

银华增强收益债券型证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	36
7.9 投资组合报告附注.....	36
§8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
§9 开放式基金份额变动	38

§10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
10.2 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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	46
§12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华增强收益债券型证券投资基金
基金简称	银华增强收益债券
基金主代码	180015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 12 月 3 日
基金管理人	银华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	487,852,316.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险、维护本金相对安全、追求基金资产稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势和债券市场资金供求状况等因素的基础上，自上而下确定大类金融资产配置和固定收益类金融工具的种类配置，动态调整组合久期，并通过自下而上精选个券，构建和调整固定收益投资组合，获取稳健收益；此外，本基金还将在严格控制风险的前提下积极参加股票一级市场申购，适度参与股票二级市场和权证投资，力争提高投资组合收益率水平。</p> <p>本基金对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，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%。本基金还可投资于股票、权证等权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。</p>
业绩比较基准	中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凌宇翔	尹东
	联系电话	(010) 58163000	(010) 67595003

	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	(010) 67595096
传真		(010)58163027	(010) 66275853
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号 东方广场东方经贸城 C2 办 公楼 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼长安兴融中心
邮政编码		100738	100033
法定代表人		王立新(代)	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	银华基金管理有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广 场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	14,908,431.20
本期利润	21,601,754.49
加权平均基金份额本期利润	0.0456
本期加权平均净值利润率	4.24%
本期基金份额净值增长率	4.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	10,486,165.03
期末可供分配基金份额利润	0.0215
期末基金资产净值	535,794,465.03
期末基金份额净值	1.098
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	28.02%

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。

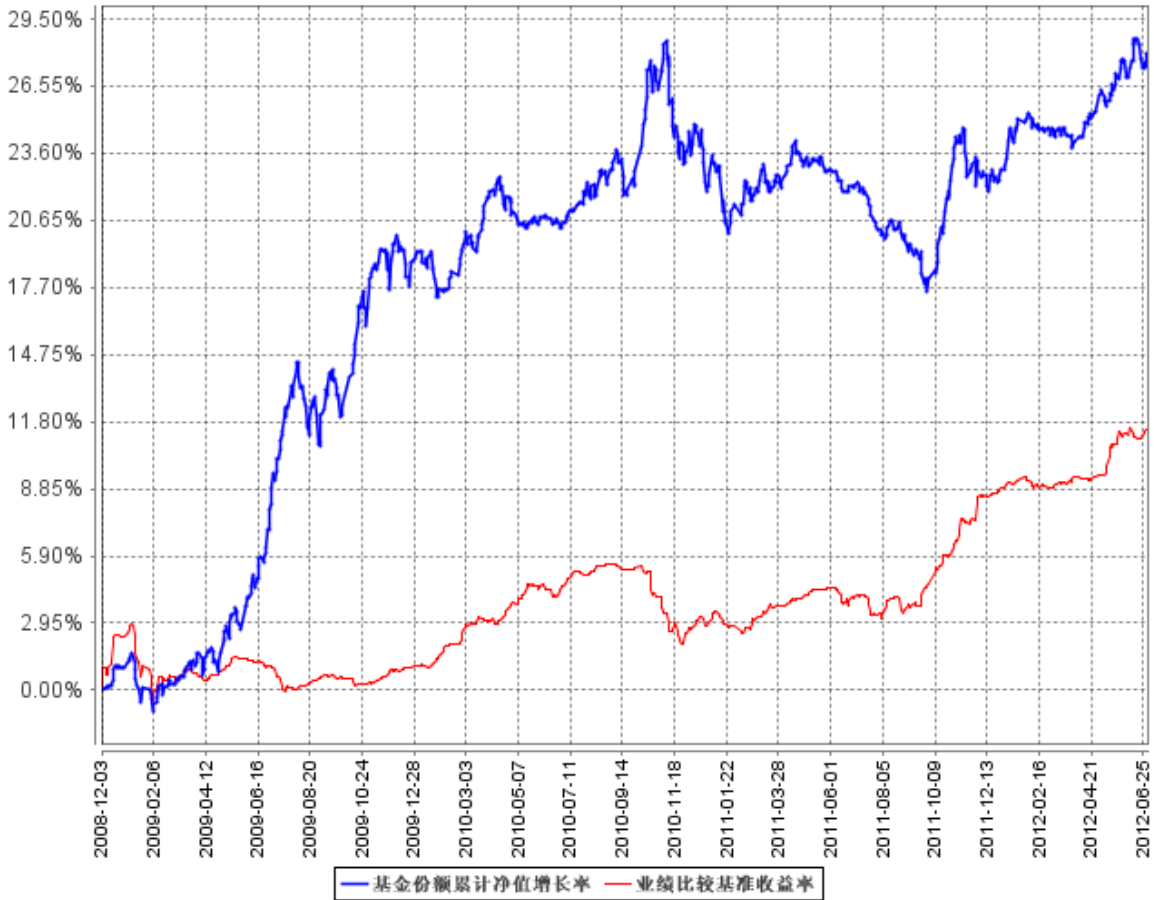
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.37%	0.29%	0.22%	0.08%	0.15%	0.21%
过去三个月	3.20%	0.23%	1.90%	0.10%	1.30%	0.13%
过去六个月	4.17%	0.21%	2.35%	0.08%	1.82%	0.13%
过去一年	4.77%	0.25%	7.11%	0.11%	-2.34%	0.14%
过去三年	19.54%	0.30%	10.28%	0.09%	9.26%	0.21%
自基金合同生效日起至 今	28.02%	0.29%	11.47%	0.11%	16.55%	0.18%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，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%。本基金还可投资于股票、权证等权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。

