

银华中证转债指数增强分级证券投资基金之  
转债 A 份额和转债 B 份额上市交易公告书  
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  
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所  
上市时间：2013 年 8 月 28 日  
公告日期：2013 年 8 月 23 日

## 目 录

一、重要声明与提示	1
二、基金概览	2
三、基金份额的募集与上市交易	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况	9
五、基金主要当事人简介	11
六、基金合同摘要	19
七、基金财务状况	38
八、基金投资组合	40
九、重大事件揭示	43
十、基金管理人承诺	44
十一、基金托管人承诺	45
十二、基金上市推荐人意见	46
十三、备查文件目录	46

### 一、重要声明与提示

《银华中证转债指数增强分级证券投资基金之转债 A 份额和转债 B 份额上市交易公告书》(以下简称“本公告书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,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”)管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对银华中证转债指数增强分级证券投资基金之转债 A 与转债 B 基金份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在 2013 年 7 月 10 日《中国证券报》的《银华中证转债指数增强分级证券投资基金招募说明书》(以下简称招募说明书)。本基金招募说明书同时发布在本公司网站(www.yhfund.com.cn)。

### 二、基金概览

- 1、基金名称：银华中证转债指数增强分级证券投资基金
- 2、基金类型：债券型
- 3、基金运作方式：契约型开放式
- 4、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（简称“银华中证转债指数增强分级”，场内简称“银华转债”）、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（简称“转债 A”）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（简称“转债 B”）。其中，转债 A 份额、转债 B 份额的基金份额配比始终保持 7：3 的比例不变。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部基金份额将确认为银华转债份额；场内认购的全部基金份额按照 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 份额和转债 B 份额。

《基金合同》生效后，银华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 份额和转债 B 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。

7、银华转债的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对银华转债份额进行申购与赎回。银华转债份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司（深圳）开放式基金账户办理银华转债份额场外申购、赎回业务。银华转债份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理银华转债份额场内申购、赎回业务。转债 A 与转债 B 将不接受投资者的申购与赎回。

8、份额配对转换：份额配对转换是指本基金的银华转债份额与转债 A 份额、转债 B 份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每十份银华转债份额的场内份额申请转换成七份转债 A 份额与三份转债 B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每七份转债 A 份额与三份转债 B 份额申请转换成十份银华转债份额的场内份额的行为。份额配对转换业务将于 2013 年 8 月 28 日开始办理。

9、定期份额折算

在转债 A 份额、转债 B 份额存续期内的每个会计年度 12 月的第一个工作日，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金的转债 A 份额、银华转债份额进行定期份额折算。对于转债 A 份额期末的约定应得收益，即转债 A 份额每个会计年度 11 月 30 日份额净值超出本金 1.000 元部分，将折算为场内银华转债份额分配给转债 A 份额持有人。银华转债份额持有人持有的每 10 份银华转债份额将按 7 份转债 A 份额获得新增银华转债份额的分配。持有场外银华转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外银华转债份额的分配；持有场内银华转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内银华转债份额的分配。经过上述份额折算，转债 A 份额和银华转债份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

10、不定期份额折算

当银华转债份额的基金份额净值达到 1.500 元及以上，或当转债 B 份额的基金份额净值达到 0.450 元及以下时，基金管理人将根据《基金合同》的规定对本基金全部份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金转债 A 份额和转债 B 份额的份额数比例为 7：3，份额折算后银华转债份额、转债 A 份额和转债 B 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

11、基金份额总额：截至 2013 年 8 月 21 日，本基金的基金份额总额为 386,033,124.32 份，其中，银华转债为 271,573,511.32 份，转债 A 为 80,121,729 份，转债 B 为 34,337,884 份。

12、基金份额净值：截至 2013 年 8 月 21 日，银华转债的基金份额净值为 0.999 元，转债 A 的基金份额净值为 1.001 元，转债 B 的基金份额净值为 0.994 元。

