

银华中证转债指数增强分级证券投资基金更新招募说明书摘要

(2016 年第 2 号)

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2013 年 6 月 6 日证监许可【2013】751 号文核准发售。

本基金的基金合同于 2013 年 8 月 15 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金发售的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

本基金按照基金份额初始面值 1.00 元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险。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。本基金经过基金份额分

级后，转债 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；转债 B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日银华转债份额的净赎回申请超过前一开放日全部基金份额（包括转债 A 份额、转债 B 份额和银华转债份额）的 10%时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部银华转债份额。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

投资者应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本招募说明书、本基金的基金份额发售公告以及相关公告。

本招募说明书（更新）摘要所载内容截止日为 2016 年 8 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日，所披露的投资组合为 2016 年 2 季度的数据（财务数据未经审计）。

一、基金管理人概况及主要人员情况

（一）基金管理人概况

名称 银华基金管理股份有限公司

住所 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

法定代表人 王珠林 设立日期 2001 年 5 月 28 日

批准设立机关 中国证监会 批准设立文号 中国证监会证监基金字[2001]7 号

组织形式 股份有限公司 注册资本 2 亿元人民币

存续期间 持续经营 联系人 冯晶

电话 010-85186558 传真 010-58163027

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,公司的股权结构为西南证券股份有限公司(出资比例49%)、第一创业证券股份有限公司(出资比例29%)、东北证券股份有限公司(出资比例21%)及山西海鑫实业股份有限公司(出资比例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。银华基金管理有限公司的法定名称已于2016年8月9日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

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“战略委员会”、“风险控制委员会”、“薪酬与提名委员会”、“审计委员会”四个专业委员会,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一部、投资管理二部、投资管理三部、量化投资部、研究部、市场营销部、机构业务部、国际合作与产品开发部、境外投资部、交易管理部、养老金业务部、风险管理部、运作保障部、信息技术部、互联网金融部、投资银行部、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、战略发展部等22个职能部门,并设有北京分公司、青岛分公司和上海分公司。此外,公司设立投资决策委员会作为公司投资业务的最高决策机构,同时下设“主动型A股投资决策、固定收益投资决策、量化和境外投资决策”三个专门委员会。公司投资决策委员会负责确定公司投资业务理念、投资政策及投资决策流程和风险管理。

(二) 主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

王珠林先生:董事长,经济学博士。曾任甘肃省职工财经学院财会系讲师,甘肃省证券公司发行部经理,中国蓝星化学工业总公司处长,蓝星清洗股份有限公司董事、副总经理、董事会秘书,西南证券副总裁,中国银河证券副总裁,西南证券董事、总裁;还曾先后担任中国证监会发行审核委员会委员、中国证监会上市公司并购重组审核委员会委员、中国证券业协会投资银行业委员会委员、重庆市证券期货业协会会长。现任银华基金管理股份有限公司董事长、西南证券股份有限公司董事,兼任中国上市公司协会并购融资委员会执行主任、中国退役士兵就业创业服务促进会副理事长、中证机构间报价系统股份有限公司董事、中航动力

股份有限公司独立董事、中国中材股份有限公司独立董事、财政部资产评估准则委员会委员。

钱龙海先生：经济学硕士。曾任北京京放投资管理顾问公司总经理助理；佛山证券有限责任公司副总经理。现任第一创业证券股份有限公司党委书记、董事、总裁，兼任第一创业投资管理有限公司董事长、第一创业摩根大通证券有限责任公司董事，银华基金管理股份有限公司董事。还担任中国证券业协会第五届理事会理事，中国证券业协会投资银行业务委员会第五届副主任委员，深圳市证券业协会副会长。

李福春先生：中共党员，研究生，高级工程师。曾任一汽集团公司发展部部长、吉林省经济贸易委员会副主任、吉林省发展和改革委员会副主任、长春市副市长、吉林省发展和改革委员会主任、吉林省政府秘书长。现任东北证券股份有限公司董事长、党委书记，银华基金管理股份有限公司董事。

