

银华中证转债指数增强分级证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

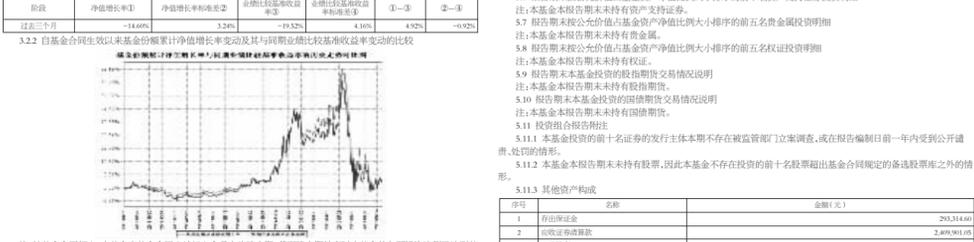
基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24日

1.1 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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者参与投资本基金的风险。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

| 基金名称 | 银华中证转债指数增强分级基金 |
|---------------|--|
| 基金简称 | 银华中证转债 |
| 交易代码 | 163426 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年11月1日 |
| 报告期末基金份额总额 | 184,598,552.39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资本增值,同时力争获得超越标的指数的超额收益,力争为投资者取得超越标的指数的超额收益。 |
| 投资策略 | 本基金在追求跟踪标的指数的基础上,力争将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均超额收益控制在0.5%以内,力争实现长期稳定的超额收益。本基金在追求跟踪标的指数的基础上,力争将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均超额收益控制在0.5%以内,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 | 本基金为中等风险基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益均较高的基金品种,其风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金、股票型基金,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 | 中国银行股份有限公司 |
| 基金经理 | 杨文君 |
| 基金合同生效日 | 2013年11月1日 |
| 报告期末基金份额总额 | 184,598,552.39份 |
| 报告期末基金份额持有人户数 | 14,807户 |
| 报告期末基金份额持有人户数 | 14,807户 |

| 主要财务指标 | 报告期(2015年7月1日—2015年9月30日) | 单位:人民币元 |
|----------------|---------------------------|---------|
| 1.本期已实现收益 | -143,500,238.75 | |
| 2.本期利润 | -123,234,623.13 | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.6704 | |
| 4.期末基金份额净值 | 1.00274838 | |
| 5.期末基金资产净值 | 1,872,162,458.38 | |

3.1 主要财务指标
注:1.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。
2.本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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



注:1.净值表现所载数据截至2015年9月30日。
2.按照《兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》规定,本基金建仓期为2010年4月22日至2010年10月21日,建仓期结束本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|----------------|--------------|
| 1 | 国债 | 19,366,106.40 | 9.77 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 26,255,924.48 | 13.24 |
| 4 | 企业债券 | 4,909,996.00 | 2.51 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 173,675,687.90 | 87.50 |
| 8 | 资产支持证券 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 190,011,990.38 | 99.87 |

| 序号 | 债券品种 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 13国债 | 国债01 | 769,040 | 99,979,266.00 | 50.22 |
| 2 | 14国债 | 国债01 | 24,400 | 31,429,236.30 | 15.85 |
| 3 | 12国债 | 国债01 | 20,500 | 26,255,924.48 | 13.24 |
| 4 | 10国债 | 国债01 | 127,840 | 16,311,114.00 | 7.73 |
| 5 | 10国债 | 国债01 | 154,280 | 19,848,975.20 | 9.29 |

5.1 其他资产构成
注:1.净值表现所载数据截至2015年9月30日。
2.按照《兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》规定,本基金建仓期为2010年4月22日至2010年10月21日,建仓期结束本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|--------|--------------|
| 1 | 银行存款 | 293,314.60 |
| 2 | 应收证券利息 | 2,809,051.60 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | 984,538.80 |
| 6 | 其他 | 11,312.21 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 其他 | 3,668,466.66 |

5.2 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
注:1.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细
注:2.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券品种 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|---------------|--------------|
| 1 | 13国债 | 国债01 | 99,979,266.00 | 50.22 |
| 2 | 14国债 | 国债01 | 31,429,236.30 | 15.85 |
| 3 | 12国债 | 国债01 | 26,255,924.48 | 13.24 |
| 4 | 10国债 | 国债01 | 16,311,114.00 | 7.73 |
| 5 | 10国债 | 国债01 | 19,848,975.20 | 9.29 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
注:1.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细
注:2.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

| 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 | 600004 | 比亚迪 | 537,000 | 5,725,900.00 | 1.48 |
| 2 | 000019 | 招商局 | 297,000 | 3,920,240.00 | 1.01 |
| 3 | 300466 | 九鼎投资 | 78,736 | 2,477,248.24 | 0.64 |
| 4 | 600123 | 美的集团 | 317,000 | 2,234,900.00 | 0.58 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 30,000 | 400,400.00 | 0.10 |

5.4 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股指期货投资明细
注:1.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细
注:2.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

| 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 | 600036 | 招商银行 | 30,000 | 400,400.00 | 0.10 |
| 2 | 600019 | 招商局 | 297,000 | 3,920,240.00 | 1.01 |
| 3 | 600123 | 美的集团 | 317,000 | 2,234,900.00 | 0.58 |
| 4 | 600004 | 比亚迪 | 537,000 | 5,725,900.00 | 1.48 |
| 5 | 300466 | 九鼎投资 | 78,736 | 2,477,248.24 | 0.64 |



注:1.净值表现所载数据截至2015年9月30日。
2.按照《兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》规定,本基金建仓期为2010年4月22日至2010年10月21日,建仓期结束本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