13、本次上市交易的基金份额简称：转债 A、转债 B

14、本次上市交易的基金份额总额：转债 A 为 80,121,729 份；转债 B 为 34,337,884 份。

15、本次上市交易的基金份额交易代码：转债 A 为 150143；转债 B 为 150144

16、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

17、上市交易日期：2013年8月28日

18、基金管理人：银华基金管理有限公司

19、基金托管人：中国银行股份有限公司

20、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

### 三、基金份额的募集与上市交易

#### （一）上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2013]751号

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、本基金发售日期：2013年7月15日至2013年8月9日

5、发售价格：1.00元人民币

6、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构

#### （1）本基金场外认购的销售机构：

本基金通过场外发售的销售机构包括直销机构和代销机构。其中直销机构包括本公司北京直销中心以及本公司深圳直销中心。代销机构包括中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、江海证券有限公司、天相投资顾问有限公司、信达证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、东吴证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、厦门证券有限公司、华宝证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、五矿证券有限公司、长江证券股份有限公司、中航证券有限公司、爱建证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、英大证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、兴业证券股份有限公司、瑞银证券有限责任公司以及中原证券股份有限公司（以上排名不分先后）。

#### （2）本基金场内认购的销售机构：

本基金通过场内发售的机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单可在深交所网站查询。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额（不含利息）为人民币 385,916,230.01 元，确认份额（不含利息转份额）385,916,230.01 份，利息结转份额 116,894.31 份，总确认份额为

386,033,124.32份。

上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于2013年8月15日全额划入本基金托管人中国银行股份有限公司开立的托管专户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，按照每份基金份额1.00元计算，本基金募集期间含本息共募集386,033,124.32份基金份额，其中场外认购的基金份额为271,573,511.32份；场内认购的基金份额为114,459,613份。

#### 10、基金备案情况

本基金已于2013年8月15日验资完毕，当日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2013年8月15日获书面确认，本基金《基金合同》自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2013年8月15日

12、基金合同生效日的基金份额总额：386,033,124.32份

#### (二) 银华转债的日常申购、赎回情况

银华转债份额将于2013年8月28日开放日常申购、赎回，具体业务办理规则请投资者参阅2013年8月23日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《银华中证转债指数增强分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。

#### (三) 转债A与转债B上市交易的主要内容

1、本基金的转债A与转债B上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2013]280号

2、上市交易日期：2013年8月28日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、上市交易份额简称：转债A、转债B

5、交易代码：转债A为150143、转债B为150144

6、本次上市交易份额：转债A为80,121,729份、转债B为34,337,884份

7、基金资产净值的披露：用于基金信息披露的基金资产净值和银华转债、转债A与转债B的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的银华转债、转债A与转债B的基金份额净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的银华转债份额托管在场外，基金份额持有人将其办理跨系统转托管至场内（证券登记结算系统）后，选择将银华转债分拆为转债A与转债B后，方可上市流通。

(四) 份额配对转换业务安排：银华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定自2013年8月28日起，开通银华中证转债指数增强分级证券投资基金的份额配对转换业务，即银华转债与转债A、转债B之间的配对转换，包括“分拆”和“合并”两个方面。“合并”或“分拆”每笔申请的份额数必须是10的整数倍，投资者在业务办理机构提交的每笔申请份额不得低于10份。本公司可根据市场情况调整“合并”或“分拆”每笔申报份额的最低数量限制，并在调整生效前依照有关规定进行公告。

中国证券登记结算有限责任公司会对具备基金份额配对转换业务办理资格的证券公司名单进行更新，投资者可登陆中国证券登记结算有限责任公司网站(www.chinaclear.cn)查询最新名单，本公司对该名单的更新不再另行公告。

#### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

##### (一) 基金份额持有情况

截至2013年8月21日，银华转债份额持有人户数为2146户，平均每户持有的基金份额为126,548.70份；转债A为576户，平均每户持有的基金份额为139,100份；转债B为576户，