吴坚先生：董事，中共党员。曾任重庆市经济体制改革委员会主任科员，重庆市证券监管办公室副处长，重庆证监局上市处处长，重庆渝富资产管理集团有限公司党委委员、副总经理，重庆东源产业投资股份有限公司董事长，重庆机电股份有限公司董事，重庆上市公司董事长协会秘书长，西南证券有限责任公司董事，安诚财产保险股份有限公司副董事长，重庆银海融资租赁有限公司董事长，重庆直升机产业投资有限公司副董事长，华融渝富股权投资基金管理有限公司副董事长，西南药业股份有限公司独立董事，西南证券股份有限公司董事，西南证券股份有限公司副总裁。现任西南证券股份有限公司总裁，重庆股份转让中心有限责任公司董事长，西证国际投资有限公司董事，西证国际证券股份有限公司执行董事，重庆仲裁委仲裁员。

王立新先生：董事、总经理，经济学博士。曾任职于中国工商银行总行、南方证券股份有限公司基金部，并历任南方基金管理有限公司研究开发部、市场拓展部总监，银华基金管理有限公司总经理助理、副总经理。自2006年至今任银华基金管理股份有限公司董事、总经理，现兼任银华财富资本管理（北京）有限公司董事长，中国证券投资基金业协会理事。

郑秉文先生：独立董事，经济学博士后，教授，博士生导师，曾任中国社会科学院培训中心主任、院长助理、副院长。现任中国社会科学院美国研究所党委书记、所长，中国社科院世界社会保障中心主任，中国社科院研究生院教授、博士生导师，政府特殊津贴享受者，中国人民大学劳动人事学院兼职教授，武汉大学社会保障研究中心兼职研究员，西南财经大学保险学院暨社会保障研究所兼职教授，辽宁工程技术大学客座教授。

刘星先生：独立董事，管理学博士，重庆大学经济与工商管理学院会计学教授、博士生导师、国务院“政府特殊津贴”获得者，全国先进会计（教育）工作者，中国注册会计师协会非执业会员。现任中国会计学会理事，中国会计学会对外学术交流专业委员会副主任，中国会计学会教育分会前任会长，中国管理现代化研究会常务理事，中国优选法统筹与经济数学研究会常务理事。

邢冬梅女士：独立董事，法律硕士，律师。曾任职于司法部中国法律事务中心（后更名为信利律师事务所），并历任北京市共和律师事务所合伙人。现任北京天达共和律师事务所管理合伙人、金融部负责人，同时兼任北京朝阳区律师协会副会长。

封和平先生：独立董事，会计学硕士，中国注册会计师。曾任职于财政部所属中华财务会计咨询公司，并历任安达信华强会计师事务所副总经理、合伙人，普华永道会计师事务所合伙人、北京主管合伙人，摩根士丹利中国区副主席；还曾担任中国证监会发行审核委员会委员、中国证监会上市公司并购重组审核委员会委员、第29届奥运会北京奥组委财务顾问。现任普华永道高级顾问，北京注册会计师协会第五届理事会常务理事。

王芳女士：监事会主席，研究生学历。2000年至2004年任大鹏证券有限责任公司法律支持部经理，2004年10月起历任第一创业证券有限公司首席律师、法律合规部总经理、合规总监、副总裁。现任第一创业证券股份有限公司副总裁、合规总监、首席风险官，兼任第一创业摩根大通证券有限公司董事。

李军先生：监事，管理学博士。曾任四川省农业管理干部学院教师，西南证券股份有限公司成都证券营业部咨询部分析师、高级客户经理、总经理助理、业务总监，西南证券股份有限公司经纪业务部副总经理。此外，还曾先后担任重庆市国有资产监督管理委员会统计评价处（企业监管三处）副处长、企业管理三处副处长、企业管理二处处长、企业管理三处处长，并曾兼任重庆渝富资产管理集团有限公司外部董事。现任西南证券股份有限公司运营管理部总经理。