§ 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 2012 年 6 月 30 日,本基金管理人管理着 23 只开放式证券投资基金和 1 只创新型封闭式证券投资基金,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、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(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 指数证券投资基金(LOF)、银华深证 100 指数分级证券投资基金、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、银华消费主题分级股票型证券投资基金、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、银华中小盘精选股票型证券投资基金和银华信用债券型证券投资基金。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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜永康先生	本基金的基金经理、公司固定收益部总监及固定收益基金投资总监。	2008 年 12 月 3 日	-	10 年	硕士学位。2001 年至 2005 年就职于中国平安保险(集团)股份有限公司,历任研究员、组合经理等职。2005 年 9 月加盟银华基金管理有限公司,曾任养老金管理部投资经理职务。自 2008 年 1 月 8 日至 2009 年 2 月 18 日期间任银华货币市场证券投资基金基金经理,自 2007 年 1 月 30 日至今任银华保本增值证券投资基金基金经理,自 2011 年 6 月 28 日起兼任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
高固先生	本基金的基金经理助理	2011 年 4 月 7 日	-	5 年	学士学位。2001 年 7 月至 2011 年 3 月先后在中国建设银行总行会计部、金融市场部从事会计制度建设、人民

					币货币市场交易、债券投资等工作，历任业务员、业务经理等职位。2011 年 3 月加盟银华基金管理有限公司。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、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《银华增强收益债券型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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人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》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，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公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，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。

综上所述，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。

4.3.2 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，本公司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 13 次，原因是指数型投资组合投资策略需要，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

2012 年上半年，受货币供应量增速下降及欧洲债务危机影响，我国经济持续放缓，投资、消费、进出口增速与去年同期相比均下一台阶，工业增加值及发电量同比增速也大幅下滑，虽然在结构性的刺激政策及鼓励合理购房需求的政策引导下，房地产销售与去年相比有所回暖，但制造业仍不乐观，宏观经济呈现软着陆态势。

国际经济方面，虽然美国经济在一季度全面复苏，就业、消费、信贷及企业盈利各方面势头较好，房地产市场也有所恢复，但二季度受欧债危机恶化影响经济有所反复；欧债危机在上半年仍找不到彻底解决的办法，虽然希腊债务谈判在欧元区国家共同努力达成协议，但随着西班牙等国债务形势的恶化，欧洲情况再次复杂化，欧洲经济的发动机德国经济也陷入衰退。

上半年消费者物价指数（CPI）持续下行，虽然房价有所反弹，资源价格改革导致水电等成本小幅上升，但在国际大宗商品价格下跌及货币供应量增速下行的影响下，我国通胀形势持续向好。

