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
送出日期:2016年3月25日

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

2015年12月31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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已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规定,于2016年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自2015年1月1日起至12月31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		
基金主代码	161826		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年8月15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		
报告期末基金份额总额	299,895,909.69份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2013-08-28		
下属分级基金的基金简称	转债A级	转债B级	中证转债
下属分级基金的交易代码	150143	150144	161826
报告期末下属分级基金份额总额	120,525,270.00份	51,653,687.00份	127,716,952.69份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型可转债指数基金,指数投资部分采用被动指数化投资策略,指数增强部分采取积极配置策略,利用可转债兼具债券和股票的特性,争取为投资者获得超越业绩比较基准的稳健收益。		
投资策略	正常市场情况下,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在0.5%以内,年跟踪误差控制在5%以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金投资策略包括指数投资策略和指数增强策略。 本基金的投资组合比例为:投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%,其中投资于中证转债指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金非现金资产的80%;本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。		
业绩比较基准	95%×中证可转换债券指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期收益和预期风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益	较低风险、较低预期收益

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王永民
	联系电话	(010)58163000	010-66594896
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95566
传真		(010)58163027	(010)66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年8月15日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	-215,224,324.15	6,817,090.05	499,430.51
本期利润	-248,057,776.69	37,618,947.53	-6,247,149.04
加权平均基金份额本期利润	-0.2307	0.3761	-0.0279
本期加权平均净值利润率	-24.10%	38.38%	-2.82%
本期基金份额净值增长率	-28.57%	57.55%	-5.44%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	-54,000,543.95	14,608,540.85	-9,219,956.06
期末可供分配基金份额利润	-0.1801	0.1603	-0.0530
期末基金资产净值	325,069,577.92	129,430,432.35	162,514,222.71
期末基金份额净值	1.084	1.420	0.934
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	6.42%	48.99%	-5.44%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,例如:基金的认购、申购、赎回费等,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 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

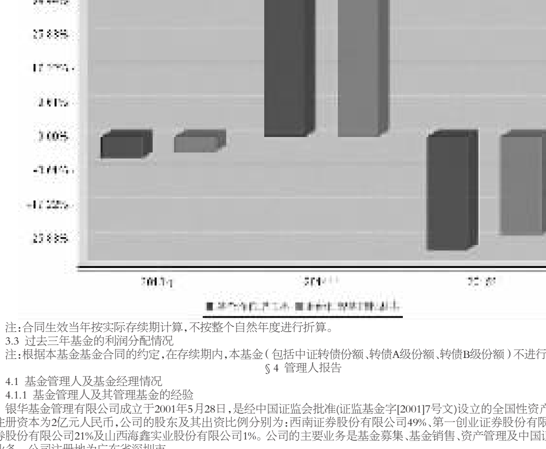
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.08%	0.96%	5.00%	1.20%	-2.92%	-0.24%
过去六个月	-12.83%	2.41%	-15.50%	3.08%	2.67%	-0.67%
过去一年	-28.57%	2.51%	-24.94%	2.99%	-3.63%	-0.48%
自基金合同生效起至今	6.42%	1.80%	10.86%	2.05%	-4.44%	-0.25%

注:由于本基金投资于中证转债指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金非现金资产的80%,且本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。因此,本基金将业绩比较基准定为95%×中证可转换债券指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动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为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同的规定:投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%,其中投资于中证转债指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金非现金资产的80%;本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:根据本基金基金合同的约定,在存续期内,本基金(包括中证转债份额、转债A级份额、转债B级份额)不进行收益分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日,是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为2亿元人民币,公司的股东及其出资比例分别为:西南证券股份有限公司49%、第一创业证券股份有限公司29%、东北证券股份有限公司21%及山西海鑫实业股份有限公司1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至2015年12月31日,本基金管理人管理着55只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深300指数分级证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重90指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票50指数债券型证券投资基金(LOF)、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金、银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金及银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦30股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华中证国防安全指数分级证券投资基金、银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金。同时,本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
贾鹏先生	本基金的基金经理	2014年8月27日	-	6年	硕士学位。2008年3月至2011年3月期间任职于银华基金管理有限公司,担任行业研究员职务;2011年4月至2012年3月期间任职于瑞银证券有限责任公司,担任行业研究组长;2012年4月至2014年6月期间任职于建信基金管理有限公司,担任基金经理助理。2014年6月起任职于银华基金管理有限公司,自2014年8月27日起兼任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理,自2014年9月12日起兼任银华保本增值证券投资基金基金经理,自2014年12月31日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理,具有从业资格。国籍:中国。
孙慧女士	本基金的基金经理助理	2015年4月15日	-	5年	硕士学位。2010年6月至2012年6月任职中邮人寿保险股份有限公司投资管理部,任投资经理助理;2012年7月至2015年2月任职于华夏人寿保险股份有限公司资产管理中心,任投资经理;2015年3月加盟银华基金管理有限公司,任基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。