龚飒女士：监事，硕士学历。曾任湘财证券有限责任公司分支机构财务负责人，泰达荷银基金管理有限公司基金事业部副总经理，湘财证券有限责任公司稽核经理，交银施罗德基金管理有限公司运营部总经理。现任公司运作保障部总监。

杜永军先生：监事，大专学历。曾任五洲大酒店财务部主管，北京赛特饭店财务部主管、主任、经理助理、副经理、经理。现任公司行政财务部总监助理。

封树标先生：副总经理，工学硕士。曾任国信证券天津营业部经理、平安证券综合研究所副所长、平安证券资产管理事业部总经理、平安大华基金管理有限责任公司总经理、广发基金机构投资部总经理等职，2011年3月加盟银华基金管理有

限公司任公司总经理助理。现任公司副总经理，兼任投资管理二部总监及投资经理。

周毅先生：副总经理。硕士学位，曾任美国普华永道金融服务部部门经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。2009年9月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华全球核心优选证券投资基金、银华沪深300指数证券投资基金（LOF）及银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理和公司总经理助理职务。现任公司副总经理，兼任公司量化投资总监、量化投资部总监以及境外投资部总监、银华国际资本管理有限公司总经理，并同时兼任银华深证100指数分级证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理职务。

凌宇翔先生：副总经理，工商管理硕士。曾任机械工业部主任科员；西南证券有限责任公司基金管理部总经理；自2001年至2015年6月任银华基金管理有限公司督察长。现任公司副总经理，兼任银华国际资本管理有限公司董事。

杨文辉先生，督察长，法学博士。曾任职于北京市水利经济发展有限公司、中国证监会。现任银华基金管理股份有限公司督察长，兼任银华财富资本管理（北京）有限公司董事。

2. 本基金基金经理

贾鹏先生，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；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日起担任本基金及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，自2016年4月1日起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。

孙慧女士，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，历任基金经理助理职务，自2016年2月6日起担任本基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华保本增值证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理

姜永康先生：管理本基金时间为2013年8月15日至2014年12月15日。

3. 公司投资决策委员会成员

委员会主席：王立新

委员：封树标、周毅、王华、姜永康、王世伟、倪明、董岚枫

王立新先生：详见主要人员情况。

封树标先生：详见主要人员情况。

周毅先生：详见主要人员情况。

王华先生，硕士学位，中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于西南证券有限责任公司。2000年10月加盟银华基金管理有限公司（筹），先后在研究策划部、基金经理部工作，曾任银华保本增值证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金基金经理。现任银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金和银华优质增长混合型证券投资基金基金经理、公司总经理助理、投资管理一部总监及A股基金投资总监。

姜永康先生，硕士学位。2001年至2005年曾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。曾担任银华货币市场证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理。现任公司总经理助理、投资管理三部总监及固定收益基金投资总监以及银华财富资本管理（北京）有限公司董事，并同时担任银华增强收益债券型证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理。

王世伟先生，硕士学位，曾担任吉林大学系统工程研究所讲师；平安证券营业部总经理；南方基金公司市场部总监；都邦保险投资部总经理；金元证券资本市场部总经理。2013年1月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华财富资本管理（北京）有限公司副总经理，现任银华财富资本管理（北京）有限公司总经理。

倪明先生，经济学博士；曾在大成基金管理有限公司从事研究分析工作，历任债券信用分析师、债券基金助理、行业研究员、股票基金助理等职，并曾任大成创新成长混合型证券投资基金基金经理职务。2011年4月加盟银华基金管理有限公司。现任银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式基金和银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

董岚枫先生，博士学位；曾任五矿工程技术有限责任公司高级业务员。2010年10月加盟银华基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、行业研究员、研究部副总监。现任研究部总监。

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人概况

（一）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

法定代表人：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

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2016年06月30日，中国银行已托管475只证券投资基金，其中境内基金444只，QDII基金31只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1. 直销机构

