

银华增强收益债券型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	196,510,610.90 份
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	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类属配置，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。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%。
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，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。
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	5,856,637.98
2. 本期利润	4,680,051.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0205
4. 期末基金资产净值	225,933,451.48
5. 期末基金份额净值	1.150

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、本报告中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。

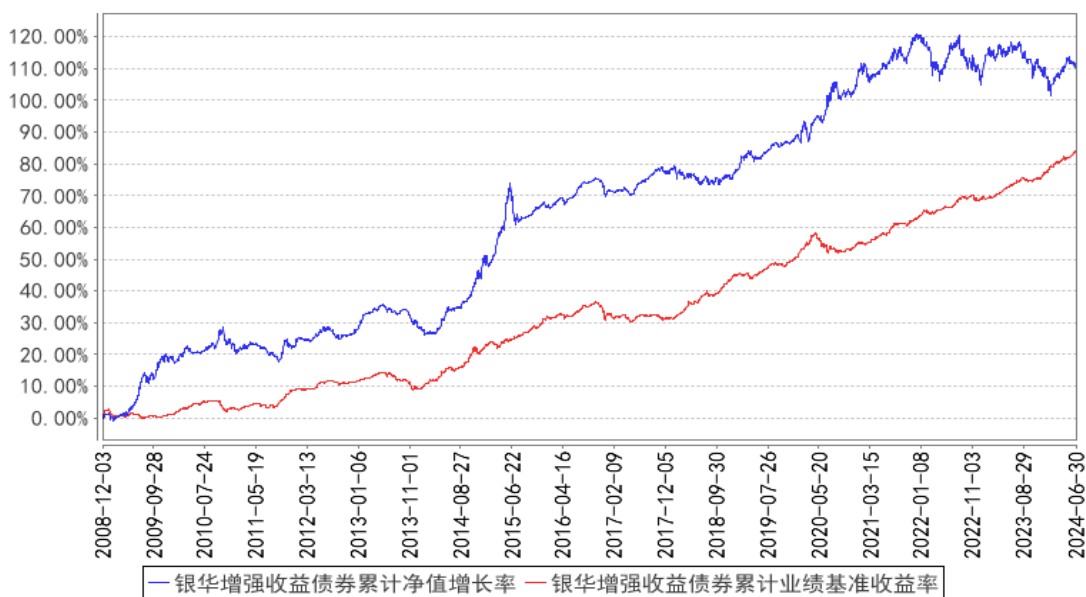
3.2 基金净值表现

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	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	1.59%	0.24%	1.75%	0.09%	-0.16%	0.15%
过去六个月	0.70%	0.31%	3.83%	0.09%	-3.13%	0.22%
过去一年	-2.21%	0.30%	5.99%	0.08%	-8.20%	0.22%
过去三年	-0.17%	0.32%	16.31%	0.08%	-16.48%	0.24%
过去五年	15.69%	0.30%	25.84%	0.10%	-10.15%	0.20%
自基金合同 生效起至今	111.61%	0.27%	84.04%	0.11%	27.57%	0.16%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

银华增强收益债券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：按基金合同的规定，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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资于股票、存托凭证、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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾鹏先生	本基金的基金经理	2020年2月19日	-	15.5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日至2017年8月7日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自2014年8月27日至2016年12月22日兼任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自2014年9月12日至2020年3月16日兼任银华保本增值证券投资基金基金经理，自2020年3月17

					日至 2020 年 5 月 21 日兼任银华增值证券投资基金基金经理，自 2014 年 12 月 31 日至 2016 年 12 月 22 日兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 1 日至 2017 年 7 月 5 日兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 5 月 19 日起兼任银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 8 月 8 日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 14 日起兼任银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 1 月 29 日至 2021 年 7 月 30 日兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 6 日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 2 月 19 日起兼任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 10 日起兼任银华多元机遇混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 8 日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月 15 日起兼任银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
冯帆女士	本基金的基金经理	2020 年 12 月 29 日	-	10 年	硕士学位。曾就职于华夏未来资本管理有限公司，2015 年 8 月加入银华基金，历任投资管理三部宏观利率研究员、基金经理助理，现任养老金投资管理部基金经理。自 2020 年 12 月 29 日起担任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理。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。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去一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。