注:1、此处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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、2016年2月6日,本基金管理人发布公告,自2016年2月6日起增聘孙慧女士为本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,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。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理有限公司公平交易制度》,对投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等所有相关业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等,规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资指令的执行过程,完善公平交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《银华基金管理有限公司公平交易制度》,制定了《银华基金管理有限公司公平交易执行制度》,规定了公平交易的执行流程及特殊情况的审批机制;明确了交易执行环节的集中交易制度,并对交易执行环节的内部控制措施进行了完善。

此外,为了加强对异常交易行为的日常监控,本基金管理人还制定了《银华基金管理有限公司异常交易监控实施细则》,规定了异常交易监控的范围以及异常交易发生后的分析、说明、报备流程。

对照2011年8月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人又对上述制度进行了修改完善,进一步修订了公平交易的范围,修订了对不同投资组合同日反向交易的监控重点,并强调了本基金管理人内部控制的要求,具体控制方法为:1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现,所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行,公平交易程序自动启动;2、一般情况下,场外交易指令以组合的名义下达,交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易,并确保每笔交易在执行前已确定交易价格和交易数量;3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、本基金管理人使用恒生O3.2系统的公平交易稽核分析模块,定期及不定期进行报告分析,对公平交易的情况进行检查,以规范操作流程,适应公平交易的需要。

综上所述,本基金管理人通过事前构建控制环境、事中强化落实执行、事后进行双重监督,来确保公平交易制度得到切实执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1整体执行情况说明

报告期内,本基金管理人根据《银华基金管理有限公司公平交易制度》及相关配套制度,在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节,建立了健全有效的公平交易执行体系,公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下:

在研究分析环节,本基金管理人构建了统一的研究平台,为旗下所有投资组合平地提供研究支持。

在投资决策环节,各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度,保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节,本基金管理人实行集中交易制度,按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节,本基金管理人定期对股票交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2.2同向交易价差专项分析

本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有2次,这两次反向交易属于指数基金或量化专户与其他基金的同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年,权益市场出现罕见的大幅波动,上半年的杠杆牛市在监管层严控风险的背景下戛然截止,6-8月份连续杀跌,十分罕见。但超跌过后,市场逐渐趋稳,并于9月下旬起出现持续反弹,整体交易环境再度正常化。后续,在大类资产配置机制驱动下,稳健慢牛格局初步显现。在此背景下,转债市场跟随股票市场大幅波动,上半年大量个券在牛市中触发赎回条款,转债供给迅速收缩。下半年,由于存量债券有限,波动率显著下降,转债的表现总体弱于正股,且显示出筹码特征。11月份开始,转债供给才逐步恢复,预计市场扩容将持续。

2015年,本基金在跟随指数的前提下,根据对市场的判断进行了一定幅度的波段操作,适时在结构上根据市场特征进行了阶段性的优化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.084元,本报告期份额净值增长率为-28.57%,同期业绩比较基准增长率为-24.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,我们认为,A股市场依然处于"新兴+转轨"期,在经济降速转型、流动性相对宽松的背景下,A股博弈特征可能更强。市场全年属于既非牛市也非熊市的结构性机会,策略上的择时要求更高。转债市场将跟随股票市场波动,供需状态得到改善,需要积极挖掘个券机会。

