械、设备、仪表	687,603.15	0.91
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	-	-
G	信息技术业	-	-
Н	批发和零售贸易	1,603,000.00	2.13
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	897,078.00	1.19
L	传播与文化产业	2,013,412.00	2.67
M	综合类	_	-
	合计 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的	13,172,643.79	17.49

0.0 ///	AND AND IN HELD	坐並以/ 呼曲に四人	STANFAL TO BUIL TO JOK SPECIA	ζ 94 94 94	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	300133	华策影视	17,357	2,013,412.00	2.67
2	000026	飞亚达 A	100,000	1,603,000.00	2.13
3	000713	丰乐种业	100,000	1,557,000.00	2.07
4	300109	新开源	19,040	1,218,369.60	1.62
5	300115	长盈精密	16,460	1,063,316.00	1.41
6	002463	沪电股份	60,000	1,023,600.00	1.36
7	002486	嘉麟杰	64,925	967,382.50	1.28
8	002469	三维工程	11,501	897,078.00	1.19
9	002505	大康牧业	23,295	649,930.50	0.86
10	002460	赣锋锂业	11,959	585,991.00	0.78
	资者欲了解本报 生物由卧雪机器	告期末基金投资的所组合的重大变动	有股票明细,应阅读登	载于 www.fscinda.com 网站的年度报告正	文。

8.4 报告期内股票投资组合的重天变动
8.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比 例(%)
1	601288	农业银行	2,489,720.00	1.06
2	002463	沪电股份	1,840,400.00	0.78
3	000026	飞亚达 A	1,601,000.00	0.68
4	000713	丰乐种业	1,548,000.00	0.66
5	002117	东港股份	1,409,404.78	0.60
6	002336	人人乐	1,357,040.04	0.58
7	600352	浙江龙盛	1,340,442.87	0.57
8	300133	华策影视	1,180,276.00	0.50
9	002353	杰瑞股份	907,970.00	0.39
10	601688	华泰证券	880,000.00	0.37
11	002419	天虹商场	859,080.00	0.37
12	002400	省广股份	822,347.60	0.35
13	002358	森源电气	776,724.00	0.33
14	300115	长盈精密	707,780.00	0.30
15	002486	嘉麟杰	707,682.50	0.30
16	002371	七星电子	705,441.00	0.30
17	002345	潮宏基	636,900.00	0.27
18	002393	力生制药	630,045.00	0.27
19	002409	雅克科技	611,310.00	0.26
20	002428	云南锗业	590,760.00	0.25

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	600219	南山铝业	3,759,352.00	1.60
2	601288	农业银行	2,499,010.00	1.06
3	601989	中国重工	2,272,994.00	0.97
4	300037	新宙邦	1,999,428.96	0.85
5	600999	招商证券	1,819,098.92	0.77
6	002154	报喜鸟	1,608,540.76	0.68
7	002117	东港股份	1,532,034.62	0.65
8	002336	人人乐	1,506,025.10	0.64
9	002308	威创股份	1,379,059.52	0.59
10	002428	云南锗业	1,281,268.41	0.55
11	002353	杰瑞股份	1,252,399.00	0.53
12	600352	浙江龙盛	1,213,495.02	0.52
13	002358	森源电气	1,190,345.00	0.51
14	002371	七星电子	1,168,919.90	0.50
15	002389	南洋科技	1,101,054.25	0.47
16	601888	中国国旅	1,087,313.20	0.46
17	002463	沪电股份	959,848.40	0.41
18	002419	天虹商场	956,731.12	0.41
19	002306	湘鄂情	954,786.13	0.41
20	601688	华泰证券	941,885.43	0.40

往:	平訂來以咸文茲重)典判,个今応相大义勿贞用。
WHO ATTENDED AND A TOTAL COMME	单位:人民币元
买人股票成本(成交)总额	29,670,501.72
卖出股票收入(成交)总额	43,450,015.41
注:本表中买入股票成本(成交)总额、卖出股票收入 交易费用。	(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

