

信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF) 2016 年半年度报告摘要

2016 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：2016 年 8 月 24 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2016年8月23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2016年01月01日起至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..... | 5 |
| 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..... | 6 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 9 |
| 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..... | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 利润表..... | 13 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 16 |
| §7 投资组合报告 | 23 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 23 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 23 |
| 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..... | 23 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 24 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 24 |
| 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..... | 25 |
| 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..... | 25 |
| 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..... | 25 |
| 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..... | 25 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 25 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 26 |

| | |
|--|-----------|
| §8 基金份额持有人信息 | 26 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 26 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 27 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 27 |
| 8.4 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的情况..... | 27 |
| §9 开放式基金份额变动 | 27 |
| §10 重大事件揭示 | 28 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 28 |
| 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..... | 28 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 28 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 28 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 28 |
| 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..... | 28 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 28 |
| 10.8 其他重大事件..... | 错误！未定义书签。 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 31 |
| §12 备查文件目录 | 错误！未定义书签。 |
| 12.1 备查文件目录..... | 错误！未定义书签。 |
| 12.2 存放地点..... | 错误！未定义书签。 |
| 12.3 查阅方式..... | 错误！未定义书签。 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-----------------|
| 基金简称 | 信达澳银稳定增利债券(LOF) |
| 场内简称 | 信达增利 |
| 基金主代码 | 166105 |
| 交易代码 | 166105 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2015年5月7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 | 17,145,176.43份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2015-6-4 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，主要通过深入分析固定收益类金融工具的公允价值并进行投资，追求基金资产的长期稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金通过自上而下和自下而上相结合的方法，对债券的公允价值进行深入研究，精选价值被低估的债券，在动态调整组合久期和债券品种配置的基础上，有效构建投资组合，优化组合收益。 |
| 业绩比较基准 | 中国债券总指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

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 | tianqingl.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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -854,032.59 |
| 本期利润 | -994,786.23 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0488 |
| 本期基金份额净值增长率 | -3.23% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0056 |
| 期末基金资产净值 | 16,425,273.29 |
| 期末基金份额净值 | 0.958 |

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

| 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 | 0.31% | 0.04% | 0.74% | 0.04% | -0.43% | 0.00% |
| 过去三个月 | 0.10% | 0.05% | 0.24% | 0.08% | -0.14% | -0.03% |
| 过去六个月 | -3.23% | 0.29% | 1.35% | 0.09% | -4.58% | 0.20% |
| 过去一年 | -3.91% | 0.66% | 6.71% | 0.09% | -10.62% | 0.57% |

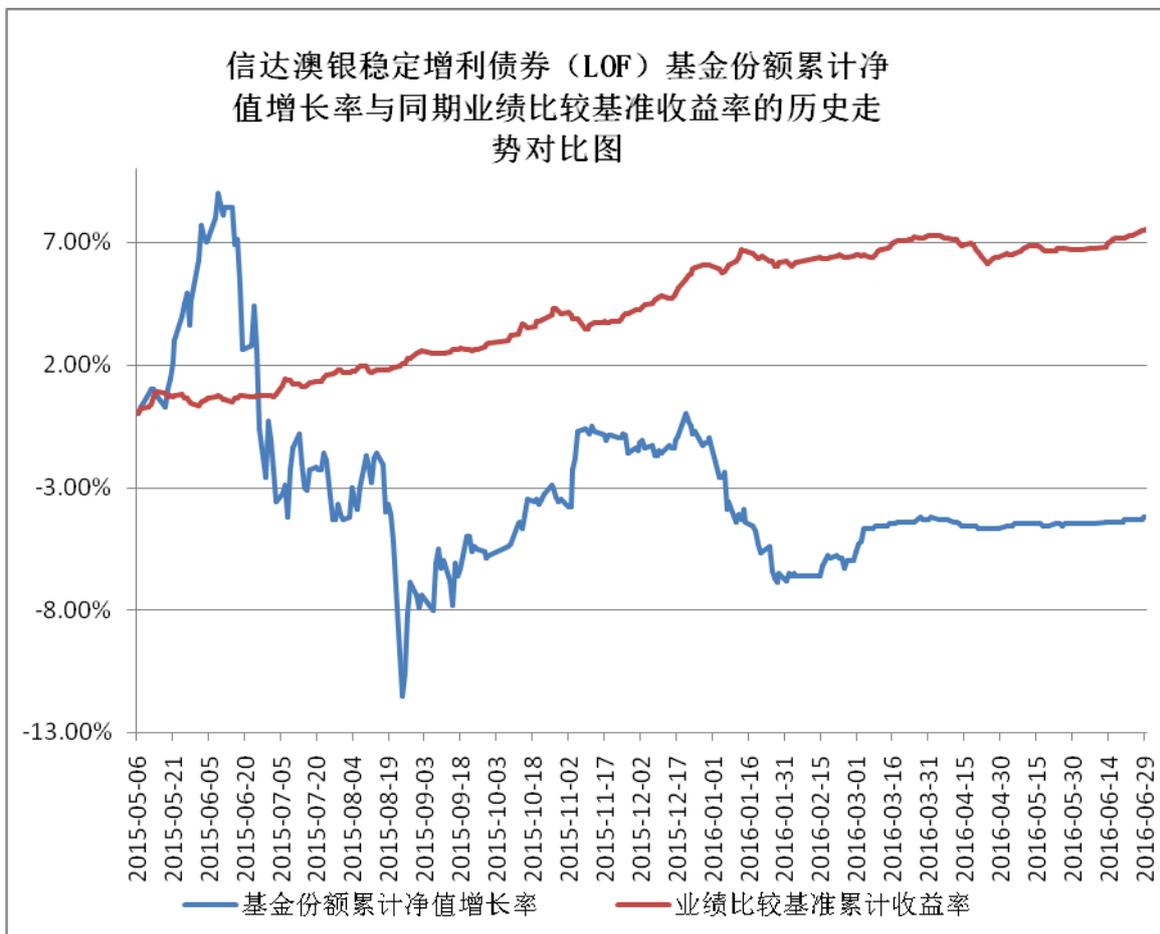
| | | | | | | |
|----------------------------|--------|-------|-------|-------|---------|-------|
| 自转型日 (2015年5月 7日)起至今 | -4.20% | 0.74% | 7.56% | 0.09% | -11.76% | 0.65% |
|----------------------------|--------|-------|-------|-------|---------|-------|