（1）银华基金管理股份有限公司北京直销中心

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

电话 010-58162950 传真 010-58162951

联系人 展璐 网址 www.yhfund.com.cn

全国统一客户服务电话 400-678-3333

(2) 银华基金管理股份有限公司网上直销交易系统

网上交易网址 trade.yhfund.com.cn/etrading

手机交易网站 m.yhfund.com.cn

客户服务电话 010-85186558, 4006783333

2. 代销机构

(1) 场外代销机构

1) 中国银行股份有限公司

注册地址 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人 田国立

客服电话 95566 网址 www.boc.cn

2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址 北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人 王洪章

客服电话 95533 网址 www.ccb.com

3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人 蒋超良

客服电话 95599 网址 www.abchina.com

4) 交通银行股份有限公司

注册地址 上海市银城中路 188 号

法定代表人 牛锡明

客服电话 95559 网址 www.bankcomm.com

5) 招商银行股份有限公司

注册地址 深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人 李建红

客服电话 95555 网址 www.cmbchina.com

6) 平安银行股份有限公司

注册地址 中国深圳市深南东路 5047 号

法定代表人 孙建一

客服电话 95511-3 网址 bank.pingan.com

7) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人 何沛良

网址 www.drcbank.com

8) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址 上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人 冀光恒

客服电话 021-962999 网址 www.srcb.com

9) 渤海证券股份有限公司

注册地址 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人 王春峰

客服电话 400-6515-988 网址 www.ewww.com.cn

10) 大通证券股份有限公司

注册地址 辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层

法定代表人 张智河

客服电话 4008-169-169 网址 www.daton.com.cn

11) 大同证券有限责任公司

注册地址 山西省大同市大北街 13 号

法定代表人 董祥

客服电话 4007121212 网址 <http://www.dtsbc.com.cn/>

12) 东北证券股份有限公司

注册地址 长春市自由大路 1138 号

法定代表人 李福春

客服电话 95360 网址 www.nesc.cn

13) 国都证券股份有限公司

注册地址 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人 王少华

客服电话 400-818-8118 网址 www.guodu.com

14) 恒泰证券股份有限公司

注册地址 内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人 庞介民

客服电话 4001966188 网址 www.cnht.com.cn

15) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址 新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

法定代表人 李季

客服电话 400-800-0562 网址 www.hysec.com

16) 华龙证券股份有限公司

注册地址 兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 4 楼

法定代表人 李晓安

客服电话 95368 网址 www.hlzqgs.com

17) 华融证券股份有限公司

注册地址 北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人 祝献忠

客服电话 400-898-9999 网址 www.hrsec.com.cn

18) 江海证券有限公司

注册地址 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人 孙名扬

客服电话 400-666-2288 网址 www.jhzq.com.cn

19) 联讯证券股份有限公司

注册地址 中国广东省惠州市惠城区江北东江三路广播电视新闻中心

法定代表人 徐刚

客服电话 95564 网址 www.lxzq.com.cn

20) 中泰证券股份有限公司

注册地址 山东省济南市经七路 86 号

法定代表人 李玮

客服电话 95538 网址 [www.qlzq.com.cn](http://www qlzq.com.cn)