平均每户持有的基金份额为 59,614 份。

机构投资者持有的本次上市交易的转债 A 与转债 B 的基金份额分别为 25,424,930 份和 10,896,399 份,分别占本次转债 A 与转债 B 上市交易基金份额比例为 31.7329%和 31.7329%;个人投资者持有的本次上市交易的转债 A 与转债 B 的基金份额分别为 54,696,799 份和 23,441,485 份,分别占本次转债 A 与转债 B 上市交易基金份额比例为 68.2671%和 68.2671%。

## (二) 基金份额前十名持有人情况:

本次上市交易的转债 A、转债 B 前十名持有人情况

序号 持有人名称 持有转债 A 份额 占转债 A 份额比(%) 持有转债 B 份额 占转债 B 份额比(%)

1	山东省国际信托有限公司-以太 10 号证券投资集合资金信托	7,000,204	8.74	3,000,087	8.74
2	中信建投证券股份有限公司	5,600,163	6.99	2,400,070	6.99
3	中国银河证券股份有限公司	5,600,163	6.99	2,400,070	6.99
4	中信证券股份有限公司	3,500,102	4.37	1,500,043	4.37
5	殷苓莉	2,800,218	3.49	1,200,093	3.49
6	中纺流通(北京)商务咨询有限公司	2,100,251	2.62	900,108	2.62
7	杨智会	2,100,204	2.62	900,087	2.62
8	中原信达知识产权代理有限责任公司	1,400,041	1.75	600,017	1.75
9	黄振江	1,057,031	1.32	453,013	1.32
10	孙杰	840,024	1.05	360,010	1.05
合计		31,998,401	39.94	13,713,598	39.94

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因,占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

## 五、基金主要当事人简介

### (一) 基金管理人

#### 1、基本信息

名称:银华基金管理有限公司

法定代表人:王珠林

总经理:王立新

设立日期:2001年5月28日

注册资本:2亿元人民币

注册地址:广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层

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

设立批准文号:中国证监会证监基金字[2001]7 号

工商登记注册的法人营业执照文号:440301103790705

经营范围: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

存续期间:持续经营

股东及其出资比例:

持股单位 占总股本比例

西南证券股份有限公司 49%

第一创业证券有限责任公司 29%

东北证券股份有限公司 21%

山西海鑫实业股份有限公司 1%

合计 100%

联系人：刘晓雅

电话：010-85186558

传真：010-58163027

## 2、经营概况

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）设立的全国性基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。

截至2013年6月30日，基金管理人共管理三十一只基金，公募基金管理资产规模约726.03亿元。本基金管理人管理的三十一只证券投资基金如下：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、银华内需精选股票型证券投资基金（LOF）、银华消费主题分级股票型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、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、银华中证等权重90指数分级证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、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、银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金、银华增强收益债券型证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金（LOF）、银华信用双利债券型证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、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、银华货币市场证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）。此外，本基金管理人于2013年7月15日—8月2日发售了银华信用四季红债券型证券投资基金，该基金基金合同于2013年8月7日生效，实际募集规模为2.78亿元；本基金管理人于2013年7月15日—8月9日发售了本基金，本基金基金合同于2013年8月15日生效，实际募集规模为3.86亿元；

公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设“风险控制委员会”和“薪酬与提名委员会”2个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由4位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置投资管理部、量化投资部、研究部、市场营销部、高端客户部、国际合作与产品开发部、境外投资部、特定资产管理部、交易管理部、固定收益部、养老金业务部、运作保障部、信息技术部、公司办公室、人力资源部、行政财务部、深圳管理部、监察稽核部等18个职能部门，并设有北京分公司。此外，公司还设有A股基金投资决策委员会、境外投资决策委员会、特定资产投资决策委员会3个投资决策委员会，分别负责指导基金及其他投资组合的运作，确定基本的投资策略。