注：本基金的业绩比较基准：中国债券总指数。

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 自基金转型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



注：1、信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）于2015年5月15日开放日常申购、赎回、转换业务，并于2015年6月4日开始在深圳证券交易所上市交易。

2、本基金转型日期为2015年5月7日。

3、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、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司共管理十三只基金，包括信达澳银领先增长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、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF)、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、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、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银纯债债券型证券投资基金。

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，稳定价值债券基金、信用债债券基金和慧管家货币市场基金的基金经理，公募投资总部副总监 | 2012年5月7日 | - | 12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、公募投资总部副总监，信达澳银稳定价值债券基金经理（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

本基金管理人对报告期内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）本基金管理人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，未发现本基金管理人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管理的投资组合未发生交易所公开竞价的对日反向交易。

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，央行仅进行了一次降准操作，实质上执行了偏中性的政策。这种政策变化，可能基于几方面的担忧：汇率贬值压力、通胀压力反弹、以及结构性改革的需要。这些因素短期对债券市场形成了压制，特别是利率品长端曲线感受明显。期间，本基金保持了较短的久期，收缩了杠杆。但由于本基金保持了一定的股票仓位，使得基金净值受到了负面冲击。

二季度，央行的货币政策仍然保持中性基调。债券市场受到营改增事件的阶段性冲击，同时大宗商品的大幅反弹也带来了通胀的担忧，因此在二季度初期债券市场压力较大，中长期利率债收益率有较大的反弹。二季度的中后期，随着美联储加息声浪的降温、英国脱欧的逐渐发酵，市场风险偏好下降，海外债券收益率大幅下降并创下新低，中国的利率债收益率也开始逐渐回落。期间，本基金减持了信用债券，增加了利率债配置，拉长了久期，维持一定的杠杆。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）份额净值为 0.958 元，份额累计净值为 1.107 元，本报告期份额净值增长率为-3.23%，同期业绩比较基准收益率为 1.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

七月份之后，信用债到期比较集中，信用违约的暴露可能还会继续。但由于风险聚集于煤炭、钢铁等行业，市场对此已有预期。同时，山西省政府为省内核心煤炭企业站台，使得市场信心略有恢复。因此，后续违约如果仍出自这些行业，那么对市场的负面影响会弱化。

英国脱欧事件，中国国内权益市场对此的预期仅限于利空出尽，这可能是不足的。而相反，中国债券市场对此的表现也似乎并不到位。我们估计，英国通过脱欧公决只是揭开了欧洲风险的一个盖子，后续的尾部风险可能会越演越烈。欧盟的破裂，甚至欧元的裂痕，越来越严重的影响成员国的经济，特别是欧元区的银行业。因此，从这点上来看，国内债券市场仍是避险的最佳场所。