2016年,本基金将坚持和优化既定的指数复制策略,并以控制基金相对指数的跟踪偏离为基本原则,并通过结构优化来增强收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会(委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干),负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务;估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定,在存续期内,本基金(包括中证转债份额、转债A级份额、转债B级份额)不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对银华中证转债指数增强分级证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,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的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《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的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2015年度财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:银华中证转债指数增强分级证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	66,815,100.56	7,426,660.96
结算备付金	1,685,682.86	927,326.03
存出保证金	434,628.01	24,734.97
交易性金融资产	321,499,772.04	140,456,185.12
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	321,499,772.04	140,456,185.12
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	338,648.48	463,263.27
应收股利	-	-
应收申购款	-	4,895,859.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	390,773,831.95	154,194,029.36
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	19,000,000.00
应付证券清算款	64,947,611.27	4,207,889.49
应付赎回款	25,670.20	1,309,115.70
应付管理人报酬	253,465.29	55,289.14
应付托管费	72,418.62	15,796.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	157.50
应交税费	-	-
应付利息	-	975.79
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	405,088.65	174,372.51
负债合计	65,704,254.03	24,763,597.01
所有者权益:		
实收基金	305,225,194.19	86,795,207.27
未分配利润	19,844,383.73	42,635,225.08
所有者权益合计	325,069,577.92	129,430,432.35
负债和所有者权益总计	390,773,831.95	154,194,029.36

注:报告截止日2015年12月31日,中证转债份额净值人民币1.084元,转债A级份额净值人民币1.004元,转债B级份额净值人民币1.271元;基金份额总额299,895,909.69份,其中中证转债份额127,716,952.69份,转债A级份额120,525,270.00份,转债B级份额51,653,687.00份。

7.2 利润表

会计主体:银华中证转债指数增强分级证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	-236,958,585.95	39,776,227.99
1.利息收入	6,109,936.87	1,134,779.69
其中:存款利息收入	901,023.32	52,246.08
债券利息收入	5,022,946.08	1,080,366.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	185,967.47	2,167.08
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-216,176,845.56	7,657,759.44
其中:股票投资收益	-3,102,715.40	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-213,074,130.16	7,657,759.44
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-32,833,452.54	30,801,857.48
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	5,941,775.28	181,831.38
减:二、费用	11,099,190.74	2,157,280.46
1.管理人报酬	7,123,762.11	685,662.05
2.托管费	2,035,360.60	195,903.36
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	111,912.43	1,482.18
5.利息支出	1,183,700.70	738,458.26
其中:卖出回购金融资产支出	1,183,700.70	738,458.26
6.其他费用	644,454.90	535,774.61
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-248,057,776.69	37,618,947.53
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-248,057,776.69	37,618,947.53

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华中证转债指数增强分级证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	86,795,207.27	42,635,225.08	129,430,432.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-248,057,776.69	-248,057,776.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	218,429,986.92	225,266,935.34	443,696,922.26
其中:1.基金申购款	3,786,597,773.79	1,413,302,060.73	5,199,899,834.52
2.基金赎回款	-3,568,167,786.87	-1,188,035,125.39	-4,756,202,912.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	305,225,194.19	19,844,383.73	325,069,577.92
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	171,734,178.77	-9,219,956.06	162,514,222.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,618,947.53	37,618,947.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-84,938,971.50	14,236,233.61	-70,702,737.89
其中:1.基金申购款	79,640,552.64	17,628,204.45	97,268,757.09
2.基金赎回款	-164,579,524.14	-3,391,970.84	-167,971,494.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	86,795,207.27	42,635,225.08	129,430,432.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

王立新　　杨清　　龚飒

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2013]751号《关于核准银华中证转债指数增强分级证券投资基金募集的批复》的核准,由银华基金管理有限公司于2013年7月15日至2013年8月9日向社会公开募集,基金合同于2013年8月15日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次募集规模为386,033,124.32份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括银华中证转债指数增强分级证券投资基金之基础份额(即"中证转债份额")、银华中证转债指数增强分级证券投资基金之稳健收益类份额(即"转债A级份额")与银华中证转债指数增强分级证券投资基金之积极收益类份额(即"转债B级份额")。其中,转债A级份额、转债B级份额的基金份额配比始终保持7:3的比例不变。基金发售结束后,本基金将投资者在场内认购的全部中证转债份额按照7:3的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别,即转债A级份额和转债B级份额。根据转债A级份额和转债B级份额的基金份额配比,转债A级份额在场内基金初始总份额中的份额占比为70%,转债B级份额在场内基金初始总份额中的份额占比为30%,且两类基金份额的基金资产合并运作。基金合同生效后,中证转债份额设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。转债A级份额与转债B级份额交易代码不同,只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。投资者可在场内申购和赎回中证转债份额,投资者可选择将其场内申购的中证转债份额按7:3的比例分拆成转债A级份额和转债B级份额。投资者可按7:3的配比将其持有的转债A级份额和转债B级份额申请合并为中证转债份额后赎回。投资者可在场外申购和赎回中证转债份额。场外申购的中证转债份额不进行分拆,但基金合同另有规定的除外。投资者可将其持有的场外中证转债份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成转债A级份额和转债B级份额后上市交易。投资者可按7:3的配比将其持有的转债A级份额和转债B级份额合并为中证转债份额后赎回。

