

## 银华恒生中国企业指数分级证券投资基金

### 2015 第一季度报告

2015年3月31日

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	143,202,351.12	35.00
	- 其中: 普通股	143,202,351.12	35.00
	- 其他权益投资	-	-
	- 资产支持证券	-	-
	- 结构化主体	-	-
	- 应收款项类投资	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	- 其中: 债券	-	-
	- 资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	- 其中: 远期	-	-
	- 期货	-	-
	- 权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	- 其中: 买入返售金融资产	-	-
6	银行存款	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,243,092.62	1.53
8	其他资产	259,675,796.49	63.47
9	合计	409,122,060.23	100.00

**5.2 报告期末在不同国家/地区证券市场的股票及存托凭证投资分布**

国家/地区	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	143,202,351.12	35.14
合计	143,202,351.12	35.14

**注:** 1. 投资组合中“地区”指股票投资所在地。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	Bank of China Ltd.	4,614,000	4.02
2	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	3,320,000	3.69
3	China Life Insurance Group Co., Ltd.	517,000	3.41
4	Ping An Insurance Group Co., Ltd.	183,500	3.32
5	PetraChina Gas Co., Ltd.	1,346,000	2.26
6	China Petroleum & Chemical Corporation	1,634,000	1.54
7	Agricultural Bank of China Ltd.	1,577,000	1.18
8	China Merchants Bank	292,500	1.08
9	China Pacific Insurance Company Co., Ltd.	141,200	0.91
10	China Telecom Corporation Ltd.	984,000	0.95

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	1,009.14	-
5	其他应收款	259,674,791.35	-
6	待摊费用	-	-
7	持有待售资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	259,675,796.49	-

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

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  
报告送出日期: 2015年4月22日

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	520,544,255.51	92.59
	- 其中: 普通股	520,544,255.51	92.59
2	固定收益投资	-	-
	- 其中: 债券	-	-
3	基金投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	- 其中: 远期	-	-
	- 期货	-	-
	- 权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	- 其中: 买入返售金融资产	-	-
6	银行存款	-	-
7	其他资产	5,875,240.01	1.01
8	合计	562,180,222.33	100.00

**注:** 1. 投资组合中“地区”指股票投资所在地。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	Bank of China Ltd.	4,614,000	4.02
2	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	3,320,000	3.69
3	China Life Insurance Group Co., Ltd.	517,000	3.41
4	Ping An Insurance Group Co., Ltd.	183,500	3.32
5	PetraChina Gas Co., Ltd.	1,346,000	2.26
6	China Petroleum & Chemical Corporation	1,634,000	1.54
7	Agricultural Bank of China Ltd.	1,577,000	1.18
8	China Merchants Bank	292,500	1.08
9	China Pacific Insurance Company Co., Ltd.	141,200	0.91
10	China Telecom Corporation Ltd.	984,000	0.95

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

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  
报告送出日期: 2015年4月22日

## 银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)

### 2015 第一季度报告

2015年3月31日

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	- 其中: 普通股	-	-
	- 优先股	-	-
	- 资产支持证券	-	-
	- 结构化主体	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	143,197,270.62	60.33
	- 其中: 债券	-	-
	- 资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	- 其中: 远期	-	-
	- 期货	-	-
	- 权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	- 其中: 买入返售金融资产	-	-
6	银行存款	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	93,715,626.36	39.49
8	其他资产	427,969.69	0.18
9	合计	237,340,866.67	100.00

**注:** 1. 投资组合中“地区”指股票投资所在地。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	PORTHARBERS DE OIL	25,163,364.96	10.98
2	FOK-BASKADAR BERTH E-BL	24,311,577.26	10.53
3	GOLDMANSACH-S&P GSCI	23,744,015.72	10.36
4	IPAT GOLDMAN SACHS CREDIT	10,926,025.47	4.77
5	UNITED STATES OF FLUND LP	10,850,294.58	4.73
6	ISHARES ASB CHINA TR	10,534,797.00	4.60
7	SPIR GOLD TRUST	8,377,469.42	3.65
8	POWER GENERATOR DR OIL FUND	8,285,827.80	3.61
9	UNITED STATES BRENT	6,569,561.99	2.87
10	SUVEEN CRESHAM DIV COMMERCIAL	4,811,052.18	2.10

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	12,720.00	-
5	其他应收款	415,234.69	-
6	待摊费用	-	-
7	持有待售资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	427,969.69	-

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

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  
报告送出日期: 2015年4月22日

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	12,720.00	-
5	其他应收款	415,234.69	-
6	待摊费用	-	-
7	持有待售资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	427,969.69	-

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	Bank of China Ltd.	4,614,000	4.02
2	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	3,320,000	3.69
3	China Life Insurance Group Co., Ltd.	517,000	3.41
4	Ping An Insurance Group Co., Ltd.	183,500	3.32
5	PetraChina Gas Co., Ltd.	1,346,000	2.26
6	China Petroleum & Chemical Corporation	1,634,000	1.54
7	Agricultural Bank of China Ltd.	1,577,000	1.18
8	China Merchants Bank	292,500	1.08
9	China Pacific Insurance Company Co., Ltd.	141,200	0.91
10	China Telecom Corporation Ltd.	984,000	0.95

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

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  
报告送出日期: 2015年4月22日

## 银华沪深300指数分级证券投资基金

### 2015 第一季度报告

2015年3月31日

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,505,448.93	0.27
	- 其中: 普通股	23,243,977.77	4.23
	- 优先股	-	-
	- 资产支持证券	-	-
	- 结构化主体	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	127,769,702.12	31.45
	- 其中: 债券	127,769,702.12	31.45
4	金融衍生品投资	-	-
	- 其中: 远期	-	-
	- 期货	-	-
	- 权证	-	-
5	买入返售金融资产	25,114,132.27	2.56
	- 其中: 买入返售金融资产	12,968,977.38	4.37
6	银行存款	-	-
7	其他资产	12,421,790.73	2.26
8	合计	149,159,574.05	100.00

**注:** 1. 投资组合中“地区”指股票投资所在地。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	Bank of China Ltd.	4,614,000	4.02
2	Industrial and Commercial Bank of China Ltd.	3,320,000	3.69
3	China Life Insurance Group Co., Ltd.	517,000	3.41
4	Ping An Insurance Group Co., Ltd.	183,500	3.32
5	PetraChina Gas Co., Ltd.	1,346,000	2.26
6	China Petroleum & Chemical Corporation	1,634,000	1.54
7	Agricultural Bank of China Ltd.	1,577,000	1.18
8	China Merchants Bank	292,500	1.08
9	China Pacific Insurance Company Co., Ltd.	141,200	0.91
10	China Telecom Corporation Ltd.	984,000	0.95

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

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  
报告送出日期: 2015年4月22日

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	12,720.00	-
5	其他应收款	415,234.69	-
6	待摊费用	-	-
7	持有待售资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	427,969.69	-

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

序号	名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	12,720.00	-
5	其他应收款	415,234.69	-
6	待摊费用	-	-
7	持有待售资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	427,969.69	-

**注:** 1. 以上数据按照公允价值计量。2. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。3. 本基金投资于境外股票资产，其公允价值按照公允价值计量。

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  
报告送出日期: 2015年4月22日