

信息披露 disclosure

信达澳银稳定价值债券型证券投资基金

2014 年 度 报 告 摘 要

R4.2累计计入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	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600999	中信银行	21,095,435.57	0.57
2	600028	中国石化	21,095,435.57	0.81
3	601088	中国铝业	2,962,148.98	3.87
4	600896	国投电力	1,725,590.00	2.26
5	603111	诺瓦科技	2,040,950.00	0.05
6	601011	华信国际	13,490.00	0.02

注:本基金报告期内上述股票发生买入交易,本表中累计计入金额是指买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
R4.2买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

序号	股票代码	股票名称	买入成交金额	卖出成交金额
1	600999	中信银行	3,022,000.00	2.27
2	600028	中国石化	7,191,100.00	5.40
3	601088	中国铝业	7,191,100.00	5.40
4	600896	国投电力	4,282,212.00	32.12
5	603111	诺瓦科技	4,050,000.00	30.07
6	601011	华信国际	10,320,000.00	7.60
7	600999	中信银行	16,838,200.00	1.25
8	600999	中信银行	16,838,200.00	76.68
9	合计		104,805,515.00	

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	112320	148国债	100,000	10,700,000.00	8.10
2	118075	11国债	100,000	10,131,000.00	7.82
3	120707	12国债	100,000	10,251,000.00	7.79
4	128239	12国债	1,000,000	10,120,000.00	7.60
5	0416002	148国债	100,000	10,154,000.00	7.58

R7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。

R8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。

R8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。

R10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

R10.1本期股指期货投资情况

R10.2报告期末本基金投资的股指期货持仓和结算明细

R10.3本期股指期货投资评价

R11报告期末本基金持有的前十名债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、通报批评的情形。

R11.1债券投资前十名债券,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

R11.2债券投资前十名债券构成

序号	证券名称	金额
1	存出保证金	10,455.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,457,593.81
5	应收申购款	959,958.68
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	3,427,958.68

R11.3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。

R11.4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。

R11.5报告期末持有的其他文字描述部分

由于持仓互斥的原因,分项之和与合计项存在误差。

§ 基金份额持有人信息

0.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

本报告期基金总申购份额	22,252,847.40	252,502,721.79
减:本报告期基金总赎回份额	32,893,928.99	216,727,452.46
本报告期基金净变动份额	--	--