

基金管理人：银华基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
公告送达日期：2015年8月26日

§ 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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本基金年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2015年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置情况、财务会计报告、投资组合报告和基金份额持有人数等信息，确认本报告的内容真实、准确、完整。

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摘要。

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

本报告书中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 银华中证转债指数增强分级证券投资基金

基金简称 银华中证转债指数增强分级

场内简称 中证转债

基金代码 161626

基金的管理费 申购型开放式

基金的托管费 0.05%

基金的运作费 0.05%

基金的分红费 不定期

基金上市的证券交易场所 深圳证券交易所

上市日期 2013年9月26日

基金管理人 银华基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

报告期末基金资产总额 1,830,566,830.11份

基金份额持有人数 1,024,157,683.11份

基金的运作期间 2015年6月30日发布，自2015年5月4日起将本基金的基础份额的场内简称由“银华转债”变更为“中证转债”。

2.2 基金产品说明

本基金为增强型可转换债券基金，指数投资部分采用被动指数化投资策略，指数增强部分采取主动配置策略，利用转换债券和股票的特性，争取为投资者获得超越行业平均的超额收益。

本基金报告期内，中国银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对银华中证转债指数增强分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的运作过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议，未出现损害基金份额持有人利益的情形，能够履行诚实守信、勤勉尽责的托管职责。

2.3 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值的影响情形

本报告期内的财务指标、净值表现、费用分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。

本基金报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.5.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

成交金额 占当期债券成交总额的比例 成交金额 占当期债券成交总额的比例

西南证券 970,622,692.78 13.93% 3,923,512.80 3.36%

6.4.5.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

回购成交金额 占当期债券回购成交总额的比例 回购成交金额 占当期债券回购成交总额的比例

东北证券 840,000,000.00 6.25% 207,800,000.00 11.13%

西证国际 700,000,000.00 6.21% 68,000,000.00 3.64%

6.4.5.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的基金应付的管理费 5,762,140.65 419,087.34

其中：支付销售机构的客户维护费 76,772.00 82,646.09

6.4.5.1.5 基金管理费

金额单位：人民币元

项目 本期 上年度可比期间

2015年1月1日至2015年6月30日 2014年1月1日至2014年6月30日

当期发生的基金应付的管理费 1,646,325.94 119,739.20

6.4.5.1.6 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.2 基金托管费

金额单位：人民币元

项目 本期 上年度可比期间

2015年1月1日至2015年6月30日 2014年1月1日至2014年6月30日

当期发生的基金应付的托管费 1,646,325.94 119,739.20

6.4.5.3 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.4 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.5 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.6 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.7 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.8 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.9 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.10 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.11 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.12 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.13 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.14 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.15 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.16 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.17 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.18 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.19 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.20 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.21 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.22 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.23 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.24 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.25 其他费用

金额单位：人民币元

关联交易方名 称 本期金额 上年度同期

当期发生的银行存款利息收入 5,762,140.65 419,087.34

6.4.5.26 其他费用

金额单位：人民币元