21) 瑞银证券有限责任公司

注册地址 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人 程宜荪

客服电话 400-887-8827 网址 www.ubssecurities.com

22) 山西证券股份有限公司

注册地址 太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人 侯巍

客服电话 400-666-1618; 95573 网址 www.i618.com.cn

23) 天相投资顾问有限公司

注册地址 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人 林义相

客服电话 010-66045678 网址 www.jjm.com.cn

24) 西部证券股份有限公司

注册地址 西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人 刘建武

客服电话 95582 网址 www.westsecu.com.cn

25) 新时代证券股份有限公司

注册地址 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人 田德军

客服电话 4006-98-98-98 网址 www.xsdzq.cn

26) 信达证券股份有限公司

注册地址 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人 张志刚

客服电话 95321 网址 www.cindasc.com

27) 中国民族证券有限责任公司

注册地址 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法定代表人 赵大建

客服电话 4008895618 网址 www.e5618.com

28) 中国银河证券股份有限公司

注册地址 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人 陈有安

客服电话 400-888-8888 网址 www.chinastock.com.cn

29) 中国国际金融股份有限公司

注册地址 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人 丁学东

客服电话 400-910-1166 网址 www.ciccs.com.cn

30) 中信建投证券股份有限公司

注册地址 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人 王常青

客服电话 400-8888-108 网址 www.csc108.com

31) 中信证券股份有限公司

注册地址 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人 张佑君

客服电话 95558 网址 www.citics.com

32) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层（266061）

法定代表人 杨宝林

客服电话 95548 网址 www.citicssd.com

33) 中原证券股份有限公司

注册地址 郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人 菅明军

客服电话 95377 网址 www.ccnew.com

34) 爱建证券有限责任公司

注册地址 上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人 钱华

网址 www.ajzq.com

35) 安信证券股份有限公司

注册地址 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人 王连志

客服电话 400-800-1001 网址 www.essence.com.cn

36) 财富证券有限责任公司

注册地址 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心

法定代表人 蔡一兵

客服电话 400-88-35316 网址 www.cfzq.com

37) 长城证券股份有限公司

注册地址 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

法定代表人 黄耀华

客服电话 0755-33680000; 400-6666-888 网址 www.cgws.com

38) 长江证券股份有限公司

注册地址 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人 尤习贵

客服电话 95579; 400-8888-999 网址 www.95579.com

39) 德邦证券股份有限公司

注册地址 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

法定代表人 姚文平

客服电话 400-888-8128 网址 www.tebon.com.cn

40) 第一创业证券股份有限公司

注册地址 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人 刘学民

客服电话 95358 网址 www.firstcapital.com.cn

41) 东莞证券股份有限公司

注册地址 东莞市莞城可园南路 1 号

法定代表人 张运勇

客服电话 95328; 95503 网址 www.dgzq.com.cn; www.dfzq.com.cn

42) 东海证券股份有限公司

注册地址 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人 赵俊

客服电话 95531; 400-8888-588 网址 <http://www.longone.com.cn>

43) 东吴证券股份有限公司

注册地址 苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人 范力

客服电话 95330 网址 <http://www.dwzq.com.cn>

44) 方正证券股份有限公司

注册地址 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 11 层

法定代表人 雷杰

客服电话 95571 网址 <http://www.foundersc.com>

45) 光大证券股份有限公司

注册地址 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人 薛峰

客服电话 95525; 400-888-8788 网址 www.ebscn.com

46) 广发证券股份有限公司

注册地址 广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人 孙树明

客服电话 95575 或致电各地营业网点 网址 <http://www.gf.com.cn>

47) 广州证券股份有限公司

注册地址 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人 邱三发

客服电话 95396 网址 www.gzs.com.cn

48) 国海证券股份有限公司

注册地址 广西桂林市辅星路 13 号

法定代表人 张雅锋

客服电话 95563 网址 www.ghzq.com.cn

49) 国金证券股份有限公司

注册地址 成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人 冉云

客服电话 95310 网址 www.gjzq.com.cn

50) 国盛证券有限责任公司

注册地址 江西省南昌市北京西路 88 号 (江信国际金融大厦)

法定代表人 马跃进

客服电话 400-8222-111 网址 www.gszq.com

51) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址 中国 (上海) 自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人 杨德红

