

信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)
(原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金转型)
2015年第2季度报告
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

报告送出日期：2015年7月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

自 2015 年 5 月 7 日信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之信达利 B 份额终止上市起，原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金名称变更为信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)。原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金本报告期自 2015 年 4 月 1 日至 2015 年 5 月 6 日止，信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)本报告期自 2015 年 5 月 7 日至 2015 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)

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
报告期末基金份额总额	50,940,733.92 份
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分析，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。

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

2.2 原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

基金简称	信达澳银稳定增利分级债券	
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	契约型。本基金基金合同生效之日起 3 年内，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，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。	
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 日	
报告期末基金份额总额	108,407,025.04 份	
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。	
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	
下属两级基金的基金简称	信达澳银稳定增利债券 A	信达澳银稳定增利债券 B
下属两级基金的场内简称	信达利 A	信达利 B
下属两级基金的交易代码	166106	150082
报告期末下属两级基金的份额总额	17,166,529.59 份	91,240,495.45 份
下属两级基金的风险收益	本基金基金合同生效之日	本基金基金合同生效之日

特征	起 3 年内, 信达利 A 为低风险、收益相对稳定的基金份额。	起 3 年内, 信达利 B 为较高风险、较高收益的基金份额。
----	---------------------------------	--------------------------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	2015 年第 2 季度报告	
	信达澳银稳定增利债券(LOF) (2015 年 5 月 7 日—2015 年 6 月 30 日)	信达澳银稳定增利分级债券(2015 年 4 月 1 日—2015 年 5 月 6 日)
1. 本期已实现收益	1,937,590.87	3,923,357.62
2. 本期利润	1,862,998.39	1,952,952.70
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0240	0.0181
4. 期末基金资产净值	50,800,621.58	118,591,447.78
5. 期末基金份额净值	0.997	1.094

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、原达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之信达利 A、信达利 B 于 2015 年 5 月 7 日以各自的份额净值为基础, 转换为信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF), 信达利 A 转换比例为 1: 1.00008904, 信达利 B 转换比例为 1: 1.10918412。

3.2 基金净值表现

3.2.1 信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)

3.2.1.1 本报告期(2015 年 5 月 7 日—2015 年 6 月 30 日)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	净值增长率①	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

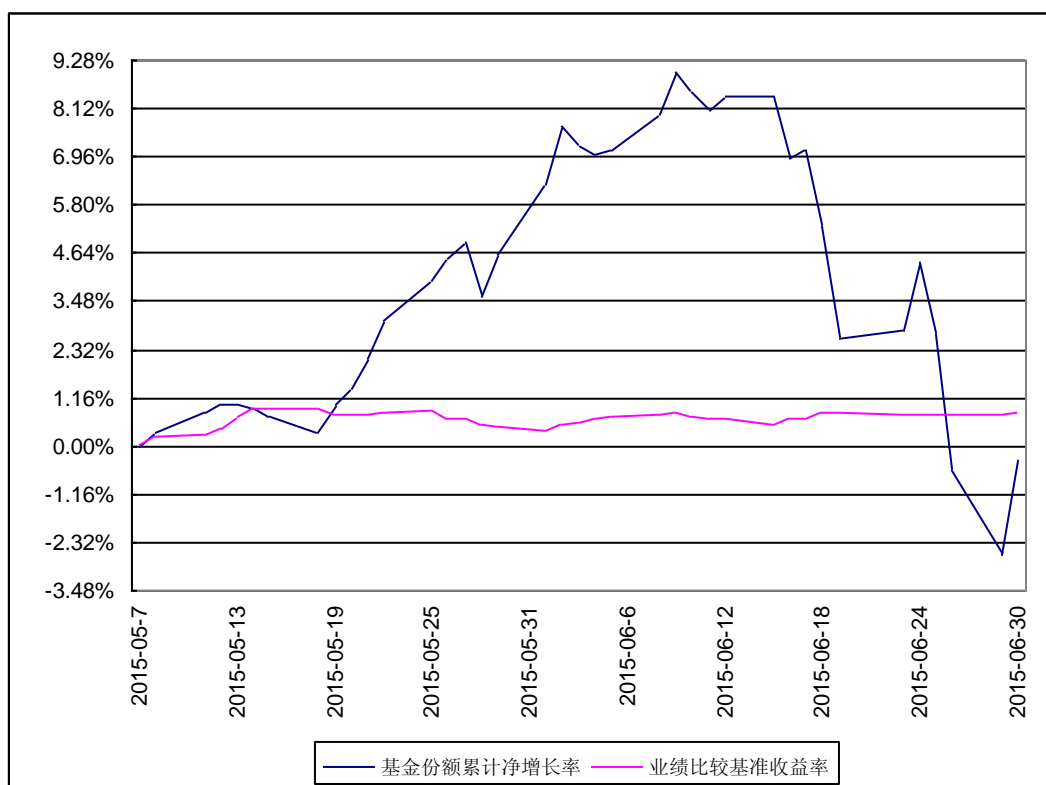
自转型日起至本报告期末 (2015. 5. 7-2015. 6. 30)	-0.30%	1.15%	0.79%	0.10%	-1.09%	1.05%
---	--------	-------	-------	-------	--------	-------

3.2.1.2 自基金转型以来基金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

信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF)

自转型以来份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 5 月 7 日至 2015 年 6 月 30 日)



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, 截止报告期末, 本基金转型未满一年。

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。

3.2.2 原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

3.2.2.1 本报告期（2015 年 4 月 1 日 — 2015 年 5 月 6 日）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	净值增长率①	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
自本报告期初至转型前一日 (2015. 4. 1-2015. 5. 6)	1.70%	0.29%	1.47%	0.17%	0.23%	0.12%

3.2.2.2 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

信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金
 转型前份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2012 年 5 月 7 日至 2015 年 5 月 6 日)



注：1、本基金基金合同于 2012 年 5 月 7 日生效。

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。

3.3 其他指标

原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

序号	其他指标	报告期末(2015 年 5 月 6 日)
1	期末信达利 A 与信达利 B 基金份额配比	0.18814595:1
2	信达利 A 累计折算份额	9,613,185.23 份
3	期末信达利 A 份额参考净值	1.000 元
4	期末信达利 A 份额累计参考净值	1.126 元
5	期末信达利 B 份额参考净值	1.112 元
6	期末信达利 B 份额累计参考净值	1.112 元

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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基金经理，固定收益总监	2012-5-7	-	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》、《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，没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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，报告期内本公司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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度，央行继续实施了降息和降准等明确的宽松手段，但期间由于新股发行以及债务置换等因素的影响，实际上并没有明显改善银行间市场的货币资金利率，相反在二季度资金利率是逐渐抬升的过程。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。

报告期内，本基金收缩了传统债券的配置，并参与了转债的投资交易，受到了转债下跌带来的负面影响。

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，未来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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至转型前一日（2015 年 5 月 6 日），信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金份额净值为 1.094 元，份额累计净值为 1.146 元，自本报告期初至转型前一日（2015.4.1-2015.5.6）份额净值增长率为 1.70%，同期业绩比较基准收益率为 1.47%；

截至本报告期末（2015 年 6 月 30 日），信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）份额净值为 0.997 元，份额累计净值为 1.146 元，自转型日起至本报告期末（2015.5.7-2015.6.30）份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.79%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）投资组合报告

（报告期：2015 年 5 月 7 日-2015 年 6 月 30 日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	10,026,489.48	17.79
	其中：股票	10,026,489.48	17.79
2	固定收益投资	44,301,300.00	78.60
	其中：债券	44,301,300.00	78.60
	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	666,256.87	1.18
7	其他资产	1,367,108.97	2.43
8	合计	56,361,155.32	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	184,540.00	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,524,893.44	6.94
E	建筑业	34,120.00	0.07
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	2,556,004.50	5.03
J	金融业	3,679,201.54	7.24
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	47,730.00	0.09
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	10,026,489.48	19.74

5.1.3 报告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

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	600016	民生银行	370,141	3,679,201.54	7.24
2	600023	浙能电力	355,332	3,524,893.44	6.94
3	600037	歌华有线	81,143	2,556,004.50	5.03
4	603020	爱普股份	1,000	50,860.00	0.10
5	603158	腾龙股份	1,000	48,160.00	0.09
6	601226	华电重工	3,000	47,730.00	0.09
7	603599	广信股份	1,000	43,460.00	0.09
8	603030	全筑股份	1,000	34,120.00	0.07
9	603688	石英股份	1,000	28,110.00	0.06
10	601968	宝钢包装	1,000	13,950.00	0.03

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,592,800.00	48.41
	其中：政策性金融债	24,592,800.00	48.41
4	企业债券	19,708,500.00	38.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	44,301,300.00	87.21

5.1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018001	国开 1301	240,000	24,592,800.00	48.41
2	122214	12 大秦债	100,000	10,080,000.00	19.84
3	112238	15 振业债	50,000	5,100,500.00	10.04
4	122126	11 庞大 02	40,000	4,206,000.00	8.28
5	132002	15 天集 EB	3,220	322,000.00	0.63

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.1.7 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。

5.1.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.1.9.2 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。

5.1.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

5.1.10 投资组合报告附注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 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。

5.1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	50,132.72
2	应收证券清算款	231,409.80
3	应收股利	-
4	应收利息	1,053,888.97
5	应收申购款	1,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,377.48
8	其他	-
9	合计	1,367,108.97

5.1.10.4 报告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。

5.1.10.5 报告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。

5.1.10.6 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。

5.2 原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金投资组合报告

（报告期：2015 年 4 月 1 日-2015 年 5 月 6 日）

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	其他资产	1,461,719.26	1.14
8	合计	128,482,863.38	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

5.2.3 报告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

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	1,695,083	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

注：本基金本报告期末仅持有上述股票。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

5.2.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	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

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.7 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。

5.2.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.2.9.2 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。

5.2.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

5.2.10 投资组合报告附注

5.2.10.1 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。

5.2.10.2 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。

5.2.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
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

5.2.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	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

5.2.10.5 报告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。

5.2.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金转型起始日（2015 年 5 月 7 日）基金份额总额	112,342,067.19
基金转型起始日至报告期期末基金总申购份额	3,695,108.33
减：基金转型起始日至报告期期末基金总赎回份额	65,096,441.60
基金转型起始日至报告期期末基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	50,940,733.92

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF)

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	22,197,658.12
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	22,197,658.12
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	43.58

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。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	20,012,600.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	20,012,600.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	18.46

7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

自 2015 年 5 月 7 日信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之信达利 B 份额终止上市起，原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金名称变更为信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）。原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金本报告期自 2015 年 4 月 1 日至 2015 年 5 月 6 日止，信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）本报告期自 2015 年 5 月 7 日至 2015 年 6 月 30 日止。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。