

银华中证转债指数增强分级证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31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
报告日期2015年1月20日

1.1 重要提示

基金管理人银华基金管理有限公司董事会及监事会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。

基金管理人银华基金管理有限公司根据本基金合同约定，于2015年1月16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，保证基金报告中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人银华基金管理有限公司承诺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。基金管理人银华基金管理有限公司承诺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。

基金管理人银华基金管理有限公司承诺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。

1.2 基金产品概况

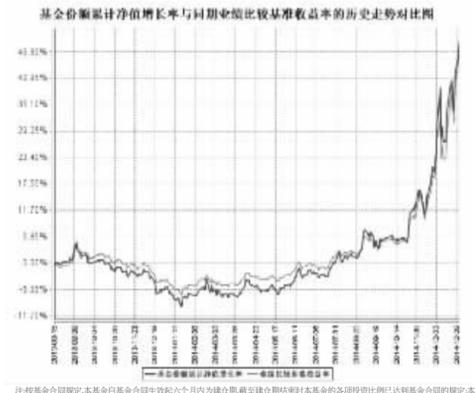
基金简称	银华中证转债指数增强分级
基金代码	161827
交易代码	161828
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日期	2013年8月15日
报告期末基金份额总额	91,138,479.140份
投资目标	本基金为增强型可转债指数基金，跟踪标的指数并采用量化投资策略，追求超越标的指数的长期投资回报，力争实现长期稳定的超额收益。
投资策略	本基金为增强型可转债指数基金，跟踪标的指数并采用量化投资策略，追求超越标的指数的长期投资回报，力争实现长期稳定的超额收益。
业绩比较基准	95%*中证转债指数收益率+5%*银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为增强型可转债指数基金，跟踪标的指数并采用量化投资策略，追求超越标的指数的长期投资回报，力争实现长期稳定的超额收益。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年10月1日—2014年12月31日)	单位:人民币元
1.本期利润总额	6,831,985.28	
2.本期费用	27,515,450.94	
3.加权平均基金份额本期利润	0.5043	
4.期末基金份额净值	1.294,430.4325	

3.2 主要财务指标和基金净值增长率

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
过去三个月	41.22%	1.90%	40.09%	1.82%	1.13%	0.08%



4.1 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
魏天	基金经理	2014年12月21日	6年	魏天先生，2008年3月至2011年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2011年4月至2012年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2012年4月至2014年6月担任银华基金管理有限公司基金经理，2014年6月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理。

4.2 基金托管人

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
姜永亮先生	基金托管人	2013年8月15日	13年	姜永亮先生，2008年12月至2010年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2010年12月至2014年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2014年12月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金托管人。

4.3 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
魏天	基金经理	2014年12月21日	6年	魏天先生，2008年3月至2011年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2011年4月至2012年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2012年4月至2014年6月担任银华基金管理有限公司基金经理，2014年6月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理。

4.4 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
姜永亮先生	基金托管人	2013年8月15日	13年	姜永亮先生，2008年12月至2010年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2010年12月至2014年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2014年12月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金托管人。

4.5 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
魏天	基金经理	2014年12月21日	6年	魏天先生，2008年3月至2011年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2011年4月至2012年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2012年4月至2014年6月担任银华基金管理有限公司基金经理，2014年6月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理。

4.6 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
姜永亮先生	基金托管人	2013年8月15日	13年	姜永亮先生，2008年12月至2010年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2010年12月至2014年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2014年12月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金托管人。

4.7 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
魏天	基金经理	2014年12月21日	6年	魏天先生，2008年3月至2011年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2011年4月至2012年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2012年4月至2014年6月担任银华基金管理有限公司基金经理，2014年6月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理。

4.8 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
姜永亮先生	基金托管人	2013年8月15日	13年	姜永亮先生，2008年12月至2010年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2010年12月至2014年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2014年12月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金托管人。

4.9 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
魏天	基金经理	2014年12月21日	6年	魏天先生，2008年3月至2011年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2011年4月至2012年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2012年4月至2014年6月担任银华基金管理有限公司基金经理，2014年6月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理。

4.10 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
姜永亮先生	基金托管人	2013年8月15日	13年	姜永亮先生，2008年12月至2010年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2010年12月至2014年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2014年12月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金托管人。

4.11 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
魏天	基金经理	2014年12月21日	6年	魏天先生，2008年3月至2011年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2011年4月至2012年3月担任银华基金管理有限公司基金经理，2012年4月至2014年6月担任银华基金管理有限公司基金经理，2014年6月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，2014年7月1日起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理。