客服电话 95521 网址 www.gtja.com

52) 国信证券股份有限公司

注册地址 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人 何如

客服电话 95536 网址 www.guosen.com.cn

53) 国元证券股份有限公司

注册地址 安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人 蔡咏

客服电话 400-8888-777 网址 www.gyzq.com.cn

54) 华安证券有限责任公司

注册地址 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人 李工

客服电话 96518(安徽) ; 400-809-6518(全国) 网址 www.hazq.com

55) 华宝证券有限责任公司

注册地址 上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人 陈林

客服电话 400-820-9898 网址 www.cnhbstock.com

56) 华福证券有限责任公司

注册地址 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人 黄金琳

客服电话 96326 (福建省外请先拨 0591) 网址 www.hfzq.com.cn

57) 华泰证券股份有限公司

注册地址 南京市江东中路 228 号

法定代表人 周易

客服电话 95597 网址 www.htsc.com.cn

58) 华鑫证券有限责任公司

注册地址 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人 俞洋

客服电话 021-32109999; 029-68918888; 400-109-9918 网址 www.cfsc.com.cn

59) 金元证券股份有限公司

注册地址 海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

法定代表人 陆涛

客服电话 400-888-8228 网址 www.jyzq.cn

60) 南京证券股份有限公司

注册地址 江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人 步国旬

客服电话 95386 网址 www.njzq.com.cn

61) 平安证券有限责任公司

注册地址 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人 谢永林

客服电话 95511-8 网址 stock.pingan.com

62) 长城国瑞证券有限公司

注册地址 厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

法定代表人 王勇

客服电话 0592-5163588 网址 www.xmzq.cn

63) 上海证券有限责任公司

注册地址 上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人 李俊杰

客服电话 021-962518 网址 www.962518.com

64) 申万宏源证券有限公司

注册地址 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人 李梅

客服电话 95523; 400-889-5523 网址 www.swhysc.com

65) 太平洋证券股份有限公司

注册地址 云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人 李长伟

客服电话 400-665-0999 网址 <http://www.tpyzq.com>

66) 天风证券股份有限公司

注册地址 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

法定代表人 余磊

客服电话 028-86711410; 027-87618882 网址 www.tfzq.com

67) 万联证券有限责任公司

注册地址 广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 18、19 层

法定代表人 张建军

客服电话 400-8888-133 网址 www.wlzq.com.cn

68) 五矿证券有限公司

注册地址 深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

法定代表人 赵立功

客服电话 400-184-0028 网址 www.wkzq.com.cn

69) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址 西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

法定代表人 陈宏

客服电话 400-911-2233 网址 www.xzsec.com

70) 西南证券股份有限公司

注册地址 重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人 吴坚

客服电话 400-809-6096 网址 www.swsc.com.cn

71) 湘财证券股份有限公司

注册地址 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人 林俊波

客服电话 400-888-1551 网址 www.xcsc.com

72) 兴业证券股份有限公司

注册地址 福州市湖东路 268 号

法定代表人 兰荣

客服电话 95562 网址 www.xyzq.com.cn

73) 英大证券有限责任公司

注册地址 深圳市福田区深南中路华能大厦 30、31 层

法定代表人 吴骏

客服电话 4000-188-688 网址 www.ydsc.com.cn

74) 招商证券股份有限公司

注册地址 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人 宫少林

客服电话 400-8888-111; 95565 网址 www.newone.com.cn

75) 中国中投证券有限责任公司

注册地址 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层
及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

法定代表人 高涛

客服电话 95532 网址 www.china-invs.cn

76) 中航证券有限公司

注册地址 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人 王宜四

客服电话 400-8866-567 网址 www.avicsec.com

77) 中山证券有限责任公司

注册地址 深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人 黄扬录

客服电话 400-1022-011 网址 <http://www.zszq.com/>

78) 首创证券有限责任公司

注册地址 北京市西城区德胜门外大街 115 号

法定代表人 吴涛

客服电话 4006200620 网址 www.sczq.com.cn

79) 中信期货有限公司

注册地址 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人 张皓

客服电话 400-990-8826 网址 www.citicsf.com

80) 深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

联系人 童彩平

客服电话 4006-788-887 网址 www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

81) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

联系人 单丙焯

客服电话 400-820-2899 网址 www.erichfund.com

82) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

联系人 韩爱彬

客服电话 4000-766-123 网址 www.fund123.cn

83) 上海好买基金销售有限公司

办公地址 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼（200120）

联系人 罗梦

客服电话 400-700-9665 网址 www.ehowbuy.com

84) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址 浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903