卖出股票!	收人(成交)总额		43,450,015.41
と 易费用。	表中买入股票成本(成交)总额、卖出股票 卡按债券品种分类的债券投资组合	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 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	19,294,170.40	25.61
2	央行票据	=	=

	田水田分			19,294,170.40	23.01		
2	央行票据			-	-		
3	金融债券			-	-		
	其中:政策性金融	被债		-			
4	企业债券			36,454,719.00		36,454,719.00	
5	企业短期融资券			9,990,000.00			
6	可转债			19,271,773.50		19,271,773.50	
7	其他			-		=	
8	合计			85,010,662.90			
8.6 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	贫明细	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	098095	09潭城建债	200,000	19,780,000.00	26.26		
2	010110	21国债(00)	170,500	17,159,120.00	22.78		
3	122033	09富力债	96,970	10,152,759.00	13.48		

本报告期末未持有资产支持证券。 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 本报告期末未持有权证。

8.9.投资组合报告附注 8.9.1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 8.9.1 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。

893	期末其他各项资产	- 松 彦			
		1774			单位:人民币:
序号		名称		金額	
1	存出保证金				5,874.63
2	应收证券清算款	(2,729,665.24
3	应收股利				-
4	应收利息				1,130,115.26
5	应收申购款				
6	其他应收款				
7	待摊费用				-
8	其他				
9	合计				3,865,655.13
8.9.4	期末持有的处于氧	股期的可转换债券明细	•		金额单位:人民币
eter tet	Alls ale Alb. Till	district to the	0.004	-	与基金资产净值比

	序号	债券代码	债券名	债券名称		债券名称 公允价值		公允价值		
Г	1	113001	中行和	中行转债		7,745,130.00		10.28		
Г	2	125731	美丰幹	美丰转债		1,732,298.40		2.30		
Г	3	110007		博汇转债		827,680.00		1.10		
	8.9.5	期末前十名股票	《中存在流通受限情》	兄的说明				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		

	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	300133	华策影视	2,013,412.00	2.67	新股网下认购
Г	2	000026	飞亚达 A	1,603,000.00	2.13	非公开发行
Г	3	000713	丰乐种业	1,557,000.00	2.07	非公开发行
Г	4	002486	嘉麟杰	967,382.50	1.28	新股网下认购
	5	002505	大康牧业	649,930.50	0.86	新股网下认购
	8.9.6 由于	投资组合报告P 四舍五人的原因	时注的其他文字描述: 时,分项之和与合计项	部分 可能存在尾差。		

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

		户均持有的基	持有人结构					
份额级别	持有人 户数		机构投资者		个人投资者			
3,000,000	(户)	金份額	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	846	30,486.42	397,894.31	1.54%	25,393,620.55	98.46%		
信达澳银稳定价值债券 B	1,065	40,703.23	200,140.00	0.46%	43,148,796.60	99.54%		
合计	1,911	36,180.25	598,034.31	0.86%	68,542,417.15	99.14%		
注:分级基金机构/个人投资者持				定,比例的分:	3采用各自级别的份额,	,对合计数,比		

单位 信达澳银稳定价值债券 A 信达澳银稳定价值债券 B

~~	III ALDON IO ALDO LA INCIDENTA	III ALIAC MANAGERI ILLIANA
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	75,182,248.33	158,234,189.81
本报告期基金总申购份额	14,185,397.55	33,495,209.89
减:本报告期基金总赎回份额	63,576,131.02	148,380,463.10
本报告期期末基金份额总额	25,791,514.86	43,348,936.60
11.1 基金份额持有人大会决议	§ 1 1 重大事件揭示	