同时，二三季度面临的增长压力会更加明显，大宗商品由于需求的不足，其上涨的势头会得到遏制。而受到海外因素的影响，人民币贬值的动力和进程预计会加快。

基于上述判断，我们认为债券市场面临较好的机遇，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，由分管基金运营的高管担任；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《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，本基金基金合同生效之日起3年内，本基金不进行收益分配；本基金基金合同生效3年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，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可分配收益的20%。截止报告期末，本基金可供分配利润为-95,921.89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。

本基金本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

截至报告期末，本基金的资产净值已连续超过60个工作日低于人民币5,000万元。本基金管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。

§ 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：信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 10,356,615.79 | 1,129,434.23 |
| 结算备付金 | | 63,336.37 | 476,955.66 |
| 存出保证金 | | 4,537.93 | 11,155.85 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 7,161,787.00 | 24,898,996.88 |
| 其中：股票投资 | | - | 4,469,373.88 |
| 基金投资 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 债券投资 | | 7,161,787.00 | 20,429,623.00 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 135,215.91 | 384,419.09 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 300.00 | 400.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 17,721,793.00 | 26,901,361.71 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015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 | | 400,000.00 | 500,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | 200,151.67 |
| 应付赎回款 | | 1,199.43 | 1,904.68 |
| 应付管理人报酬 | | 9,462.28 | 19,202.62 |
| 应付托管费 | | 2,703.51 | 5,486.42 |
| 应付销售服务费 | | 5,407.01 | 10,972.92 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 302.00 | 1,515.46 |
| 应交税费 | | 763,895.84 | 763,895.84 |
| 应付利息 | | 124.44 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 113,425.20 | 50,000.00 |
| 负债合计 | | 1,296,519.71 | 1,553,129.61 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 15,441,900.80 | 23,052,925.16 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 983,372.49 | 2,295,306.94 |
| 所有者权益合计 | | 16,425,273.29 | 25,348,232.10 |
| 负债和所有者权益总计 | | 17,721,793.00 | 26,901,361.71 |

注：1、本基金转型后的起始日为2015年5月7日，本财务报表的可比期间为自2015年5月7日（基金转型后起始日）至2015年6月30日。

2、报告截止日2016年6月30日，基金份额净值0.958元，基金份额总额17,145,176.43份。

6.2 利润表

会计主体：信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016年1月1日至 2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年5月7日（基 金转型后起始日）至 2015年6月30日 |
|----------------------------|------------|--------------------------------|---|
| 一、收入 | | -711,594.56 | 2,108,807.37 |
| 1.利息收入 | | 506,173.57 | 477,350.28 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 5,561.66 | 6,644.33 |
| 债券利息收入 | | 499,925.76 | 468,141.36 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 686.15 | 2,564.59 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -1,081,141.52 | 1,694,481.72 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -822,962.84 | 2,492,732.40 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -266,791.02 | -897,609.98 |
| 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 | 8,612.34 | 99,359.30 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -140,753.64 | -74,592.48 |
| 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 | 4,127.03 | 11,567.85 |
| 减：二、费用 | | 283,191.67 | 245,808.98 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 67,509.36 | 84,176.34 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 19,288.41 | 24,050.36 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 38,576.80 | 48,100.74 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 7,487.15 | 23,300.39 |
| 5. 利息支出 | | 16,205.56 | 15,807.65 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 16,205.56 | 15,807.65 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 134,124.39 | 50,373.50 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -994,786.23 | 1,862,998.39 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -994,786.23 | 1,862,998.39 |

注：本基金转型后的起始日为2015年5月7日，本财务报表的可比期间为自2015年5月7日（基金转型后起始日）至2015年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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） | 23,052,925.16 | 2,295,306.94 | 25,348,232.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -994,786.23 | -994,786.23 |
| 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） | -7,611,024.36 | -317,148.22 | -7,928,172.58 |
| 其中：1.基金申购款 | 14,755,344.34 | 873,290.81 | 15,628,635.15 |
| 2.基金赎回款 | -22,366,368.70 | -1,190,439.03 | -23,556,807.73 |
| 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） | 15,441,900.80 | 983,372.49 | 16,425,273.29 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 5 月 7 日（基金转型后起始日）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） | 101,129,708.22 | 12,109,901.92 | 113,239,610.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,862,998.39 | 1,862,998.39 |
| 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） | -55,268,454.15 | -9,033,532.80 | -64,301,986.95 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,326,427.62 | 578,570.20 | 3,904,997.82 |
| 2.基金赎回款 | -58,594,881.77 | -9,612,103.00 | -68,206,984.77 |

| | | | |
|--|---------------|--------------|---------------|
| 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） | 45,861,254.07 | 4,939,367.51 | 50,800,621.58 |