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括可转债(含可分离交易的可转换债)、国债、中央银行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、地方政府债、正回购、逆回购、次级债、资产支持证券、银行存款,以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不主动参与一、二级市场股票投资,对于因可转债转股形成的股票或因投资可分离交易的可转换债券而获得的权证,须在达到可交易状态日起10个交易日内卖出。本基金的投资组合比例为:投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%,其中投资于中证转债指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金非现金资产的80%;本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:95%×中证可转换债券指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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

本基金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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月25日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6.3个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司("西南证券")	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司("第一创业")	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司("东北证券")	基金管理人股东、基金代销机构
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金代销机构
银华财富资本管理(北京)有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
西南证券	1,863,351,055.30	21.23%	5,145,967.80	1.24%
东北证券	-	-	640,500.00	0.15%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 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	5.68%	451,300,000.00	12.34%
西南证券	700,000,000.00	4.73%	78,100,000.00	2.14%

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,123,762.11	685,662.05
其中:支付销售机构的客户维护费	132,824.40	117,862.90

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.70%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,035,360.60	195,903.36

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国银行	66,815,100.56	752,837.10	7,426,660.96	23,328.89

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别:债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	2,210	221,000.00	221,000.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

银行存款、结算备付金、结算保证金、应付证券清算款等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币286,198,170.04元,属于第二层次的余额为人民币35,301,602.00元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次人民币137,451,685.12元,第二层次人民币3,004,500.00元,无属于第三层次的余额)。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转换(2014年度:无)。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月25日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况(2014年度:无)。

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月23日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	321,499,772.04	82.27
	其中:债券	321,499,772.04	82.27
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	68,500,783.42	17.53
7	其他各项资产	773,276.49	0.20
8	合计	390,773,831.95	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.2.1 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603993	洛阳钼业	40,890,080.36	31.59

注:"买入金额"按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603993	洛阳钼业	37,787,364.96	29.20

注:"卖出金额"按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	40,890,080.36
卖出股票收入(成交)总额	37,787,364.96

注:"买入股票成本总额"和"卖出股票收入总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	18,487,050.00	5.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	303,012,722.04	93.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	321,499,772.04	98.90

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	950,212	133,476,279.64	41.06
2	113008	电气转债	868,040	119,503,066.80	36.76
3	110030	格力转债	217,300	29,983,054.00	9.22
4	019518	15国债18	185,000	18,487,050.00	5.69
5	110031	航信转债	127,800	16,593,552.00	5.10

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金本报告期末未持有股票,因此本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	434,628.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	338,648.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	773,276.49

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	133,476,279.64	41.06
2	113008	电气转债	119,503,066.80	36.76
3	110030	格力转债	29,983,054.00	9.22
4	110031	航信转债	16,593,552.00	5.10

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,比例的分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
转债A级	521	231,334.49	112,325,337.00	93.20%	8,199,933.00	6.80%
转债B级	4,550	11,352.46	20,495,134.00	39.68%	31,158,553.00	60.32%
中证转债	3,860	33,087.29	105,302,533.48	82.45%	22,414,419.21	17.55%
合计	8,931	33,579.21	238,123,004.48	79.40%	61,772,905.21	20.60%

注:对于分级基金,下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额,对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