回顾上半年的宏观经济政策，整体上贯彻了中央经济工作会议制定的稳中求进、预调微调的思路，全年的新增信贷目标控制在 8 万亿左右不变，对国家支持的产业及小微企业的扶持力度有所加大，虽然下调法定存款准备金率及降息手段并用，但在节奏上有所控制，总体看体现了求稳的特征。

受政策放松影响，上半年银行间市场资金面好于去年下半年，货币市场利率持续下降，但平均水平仍在 3%以上，受 CPI 下行及资金面好转影响债券市场上半年表现较好，尤其是中低等级信用债表现更好，受资金成本限制，利率债表现一般。股票市场受经济下行影响上半年表现低迷，经过两次反复后上证综指又重新接近年初水平。

操作方面，本基金逐步提高了股票仓位，降低了可转债配置比例，适当降低了债券组合久期，调整了信用债结构，以获取稳定的持有期收益。

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 1.098 元，本报告期份额净值增长率为 4.17%，同期业绩比较基准增长率为 2.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，由于欧洲陷入偿还债务与发展经济相矛盾的恶性循环中，在欧元区没有重大变

革之前很难找到解决问题的办法，因此短期内欧洲经济很难复苏，美国经济也将继续受到拖累。

国内方面，由于上半年一线城市房价在调整未达政策预期的情况下出现一波反弹，对房地产调控政策造成一定威胁，引发新调控手段的风险增大；房价上涨的压力同时限制了经济政策放松的空间与手段，导致下半年国内经济很难出现超预期增长，通胀压力将继续减小。

基于以上判断，本基金将继续保持债券资产的结构与久期，以获取较高的持有期收益；灵活对待权益资产，在控制风险的前提下提高组合收益。

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验。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

本基金本报告期末进行利润分配。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监

督，未发现基金管理人有关害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华增强收益债券型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,854,541.51	38,326,525.11
结算备付金		4,584,070.63	7,294,122.11
存出保证金		316,667.63	279,572.88
交易性金融资产	6.4.7.2	593,612,157.81	550,778,738.23
其中：股票投资		98,148,799.30	32,269,591.06
基金投资		-	-
债券投资		495,463,358.51	518,509,147.17
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,960,158.11	-
应收利息	6.4.7.5	5,761,121.85	7,563,034.21
应收股利		-	-
应收申购款		92,292.05	1,108,871.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		610,181,009.59	605,350,864.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		70,000,000.00	61,400,000.00
应付证券清算款		-	18,635,638.30

应付赎回款		720,784.41	12,493,288.42
应付管理人报酬		286,799.78	295,465.58
应付托管费		88,246.11	90,912.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	64,956.50	130,647.30
应交税费		2,761,412.36	2,759,979.68
应付利息		15,863.52	6,387.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	448,481.88	349,226.56
负债合计		74,386,544.56	96,161,545.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	487,852,316.25	483,231,631.66
未分配利润	6.4.7.10	47,942,148.78	25,957,686.63
所有者权益合计		535,794,465.03	509,189,318.29
负债和所有者权益总计		610,181,009.59	605,350,864.00

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.098 元，基金份额总额为 487,852,316.25 份。

6.2 利润表

会计主体：银华增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		24,953,701.85	849,105.00
1.利息收入		9,360,995.88	15,508,735.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	105,597.20	168,435.60
债券利息收入		9,255,398.68	15,340,300.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,861,362.46	-11,887,563.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-525,003.55	-13,259,287.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,015,320.10	843,959.12
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	371,045.91	527,764.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	6,693,323.29	-2,846,358.65

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	38,020.22	74,290.87
减：二、费用		3,351,947.36	6,578,683.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,649,688.16	3,624,805.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	507,596.39	1,115,324.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	156,420.29	965,867.32
5. 利息支出		818,450.82	658,439.15
其中：卖出回购金融资产支出		818,450.82	658,439.15
6. 其他费用	6.4.7.19	219,791.70	214,246.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,601,754.49	-5,729,578.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,601,754.49	-5,729,578.67

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）	483,231,631.66	25,957,686.63	509,189,318.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,601,754.49	21,601,754.49
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）	4,620,684.59	382,707.66	5,003,392.25
其中：1. 基金申购款	223,265,388.55	16,319,364.76	239,584,753.31
2. 基金赎回款	-218,644,703.96	-15,936,657.10	-234,581,361.06
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）	487,852,316.25	47,942,148.78	535,794,465.03

