(上接B518版)

根据深交所深证上[2015]238号《上市通知书》审核同意,信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)28,396,215.00份额于2015年6月4日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》,基金合同及于2015年12月19日公告的《信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)》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股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括企业债券、公司债券、短期融资券、地方政府债券、金融债券、商业银行次级债、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购、国债、中央银行票据,以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金也可投资于股票、权证以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他权益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可以参与一级市场新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离交易的可转换公司债券而产生的权证。基金的投资组合比例为:债券等固定收益类金融工具不低于基金资产的80%,股票等权益类金融工具不超过基金资产的20%;基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中国债券总指数。

1.1.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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、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,也参考了中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定及中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

1.1.4.3 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2015年12月31日的财务状况以及自2015年5月7日(基金转型后起始日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

1.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

1.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。唯本期财务报表的实际编制期间系自2015年5月7日(基金转型后起始日)至2015年12月31日止。

1.1.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

1.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资);

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

1.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债,按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益;应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量,如名义利率与实际利率计差异较小的,也可采用名义利率进行后续计量,其摊销或减值产生的利得或损失,均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

1.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,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,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,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值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作为公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术,优先使用相关可观察输入值,只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值。

1.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

1.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

1.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时,申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时,申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认,于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

1.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账;

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;资产支持证券利息收入 按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(3) 买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在实际持有期间内逐日计提;

(4) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(5) 债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账;

(6) 衍生工具收益/(损失) 于卖出衍生工具成交日确认,并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账;

(7) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(8) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(9) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

1.1.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同,基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率逐日计提;

(2) 根据基金合同,基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提;

(3) 根据基金合同,基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.4%年费率逐日计提;

(4) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(5) 交易费用发生时按照确定的金额计入费用;

(6) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

1.1.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权;

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权日的单位净值自动转为基金份额;

(3) 本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%;

(4) 基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资。

场外的基金份额,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;投资人在不同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式,如投资人在某一销售机构交易账户不选择收益分配方式,则按默认的收益分配方式处理。

场内的基金份额的分红方式为现金分红,投资人不能选择其他的分红方式,具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

(5) 基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截至日)的时间不得超过15个工作日;

(6) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

1.1.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度,本基金整体为一个报告分部,且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

1.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

1.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

1.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

1.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

1.1.4.5.3 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。

1.1.4.6 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》、财税[2015]101号《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》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;自2013年1月1日起,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。自2015年9月8日起,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

(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。

7.2.4.9关联方关系

7.2.4.9.1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。基于基金管理人的控股股东变更,原基金管理人控股股东中国信达资产管理股份有限公司的子公司——幸福人寿保险股份有限公司,及信达财产保险股份有限公司,自2015年5月22日起,不再作为与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方。

7.2.4.9.2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、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
信达财产保险股份有限公司("信达财产")	原基金管理人的控股股东的子公司
幸福人寿保险股份有限公司("幸福人寿")	原基金管理人的控股股东的子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.2.4.10本报告期间的关联方交易

7.2.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.10.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年5月7日(基金转型后起始日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	629,866.18	4.26%

7.2.4.10.1.2权证交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.2.4.10.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年5月7日(基金转型后起始日)至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	586.60	4.34%	-	-

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.2.4.10.2关联方报酬

7.2.4.10.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月7日(基金转型后起始日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	236,309.31
其中:支付销售机构的客户维护费	28,882.33

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0.70%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×0.70%/当年天数。

7.2.4.10.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年5月7日(基金转型后起始日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	67,516.90

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

7.2.4.10.2.3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5月7日(基金转型后起始日)至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
信达澳银基金公司	98,867.65
中国建设银行	31,344.38
信达证券	335.34
合计	130,547.37

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日的基金资产净值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=前一日的基金资产净值×0.40%/当年天数。

7.2.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.2.4.10.4各关联方投资本基金的情况

7.2.4.10.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年5月7日(基金转型后起始日)至2015年12月31日
基金转型后起始日(2015年5月7日)持有的基金份额	22,197,658.12
报告期初持有的基金份额	22,197,658.12
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	22,197,658.12
报告期末持有的基金份额	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	

注:基金管理人持有的原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金份额,在基金合同生效之日起3年分级运作期届满日(即2015年5月7日),转换为信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)的基金份额22,197,658.12份。

7.2.4.10.4.2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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

7.2.4.10.5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5月7日(基金转型后起始日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,129,434.23	11,291.95

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。

7.2.4.10.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券。

7.2.4.10..7其他关联交易事项的说明

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

7.2.4.12期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.2.4.12.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.2.4.12.1.1受限证券类别:股票

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限股票。

7.2.4.12.1.2受限证券类别:债券

金额单位:人民币元

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(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	230	23,000.00	23,000.00	-