4.3.2 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，原因是量化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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2 季度，经济基本面边际有所放缓，但总体仍保持在政策合意区间。结构上，供需裂口较前期有所收敛，且存在出口链条、设备更新改造等亮点。货币流动性方面，2 季度呈现资金面分层阶段性弱化、央行流动性投放适度均衡的特征。权益市场在 2 季度围绕政策预期与经济现实展开博弈，总体经历了较大波动。分行业看，市场保持分化格局：红利风格占优，大金融、家电、公用事业、煤炭等超额收益明显，科技方向也有主题反弹，消费和地产方向则相对偏弱。债券市场在 2 季度延续上涨行情，基本面磨底下机构普遍存在配置压力。不过，随着收益率快速下行至低位，债券市场波动性有所放大。转债市场总体跟随权益节奏，几度出现品种层面的明显调整。

操作上，我们总体保持了均衡的配置。股票方面，根据市场情况进行了一些结构调整。考虑到消费整体的修复力度仍然较弱，我们适当降低了消费和医药的持仓，增加了低估值红利资产的配置。在科技方向继续做高低切换，小幅兑现了一些弹性标的，增加了一些低位行业的配置，如电子、军工等。债券方面，结合整体组合的风险收益特征，保持一定久期下，结构上积极进行了利差轮动操作，充分挖掘曲线结构上的定价机会。在转债的投资上，操作重点在于以精选结构的优势来对抗资产整体负凸性的劣势，并在比价优势明显时进行大类资产间的阶段性切换。

展望 3 季度，我们将继续在把握投资组合风险收益特征的前提下，积极寻找机会。基本面层面，地产政策的调整与发力，财政发债与开工节奏的加快，均有利于宏观预期的边际改善；流动

性层面，美国通胀与降息交易在波折中推进，短期内再度处于通胀降温与流动性改善窗口，同时国内在呵护经济的诉求下，总量宽松政策也有望逐步落地。当然，对于权益资产而言，高度与持续性最终仍然需要看到政策到盈利端的兑现。在此之前，交易节奏以及其他风险因子的扰动仍然不可避免。对于纯债资产，机构欠配的现实压力下，市场倾向于更多交易现实而非预期。不过，接下来低利率、低利差、高波动也将逐步成为市场新格局。操作上回归中性，以利差轮动与骑乘策略为主。转债继续保持适度积极的操作，核心是机会成本角度进行多资产比价。不过在这过程中，择券依然重要，转债组合需持续保持在风险收益比占优的凸性状态。

具体到权益资产方面，市场重回低位后，我们对中期机会保持乐观，当前时点耐心更加重要。向后展望，7月国内有重要会议召开，届时政策脉络进一步明朗，有利于风险偏好的提升。结构上看，考虑到7-8月市场逐渐迎来业绩披露期，处于行业周期拐点或者业绩景气确定性高的板块有望出现行情催化。

科技方向：展望3季度，分母端的制约因素仍然存在，因此分子端是影响股价更重要的因素，重点关注接下来的中报和三季度报。横向比较科技制造大板块的不同方向，我们重点关注以下几个方面：（1）首要关注业绩好的方向，对应海外算力、电子。（2）其次适当关注科技内部的困境反转方向，以景气度触底和股价位置偏低为主要标准，我们判断军工行业、以及设备更新改造方向（比如电力设备、工程机械等）、汽车锂电行业、储能都可能存在上行修复催化，中报落地前后，行业贝塔可能逐步由弱转强，不过，这些行业的选股更重要。

消费方向：短期看收入预期走弱仍是压制居民消费力的主要因素，当前的股价也基本反应了较差的基本面。中期看，结构变化仍是我们持续关注的重点，寻找更高质价比已经成为最重要的趋势，一些具有强供应链能力和产品开发能力的公司有望通过份额提升开启新一轮的成长，关注出口制造、黄金珠宝、啤酒、餐饮、两轮车等细分领域龙头。另外生猪养殖板块经过连续的产能去化后，当前已经进入基本面右侧阶段，未来随着猪价上涨，板块有望获得超额收益。对于医药，板块上半年表现低于预期。认为行业当下处于底部区域：一方面，下半年随着基数的回落，政策对基本面的影响会边际减弱，同比数据有望逐步修复。另一方面，医药行业的成长性依然很好，老龄化带来需求高景气度，同时创新出海也开辟了新的市场空间，这都给行业带来更多机会。因此我们仍然维持一定的配置比例。