注：本基金转型后的起始日为 2015 年 5 月 7 日，本财务报表的可比期间为自 2015 年 5 月 7 日（基金转型后起始日）至 2015 年 6 月 30 日。

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
基金管理人负责人

于鹏
主管会计工作负责人

刘玉兰
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金转型而来。根据《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》，原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金为契约型基金，分级运作期为 3 年期。信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之 B 份额在深圳证券交易所交易上市，至 2015 年 5 月 7 日终止上市。根据深交所深证上[2015]172 号《终止上市同意书》，原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之 B 份额于 2015 年 5 月 6 日进行基金份额权益登记。信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金分级运作期届满后自动转为上市开放式基金 (LOF)，并更名为信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF)。本基金为契约型开放式，存续期间不定。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。

根据《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》、《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金招募说明书》、《关于信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之信达利 A 份额开放赎回业务的公告》以及《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之信达利 A 份额折算与赎回结果的公告》，信达利 A 自基金合同生效之日起每满 6 个月开放一次，信达利 B 封闭运作并上市交易；本基金基金合同生效后 3 年期届满，转换为上市开放式基金 (LOF)。本基金转换成上市开放式基金 (LOF) 后的基金份额净值调整为 1.000 元。开放赎回转换后信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF) 份额总额为 112,342,067.19 份，实收基金余额为人民币 101,129,708.22 元。

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。

6.4.2 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。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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 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》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》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。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，免征营业税。

(2) 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免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；金融机构开展买断式买入返售金融商品、持有金融债券、同业存单业务取得的利息收入，免征增值税。

(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，暂免于缴纳印花税、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

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、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 |

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。

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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金，本期末及上年度末无应支付关联方的佣金余额。

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 2016年1月1日至2016年6月 30日 | 上年度可比期间 2015年5月7日（转型起始日）至2015 年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 67,509.36 | 84,176.34 |

| | | |
|-----------------|-----------|----------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 14,366.70 | 8,839.33 |
|-----------------|-----------|----------|

注：1、本基金转型后的起始日为 2015 年 5 月 7 日，本财务报表的可比期间为自 2015 年 5 月 7 日（基金转型后起始日）至 2015 年 6 月 30 日。

2、支付基金管理人信达澳银基金管理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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年5月7日（转型起始日）至 2015年6月30日 |
|----------------|----------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 19,288.41 | 24,050.36 |

注：1、本基金转型后的起始日为 2015 年 5 月 7 日，本财务报表的可比期间为自 2015 年 5 月 7 日（基金转型后起始日）至 2015 年 6 月 30 日。

2、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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费各关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年5月7日（转型起始日）至2015 年6月30日 |
|---------------|----------------------------|--|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 信达澳银基金公司 | 20,860.21 | 6,713.22 |
| 中国建设银行 | 16,051.33 | 10,197.51 |
| 信达证券 | 182.92 | 127.03 |
| 合计 | 37,094.46 | 17,037.76 |

注：1、本基金转型后的起始日为 2015 年 5 月 7 日，本财务报表的可比期间为自 2015 年 5 月 7 日（基金转型后起始日）至 2015 年 6 月 30 日。

2、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。

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 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

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------------|----------------------|-----------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年5月7日(转型起始日)至2015年6月30日 |
| 基金转型起始日(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 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 22,197,658.12 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总额比例 | - | 43.58% |

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

本期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|----------------------|----------|-----------------------------|----------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 2015年5月7日(转型起始日)至2015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 | 10,356,615.79 | 4,569.84 | 319,731.62 | 5,520.37 |

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

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.12 期末（2016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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

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2016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为0，无抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30日止，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400,000.00元，于2016年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或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

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2016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人民币230,400.00元，属于第二层次的余额为人民币6,931,387.00元，无属于第三层次的余额。（2015年12月31日，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。）

(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。

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 2016 年 8 月 23 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 | 固定收益投资 | 7,161,787.00 | 40.41 |
| | 其中：债券 | 7,161,787.00 | 40.41 |
| | 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 | 10,419,952.16 | 58.80 |
| 7 | 其他各项资产 | 140,053.84 | 0.79 |
| 8 | 合计 | 17,721,793.00 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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发生买入股票交易。

