

信息披露 Disclosure

银华增强收益债券型证券投资基金 [2013]第四季度报告

基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

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于2014年1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，保证复核后不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

| 基金名称 | | 银华增强收益债券 |
|------------|--|----------|
| 交易代码 | 180001 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2006年12月1日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 650,183,177,333.00 | |
| 投资目标 | 本基金在严格控制投资风险、维护本金相对安全、追求基金资产增值的基础上，为机构投资者提供稳定的收入来源。 | |
| 投资策略 | 本基金将通过分析宏观经济形势、政策导向、资金供求状况、利率水平、收益率曲线、信用利差等影响债券价格的因素，在充分考虑债券的流动性、安全性、收益性的基础上，综合运用久期调整、期限配置、券种选择、杠杆操作、回购操作、资产支持证券、逆回购、买入返售金融资产、定期存款、结构性存款、货币市场基金、股票等投资工具，以获取超额收益。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金对债券型基金收益类别的预期回报率不低于同期一年期银行定期存款利率（税后）+5%。本基金投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的20%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其风险收益特征低于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 银华基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | | 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日) |
|----------------|----------------|-------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | - | -27,859,850.70 |
| 2.本期利润 | - | -33,975,273.54 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | - | -0.0446 |
| 4.期末基金份额净值 | 695,598,852.30 | |
| 5.期末基金份额净值 | 1.070 | |

注:1.本期已实现收益指基金本期期间利息收入、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，即本期利润；2.上述基金业绩指标包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平以列示所列各项。

3.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的限制；对债券等固定收益类投资工具的投资比例合计不低于基金资产的90%，其中现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产的20%。本基金还可投资股票、权证等权益类金融工具，但其投资比例合计不超过基金资产的20%。

4 管理人报告

| 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 | |
|---|---------------------------------------|
| 姓名 | 任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 证券从业年限 |
| 贾永康先生 | 2008年12月31日 - 11年 |
| 本基金的基金经理, 固定收益部总监, 定投收益基金经理 | |
| 注:1.此处在的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。 2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的有关规定。 | |

本基金管理人在本报告期内严格执行《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《货币型证券投资基金持券人资金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚信经营、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。

4.2 公平交易制度的执行情况

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 公平交易制度的执行情况

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.6 对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.7 对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.8 影响投资者决策的其他重要信息

4.9 备查文件目录

9.1 中国证监会核准银华增强收益债券型证券投资基金募集的文件

9.2 《银华增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

9.3 《银华增强收益债券型证券投资基金托管协议》

9.4 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》

9.5 《银华基金管理有限公司客户服务政策》

9.6 其他信息披露文件

9.7 临时公告和澄清公告

9.8 其他

9.9 合计

15,237,148.88

注:总申购金额转换为份额, 总赎回份额转换出份额。

9.10 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期内未持有固有资金投资交易。

9.11 投资组合报告的前十名股票, 按照市值占总资产的比例排序。

9.12 由于四舍五入的原因, 比例数可能有尾差。

9.13 6.5 开放式基金份额变动

单位:份

报告期初基金份额总额

报告期初基金份额持有人数

报告期初基金份额净值

报告期初基金份额总额与持有人数乘积

报告期末基金份额总额

报告期末基金份额持有人数

报告期末基金份额净值

报告期末基金份额总额与持有人数乘积

报告期基金份额变动情况

报告期基金份额变动原因

报告期基金份额变动原因