各部门主要职能如下：

投资管理部：根据A股基金投资决策委员会制定的原则进行投资。

量化投资部：基金的投资管理（包括指数基金、ETF及主动量化基金的管理）、数量化投资策略和模型研究与开发、量化产品的设计和创新、为其他部门提供金融工程支持。

研究部：负责宏观、策略、行业和公司研究。

市场营销部：负责营销策划、客户服务、市场推广、基金销售、销售渠道管理等工作。

高端客户部：特定客户资产管理业务（包括特定多个客户资产管理业务）产品营销、公募基金的高端客户直销、公司大客户服务、协助公司新业务的策划及营销等工作。

国际合作与产品开发部：负责开展对外合作及新产品的开发工作。

境外投资部：负责公司 QDII 产品的投资管理，并协助 QDII 产品的设计、发行等工作。

特定资产管理部：负责特定客户资产管理业务，包括特定多个客户资产管理业务；协助组织特定客户资产管理业务的产品设计和市场营销工作；企业年金基金投资管理；理财产品投资顾问；社保基金产品投资管理；QFII 投资顾问。

交易管理部：负责公司所有产品的交易管理工作。

固定收益部：负责固定收益产品的投资、研究。

养老金业务部：负责企业年金业务的市场开发、客户维护和产品推广；负责全国社保基金和地方社保基金等养老金业务的市场开发、客户维护和产品推广。

运作保障部：负责公司基金的注册登记、资金清算、会计核算、估值。

信息技术部：负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。

公司办公室：负责公司董事会相关工作，负责文档、印鉴管理，公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。

人力资源部：负责公司人力资源管理工作。

行政财务部：负责公司财务管理、会计核算，行政、后勤等相关工作。

深圳管理部：负责公司财务管理、会计核算、税务报送，与主管机关及相关单位的联络沟通，以及其他行政工作等。

监察稽核部：负责揭示、控制公司各项业务风险，对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核，督促公司内部管理制度的执行，处理日常法律事务、信息披露事务。

北京分公司：负责所辖区域内的行政管理。

信息披露负责人及咨询电话：凌宇翔；010-58163096。

截至 2013 年 8 月 19 日，公司共有员工 309 人，其中 172 人具有硕士以上学历，10 人具有博士以上学历。公司主要业务部门人员大部分具有基金从业资格。

### 3、本基金基金经理

姜永康先生：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，现任公司总经理助理、固定收益部总监及固定收益基金投资总监。自 2007 年 1 月 30 日起任银华保本增值证券投资基金基金经理，在 2008 年 1 月 8 日至 2009 年 2 月 18 日期间曾兼任银华货币市场证券投资基金基金经理，自 2008 年 12 月 3 日起兼任银华增强收益债券型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，自 2013 年 7 月 8 日起兼任银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理，自 2013 年 8 月 15 日起兼任本基金基金经理。

#### （二）基金托管人

##### 1、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

行长：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：(010) 66594855

传真：(010) 66594942

## 2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工 120 余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务，托管资产规模居同业前列。

### （三）基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

办公地址：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

法定代表人：吴港平

经办注册会计师：李慧民、王珊珊

电话：010-58153280；010-58152145

传真：010-85188298

## 六、基金合同摘要

### （一）基金合同当事人及其权利、义务

#### 1、基金管理人

##### （1）基金管理人简况

名称：银华基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层

法定代表人：王珠林

设立日期：2001 年 5 月 28 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字 [2001] 7 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：400 678 3333

##### （2）基金管理人的权利与义务

1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

○1 依法募集基金；

○2 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

○3 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

○4 销售基金份额；

○5 召集基金份额持有人大会；

○6 依据基金合同及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

○7 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

○8 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

○9 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规



定的费用；

- 10 依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
- 11 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- 12 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 13 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- 14 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 15 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- 16 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；
- 17 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- 1 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2 办理基金备案手续；
- 3 自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- 4 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- 6 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7 依法接受基金托管人的监督；
- 8 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- 9 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 10 编制季度、半年度和年度基金报告；
- 11 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 12 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- 13 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 14 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- 17 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- 18 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