联系人 吴杰

客服电话 4008-773-772 网址 www.ijijin.cn

85) 上海天天基金销售有限公司

办公地址 上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

联系人 潘世友

客服电话 400-1818-188 网址 www.1234567.com.cn

86) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层

联系人 张燕

客服电话 4008507771 网址 t.jrj.com

87) 北京钱景财富投资管理有限公司

办公地址 北京市海淀区海淀南路13号楼6层616室

联系人 魏争

客服电话 400-678-5095 网址 www.niuji.net

88) 嘉实财富管理有限公司

办公地址 北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

联系人 费勤雯

客服电话 400-021-8850 网址 www.harvestwm.cn

89) 北京恒天明泽基金销售有限公司

办公地址 北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

联系人 马鹏程

客服电话 400-786-8868-5 网址 www.chtfund.com

90) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址 上海市浦东新区陆家嘴 1333 号 14 楼

联系人 宁博宇

客服电话 400-821-9031 网址 www.lufunds.com

91) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址 上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12F

联系人 张裕

客服电话 400-821-5399 网址 www.noah-fund.com

92) 珠海盈米财富管理有限公司

办公地址 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

联系人 黄敏嫦

客服电话 020-89629066 网址 www.yingmi.cn

（以上排名不分先后）

（2）场内代销机构

具有基金代销业务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）。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

3. 网上直销

投资者可以通过本公司网上直销交易系统办理本基金的开户和认购手续，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网址：www.yhfund.com.cn

（二）注册登记机构

名称 中国证券登记结算有限责任公司

住所及办公地址 中国北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人 金颖 联系人 崔巍

电话 010-66210988, 010-59378888 传真 010-66210938

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称 上海市通力律师事务所
住所及办公地址 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人 韩炯 联系人 黎明
电话 021-31358666 传真 021-31358600
经办律师 吕红、黎明

（四）会计师事务所及经办注册会计师

名称 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
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安永大楼（即东 3 办公楼）16 层
法定代表人 吴港平 联系人 王珊珊
电话 010-58153280；010-58152145 传真 010-85188298
经办注册会计师 李慧民、王珊珊

四、基金类型

债券型证券投资基金

五、基金的运作方式

契约型开放式

六、上市交易所

深圳证券交易所

七、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。

八、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。

九、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。

1、指数投资策略

对指数投资部分，采用指数成分复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、流动性风险、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。

（1）可转债投资组合的定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份券及成份券权重的调整而进行相应调整。

（2）可转债投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势，本基金将根据本基金的资产规模、日常申购/赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整以保证对标的指数的有效跟踪。

2、指数增强策略

（1）可转债投资组合的不定期调整

当发生以下情况时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对个券权重和券种进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

- 1) 本基金预期标的指数的成份券即将调整或权重发生变化;
- 2) 成份券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例;
- 3) 由于市场因素影响、法律法规限制等原因, 本基金无法根据指数构建组合和基金发生申购赎回、市场流动性变化等其他可能影响跟踪效果的情形。

(2) 可转债条款投资策略

一般情况下, 可转债本身会附加的提前赎回条款、回售条款及向下修正股价条款, 在一定环境下这些条款对可转债的投资价值有很大影响。

提前赎回条款是指在可转债存续期内, 当可转债正股价格连续一段时间高于其转股价格一定幅度时, 可转债发行公司有权按照高于债券面值一定幅度的赎回价格赎回全部或部分未转股的可转债, 该条款是赋予可转债发行方的一个权利。提前赎回的条件往往可以视为可转债的价值最大限度, 本基金将会在接近提前赎回条件触发的时候, 理性分析可转债正股的基本面状况及未来走势, 以选择抛出或转股出售。

提前回售条款是指在可转债存续期内, 如果可转债正股价格连续一段时间内低于转股价格一定幅度或者可转债发行方改变募集资金投资用途时, 可转债持有人有权将其持有的可转债全部或部分按照高于可转债面值一定幅度的价格回售给可转债的发行公司, 该条款是赋予可转债持有人的一个权利。本基金将通过对可转债及其正股投资价值的合理分析, 以选择是否行使该项权利。