4.12 基金管理人及基金经理

姓名	职务	任本基金的基金托管人的期限	证券从业年限	说明
姜永亮先生	基金托管人	2013年8月15日	13年	姜永亮先生，2008年12月至2010年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2010年12月至2014年12月担任银华基金管理有限公司基金托管人，2014年12月起担任银华永益分级债券型证券投资基金基金托管人。

5.1 投资组合报告

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	140,456,185.12	91.09
2	固定收益投资	140,456,185.12	91.09
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,553,989.99	5.42
7	其他资产	5,383,857.25	3.49
8	合计	154,194,029.36	100.00

5.2 报告期末按行业分类的资产配置

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 农林牧渔	-	-
2 采矿业	-	-
3 制造业	-	-
4 建筑业	-	-
5 交通运输、仓储和邮政业	-	-
6 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
7 批发和零售业	-	-
8 住宿和餐饮业	-	-
9 金融业	-	-
10 房地产业	-	-
11 租赁和商务服务业	-	-
12 科学研究和技术服务业	-	-
13 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
14 交通运输、仓储和邮政业	-	-
15 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
16 批发和零售业	-	-
17 住宿和餐饮业	-	-
18 金融业	-	-
19 房地产业	-	-
20 租赁和商务服务业	-	-
21 科学研究和技术服务业	-	-
22 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
23 交通运输、仓储和邮政业	-	-
24 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
25 批发和零售业	-	-
26 住宿和餐饮业	-	-
27 金融业	-	-
28 房地产业	-	-
29 租赁和商务服务业	-	-
30 科学研究和技术服务业	-	-
31 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
32 交通运输、仓储和邮政业	-	-
33 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
34 批发和零售业	-	-
35 住宿和餐饮业	-	-
36 金融业	-	-
37 房地产业	-	-
38 租赁和商务服务业	-	-
39 科学研究和技术服务业	-	-
40 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
41 交通运输、仓储和邮政业	-	-
42 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
43 批发和零售业	-	-
44 住宿和餐饮业	-	-
45 金融业	-	-
46 房地产业	-	-
47 租赁和商务服务业	-	-
48 科学研究和技术服务业	-	-
49 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
50 交通运输、仓储和邮政业	-	-
51 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
52 批发和零售业	-	-
53 住宿和餐饮业	-	-
54 金融业	-	-
55 房地产业	-	-
56 租赁和商务服务业	-	-
57 科学研究和技术服务业	-	-
58 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
59 交通运输、仓储和邮政业	-	-
60 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
61 批发和零售业	-	-
62 住宿和餐饮业	-	-
63 金融业	-	-
64 房地产业	-	-
65 租赁和商务服务业	-	-
66 科学研究和技术服务业	-	-
67 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
68 交通运输、仓储和邮政业	-	-
69 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
70 批发和零售业	-	-
71 住宿和餐饮业	-	-
72 金融业	-	-
73 房地产业	-	-
74 租赁和商务服务业	-	-
75 科学研究和技术服务业	-	-
76 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
77 交通运输、仓储和邮政业	-	-
78 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
79 批发和零售业	-	-
80 住宿和餐饮业	-	-
81 金融业	-	-
82 房地产业	-	-
83 租赁和商务服务业	-	-
84 科学研究和技术服务业	-	-
85 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
86 交通运输、仓储和邮政业	-	-
87 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
88 批发和零售业	-	-
89 住宿和餐饮业	-	-
90 金融业	-	-
91 房地产业	-	-
92 租赁和商务服务业	-	-
93 科学研究和技术服务业	-	-
94 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
95 交通运输、仓储和邮政业	-	-
96 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
97 批发和零售业	-	-
98 住宿和餐饮业	-	-
99 金融业	-	-
100 房地产业	-	-

