银华中证转债指数增强分级证券投资基金
2020年第2季度报告

2020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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2020年7月18日

cninf 巨潮资讯
www.cninfo.com.cn

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 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 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银华中证转债指数增强分级
场内简称	中证转债
交易代码	161826
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 8 月 15 日
报告期末基金份额总额	79,239,843.33 份
投资目标	本基金为增强型可转债指数基金，指数投资部分采用被动指数化投资策略，指数增强部分采取积极配置策略，利用可转债兼具债券和股票的特性，争取为投资者获得超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.5%以内，年跟踪误差控制在 5%以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金投资策略包括指数投资策略和指数增强策略。 本基金的投资组合比例为：投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证转债指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金非现金资产的 80%；本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准	95%×中证可转换债券指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为债券型基金，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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	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。		
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		
下属分级基金的基金简称	转债 A 级	转债 B 级	中证转债
下属分级基金的交易代码	150143	150144	161826
报告期末下属分级基金的份额总额	16,815,325.00 份	7,206,567.00 份	55,217,951.33 份
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较低风险、较低预期收益。

§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（ 2020 年 4 月 1 日 － 2020 年 6 月 30 日 ）
1.本期已实现收益	-114,692.78
2.本期利润	-1,216,407.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0219
4.期末基金资产净值	82,000,163.25
5.期末基金份额净值	1.035

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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、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 本报告期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	-2.17%	0.47%	-1.76%	0.43%	-0.41%	0.04%
过去六个月	-4.96%	0.77%	-1.73%	0.68%	-3.23%	0.09%
过去一年	4.77%	0.62%	8.02%	0.55%	-3.25%	0.07%
过去三年	5.64%	0.69%	17.33%	0.62%	-11.69%	0.07%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

过去五年	-21.58%	1.00%	-9.75%	1.14%	-11.83%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-4.27%	1.19%	18.41%	1.30%	-22.68%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：按基金合同的规定，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：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%。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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		
孙慧女士	本基金的基金经理	2016 年 2 月 6 日	-	9.5 年	硕士学位。2010 年 6 月至 2012 年 6 月任职中邮人寿保险股份有限公司投资管理部，任投资经理助理；2012 年 7 月至 2015 年 2 月任职于华夏人寿保险股份有限公司资产管理中心，任投资经理;2015 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，历任基金经理助理。自 2016 年 2 月 6 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 2016 年 2 月 6 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 2016 年 2 月 6 日起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 2016 年 10 月 17 日至 2018 年 2 月 5 日兼任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月 17 日至 2018 年 6 月 26 日兼任银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 12 月 22 日起兼任银华远景债券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 2018 年 3 月 7 日起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 2018 年 8 月 31 日起兼任银华可转债债券型证券投资基金基金

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

					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。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、由于本基金基金经理孙慧女士因个人原因（休产假）无法正常履行职务，本基金管理人决定自 2020 年 3 月 19 日起暂由本公司基金经理王智伟先生代为管理本基金。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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，本基金管理人所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年 2 季度，“新冠”疫情经过爆发期，逐渐进入后半场。国内经济走过疫情初期的失速阶段，尽管各行业回升步伐存在差异，但总体仍然展现出向上修复的趋势，并且海外经济体同样走过最差阶段，全球性衰退的压力显著缓解。在此背景下，全球风险资产普遍表现较好。具体到国内，2 季度 A 股市场震荡上行，尤其是外需受损逻辑的行业走势发生逆转，出现显著修复。风格上，成长再次领涨，创业板指、中小板指均率先创出阶段新高。行业方面，大消费板块表现超出市场预期，传媒、电子、计算机、电动车表现也较好。债券市场则在疫情发展阶段的变化以及货币政策重心的切换下，收益率于 5 月初起开始持续向上调整。其中，短端资金利率向上靠拢公开市场政策利率，带动收益率体系经历重定价过程。转债市场先抑后扬，5 月中旬受整体估值高企、权益阶段性趋势不明、债券市场显著调整的共同压力下，一度出现主动压缩估值的下跌行情；后随着估值重回历史中性区间以及权益市场结构性亮点不断涌现，转债市场再度焕发活力，其中个券机会优于指数。