7.2.4.12.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末无持有暂时停牌等流通受限股票。

7.2.4.12.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.12.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31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为0,无抵押的债券。

7.2.4.12.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末,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500,000.00元,于2016年1月4日到期。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。

7.2.4.14有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.2.4.14.1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) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31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人民币6,824,233.88元,属于第二层次的余额为人民币18,074,763.00元,无属于第三层次的余额。

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术参见7.4.4.5。

(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。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

8.1.1 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	11,311,767.18	8.80
	其中:股票	11,311,767.18	8.80
2	固定收益投资	86,020,214.20	66.95
	其中:债券	86,020,214.20	66.95
	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	29,689,162.74	23.11
7	其他各项资产	1,461,719.26	1.14
8	合计	128,482,863.38	100.00

8.1.2 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	106,140.00	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,840.00	0.03
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	2,425,071.39	2.04
J	金融业	8,695,775.79	7.33
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	45,940.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	11,311,767.18	9.54

8.1.3 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	601398	工商银行	1,696,083	8,695,775.79	7.33
2	600037	歌华有线	81,143	2,412,381.39	2.03
3	601226	华电重工	2,000	45,940.00	0.04
4	603020	爱普股份	1,000	44,960.00	0.04
5	603030	全筑股份	1,000	38,840.00	0.03
6	603158	腾龙股份	1,000	38,300.00	0.03
7	603688	石英股份	1,000	22,880.00	0.02
8	600959	江苏有线	1,000	12,690.00	0.01

本基金本报告期仅持有上述股票。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 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	8,666,664.12	7.24
2	600028	中国石化	6,981,590.17	5.83
3	601988	中国银行	6,431,677.35	5.37
4	600037	歌华有线	2,580,870.22	2.16
5	600958	东方证券	60,180.00	0.05
6	603012	创力集团	27,120.00	0.02
7	603020	爱普股份	20,470.00	0.02
8	603158	腾龙股份	14,530.00	0.01
9	603030	全筑股份	9,850.00	0.01
10	600959	江苏有线	5,470.00	0.00

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

8.1.4.2 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	8,985,931.67	7.51
2	601988	中国银行	6,603,873.67	5.52
3	601398	工商银行	1,537,759.72	1.28
4	600958	东方证券	135,540.00	0.11
5	603012	创力集团	53,760.00	0.04
6	603099	长白山	20,390.00	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。

8.1.4.3 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	24,798,421.96
卖出股票收入(成交)总额	17,337,256.06

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。

8.1.5 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	60,371,944.20	50.91
	其中:政策性金融债	60,371,944.20	50.91
4	企业债券	19,336,100.00	16.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,312,170.00	5.32
8	其他	-	-
9	合计	86,020,214.20	72.53

8.1.6 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	018001	国开1301	587,390	60,371,944.20	50.91
2	122214	12大秦债	100,000	10,080,000.00	8.50
3	112238	15振业债	50,000	5,052,500.00	4.26
4	122126	11庞大02	40,000	4,203,600.00	3.54
5	110029	浙能转债	20,000	2,907,800.00	2.45

8.1.7 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。

8.1.8 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。

8.1.9 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。

8.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金未参与投资国债期货。

8.1.10.2 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。

8.1.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金未参与投资国债期货。

8.1.11 投资组合报告附注

8.1.11.1 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。

8.1.11.2 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。

8.1.11.3 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	47,982.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,413,736.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,461,719.26

8.1.11.4 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	110029	浙能转债	2,907,800.00	2.45
2	110023	民生转债	1,355,000.00	1.14

8.1.11.5 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情况。

8.1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

8.2 信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)

8.2.3 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	4,469,373.88	16.61
	其中:股票	4,469,373.88	16.61
2	固定收益投资	20,429,623.00	75.94
	其中:债券	20,429,623.00	75.94
	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	1,606,389.89	5.97
7	其他资产	395,974.94	1.47
8	合计	26,901,361.71	100

8.2.4 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	207,300.00	0.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,259,073.88	8.91
E	建筑业	37,050.00	0.15
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	1,928,000.00	7.61
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	37,950.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	4,469,373.88	17.63

8.2.5 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	301,612	2,259,073.88	8.91
2	600016	民生银行	200,000	1,928,000.00	7.61
3	603158	腾龙股份	1,000	62,960.00	0.25
4	603020	爱普股份	1,000	57,320.00	0.23
5	603599	广信股份	1,000	49,740.00	0.20
6	601226	华电重工	3,000	37,950.00	0.15
7	603030	全筑股份	1,000	37,050.00	0.15
8	603688	石英股份	1,000	23,920.00	0.09
9	601968	宝钢包装