○22 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

○23 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

○24 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

○25 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

○26 建立并保存基金份额持有人名册；

○27 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 2、基金托管人

### (1) 基金托管人简况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

行长：李礼辉

成立时间：1983 年 10 月 31 日

批准设立机关和批准设立文号：经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会银监复[2004]123 号文

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

### (2) 基金托管人的权利与义务

1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

○1 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

○2 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

○3 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

○4 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

○5 提议召开或召集基金份额持有人大会；

○6 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

○7 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

○1 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

○2 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

○3 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

○4 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

○5 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

○6 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投

资指令，及时办理清算、交割事宜；

○7 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

○8 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

○9 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

○10 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

○11 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

○12 建立并保存基金份额持有人名册；

○13 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

○14 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

○15 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

○16 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

○17 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

○18 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

○19 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

○20 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

○21 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

○22 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### 3、基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- 9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- 1) 认真阅读并遵守基金合同；
- 2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- 3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

- 4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- 7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- 8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

### 1、 会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；  
(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；  
(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

(4) 代表单独或合计持有银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表单独或合计持有银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(5) 代表单独或合计持有银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表单独或合计持有银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 2、 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### 3、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式等方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日各自基金总份额的 50% 以上（含 50%）

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 会议召集人按基金合同约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额各自的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）；

4) 上述第 3) 项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符。

(3) 在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络等非现场方式召开，且除纸面授权外，基金份额持有人之间的授权亦可根据召集人在大会通知中规定的方式，通过电话、网络等方式进行。

### 4、议事内容与程序

#### (1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他

事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额各自基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 5、 表决

银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 特别决议须经出席会议的银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

(2) 一般决议须经出席会议的银华转债份额、转债 A 份额、转债 B 份额的各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效。除上述 1 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 6、 计票

### (1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

#### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

### (三) 基金收益与分配

#### 1、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

#### 2、基金收益分配原则

在存续期内,本基金(包括银华转债份额、转债A份额、转债B份额)不进行收益分配。

### (四) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### 1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
- (4) 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
- (5) 基金份额持有人大会费用;
- (6) 基金的证券交易费用;
- (7) 基金的银行汇划费用;
- (8) 基金上市初费和上市月费
- (9) 因基金的证券交易或结算而产生的费用;
- (10) 基金的指数使用许可费;
- (11) 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### (1) 基金管理人的管理费

自基金合同生效之日起,本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

##### (2) 基金托管人的托管费

自基金合同生效之日起,本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### (3) 指数使用许可费

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之一点二(1.2个基点)的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.012\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应付的指数许可使用基点费，E为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。许可使用基点费的收取下限为每季度人民币贰万伍仟元(2.5万元)，基金设立当年，不足3个月的，按照3个月收费。

### (五) 基金财产的投资方向和投资限制

#### 1、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。

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。

#### 2、投资范围

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%。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 3、投资限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

(2) 本基金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) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(4) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

(5) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其



各类资产支持证券合计规模的 10%；

(7) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(8) 法律法规、监管部门以及基金合同规定的其它投资限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

#### 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为，无需召开基金份额持有人大会。

#### (六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### (七) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、基金合同的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

(2) 关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行，自决议生效之日起按照《信息披露办法》的规定在指定媒体公告。

##### 2、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算小组成员：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事

证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 7) 对基金财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### (八) 争议的处理和适用的法律

本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。基金合同受中国法律管辖。除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

### (九) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

### 七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金认购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

银华中证转债指数增强分级证券投资基金 2013 年 8 月 21 日资产负债表（未经审计）如下：

银华中证转债指数增强分级证券投资基金

2013 年 8 月 21 日资产负债表

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资产

银行存款	8,887,162.49
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	218,505,257.23
其中：股票投资	-
债券投资	218,505,257.23
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	100,000,000.00
应收证券清算款	59,064,838.55
应收股利	-
应收利息	1,378,901.45
应收申购款	-
其他资产	117,234.83
资产总计	387,953,394.55

负债及所有者权益

负债

应付证券清算款	2,431,250.22
应付管理人报酬	44,417.12
应付托管费	12,690.60
应付交易费用	-
应付税费	-
应付赎回款	-
其他负债	7,560.05
负债合计	2,495,917.99