发告期内,来召开基金份额持有人大会,来有相关决议。
11.2基金管理人,基金合管型内与订基全大管。
2000年2月12日,本基金管理人股东会以书面方式通过决议,同意受礼信先生辞去剧童事长和董事职务,选举关来诚先生担董雄,同意由关策诚先生接替受礼信先生为基金管理人危害政场企会员。2000年3月10日,本基金管理人营申会以书面方式通过决议。英格德等数生担任基金管理人第一次基金管理人营,公司工程,以上发生的企业,是一个企业,但一个企业,是一个一

	儿奴里	成交金额	交总额的比例	佣金	总量的比例	
中信证券	3	28,251,222.12	65.02%	22,954.21	62.44%	-
招商证券	2	6,187,956.66	14.24%	5,259.58	14.31%	-
中金公司	1	4,005,375.20	9.22%	3,404.60	9.26%	-
东兴证券	1	3,492,741.43	8.04%	2,968.80	8.08%	新增交易单元
高华证券	1	1,315,500.00	3.03%	1,118.15	3.04%	-
国金证券	1	80,870.00	0.19%	68.73	0.19%	-
国信证券	2	68,170.00	0.16%	57.94	0.16%	-
平安证券	1	39,300.00	0.09%	33.41	0.09%	-
华林证券	1	8,880.00	0.02%	7.54	0.02%	-
申银万国	1	-	-	888.69	2.42%	-
光大证券	1	-	-	-	-	新增交易单元
宏源证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	新增交易单元
信达证券	1	-	-	-	-	新增交易单元
东方证券	1	-	-	-	-	新增交易单元
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	退租1个交易单元
华泰联合	1	-	-	-	-	新增交易单元
银河证券	1	-	-	-	-	新增交易单元
世纪证券	1	-	-	-	-	新增交易单元
兴业证券	1	-	-	-	-	新增交易单元
广发证券	1	-	-	-	-	新增交易单元
中投证券	1	-	-	-	-	新增交易单元

券商名称	成交金額	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	成交金額	占当期权证 成交总额的比 例
中信证券	17,328,160.53	6.04%	27,000,000.00	1.82%	-	-
招商证券	38,337,583.45	13.36%	150,000,000.00	10.12%	-	-
中金公司	88,728,984.45	30.91%	246,000,000.00	16.60%	-	-
东兴证券	18,004,802.50	6.27%	201,000,000.00	13.56%	-	-
高华证券	1,089,780.30	0.38%	30,000,000.00	2.02%	-	-
国金证券	29,686,870.24	10.34%	201,000,000.00	13.56%	-	-
国信证券	5,964,106.50	2.08%	54,000,000.00	3.64%	-	-
平安证券	31,429,450.00	10.95%	45,000,000.00	3.04%	-	-
华林证券	37,938,655.51	13.22%	103,400,000.00	6.98%	-	-
申银万国	16,312,778.52	5.68%	107,900,000.00	7.28%	987,483.07	100.00%
光大证券	1,292,974.04	0.45%	42,000,000.00	2.83%	-	-
宏源证券	927,500.00	0.32%	42,000,000.00	2.83%	-	-
中信建投	-	-	150,000,000.00	10.12%	-	-
信达证券	-	-	45,000,000.00	3.04%	-	-
东方证券	-	-	38,000,000.00	2.56%	-	-
国泰君安	-	-	ı	1	-	-
海通证券	-	-	1	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	ı	1	-	-
华泰联合	-	-	1	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	ı	-	-	-
广发证券	-	-	1	-	-	-
中投证券	-	-	-		-	
注:根据《交易	单元及佣金管理办法》、(投资审议委员会	议事規則)的規定,交易	単元开设、増设す	发退租由投资研	究部提议,经公司

02 元(合稅)。 2010 年9月15日,托管人中国建设银行股份有限公司发布公告,张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长,谢渡拯生龄未日期建设银行股份有限公司监事、监事长职务。 2010年11月2日,托管人中国建设银行股份有限公司发布2010年度A股配股发行公告。