转股价格向下修正条款是指在可转债存续期间内, 当一段时间内正股价格持续低于转股价达到一定程度, 则可转债发行方董事会可发起向下修正转股价的提议, 通过向下修正转股价而大幅提高可转债的转股价值, 从而提升可转债价值, 也为该转债未来可能出现较好表现提供支撑, 这也有效地降低了正股可能较大幅下跌给转债带来的损失, 因此提前对此进行合理的判断将提升组合投资价值。除此之外, 当可转债发行方发生送红股、转增股本、增发新股、配股以及派发股利等情况时, 可转债发行方会对可转债的转股价格作出相应调整, 本公司可以通过对相关事件及正股基本面的分析, 把握可能存在的投资机会。

(3) 可转债一级市场申购策略

本基金跟踪的可转债指数为全样本指数, 对于一级市场新发可转债, 本基金将综合可转债上市定价、中签率等因素, 判断是否参与一级市场申购, 以降低买入成本。

十、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)

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十一、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。

从本基金所分离的两类基金份额来看，转债 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；转债 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

十二、投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行根据本基金合同规定，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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

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 --

其中：股票 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 375,464,056.37 97.00

其中：债券 375,464,056.37 97.00

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 2,283,442.32 0.59

8 其他资产 9,338,681.43 2.41

9 合计 387,086,180.12 100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数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。

2.2 报告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。

2.3 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。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1 报告期末指数投资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

注：本基金本报告期末未持有股票。

3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

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 18,498,150.00 5.78

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） 356,965,906.37 111.47

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 375,464,056.37 117.24

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 113008 电气转债 540,040 58,383,724.40 18.23

2	113009	广汽转债	471,170	55,894,897.10	17.45
3	110032	三一转债	432,000	45,943,200.00	14.35
4	110033	国贸转债	371,750	43,829,325.00	13.69
5	128009	歌尔转债	300,739	38,732,175.81	12.09

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。

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。

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。

9. 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。

10. 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。

11. 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	23,674.36
2	应收证券清算款	8,549,054.56
3	应收股利	-
4	应收利息	752,970.68
5	应收申购款	12,981.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,338,681.43

11.4 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	113008	电气转债	58,383,724.40	18.23
2	128009	歌尔转债	38,732,175.81	12.09
3	110031	航信转债	14,095,062.00	4.40
4	110030	格力转债	11,223,555.00	3.50
5	123001	蓝标转债	12,513,770.70	3.91

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

11.6 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。

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

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

自基金合同生效日(2013.08.15)起至 2013.12.31 -5.44% 0.52% -3.83% 0.48% -
1.61% 0.04%

2014.01.01 至 2014.12.31 57.55% 1.14% 53.57% 1.01% 3.98% 0.13%

2015.1.1 至 2015.12.31 -28.57% 2.51% -24.94 2.99% -3.63% -0.48%

2016.1.1 至 2016.6.30 -13.19% 0.91% -11.31% 0.87% -1.88% 0.04%

自基金合同生效日(2013.08.15)起至 2016.6.30 -7.62% 1.68% -1.68% 1.90% -
5.94% -0.22%

十四、基金的费用

(一)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。

(二)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2-5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2-5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。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

银华中证转债指数增强分级证券投资基金招募说明书依据《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》及其它有关法律法规的要求，对本基金原更新招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期；
- 2、在“三、基金管理人”部分，对基金管理人的相关情况进行了更新。
- 3、在“四、基金托管人”部分，对基金托管人的基本情况进行了更新。
- 4、在“五、相关服务机构”部分，增加了部分代销机构，并更新了部分代销机构的信息。
- 5、在“十、（七）申购与赎回的数额限制”部分，更新了本基金赎回的最低份额和最低保有份额。
- 6、在“十二、基金的投资”部分，更新了最近一期投资组合报告的内容。
- 7、在“十三、基金的业绩”部分，新增了基金合同生效至2016年6月30日的

基金投资业绩。

8、在“二十六、其他应披露事项”，列出了自上次招募说明书公告之日以来涉
及本基金的重要公告；

9、对部分表述进行了更新。

银华基金管理股份有限公司

2016年9月29日