低估值方向：从中长期角度看，宏观经济仍旧在转型阶段，当前低利率环境大概率还要延续，在“安全”和“防御”为主的投资风格影响下，红利策略仍然具备长期的配置价值。如有回调可关注银行、交运、石油石化等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.150 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.59%，业绩比较基准收益率为 1.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 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	35,460,859.13	11.27
	其中：股票	35,460,859.13	11.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	269,386,139.18	85.61
	其中：债券	269,386,139.18	85.61
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,442,236.46	3.00
8	其他资产	373,430.67	0.12
9	合计	314,662,665.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,503,855.00	1.55
C	制造业	18,133,063.71	8.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,389,584.00	1.06
E	建筑业	412,705.00	0.18
F	批发和零售业	76,052.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,319,974.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,099,263.92	0.49

J	金融业	4,718,321.50	2.09
K	房地产业	1,014,132.00	0.45
L	租赁和商务服务业	175,122.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	101,905.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	259,909.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,256,972.00	0.56
S	综合	-	-
	合计	35,460,859.13	15.70

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 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

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600373	中文传媒	71,300	1,058,092.00	0.47
2	600036	招商银行	28,300	967,577.00	0.43
3	600938	中国海油	28,200	930,600.00	0.41
4	600900	长江电力	31,600	913,872.00	0.40
5	601899	紫金矿业	45,400	797,678.00	0.35
6	600487	亨通光电	44,832	707,000.64	0.31
7	600012	皖通高速	48,000	670,560.00	0.30
8	601658	邮储银行	123,800	627,666.00	0.28
9	300750	宁德时代	3,340	601,300.20	0.27
10	300677	英科医疗	22,200	595,182.00	0.26

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,027,695.15	5.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	136,700,365.32	60.50
	其中：政策性金融债	43,537,112.55	19.27
4	企业债券	20,539,104.12	9.09
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,307,627.13	18.28
7	可转债（可交换债）	58,811,347.46	26.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	269,386,139.18	119.23

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	09230220	23 国开清发 20	200,000	22,381,918.03	9.91
2	019733	24 国债 02	119,000	12,027,695.15	5.32
3	102101296	21 宿迁城投 MTN003	100,000	10,615,214.21	4.70
4	2120110	21 北京银行永续 债 02	100,000	10,604,708.20	4.69
5	200205	20 国开 05	100,000	10,588,043.84	4.69

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资
明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.9.1 本期国债期货投资政策**

本基金在本报告期末投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注**5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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**

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	33,952.37
2	应收证券清算款	338,562.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	915.42
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	373,430.67

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	2,483,595.55	1.10
2	113042	上银转债	2,347,357.92	1.04
3	110067	华安转债	2,292,611.63	1.01
4	113037	紫银转债	2,065,398.30	0.91
5	127045	牧原转债	2,048,627.12	0.91
6	113056	重银转债	1,503,244.21	0.67
7	113043	财通转债	1,500,591.58	0.66
8	110073	国投转债	1,419,022.09	0.63
9	113045	环旭转债	1,217,587.95	0.54
10	127067	恒逸转 2	1,195,959.10	0.53
11	127016	鲁泰转债	1,055,559.45	0.47
12	118024	冠宇转债	1,034,036.96	0.46
13	113579	健友转债	1,029,609.13	0.46
14	113641	华友转债	1,001,479.43	0.44
15	123108	乐普转 2	997,647.62	0.44
16	113065	齐鲁转债	951,880.10	0.42
17	113049	长汽转债	942,531.51	0.42
18	127035	濮耐转债	940,590.35	0.42
19	113021	中信转债	880,241.99	0.39
20	110089	兴发转债	875,432.73	0.39
21	123224	宇邦转债	803,086.56	0.36
22	123212	立中转债	793,144.60	0.35
23	113616	韦尔转债	773,528.03	0.34
24	113545	金能转债	753,670.76	0.33
25	113615	金诚转债	745,927.06	0.33
26	110048	福能转债	745,426.49	0.33