转债A级

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	26,147,890.00	22.39%
2	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001深	16,098,400.00	13.78%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司-万能-个人万能	16,000,000.00	13.70%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-团体分红	13,943,150.00	11.94%
5	申万菱信基金-工商银行-中国工商银行股份有限公司私人银行部	10,248,759.00	8.77%
6	太平洋资产-工商银行-南方资本管理有限公司	8,351,320.00	7.15%
7	华泰期货有限公司-华泰期货分级基金一号资产管理计划	3,329,691.00	2.85%
8	国泰君安资管-浦发银行-国泰君安君享卓越三号集合资产管理计划	2,479,971.00	2.12%
9	申万宏源证券-中国银行-申万宏源宝鼎债券3期集合资产管理计划	2,352,293.00	2.01%
10	广发证券-广发银行-广发多添富2号集合资产管理计划	2,253,500.00	1.93%

转债B级

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	太平洋证券-兴业银行-太平洋红珊瑚智汇1号分级集合资产管理计划	6,309,640.00	12.60%
2	上海常春藤资产管理有限公司-常春藤策略证券投资基金	5,355,060.00	10.70%
3	汪文迎	2,400,000.00	4.79%
4	李菁菁	1,870,000.00	3.74%
5	太平洋资管-建设银行-太平洋智选债基FOF型产品	1,804,295.00	3.60%
6	广州证券-工商银行-广州证券鲲鹏越鑫1号集合资产管理计划	1,594,091.00	3.18%
7	太平洋资产-工商银行-南方资本管理有限公司	1,315,069.00	2.63%
8	谢永新	1,116,700.00	2.23%
9	中信建投证券股份有限公司	1,000,000.00	2.00%
10	上海明汯投资管理有限公司-明汯CTA一号基金	683,331.00	1.36%

注:以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:截至本报告期末,本基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注:截至本报告期末,本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0;本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	转债A级	转债B级	中证转债
基金合同生效日(2013年8月15日)基金份额总额	-	-	386,033,124.32
本报告期期初基金份额总额	36,663,069.00	15,712,744.00	38,762,866.14
本报告期基金总申购份额	-	-	5,574,412,972.82
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	4,800,230,122.15
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	83,862,201.00	35,940,943.00	-685,228,764.12
本报告期期末基金份额总额	120,525,270.00	51,653,687.00	127,716,952.69

注:拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中的调整份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于2015年6月10日发布公告,凌宇翔先生自2015年6月8日起担任本基金管理人副总经理,代为履行督察长职务。

本基金管理人于2015年7月25日发布公告,自2015年7月24日起聘任杨文辉先生担任本基金管理人督察长,凌宇翔先生自该日起不再代任督察长职务。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年4月,李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币80,000.00元。该审计机构已为本基金连续提供了3年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
恒泰证券股份有限公司	1	37,787,364.96	100.00%	34,401.28	100.00%	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增2个交易单元
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国开证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增1个交易单元
华融证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增2个交易单元
川财证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增2个交易单元
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

注:1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力,能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后,确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	759,777,677.80	8.66%	672,500,000.00	4.55%	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	297,957,141.10	3.39%	178,000,000.00	1.20%	-	-
招商证券股份有限公司	168,265,679.86	1.92%	263,000,000.00	1.78%	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	840,000,000.00	5.68%	-	-
广州证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	1,643,339,145.30	18.72%	3,037,000,000.00	20.53%	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	10,000,000.00	0.07%	-	-
中信证券股份有限公司	472,891,157.97	5.39%	498,000,000.00	3.37%	-	-
华创证券有限责任公司	3,180,298.30	0.04%	59,000,000.00	0.40%	-	-
财达证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	498,412,317.56	5.68%	1,740,000,000.00	11.76%	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1,863,351,055.30	21.23%	700,000,000.00	4.73%	-	-
中信建投证券股份有限公司	343,126,886.57	3.91%	2,250,000,000.00	15.21%	-	-
平安证券有限责任公司	92,838,207.00	1.06%	346,000,000.00	2.34%	-	-
渤海证券股份有限公司	633,181,975.80	7.21%	482,000,000.00	3.26%	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	180,000,000.00	1.22%	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	1,869,801,469.00	21.30%	3,174,000,000.00	21.46%	-	-
国开证券有限责任公司	19,738,704.50	0.22%	160,500,000.00	1.09%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	110,535,960.80	1.26%	201,500,000.00	1.36%	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

银华基金管理有限公司

2016年3月25日