2 季度，本基金根据对市场的判断进行了一定幅度的波段操作，结构上根据市场特征进行了阶段性的优化，总体与指数保持一致。但规模变动、个券停牌、流动性差异等原因，导致与指数存在一定的偏差。

展望 2020 年 3 季度，“后疫情”时期的经济恢复趋势预计仍将延续，但考虑到本轮政策刺激的总力度较为克制以及疫情防控常态化对经济运行施加的摩擦成本，名义经济增速的回升幅度预计温和，资本市场目前一定程度上反映了经济改善的乐观预期。权益方面，预计未来寻找结构性机会更为重要。债券方面，关注收益率调整后与宏观环境的匹配程度以及相应的配置价值，同时在曲线上寻找相对优势品种。转债方面，当前整体估值水平较为中性，未来板块性机会仍需依赖于底层权益资产的表现，以自下而上个券挖掘为主。

3 季度，本基金将继续跟踪指数，通过积极的波段操作和精选品种来增强收益。

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 1.035 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.17%，业绩比较基准收益率为-1.76%。

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	71,813,725.67	87.11
	其中：债券	71,813,725.67	87.11
	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	10,356,555.82	12.56
8	其他资产	273,880.52	0.33
9	合计	82,444,162.01	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。

5.2.2 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。

5.2.3 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股票投资。

5.3 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

5.3.1 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。

5.3.2 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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,320,471.00	5.27
	其中：政策性金融债	4,320,471.00	5.27
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）	67,493,254.67	82.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	71,813,725.67	87.58

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	110059	浦发转债	102,450	10,434,532.50	12.73
2	110053	苏银转债	85,390	9,044,508.80	11.03
3	113021	中信转债	85,400	8,940,526.00	10.90
4	113011	光大转债	48,480	5,529,628.80	6.74
5	018007	国开 1801	43,140	4,320,471.00	5.27

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。

5.10 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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,655.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	271,224.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	273,880.52

5.11.4 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	110059	浦发转债	10,434,532.50	12.73
2	110053	苏银转债	9,044,508.80	11.03
3	113021	中信转债	8,940,526.00	10.90
4	113011	光大转债	5,529,628.80	6.74
5	113516	吴银转债	2,161,803.80	2.64
6	128080	顺丰转债	1,183,689.00	1.44
7	113026	核能转债	999,400.00	1.22
8	113013	国君转债	939,244.60	1.15
9	110047	山鹰转债	755,748.10	0.92
10	128035	大族转债	708,737.20	0.86
11	127005	长证转债	680,944.32	0.83
12	110061	川投转债	655,292.00	0.80
13	113020	桐昆转债	652,791.00	0.80
14	127012	招路转债	646,686.60	0.79
15	110051	中天转债	634,214.40	0.77
16	113009	广汽转债	565,601.40	0.69