项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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)	1,077,853,726.19	122,191,340.96	1,200,045,067.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,729,578.67	-5,729,578.67
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)	-99,315,604.73	-669,131.96	-99,984,736.69
其中：1.基金申购款	266,429,250.05	22,537,607.69	288,966,857.74
2.基金赎回款	-365,744,854.78	-23,206,739.65	-388,951,594.43
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)	-	-69,294,105.00	-69,294,105.00
五、期末所有者权益(基金净值)	978,538,121.46	46,498,525.33	1,025,036,646.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

杨清

龚飒

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华增强收益债券型证券投资基金（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[2008]1157号文《关于核准银华增强收益债券型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2008年10月30日至2008年11月28日向社会公开募集，基金合同于2008年12月3日生效。首次设立募集规模为2,466,876,891.58份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为银华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资对象是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。本基金主要投资于国债、金融债券、

企业债券、公司债券、中央银行票据、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、短期融资券、资产支持证券等固定收益类金融工具。本基金对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，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%。本基金还可投资于股票、权证等权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《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 3 号《半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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更的说明。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

(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、国家税务总局财税字[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。

(2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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[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。

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[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》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	3,854,541.51
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,854,541.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	97,961,157.32	98,148,799.30	187,641.98	
债券	交易所市场	301,460,280.92	311,177,358.51	9,717,077.59
	银行间市场	182,372,380.13	184,286,000.00	1,913,619.87
	合计	483,832,661.05	495,463,358.51	11,630,697.46
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	581,793,818.37	593,612,157.81	11,818,339.44	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金于本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
----	------------------------

应收活期存款利息	1,179.95
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,062.80
应收债券利息	5,757,878.73
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.37
其他	-
合计	5,761,121.85

6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	62,356.50
银行间市场应付交易费用	2,600.00
合计	64,956.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	41.46
预提账户维护费	4,500.00
预提审计费	44,753.80
预提信息披露费	149,178.12
应付其他	8.50
合计	448,481.88

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	483,231,631.66	483,231,631.66
本期申购	223,265,388.55	223,265,388.55
本期赎回(以“-”号填列)	-218,644,703.96	-218,644,703.96
本期末	487,852,316.25	487,852,316.25

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,639,108.42	30,596,795.05	25,957,686.63
本期利润	14,908,431.20	6,693,323.29	21,601,754.49
本期基金份额交易产生的变动数	216,842.25	165,865.41	382,707.66
其中：基金申购款	139,023.43	16,180,341.33	16,319,364.76
基金赎回款	77,818.82	-16,014,475.92	-15,936,657.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,486,165.03	37,455,983.75	47,942,148.78

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	66,330.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	33,844.98
其他	5,421.97
合计	105,597.20

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	25,918,451.50
减：卖出股票成本总额	26,443,455.05
买卖股票差价收入	-525,003.55

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	616,664,266.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	597,315,931.98
减：应收利息总额	10,333,014.48
债券投资收益	9,015,320.10

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金于本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	371,045.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	371,045.91

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	6,693,323.29
——股票投资	2,793,521.17
——债券投资	3,899,802.12
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	6,693,323.29

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	37,360.35
转换费收入	659.87

合计	38,020.22
----	-----------

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	152,945.29
银行间市场交易费用	3,475.00
合计	156,420.29

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	149,178.12
债券帐户维护费	13,500.00
银行费用	12,359.78
合计	219,791.70

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

2012 年 3 月 23 日，本基金管理人发布公告，经本基金管理人股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批准，西南证券股份有限公司受让山西海鑫实业股份有限公司持有的本基金管理人 20%的股权。本股权转让完成后，西南证券股份有限公司对本基金管理人的出资比例由 29%变更为 49%，山西海鑫实业股份有限公司对本基金管理人的出资比例相应地由 21%变更为 1%。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
东北证券	4,859,186.03	4.21%	114,771,223.70	20.78%
第一创业	3,733,885.87	3.24%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	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	5,279,078.70	0.96%	-	-
第一创业	49,633,591.80	8.98%	10,929,057.00	2.19%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	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
西南证券	75,000,000.00	1.80%	-	-
第一创业	671,000,000.00	16.07%	-	-