兴全合润分级混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24日

1.1 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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者参与投资本基金的风险。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

| 基金名称 | 兴全合润分级混合基金 |
|--|--|
| 基金简称 <td>兴全合润分级</td> | 兴全合润分级 |
| 交易代码 <td>163406</td> | 163406 |
| 基金运作方式 <td>契约型开放式</td> | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 <td>2013年11月1日</td> | 2013年11月1日 |
| 报告期末基金份额总额 <td>2,075,938,714.92份</td> | 2,075,938,714.92份 |
| 投资目标 <td>本基金为追求长期增值,在追求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资本增值,同时力争获得超越标的指数的超额收益,力争为投资者取得超越标的指数的超额收益。</td> | 本基金为追求长期增值,在追求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资本增值,同时力争获得超越标的指数的超额收益,力争为投资者取得超越标的指数的超额收益。 |
| 投资策略 <td>本基金在追求跟踪标的指数的基础上,力争将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均超额收益控制在0.5%以内,力争实现长期稳定的超额收益。</td> | 本基金在追求跟踪标的指数的基础上,力争将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均超额收益控制在0.5%以内,力争实现长期稳定的超额收益。 |
| 业绩比较基准 <td>95%×沪深300指数收益率+5%×中国国债收益率</td> | 95%×沪深300指数收益率+5%×中国国债收益率 |
| 风险收益特征 <td>本基金为中等风险基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益均较高的基金品种,其风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金、股票型基金,低于混合型基金和股票型基金。</td> | 本基金为中等风险基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益均较高的基金品种,其风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金、股票型基金,低于混合型基金和股票型基金。 |
| 基金管理人 <td>兴业全球基金管理有限公司</td> | 兴业全球基金管理有限公司 |
| 基金托管人 <td>招商银行股份有限公司</td> | 招商银行股份有限公司 |
| 基金经理 <td>杨文君</td> | 杨文君 |
| 基金合同生效日 <td>2013年11月1日</td> | 2013年11月1日 |
| 报告期末基金份额总额 <td>2,075,938,714.92份</td> | 2,075,938,714.92份 |
| 报告期末基金份额持有人户数 <td>14,807户</td> | 14,807户 |
| 报告期末基金份额持有人户数 <td>14,807户</td> | 14,807户 |

| 主要财务指标 | 报告期(2015年7月1日—2015年9月30日) | 单位:人民币元 |
|----------------|---------------------------|---------|
| 1.本期已实现收益 | -159,902,114.28 | |
| 2.本期利润 | -170,742,728.70 | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.8231 | |
| 4.期末基金份额净值 | 1.0753240984 | |
| 5.期末基金资产净值 | 2,232,314,623.13 | |

3.1 主要财务指标
注:1.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。
2.本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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



注:1.净值表现所载数据截至2015年9月30日。
2.按照《兴全合润分级混合型证券投资基金(LOF)基金合同》规定,本基金建仓期为2010年4月22日至2010年10月21日,建仓期结束本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

| 序号 | 债券品种 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 13国债 | 国债01 | 1,041,530 | 108,550,658.50 | 5.18 |
| 2 | 14国债 | 国债01 | 90,000 | 90,000.00 | 0.40 |
| 3 | 12国债 | 国债01 | 1,234,000 | 1,592,236.30 | 0.71 |
| 4 | 10国债 | 国债01 | 1,234,000 | 1,592,236.30 | 0.71 |
| 5 | 10国债 | 国债01 | 2,079,920 | 47,891,215.15 | 2.14 |

5.1 其他资产构成
注:1.净值表现所载数据截至2015年9月30日。
2.按照《兴全合润分级混合型证券投资基金(LOF)基金合同》规定,本基金建仓期为2010年4月22日至2010年10月21日,建仓期结束本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|--------|----------------|
| 1 | 银行存款 | 2,814,958.80 |
| 2 | 应收证券利息 | 26,815,168.96 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收申购款 | 4,098,724.50 |
| 5 | 其他应收款 | 93,814,818.28 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 其他 | 127,532,804.81 |

5.2 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
注:1.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细
注:2.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券品种 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 13国债 | 国债01 | 1,041,530 | 108,550,658.50 | 5.18 |
| 2 | 14国债 | 国债01 | 90,000 | 90,000.00 | 0.40 |
| 3 | 12国债 | 国债01 | 1,234,000 | 1,592,236.30 | 0.71 |
| 4 | 10国债 | 国债01 | 1,234,000 | 1,592,236.30 | 0.71 |
| 5 | 10国债 | 国债01 | 2,079,920 | 47,891,215.15 | 2.14 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
注:1.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细
注:2.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

| 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 | 600004 | 比亚迪 | 537,000 | 5,725,900.00 | 1.48 |
| 2 | 000019 | 招商局 | 297,000 | 3,920,240.00 | 1.01 |
| 3 | 300466 | 九鼎投资 | 78,736 | 2,477,248.24 | 0.64 |
| 4 | 600123 | 美的集团 | 317,000 | 2,234,900.00 | 0.58 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 30,000 | 400,400.00 | 0.10 |

5.4 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股指期货投资明细
注:1.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细
注:2.本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

| 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 | 600036 | 招商银行 | 30,000 | 400,400.00 | 0.10 |
| 2 | 600019 | 招商局 | 297,000 | 3,920,240.00 | 1.01 |
| 3 | 600123 | 美的集团 | 317,000 | 2,234,900.00 | 0.58 |
| 4 | 600004 | 比亚迪 | 537,000 | 5,725,900.00 | 1.48 |
| 5 | 300466 | 九鼎投资 | 78,736 | 2,477,248.24 | 0.64 |



注:1.净值表现所载数据截至2015年9月30日。
2.按照《兴全合润分级混合型证券投资基金(LOF)基金合同》规定,本基金建仓期为2010年4月22日至2010年10月21日,建仓期结束本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。