所有者权益

实收基金	386,033,124.32
未分配利润	-575,647.76
所有者权益合计	385,457,476.56

负债及所有者权益总计 387,953,394.55

截至 2013 年 8 月 21 日，银华转债的基金份额净值为 0.999 元，转债 A 的基金份额净值为 1.001 元，转债 B 的基金份额净值为 0.994 元。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，银华中证转债指数增强分级证券投资基金的投资组合如下：

（一）基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	-	-
债券	218,505,257.23	56.32%

权证	-	-	
资产支持证券	-	-	
买入返售金融资产	100,000,000.00	25.78%	
银行存款和清算备付金合计	8,887,162.49	2.29%	
应收申购款	-	-	
其他资产	60,560,974.83	15.61%	
合计	387,953,394.55	100.00%	

注：由于四舍五入的原因，“占基金总资产的比例”分项之和与合计可能有尾差。

#### （二）按行业分类的股票投资组合

截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，本基金未持有股票。

（三）截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，本基金未持有股票。

（四）截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，按券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	19,940,000.00	5.17
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	198,565,257.23	51.51
8	其他	-	-
9	合计	218,505,257.23	56.69

（五）截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细：

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1	110015	石化转债	950,870	92,766,877.20	24.07
2	113002	工行转债	510,630	56,439,933.90	14.64
3	019302	13 国债 02	200,000	19,940,000.00	5.17
4	110018	国电转债	153,430	16,734,610.10	4.34
5	110020	南山转债	100,000	9,967,000.00	2.59

（六）截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细：

截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，本基金未持有资产支持证券。

#### （七）投资组合报告附注

1、截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，本基金未持有股票，因此，不存在前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、申明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。

截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，本基金未持有股票。

3、本基金 2013 年 8 月 21 日，其他资产构成如下：

序号 其他资产 金额(元)

1	交易保证金	-
2	应收证券清算款	59,064,838.55
3	应收股利	-
4	应收利息	1,378,901.45
5	其他应收款	117,234.83
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	60,560,974.83

4、截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，持有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	110015	石化转债	92,766,877.20	24.07
2	113002	工行转债	56,439,933.90	14.64
3	110018	国电转债	16,734,610.10	4.34
4	110020	南山转债	9,967,000.00	2.59
5	110017	中海转债	7,735,675.20	2.01
6	110022	同仁转债	3,448,640.00	0.89
7	110016	川投转债	2,566,800.00	0.67
8	125089	深机转债	657,650.83	0.17
9	127001	海直转债	559,650.00	0.15

5、截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，本基金未持有权证。

6、截至公告前两个工作日即 2013 年 8 月 21 日，本基金未持有股票。

#### 九、重大事件揭示

银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同已于 2013 年 8 月 15 日正式生效，基金管理人已于 2013 年 8 月 16 日在《中国证券报》刊登《银华基金管理有限公司关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同生效公告》。

银华转债份额将于 2013 年 8 月 28 日开放日常申购、赎回，具体业务办理规则请投资者参阅 2013 年 8 月 23 日刊登在《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》上的《银华中证转债指数增强分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

#### 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

#### 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三) 基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定, 将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正, 督促基金管理人改正。

(四) 基金托管人发现基金管理人重大违规行为, 将立即报告中国证监会, 同时通知基金管理人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

## 十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所, 投资者可在办公时间免费查阅; 也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件, 但应以基金合同正本为准。

- (一) 中国证监会核准银华中证转债指数增强分级证券投资基金募集的文件;
- (二) 《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》;
- (三) 《银华中证转债指数增强分级证券投资基金招募说明书》;
- (四) 《银华中证转债指数增强分级证券投资基金托管协议》;
- (五) 《关于银华基金管理有限公司募集设立银华中证转债指数增强分级证券投资基金之法律意见书》;
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照;
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

银华基金管理有限公司

2013年8月23日