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 | 600016 | 民生银行 | 1,832,585.83 | 7.23 |
| 2 | 600023 | 浙能电力 | 1,586,805.83 | 6.26 |
| 3 | 603020 | 爱普股份 | 38,520.00 | 0.15 |
| 4 | 603158 | 腾龙股份 | 33,607.00 | 0.13 |
| 5 | 603599 | 广信股份 | 32,750.00 | 0.13 |
| 6 | 601226 | 华电重工 | 27,570.00 | 0.11 |
| 7 | 603030 | 全筑股份 | 24,810.00 | 0.10 |
| 8 | 603688 | 石英股份 | 15,796.00 | 0.06 |
| 9 | 601968 | 宝钢包装 | 8,590.00 | 0.03 |

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 | - |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,601,034.66 |

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 | 6,172,107.00 | 37.58 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 759,280.00 | 4.62 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 230,400.00 | 1.40 |

| | | | |
|----|------|--------------|-------|
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 7,161,787.00 | 43.60 |

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 | 010107 | 21 国债(7) | 30,000 | 3,242,400.00 | 19.74 |
| 2 | 019518 | 15 国债 18 | 29,300 | 2,929,707.00 | 17.84 |
| 3 | 112311 | 16 昆仑 01 | 8,000 | 759,280.00 | 4.62 |
| 4 | 132001 | 14 宝钢 EB | 2,000 | 230,400.00 | 1.40 |

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

注：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

注：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 | 4,537.93 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 135,215.91 |
| 5 | 应收申购款 | 300.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 140,053.84 |

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

| 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 |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|-----------|--------------|--------|--------------|--------|
| 572 | 29,974.08 | 8,295,293.06 | 48.38% | 8,849,883.37 | 51.62% |
|-----|-----------|--------------|--------|--------------|--------|

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|-------------|------------|----------|
| 1 | 全国社保基金二零三组合 | 518,745.00 | 53.81% |
| 2 | 李芳 | 103,265.00 | 10.71% |
| 3 | 金挺 | 43,199.00 | 4.48% |
| 4 | 王秀 | 35,383.00 | 3.67% |
| 5 | 吴溪水 | 33,276.00 | 3.45% |
| 6 | 周希海 | 20,000.00 | 2.07% |
| 7 | 方二胜 | 20,000.00 | 2.07% |
| 8 | 董霞 | 20,000.00 | 2.07% |
| 9 | 刘志君 | 12,534.00 | 1.30% |
| 10 | 孙继灵 | 11,101.00 | 1.15% |

注：1、持有人为场内持有人；

2、持有人持有份额占上市总份额比例的计算中，上市总份额为截至2016年6月30日于深圳证券交易所上市的信达利基金份额964,108.00份。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 36,802.50 | 0.21% |

8.4 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的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金转型后起始日（2015年5月7日）基金份额总额 | 112,342,067.19 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 25,604,247.50 |
| 本报告期基金总申购份额 | 16,381,926.94 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 24,840,998.01 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |

| | |
|-------------|---------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 17,145,176.43 |
|-------------|---------------|

§ 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

本基金管理人 2016 年 4 月 12 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会审议通过，聘任焦巍先生为信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人双方股东于 2016 年 3 月 28 日作出决议，一致同意黄慧玲女士不再担任信达澳银基金管理有限公司董事。

本基金管理人双方股东于 2016 年 5 月 14 日作出决议，一致同意选举潘广建先生担任信达澳银基金管理有限公司第四届董事会董事。

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

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

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 | |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|--------------|---|--------------|--------|----------|--------|--------|
| 恒泰证券 | 1 | 2,014,228.83 | 55.93% | 1,875.86 | 55.94% | - |
| 招商证券 | 2 | 1,586,805.83 | 44.07% | 1,477.77 | 44.06% | 退租 1 个 |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信万通 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | 退租 1 个 |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 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 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - |
| 银泰证券 | 1 | - | - | - | - |

注：1、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。

2、本报告期东吴证券席位退租。

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 |
| 恒泰证券 | 3,969,624.20 | 15.85% | 28,600,000.00 | 50.00% | - | - |
| 招商证券 | 4,411,043.74 | 17.62% | 7,900,000.00 | 13.81% | - | - |
| 浙商证券 | - | - | 1,500,000.00 | 2.62% | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中信万通 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 25,593.61 | 0.10% | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | 1,600,000.00 | 2.80% | - | - |
| 方正证券 | 12,810,458.81 | 51.16% | 1,900,000.00 | 3.32% | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|--------------|--------|---------------|--------|---|---|
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | 400,000.00 | 0.70% | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | 12,100,000.00 | 21.15% | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 787,865.21 | 3.15% | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 3,032,986.04 | 12.11% | 3,200,000.00 | 5.59% | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银泰证券 | - | - | - | - | - | - |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。