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券	3,948.14	4.06%	-	-
西南证券	-	-	-	-
第一创业	3,206.74	3.30%	3,206.74	5.14%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券	93,252.35	20.17%	1,229.09	0.76%
第一创业	-	-	-	-

注：(1) 上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于经手费、证管费和证券结算风险基金等）。

(2) 该类佣金协议的范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,649,688.16
其中：支付销售机构的客户维护费	113,282.77	456,479.15

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.65% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.65\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从

基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	507,596.39	1,115,324.84

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未持有本基金份额。

6.4.10.4.2 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：本基金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。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	3,854,541.51	66,330.25	44,116,972.90	123,534.84

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金未因认购新发/增发而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 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股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 70,000,000.00 元，于 2012 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不

超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,854,541.51	-	-	-	-	-	3,854,541.51
结算备付金	4,584,070.63	-	-	-	-	-	4,584,070.63
存出保证金	-	-	-	-	-	316,667.63	316,667.63
交易性金融资产	2,844,733.18	10,684,650.00	91,164,463.60	253,587,511.73	137,182,000.00	98,148,799.30	593,612,157.81
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,960,158.11	1,960,158.11
应收利息	-	-	-	-	-	5,761,121.85	5,761,121.85
应收申购款	99.41	-	-	-	-	92,192.64	92,292.05
资产总计	11,283,444.73	10,684,650.00	91,164,463.60	253,587,511.73	137,182,000.00	106,278,939.53	610,181,009.59
负债							
卖出回购金融资产款	70,000,000.00	-	-	-	-	-	70,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	720,784.41	720,784.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	286,799.78	286,799.78
应付托管费	-	-	-	-	-	88,246.11	88,246.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	64,956.50	64,956.50
应付利息	-	-	-	-	-	15,863.52	15,863.52
应交税费	-	-	-	-	-	2,761,412.36	2,761,412.36
其他负债	-	-	-	-	-	448,481.88	448,481.88
负债总计	70,000,000.00	-	-	-	-	4,386,544.56	74,386,544.56
利率敏感度缺口	-58,716,555.27	10,684,650.00	91,164,463.60	253,587,511.73	137,182,000.00	101,892,394.97	535,794,465.03
上年度末	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

2011 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	38,326,525.11	-	-	-	-	-	38,326,525.11
结算备付金	7,294,122.11	-	-	-	-	-	7,294,122.11
存出保证金	-	-	-	-	-	279,572.88	279,572.88
交易性金融资产	90,981,000.00	-	28,209,250.50	316,507,850.77	82,811,045.90	32,269,591.06	550,778,738.23
应收利息	-	-	-	-	-	7,563,034.21	7,563,034.21
应收申购款	-	-	-	-	-	1,108,871.46	1,108,871.46
资产总计	136,601,647.22	-	28,209,250.50	316,507,850.77	82,811,045.90	41,221,069.61	605,350,864.00
负债							
卖出回购金融资产款	61,400,000.00	-	-	-	-	-	61,400,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	18,635,638.30	18,635,638.30
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,493,288.42	12,493,288.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	295,465.58	295,465.58
应付托管费	-	-	-	-	-	90,912.51	90,912.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	130,647.30	130,647.30
应交税费	-	-	-	-	-	2,759,979.68	2,759,979.68
应付利息	-	-	-	-	-	6,387.36	6,387.36
其他负债	-	-	-	-	-	349,226.56	349,226.56
负债总计	61,400,000.00	-	-	-	-	34,761,545.71	96,161,545.71
利率敏感度缺口	75,201,647.22	-	28,209,250.50	316,507,850.77	82,811,045.90	6,459,523.90	509,189,318.29

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	+25 个基准点	-3,105,910.01	-1,963,797.49
	-25 个基准点	3,105,910.01	1,963,797.49

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资对象是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。本基金主要投资于国债、金融债券、企业债券、公司债券、中央银行票据、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、短期融资券、资产支持证券等固定收益类金融工具。本基金对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，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%。本基金还可投资于股票、权证等权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。于 2012 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）

		(%)		
交易性金融资产-股票投资	98,148,799.30	18.32	32,269,591.06	6.34
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	495,463,358.51	92.47	518,509,147.17	101.83
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	593,612,157.81	110.79	550,778,738.23	108.17