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

17	128086	国轩转债	509,541.60	0.62
18	113022	浙商转债	497,896.10	0.61
19	110062	烽火转债	490,110.30	0.60
20	113544	桃李转债	469,594.40	0.57
21	128045	机电转债	455,259.92	0.56
22	128029	太阳转债	435,998.14	0.53
23	128078	太极转债	419,716.50	0.51
24	128081	海亮转债	417,869.01	0.51
25	110034	九州转债	411,986.40	0.50
26	128084	木森转债	408,916.20	0.50
27	110042	航电转债	402,636.00	0.49
28	113508	新凤转债	398,627.70	0.49
29	110043	无锡转债	393,455.90	0.48
30	110048	福能转债	392,557.50	0.48
31	113014	林洋转债	389,816.90	0.48
32	113024	核建转债	383,191.50	0.47
33	113551	福特转债	379,633.80	0.46
34	110065	淮矿转债	372,309.10	0.45
35	113028	环境转债	369,863.00	0.45
36	113543	欧派转债	366,950.50	0.45
37	128048	张行转债	359,037.54	0.44
38	123022	长信转债	347,536.80	0.42
39	110056	亨通转债	342,691.20	0.42
40	128074	游族转债	322,134.00	0.39
41	113534	鼎胜转债	319,633.70	0.39
42	113518	顾家转债	306,796.50	0.37
43	113550	常汽转债	305,193.20	0.37
44	128088	深南转债	304,808.64	0.37
45	113025	明泰转债	291,298.80	0.36
46	110031	航信转债	291,249.00	0.36
47	110057	现代转债	275,717.70	0.34
48	110038	济川转债	267,055.20	0.33
49	127013	创维转债	259,558.80	0.32
50	110041	蒙电转债	255,792.00	0.31
51	128067	一心转债	254,142.10	0.31
52	113029	明阳转债	246,110.50	0.30
53	128071	合兴转债	238,657.90	0.29
54	128034	江银转债	233,215.81	0.28
55	113545	金能转债	218,462.00	0.27
56	110052	贵广转债	216,180.00	0.26
57	128046	利尔转债	215,667.90	0.26

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

58	113553	金牌转债	207,548.10	0.25
59	113558	日月转债	204,265.60	0.25
60	128010	顺昌转债	191,316.72	0.23
61	113017	吉视转债	188,347.00	0.23
62	127007	湖广转债	162,557.36	0.20
63	110033	国贸转债	152,435.10	0.19
64	123036	先导转债	152,269.80	0.19
65	110060	天路转债	151,996.50	0.19
66	128028	赣锋转债	149,747.88	0.18
67	128019	久立转 2	138,874.50	0.17
68	113016	小康转债	127,129.20	0.16
69	128065	雅化转债	126,105.00	0.15
70	123035	利德转债	118,065.00	0.14
71	128058	拓邦转债	115,159.80	0.14
72	113542	好客转债	114,723.80	0.14
73	128083	新北转债	114,225.60	0.14
74	128023	亚太转债	103,375.60	0.13
75	113509	新泉转债	102,973.00	0.13
76	128032	双环转债	101,314.50	0.12
77	123017	寒锐转债	100,528.00	0.12
78	123025	精测转债	97,518.50	0.12
79	128059	视源转债	89,401.32	0.11
80	132013	17 宝武 EB	78,717.10	0.10
81	128022	众信转债	69,088.56	0.08
82	113012	骆驼转债	57,629.60	0.07
83	123033	金力转债	47,999.60	0.06
84	128036	金农转债	14,447.40	0.02
85	128033	迪龙转债	8,335.95	0.01
86	113030	东风转债	5,449.00	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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。

5.11.6 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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	转债 A 级	转债 B 级	中证转债
报告期期初基金份额总额	18,435,727.00	7,901,025.00	23,482,660.96
报告期期间基金总申购份额	-	-	33,758,740.50
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	4,338,310.13
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-1,620,402.00	-694,458.00	2,314,860.00
报告期期末基金份额总额	16,815,325.00	7,206,567.00	55,217,951.33

注：如有相应情况，拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算后的调整份额。

§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未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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020/04/01-2020/06/09	10,171,901.82	0.00	0.00	10,171,901.82	12.84%
	2	2020/06/10-2020/06/30	0.00	33,717,726.00	0.00	33,717,726.00	42.55%
产品特有风险							
投资人在投资本基金时，将面临本基金的特有风险，具体包括： 1）当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权； 2）在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；							

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
4）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
5）当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2020 年 6 月 9 日发布《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，会议审议《关于终止银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同以及转债 A 份额、转债 B 份额终止上市有关事项的议案》。

§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中证转债指数增强分级证券投资基金募集的文件

9.1.2《银华中证转债指数增强分级证券投资基金招募说明书》

9.1.3《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》

9.1.4《银华中证转债指数增强分级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住所。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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

2020 年 7 月 18 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn