信达澳银稳定价值债券型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6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:2015年8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2015年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6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	
场内简称	-	
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4月8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	25,304,539.02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
下属分级基金场内简称	-	-
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	5,904,711.14份	19,399,827.88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	黄晖	田青
	联系电话	0755-83172666	010-67595096
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	tianqing1.zh@ccb.com
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(2015年1月1日-2015年6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	614,633.77	218,245.19
本期利润	49,843.34	840,594.37
加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0238
本期基金份额净值增长率	5.90%	5.63%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2015年6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	0.4996	0.4586
期末基金资产净值	9,112,311.18	29,120,023.02
期末基金份额净值	1.543	1.501

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	-0.39%	0.76%	0.30%	0.08%	-0.69%	0.68%
过去三个月	7.23%	0.52%	2.27%	0.13%	4.96%	0.39%
过去六个月	5.90%	0.62%	2.60%	0.13%	3.30%	0.49%
过去一年	26.17%	0.65%	7.62%	0.15%	18.55%	0.50%
过去三年	34.06%	0.43%	11.90%	0.12%	22.16%	0.31%
自基金合同生效起至今	54.30%	0.36%	24.05%	0.11%	30.25%	0.25%

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	-0.46%	0.75%	0.30%	0.08%	-0.76%	0.67%
过去三个月	7.14%	0.52%	2.27%	0.13%	4.87%	0.39%
过去六个月	5.63%	0.62%	2.60%	0.13%	3.03%	0.49%
过去一年	25.61%	0.65%	7.62%	0.15%	17.99%	0.50%
过去三年	32.36%	0.43%	11.90%	0.12%	20.46%	0.31%
自基金合同生效起至今	50.10%	0.36%	24.05%	0.11%	26.05%	0.25%

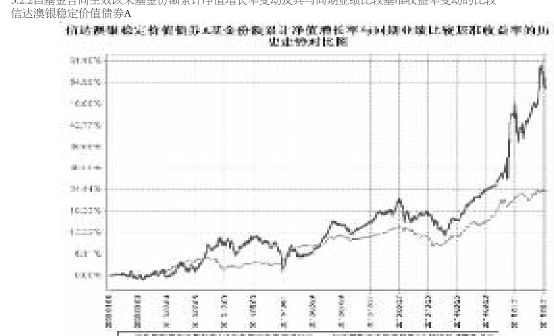
注:本基金的业绩比较基准:中国债券总指数收益率。

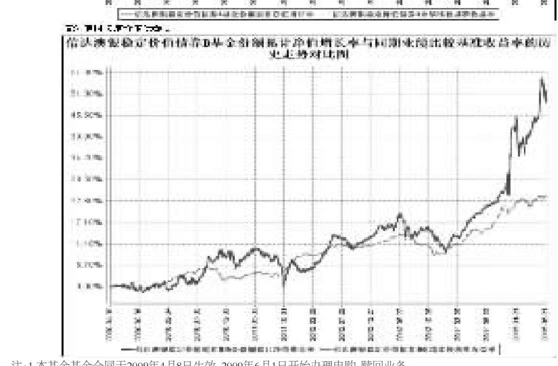
中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数,拥有独立的数据源和自主的编制方法,该指数同时覆盖了国内交易所和银行间两个债券市场,能够反映债券市场总体走势,具有较强的代表性、公正性与权威性,可以较好地衡量固定收益类投资的业绩。指数的详细编制规则敬请参见中央国债登记结算有限责任公司网站:

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





注:1.本基金基金合同于2009年4月8日生效,2009年6月1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。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,与康联首域共同持有公司股份。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治理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构,设立了公募投资总部、专户理财部、市场销售总部、产品创新部、运营管理总部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部等部门,各部门分工协作,职责明确。

截至2015年6月30日,公司共管理十一只基金,包括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、信达澳银产业升级股票型证券投资基金、信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)、信达澳银消费优选股票型证券投资基金、信达澳银信用债债券型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银转型创新股票型证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔学峰	本基金的基金经理、稳定增利债券基金(LOF)、信用债债券基金和慧管家货币市场基金基金经理,固定收益总监	2011-9-29	-	11年	中央财经大学金融学硕士。历任金元证券股份有限公司研究员、固定收益总部副总经理;2011年8月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部下固定收益部总经理、固定收益副总监、固定收益总监、信达澳银稳定价值债券基金基金经理(2011年9月29日起至今)、信达澳银稳定增利债券基金(LOF)基金经理(2012年5月7日起至今)、信达澳银信用债债券基金基金经理(2013年5月14日起至今)、信达澳银慧管家货币市场基金基金经理(2014年6月26日起至今)。

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遵规守信情况的说明

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同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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,报告期内本基金管理人所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

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

一季度,央行总体政策基调是宽松的,实施了降息和降准等明确的调控手段,但实际上并没有明显改善银行间市场的货币资金利率。地方政府债务到期置换事件,成了压垮市场的最后一根稻草。债券长端收益率先下后上,配置需求疲弱,交易力量主导了市场的走势。相反,权益类市场异常火爆,在此期间,本基金参与了可转债的投资。

二季度,央行继续降息和降准,但期间由于新股发行以及债务置换等因素的影响,实际利率仍有较大波动。对于收益率曲线而言,短端下行明显,波动也很大,长端略有上升,市场的情绪比较疲态。在期间内,股票市场经历了过山车行情,转债市场也受到了重创,本基金也因此受到了较大负面影响。

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1.543元,份额累计净值为1.543元,本报告期份额净值增长率为5.90%,同期业绩比较基准收益率为2.60%;

截至报告期末,B类基金份额:基金份额净值为1.501元,份额累计净值为1.501元,本报告期份额净值增长率为5.63%,同期业绩比较基准收益率为2.60%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从一些微观的数据看,中国经济逐步企稳的概率在加大。房地产销售及价格的好转,也有助于推动房地产投资回升。同时,预计政府主导的基建投资在下半年会有较大的起色。物价指数有所走稳,显示底部区域形成,猪肉价格的强势反弹,使得未来CPI上行的压力会逐渐加大。债券市场的主要矛盾在于,对于经济企稳和债务置换的预期比较强烈,同时整体的收益率已经显著低于历史中值,上行的压力犹存。

股市正在经历如2013年债市一样的去杠杆过程,而且这一轮的调整更快更猛烈。事实上,货币政策宽松、强改革,这些基本条件依然还在,可能表明在调整完成之后市场应该会重拾向上的信心,我们会积极挖掘转债的投资机会。

基于上述判断,本基金将保持匹配的组合久期,在保证流动性的前提下,积极挖掘潜在的投资机会,提高组合收益,不辜负基金持有人的托付。

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,由分管基金运营的副总经理担任;基金估值小组成员若干名,由公募投资总部、专户理财部、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2,950,045.59元,B类基金份额可供分配利润为8,895,989.45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。

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

2015年4月7日至2015年6月30日,本基金存在连续二十个交易日基金资产净值低于五千万元的情形,本基金资产净值于2015年7月1日超过五千万元。

§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:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	504,415.66	20,549,209.32
结算备付金		340,510.75	496,853.06
存出保证金		45,799.70	10,455.49
交易性金融资产	6.4.7.2	37,227,313.56	104,866,605.60
其中:股票投资		4,759,236.66	61,090.00
基金投资		-	-
债券投资		32,468,076.90	104,805,515.60
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	-	20,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	661,129.43	2,457,393.51
应收股利		-	-
应收申购款		11,155,260.27	959,958.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		49,934,429.37	149,340,475.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		10,899,865.75	-
应付证券清算款		200,043.00	14,220,622.98
应付赎回款		276,121.68	1,499,171.36
应付管理人报酬		13,785.39	88,334.39
应付托管费		4,595.14	29,444.79
应付销售服务费		6,533.08	51,414.69
应付交易费用	6.4.7.7	11,360.47	29,376.62
应交税费		49,516.78	49,516.78
应付利息		2,153.42	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	238,120.46	160,140.30
负债合计		11,702,095.17	16,128,021.91
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	25,304,539.02	93,372,733.68
未分配利润	6.4.7.10	12,927,795.18	39,839,720.07
所有者权益合计		38,232,334.20	133,212,453.75
负债和所有者权益总计		49,934,429.37	149,340,475.66

注:报告截止日2015年6月30日,信达澳银稳定价值债券A基金份额净值1.543元,信达澳银稳定价值债券B基金份额净值1.501元;基金份额总额25,304,539.02份,其中信达澳银稳定价值债券A基金份额为5,904,711.14份,信达澳银稳定价值债券B基金份额为19,399,827.88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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		1,696,579.65	5,145,158.00
1.利息收入		1,897,418.95	2,286,251.23
其中:存款利息收入	6.4.7.11	29,441.57	19,010.25
债券利息收入		1,863,746.83	2,261,771.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,230.55	5,469.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-264,713.35	-4,573,035.24
其中:股票投资收益	6.4.7.12	2,720,106.85	-116,531.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,028,156.11	-4,481,704.14
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	43,335.91	25,200.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	57,558.75	7,429,224.93
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	6,315.30	2,717.08
减:二、费用		806,141.94	781,473.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2	188,063.90	194,798.76
2. 托管费	6.4.10.2	62,688.00	64,932.88
3. 销售服务费		101,980.08	76,189.47
4. 交易费用	6.4.7.18	48,558.04	4,929.76
5. 利息支出		243,664.95	248,253.07
其中:卖出回购金融资产支出		243,664.95	248,253.07
6. 其他费用	6.4.7.19	161,186.97	192,369.85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		890,437.71	4,363,684.21
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		890,437.71	4,363,684.21

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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	93,372,733.68	39,839,720.07	133,212,453.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	890,437.71	890,437.71
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)	-68,068,194.66	-27,802,362.60	-95,870,557.26
其中:1.基金申购款	41,640,515.02	18,455,592.86	60,096,107.88
2.基金赎回款	-109,708,709.68	-46,257,955.46	-155,966,665.14
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)	25,304,539.02	12,927,795.18	38,232,334.20
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	68,240,545.94	8,277,331.50	76,517,877.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,363,684.21	4,363,684.21
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)	-7,609,553.55	-140,094.34	-7,749,647.89
其中:1.基金申购款	30,823,834.89	5,558,328.32	36,382,163.21
2.基金赎回款	-38,433,388.44	-5,698,422.66	-44,131,811.10
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)	60,630,992.39	12,500,921.37	73,131,913.76

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:

______于建伟______　　______于鹏______　　____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,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》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2015年8月24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以及2014年新颁布及经修订的准则及相关规定 (以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

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和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况以及2015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

除"6.4.5.2会计估计变更的说明"所述内容外,本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的通知的规定,自2015年3月26日起,对本基金持有的在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5.3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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作,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,不缴纳营业税。

(2) 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,暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;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。

(4) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

(5) 对于基金从事A股买卖,自2008年9月19日起,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

(6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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

经本基金管理人股东会决议通过,并中国证券监督管理委员会(证监许可[2015]339号)批准,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本公司54%的股权。上述股东变更的工商变更手续已于 2015年5月22日办理完毕。

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
康联首域集团有限公司 (Colonial First State Group Limited)	基金管理人的股东
信达新兴财富(北京)资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股20%以上的股东,原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

6.4.10.1.1股票交易

无。

6.4.10.1.2权证交易

无。

6.4.10.1.3应支付关联方的佣金

无。

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	188,063.90	194,798.76
其中:支付销售机构的客户维护费	37,180.54	42,593.58

注: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0.6%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×0.6%/当年天数。

6.4.10.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	62,688.00	64,932.88

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0.2%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×0.2%/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 2015年1月1日至2015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
信达澳银基金公司	-	17,980.48	17,980.48
中国建设银行	-	70,624.06	70,624.06
合计	-	88,604.54	88,604.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
信达澳银基金公司	-	7,702.67	7,702.67
中国建设银行	-	63,524.51	63,524.51
合计	-	71,227.18	71,227.18

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×0.4%/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

无。

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

无。

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

份额单位:份

信达澳银稳定价值债券A

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
信达证券	-	-	-	-

信达澳银稳定价值债券B

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
信达证券	-	-	8,547,008.55	9.15%

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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6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	504,415.66	11,654.25	1,179,927.59	11,397.66

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

无。

6.4.10.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.12期末(2015年6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

无。

6.4.12.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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2015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9,499,865.75元,是以如下债券作为质押:

金额单位: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	2015-7-13	104.79	100,000	10,479,000.00
合计				100,000	10,479,000.00

6.4.12.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止,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1,400,000.00元,于2015年7月1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贷款及应收款项和其他金融负债,其账面价值接近于公允价值。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,被划分为三个层次:

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii)各层次金融工具公允价值

于2015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4,759,236.66元,属于第二层次的余额为32,468,076.90元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次37,170,605.60元,第二层次67,696,000.00 元,无属于第三层次的余额)。

(iii)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将相关股票和债券的公允价值列入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。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	4,759,236.66	9.53
	其中:股票	4,759,236.66	9.53
2	固定收益投资	32,468,076.90	65.02
	其中:债券	32,468,076.90	65.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	844,926.41	1.69
7	其他各项资产	11,862,189.40	23.76
8	合计	49,934,429.37	100.00

7.2报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	135,750.00	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,892,436.24	4.95
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,659,975.42	6.96
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	23,865.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	47,210.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,759,236.66	12.45

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600023	浙能电力	181,547	1,800,946.24	4.71
2	600016	民生银行	144,355	1,434,888.70	3.75
3	601398	工商银行	232,024	1,225,086.72	3.20
4	601985	中国核电	7,000	91,490.00	0.24
5	603019	中科曙光	1,000	86,590.00	0.23
6	603989	艾华集团	1,000	49,160.00	0.13
7	603199	九华旅游	1,000	47,210.00	0.12
8	601226	华电重工	1,500	23,865.00	0.06

注:本基金本报告期仅持有上述股票。

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

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	601398	工商银行	6,666,662.36	5.00
2	601988	中国银行	6,274,806.87	4.71
3	600028	中国石化	5,807,765.92	4.36
4	600023	浙能电力	2,210,586.76	1.66
5	601318	中国平安	1,724,400.80	1.29
6	600016	民生银行	1,322,291.80	0.99
7	600958	东方证券	70,210.00	0.05
8	601985	中国核电	23,730.00	0.02
9	603989	艾华集团	20,740.00	0.02
10	603199	九华旅游	12,080.00	0.01
11	603198	迎驾贡酒	11,800.00	0.01
12	601689	拓普集团	11,370.00	0.01

注: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	600028	中国石化	6,871,501.06	5.16
2	601988	中国银行	6,585,808.35	4.94
3	601398	工商银行	6,370,363.53	4.78
4	601318	中国平安	1,805,186.60	1.36
5	600023	浙能电力	1,116,871.36	0.84
6	600958	东方证券	158,130.00	0.12
7	603198	迎驾贡酒	38,000.00	0.03
8	601689	拓普集团	25,880.00	0.02

注:本基金本报告期仅上述所列股票发生卖出交易。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	24,156,444.51
卖出股票收入(成交)总额	22,971,740.90

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	1,537,050.00	4.02
	其中:政策性金融债	1,537,050.00	4.02
4	企业债券	20,749,026.90	54.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,182,000.00	26.63
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	32,468,076.90	84.92

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	1180075	11鄂城投债	100,000	10,479,000.00	27.41
2	122507	12玉交投	100,010	10,270,026.90	26.86
3	1282128	12渝建工MTN2	100,000	10,182,000.00	26.63
4	018001	国开1301	15,000	1,537,050.00	4.02

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

注: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

注: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

注: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国债期货交易情况说明

7.10.1本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

7.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.11投资组合报告附注

7.11.1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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

工商银行(601398)在2015年2月4日收到中国银行间市场交易商协会的整改通知书,主要原因在于:作为债务融资工具"13浙建投MTN001"主承销商,工商银行在获知发行人浙江省建设投资集团有限公司整合下属子公司少数股东权益事项后未及时组织召开持有人会议,交易商协会认为违反了《银行间债券市场非金融企业债务融资工具持有人会议规程》的规定,应该对此进行整改。

基金管理人认为,该公司在收到整改通知后,即进行了整改,切实保护了投资者利益。基金管理人经过审慎分析,认为该通知所述之问题不会对该公司的经营和价值构成重大影响。

除工商银行(601398)外,其余的本基金投资的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。

7.11.2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。

7.11.3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	45,799.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	661,129.43
5	应收申购款	11,155,260.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,862,189.40

7.11.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.6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	1,484.00	3,978.92	-	-	5,904,711.14	100.00%
信达澳银稳定价值债券B	492.00	39,430.54	6,706,908.12	34.57%	12,692,919.76	65.43%
合计	1,976.00	12,805.94	6,706,908.12	26.50%	18,597,630.90	73.50%

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

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信达澳银稳定价值债券A	-	-
	信达澳银稳定价值债券B	-	-
	合计	-	-

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	信达澳银稳定价值债券A	0
	信达澳银稳定价值债券B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信达澳银稳定价值债券A	0
	信达澳银稳定价值债券B	0
	合计	0

§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4月8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	15,428,146.07	77,944,587.61
本报告期基金总申购份额	4,936,649.99	36,703,865.03
减:本报告期基金总赎回份额	14,460,084.92	95,248,624.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,904,711.14	19,399,827.88

§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

报告期内,基金管理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

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

本基金管理人2015年5月27日发布公告,改聘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

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	
招商证券	3	21,166,554.30	92.14%	19,269.96	92.14%	-
平安证券	1	1,805,186.60	7.86%	1,643.45	7.86%	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	新增
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	新增
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	新增1个
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	新增
民生证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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
招商证券	145,185,393.42	59.12%	1,145,300,000.00	86.95%	-	-
平安证券	74,736,187.41	30.43%	92,300,000.00	7.01%	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	2,775,748.71	1.13%	6,000,000.00	0.46%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	22,899,784.15	9.32%	73,536,000.00	5.58%	-	-

§11影响投资者决策的其他重要信息

无。