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2012 年 6 月 30 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	+5%	6,032,898.72	12,048,479.45
	-5%	-6,032,898.72	-12,048,479.45

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	98,148,799.30	16.09
	其中：股票	98,148,799.30	16.09
2	固定收益投资	495,463,358.51	81.20
	其中：债券	495,463,358.51	81.20
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	8,438,612.14	1.38
6	其他各项资产	8,130,239.64	1.33
7	合计	610,181,009.59	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,069,800.00	0.20
B	采掘业	-	-
C	制造业	8,965,876.00	1.67
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	925,100.00	0.17
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	4,956,776.00	0.93
C8	医药、生物制品	3,084,000.00	0.58
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,681,000.00	1.06
F	交通运输、仓储业	21,691,857.00	4.05
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	53,890,382.30	10.06
J	房地产业	3,264,660.00	0.61
K	社会服务业	3,585,224.00	0.67
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	98,148,799.30	18.32

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	432,950	19,803,133.00	3.70

2	601006	大秦铁路	2,719,500	19,118,085.00	3.57
3	601601	中国太保	684,932	15,191,791.76	2.84
4	601628	中国人寿	604,911	11,069,871.30	2.07
5	601336	新华保险	228,551	7,825,586.24	1.46
6	601669	中国水电	1,300,000	5,681,000.00	1.06
7	002638	勤上光电	313,720	4,956,776.00	0.93
8	000826	桑德环境	156,560	3,585,224.00	0.67
9	600518	康美药业	200,000	3,084,000.00	0.58
10	600256	广汇股份	204,000	2,747,880.00	0.51
11	601000	唐山港	196,050	1,301,772.00	0.24
12	600125	铁龙物流	150,000	1,272,000.00	0.24
13	000998	隆平高科	60,000	1,069,800.00	0.20
14	002243	通产丽星	110,000	925,100.00	0.17
15	000002	万科A	58,000	516,780.00	0.10

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601318	中国平安	18,033,065.50	3.54
2	601601	中国太保	14,759,394.06	2.90
3	601628	中国人寿	10,953,864.27	2.15
4	601336	新华保险	7,249,129.44	1.42
5	601669	中国水电	5,849,992.00	1.15
6	600518	康美药业	5,027,716.66	0.99
7	002638	勤上光电	4,915,611.00	0.97
8	000157	中联重科	3,246,364.30	0.64
9	000826	桑德环境	3,176,963.05	0.62
10	600256	广汇股份	3,130,351.54	0.61
11	002123	荣信股份	2,302,376.31	0.45
12	600125	铁龙物流	1,895,534.33	0.37
13	000002	万科A	1,309,434.00	0.26
14	601000	唐山港	1,244,080.00	0.24
15	000423	东阿阿胶	1,020,538.00	0.20
16	000998	隆平高科	1,000,977.00	0.20

17	002243	通产丽星	943,289.85	0.19
18	002353	杰瑞股份	704,982.00	0.14
19	600418	江淮汽车	675,355.81	0.13
20	600809	山西汾酒	621,322.50	0.12

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。

7.4.2 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	600028	中国石化	7,236,014.42	1.42
2	000157	中联重科	3,215,175.14	0.63
3	601100	恒立油缸	2,890,986.98	0.57
4	601336	新华保险	2,347,600.17	0.46
5	600518	康美药业	2,329,473.15	0.46
6	002123	荣信股份	1,854,338.50	0.36
7	000423	东阿阿胶	976,101.42	0.19
8	002353	杰瑞股份	852,861.05	0.17
9	000002	万科A	845,500.00	0.17
10	600418	江淮汽车	687,600.00	0.14
11	600809	山西汾酒	663,547.40	0.13
12	600031	三一重工	576,000.00	0.11
13	002146	荣盛发展	486,083.27	0.10
14	600125	铁龙物流	451,000.00	0.09
15	002340	格林美	439,250.00	0.09
16	601800	中国交建	29,200.00	0.01
17	002662	京威股份	22,230.00	0.00
18	300297	蓝盾股份	15,490.00	0.00

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。

7.4.3 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	89,529,142.12
卖出股票收入（成交）总额	25,918,451.50

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。

7.5 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	12,433,628.30	2.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	91,601,000.00	17.10
	其中：政策性金融债	91,601,000.00	17.10
4	企业债券	298,595,511.73	55.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,819,000.00	3.89
7	可转债	72,014,218.48	13.44
8	其他	-	-
9	合计	495,463,358.51	92.47

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	120220	12 国开 20	500,000	50,825,000.00	9.49
2	110015	石化转债	405,030	40,466,547.30	7.55
3	126018	08 江铜债	452,070	39,176,386.20	7.31
4	122923	10 北汽投	300,000	30,333,000.00	5.66
5	122068	11 海螺 01	221,200	22,675,212.00	4.23

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.9.3 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	316,667.63
2	应收证券清算款	1,960,158.11
3	应收股利	-
4	应收利息	5,761,121.85
5	应收申购款	92,292.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,130,239.64

7.9.4 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	110015	石化转债	40,466,547.30	7.55
2	110018	国电转债	10,684,650.00	1.99
3	110013	国投转债	4,835,700.00	0.90
4	129031	巨轮转 2	2,844,733.18	0.53

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
11,693	41,721.74	179,226,711.85	36.74%	308,625,604.40	63.26%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	9,390.36	0.00%

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008 年 12 月 3 日）基金份额总额	2,466,876,891.58
本报告期期初基金份额总额	483,231,631.66
本报告期基金总申购份额	223,265,388.55
减：本报告期基金总赎回份额	218,644,703.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	487,852,316.25

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

10.2.1.1 2012 年 2 月 16 日，本基金管理人发布关于公司高级管理人员变更的公告，经本基金管理人董事会批准，彭越先生自 2012 年 2 月 14 日起不再担任本基金管理人公司董事长职务，本基金管理人聘任王珠林先生为公司董事长，同时在中国证监会核准王珠林先生的任职资格和任职事项前，本基金管理人董事会决定由公司董事、总经理王立新先生代为履行董事长职责；

10.2.1.2 2012 年 2 月 23 日，本基金管理人发布关于公司董事变更的公告，经本基金管理人股东会审议通过，增选钱龙海先生、周晓冬先生以及高歌女士为公司董事，其中高歌女士为公司独立董事，彭越先生、李兆会先生以及汪贻祥先生不再担任公司董事职务；

10.2.1.3 2012 年 7 月 20 日，本基金管理人发布公告，本基金管理人拟任董事长王珠林先生高管任职资格已经中国证监会核准，王珠林先生自 2012 年 7 月 18 日起担任本基金管理人董事长职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
江海证券有限公司	2	45,279,506.67	39.24%	38,487.89	39.58%	新增 2 个交易单元
红塔证券股份有限公司	2	14,334,345.26	12.42%	12,184.36	12.53%	-
光大证券股份有限公司	2	9,502,067.27	8.23%	7,720.52	7.94%	-
中国银河证券股份有限公司	1	7,517,996.42	6.52%	6,390.36	6.57%	-
东方证券股份有限公司	2	6,386,431.60	5.53%	5,189.04	5.34%	-
东北证券股份有限公司	3	4,859,186.03	4.21%	3,948.14	4.06%	-
中国中投证券	1	4,393,956.12	3.81%	3,734.91	3.84%	-

有限责任公司							
第一创业证券股份有限公司	2	3,733,885.87	3.24%	3,206.74	3.30%	-	
西部证券股份有限公司	1	3,631,049.34	3.15%	3,170.05	3.26%	-	
中信证券股份有限公司	3	3,459,456.19	3.00%	2,810.86	2.89%	-	
长城证券有限责任公司	2	2,713,236.30	2.35%	2,204.49	2.27%	-	
国金证券股份有限公司	2	2,543,298.00	2.20%	2,220.32	2.28%	-	
中国国际金融有限公司	2	2,210,277.54	1.92%	1,878.64	1.93%	-	
齐鲁证券有限公司	1	1,779,855.81	1.54%	1,512.83	1.56%	-	
华泰联合证券有限责任公司	2	1,730,657.20	1.50%	1,470.93	1.51%	-	
民生证券有限责任公司	2	1,317,388.00	1.14%	1,116.52	1.15%	新增 2 个交易单元	
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-	
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	
首创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-	
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-	
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-	新增 1 个交

有限公司						易单元
兴业证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	3	-	-	-	-	-
上海证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信万通证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东莞证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-

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等。

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。

10.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
江海证券有限公司	67,945,181.46	12.30%	479,500,000.00	11.48%	-	-
红塔证券股份有限公司	8,101,545.57	1.47%	335,000,000.00	8.02%	-	-
光大证券股份有限公司	20,444,109.95	3.70%	135,000,000.00	3.23%	-	-
中国银河证券股份有限公司	53,701,737.15	9.72%	627,000,000.00	15.02%	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	51,115,348.12	9.25%	705,000,000.00	16.88%	-	-
第一创业证券股份有限公司	49,633,591.80	8.98%	671,000,000.00	16.07%	-	-
西部证券股份有限公司	21,486,909.30	3.89%	260,000,000.00	6.23%	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	32,168,227.46	5.82%	63,000,000.00	1.51%	-	-
中国国际金融有限公司	20,144,217.73	3.65%	301,000,000.00	7.21%	-	-
齐鲁证券有限公司	5,690,672.29	1.03%	58,100,000.00	1.39%	-	-
华泰联合证券有限责任公司	200,258.35	0.04%	75,000,000.00	1.80%	-	-
民生证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	5,279,078.70	0.96%	75,000,000.00	1.80%	-	-

中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	7,084,933.63	1.28%	340,000,000.00	8.14%	-	-
山西证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券 股份有限公司	176,913,920.24	32.02%	-	-	-	-
新时代证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	-	-	51,000,000.00	1.22%	-	-
首创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	684,846.24	0.12%	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
国都证券有限 责任公司	53,348.20	0.01%	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-

北京高华证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信万通证券 有限责任公司	31,883,199.40	5.77%	-	-	-	-
东莞证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序 号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购业务费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012年6月29日
2	《银华基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012年6月29日
3	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华融证券网上申购业务费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012年5月30日
4	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券开通定期定额投资业务的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012年5月21日
5	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加重庆银行网上申购业务费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012年5月21日
6	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012年5月12日
7	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在东吴证券开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012年5月9日
8	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在包商银行	三大证券报及本	2012年5月8日

	《开通定期定额投资业务的公告》	基金管理人网站	
9	《银华基金管理有限公司关于增加包商银行为旗下部分基金代销及转换业务办理机构的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 26 日
10	《银华增强收益债券型证券投资基金 2012 年第 1 季度报告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 24 日
11	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易等系统服务的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 19 日
12	《银华基金管理有限公司关于开通“易购通”基金网上直销第三方支付业务的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 18 日
13	《关于增加红塔证券为银华旗下部分基金的代销及转换业务办理机构的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 12 日
14	《银华基金管理有限公司关于增加大通证券为旗下部分基金代销及转换业务办理机构的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 11 日
15	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 6 日
16	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 6 日
17	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易等系统服务的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 3 月 30 日
18	《银华增强收益债券型证券投资基金 2011 年年度报告及摘要》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 3 月 27 日
19	《银华基金管理有限公司关于公司股东出资比例变更的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 3 月 23 日
20	《银华基金管理有限公司关于调整中国农业银行借记卡网上直销申购费率的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 29 日
21	《银华基金管理有限公司关于董事变更的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 23 日
22	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 16 日

23	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在齐鲁证券开通转换业务的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 10 日
24	《银华增强收益债券型证券投资基金 2011 年第 4 季度报告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 20 日
25	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 19 日
26	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 18 日
27	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在中航证券开通转换业务的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 17 日
28	《银华增强收益债券型证券投资基金更新招募说明书及摘要(2012 年第 1 号)》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 17 日
29	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在西南证券开通转换业务的公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 10 日
30	《银华基金管理有限公司 2011 年 12 月 31 日基金净值公告》	三大证券报及本 基金管理人网站	2012 年 1 月 4 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

<p>11.1 本基金管理人无影响投资者决策的其他重要信息</p> <p>11.2 本基金托管人影响投资者决策的其他重要信息披露如下： 2012 年 1 月 16 日，本基金托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任中国建设银行股份有限公司董事长、执行董事。</p>
--

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准银华增强收益债券型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

- 12.1.3 《银华增强收益债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华增强收益债券型证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理有限公司
2012 年 8 月 24 日