27	113059	福莱转债	726,321.97	0.32
28	113666	爱玛转债	699,618.58	0.31
29	127066	科利转债	699,281.83	0.31
30	127041	弘亚转债	698,147.70	0.31
31	127038	国微转债	694,032.57	0.31
32	113673	岱美转债	674,158.58	0.30
33	111017	蓝天转债	672,455.91	0.30
34	113047	旗滨转债	619,533.34	0.27
35	118034	晶能转债	617,954.37	0.27
36	123133	佩蒂转债	611,322.59	0.27
37	113050	南银转债	605,740.36	0.27
38	118028	会通转债	589,064.70	0.26
39	111010	立昂转债	562,208.47	0.25
40	127073	天赐转债	560,739.73	0.25
41	110062	烽火转债	558,136.58	0.25
42	118012	微芯转债	497,308.85	0.22
43	113064	东材转债	494,774.58	0.22
44	123188	水羊转债	493,947.87	0.22
45	118037	上声转债	487,923.55	0.22
46	118013	道通转债	487,643.94	0.22
47	123211	阳谷转债	483,990.19	0.21
48	110068	龙净转债	482,726.07	0.21
49	127085	韵达转债	478,939.41	0.21
50	123114	三角转债	473,204.73	0.21
51	127078	优彩转债	455,375.73	0.20
52	118043	福立转债	454,965.21	0.20
53	123178	花园转债	454,339.46	0.20
54	113648	巨星转债	450,481.10	0.20
55	110082	宏发转债	450,228.29	0.20
56	123221	力诺转债	447,300.87	0.20
57	123213	天源转债	440,573.04	0.20
58	113623	凤 21 转债	438,415.42	0.19
59	113627	太平转债	436,357.63	0.19
60	123101	拓斯转债	428,565.35	0.19
61	123170	南电转债	422,406.60	0.19
62	123191	智尚转债	416,374.18	0.18
63	127101	豪鹏转债	404,958.96	0.18
64	127056	中特转债	395,805.54	0.18
65	127051	博杰转债	387,678.97	0.17
66	123228	震裕转债	372,917.02	0.17
67	113069	博 23 转债	365,764.21	0.16
68	113671	武进转债	345,271.55	0.15

69	118046	诺泰转债	333,102.23	0.15
70	127084	柳工转 2	328,610.15	0.15
71	127099	盛航转债	297,555.95	0.13
72	110077	洪城转债	288,756.29	0.13
73	127090	兴瑞转债	272,691.72	0.12
74	113637	华翔转债	265,072.30	0.12
75	113662	豪能转债	255,716.29	0.11
76	113674	华设转债	253,296.39	0.11
77	113678	中贝转债	252,162.22	0.11
78	113039	嘉泽转债	235,419.86	0.10
79	113658	密卫转债	227,813.90	0.10
80	110085	通 22 转债	217,880.05	0.10
81	113582	火炬转债	207,555.01	0.09
82	113669	景 23 转债	117,770.53	0.05
83	110083	苏租转债	113,635.41	0.05
84	111003	聚合转债	113,208.19	0.05
85	128087	孚日转债	111,785.53	0.05
86	118009	华锐转债	110,998.30	0.05
87	127074	麦米转 2	107,915.42	0.05

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	253,965,343.70
报告期期间基金总申购份额	534,449.28
减：报告期期间基金总赎回份额	57,989,182.08
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	196,510,610.90

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会核准银华增强收益债券型证券投资基金募集的文件
- 9.1.2 《银华增强收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 9.1.3 《银华增强收益债券型证券投资基金基金合同》
- 9.1.4 《银华增强收益债券型证券投资基金托管协议》
- 9.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 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。

9.3 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。

银华基金管理股份有限公司

2024 年 7 月 18 日