5.3 报告期末按行业分类的资产配置

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 农林牧渔	-	-
2 采矿业	-	-
3 制造业	-	-
4 建筑业	-	-
5 交通运输、仓储和邮政业	-	-
6 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
7 批发和零售业	-	-
8 住宿和餐饮业	-	-
9 金融业	-	-
10 房地产业	-	-
11 租赁和商务服务业	-	-
12 科学研究和技术服务业	-	-
13 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
14 交通运输、仓储和邮政业	-	-
15 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
16 批发和零售业	-	-
17 住宿和餐饮业	-	-
18 金融业	-	-
19 房地产业	-	-
20 租赁和商务服务业	-	-
21 科学研究和技术服务业	-	-
22 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
23 交通运输、仓储和邮政业	-	-
24 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
25 批发和零售业	-	-
26 住宿和餐饮业	-	-
27 金融业	-	-
28 房地产业	-	-
29 租赁和商务服务业	-	-
30 科学研究和技术服务业	-	-
31 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
32 交通运输、仓储和邮政业	-	-
33 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
34 批发和零售业	-	-
35 住宿和餐饮业	-	-
36 金融业	-	-
37 房地产业	-	-
38 租赁和商务服务业	-	-
39 科学研究和技术服务业	-	-
40 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
41 交通运输、仓储和邮政业	-	-
42 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
43 批发和零售业	-	-
44 住宿和餐饮业	-	-
45 金融业	-	-
46 房地产业	-	-
47 租赁和商务服务业	-	-
48 科学研究和技术服务业	-	-
49 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
50 交通运输、仓储和邮政业	-	-
51 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
52 批发和零售业	-	-
53 住宿和餐饮业	-	-
54 金融业	-	-
55 房地产业	-	-
56 租赁和商务服务业	-	-
57 科学研究和技术服务业	-	-
58 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
59 交通运输、仓储和邮政业	-	-
60 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
61 批发和零售业	-	-
62 住宿和餐饮业	-	-
63 金融业	-	-
64 房地产业	-	-
65 租赁和商务服务业	-	-
66 科学研究和技术服务业	-	-
67 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
68 交通运输、仓储和邮政业	-	-
69 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
70 批发和零售业	-	-
71 住宿和餐饮业	-	-
72 金融业	-	-
73 房地产业	-	-
74 租赁和商务服务业	-	-
75 科学研究和技术服务业	-	-
76 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
77 交通运输、仓储和邮政业	-	-
78 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
79 批发和零售业	-	-
80 住宿和餐饮业	-	-
81 金融业	-	-
82 房地产业	-	-
83 租赁和商务服务业	-	-
84 科学研究和技术服务业	-	-
85 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
86 交通运输、仓储和邮政业	-	-
87 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
88 批发和零售业	-	-
89 住宿和餐饮业	-	-
90 金融业	-	-
91 房地产业	-	-
92 租赁和商务服务业	-	-
93 科学研究和技术服务业	-	-
94 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
95 交通运输、仓储和邮政业	-	-
96 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
97 批发和零售业	-	-
98 住宿和餐饮业	-	-
99 金融业	-	-
100 房地产业	-	-

5.4 报告期末按行业分类的资产配置

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 农林牧渔	-	-
2 采矿业	-	-
3 制造业	-	-
4 建筑业	-	-
5 交通运输、仓储和邮政业	-	-
6 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
7 批发和零售业	-	-
8 住宿和餐饮业	-	-
9 金融业	-	-
10 房地产业	-	-
11 租赁和商务服务业	-	-
12 科学研究和技术服务业	-	-
13 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
14 交通运输、仓储和邮政业	-	-
15 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
16 批发和零售业	-	-
17 住宿和餐饮业	-	-
18 金融业	-	-
19 房地产业	-	-
20 租赁和商务服务业	-	-
21 科学研究和技术服务业	-	-
22 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
23 交通运输、仓储和邮政业	-	-
24 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
25 批发和零售业	-	-
26 住宿和餐饮业	-	-
27 金融业	-	-
28 房地产业	-	-
29 租赁和商务服务业	-	-
30 科学研究和技术服务业	-	-
31 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
32 交通运输、仓储和邮政业	-	-
33 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
34 批发和零售业	-	-
35 住宿和餐饮业	-	-
36 金融业	-	-
37 房地产业	-	-
38 租赁和商务服务业	-	-
39 科学研究和技术服务业	-	-
40 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
41 交通运输、仓储和邮政业	-	-
42 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
43 批发和零售业	-	-
44 住宿和餐饮业	-	-
45 金融业	-	-
46 房地产业	-	-
47 租赁和商务服务业	-	-
48 科学研究和技术服务业	-	-
49 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
50 交通运输、仓储和邮政业	-	-
51 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
52 批发和零售业	-	-
53 住宿和餐饮业	-	-
54 金融业	-	-
55 房地产业	-	-
56 租赁和商务服务业	-	-
57 科学研究和技术服务业	-	-
58 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
59 交通运输、仓储和邮政业	-	-
60 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
61 批发和零售业	-	-
62 住宿和餐饮业	-	-
63 金融业	-	-
64 房地产业	-	-
65 租赁和商务服务业	-	-
66 科学研究和技术服务业	-	-
67 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
68 交通运输、仓储和邮政业	-	-
69 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
70 批发和零售业	-	-
71 住宿和餐饮业	-	-
72 金融业	-	-
73 房地产业	-	-
74 租赁和商务服务业	-	-
75 科学研究和技术服务业	-	-
76 水利、电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
77 交通运输、仓储和邮政业	-	-
78 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
79 批发和零售业	-	-
80 住宿和餐饮业	-	-
81 金融业	-	-
82 房地产业	-	-
83 租赁和商务服务业	-	