

银华中证转债指数增强分级证券投资基金

[2015] 年度报告摘要

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

5.3 投资人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务数据、净值表现、收益分配情况、财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内,投资组合报告等信息未经托管人复核。

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。

基金经理对本年度报告中财务信息等内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

基金经理对本年度报告中财务信息等内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

本报告期为2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

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

基金代码 161026

基金运作方式 灵活配置型

基金合同生效日 2013年1月16日

报告期截止日 2015年12月31日

单位:人民币元

资产 本期末 上年末度 2015年12月31日 2014年12月31日

货币 66,815,10056 7,426,66030

银行存款 1,689,69238 927,32603

存出保证金 434,62801 24,73497

交易性金融资产 321,409,77204 140,456,18512

其中:股票投资 - -

债券投资 - -

基金投资 321,409,77204 140,456,18512

衍生工具 - -

资产支持证券投资 - -

贵金属投资 - -

应收利息 339,646485 463,26327

应收股利 - -

应收申购款 - -

应付赎回款 4,896,85601 -

应付申购款 - -

应付赎回费用 - -

应付申购费用 - -

其他资产 300,777,83116 154,194,02936

负债和所有者权益 本期末 上年末度 2015年12月31日 2014年12月31日

负债: - -

短期借款 - -

应付票据 - -

应付账款 - -

预收款项 - -

应付职工薪酬 - -

应交税费 - -

应付利息 97,7979

应付股利 - -

应付利润 - -

应付未付保理费 - -

应付未付货款 - -

应付未付租赁费 - -

应付未付工资 - -

应付未付福利费 - -

应付未付税金 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -

应付未付办公费 - -

应付未付邮电费 - -

应付未付水电费 - -

应付未付通讯费 - -

应付未付会议费 - -

应付未付招待费 - -

应付未付咨询费 - -

应付未付手续费 - -

应付未付佣金 - -

应付未付会议费 - -

应付未付差旅费 - -