# 银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金

## 2015 半年度报告摘要

2015年6月30日

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
送出日期：2015年8月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2015年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要编自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金名称 | 银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金 | | |
| 基金简称 | 银华中证800等权重指数增强分级 | | |
| 场内简称 | 800分级 | | |
| 基金主代码 | 161825 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2013年11月5日 | | |
| 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 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 148,341,582.72份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 | | |
| 上市日期 | 2013-12-11 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中证800A | 中证800B | 800分级 |
| 下属分级基金的交易代码 | 150138 | 150139 | 161825 |
| 报告期末下属分级基金份额总额 | 49,546,701.00份 | 49,546,701.00份 | 47,248,180.72份 |

注：本基金管理人于2015年4月30日发布公告，自2015年5月4日起将本基金的基础份额的场内简称由“银华800”变更为“800分级”。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为获得指数增强型基金，本基金在对中证800等权重指数进行有效跟踪的基础上，通过量化投资技术与基本面分析相结合的方法对目标指数进行积极的组合管理与风险控制，力争可观超越目标指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金以中证800等权重指数为目标指数，以有效复制目标指数的基础上，结合量化投资技术与基本面分析对投资组合进行积极的管理与风险控制，本基金在控制投资组合与金融比较基准跟踪误差的基础上，力争获得超越金融比较基准的收益。<br>当股票或债权发生调整，或份额发生配股、增发、分红等行为，以及因基金份额申购和赎回对本基金跟踪中证800指数权重指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内，出现特殊情况(比如市场流动性不足，个别成份股被限制投资等)导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将据配使用其他合理方法(如买入替代股票等)进行适当的替代。<br>本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为80%-95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的80%，投资于中证800等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。 |
| 业绩比较基准 | 95%×中证800等权重指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 低风险、收益相对稳定。 低风险、高预期收益 较高风险、较高预期收益。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 银华基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨文辉 | 王东民 |
| | 联系电话 | (010)58162800 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | yhjd@yhfund.com.cn | tfxd@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 4006783333,(010)85186558 | 95566 |
| 传真 | | (010)58162827 | (010)66594942 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本报告全年年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.yhfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 38,084,243.15 |
| 本期利润 | 31,470,922.08 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3572 |
| 本期加权平均净值利润率 | 31.24% |
| 本期基金份额净值增长率 | 48.02% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 65,613,981.77 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4423 |
| 期末基金资产净值 | 127,490,213.49 |
| 期末基金份额净值 | 0.859 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2015年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 105.93% |

注：1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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.期末可供分配利润采用期末资产负债表中分配利润与未分配利润中已实现部分的较低数。

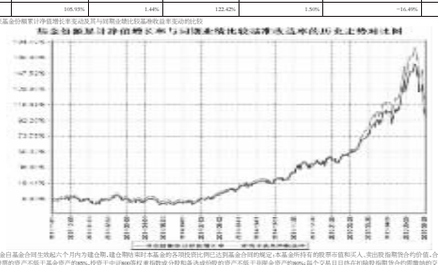
3.加权平均可供基金份额利润=期末可供分配利润/期末基金份额总数。

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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -9.67% | 3.53% | -8.30% | 3.56% | -1.37% | -0.03% |
| 过去三个月 | 17.14% | 2.67% | 20.62% | 2.69% | -3.48% | -0.02% |
| 过去六个月 | 48.02% | 2.10% | 57.37% | 2.14% | -9.35% | -0.04% |
| 过去一年 | 109.94% | 1.64% | 122.24% | 1.69% | -12.30% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 105.93% | 1.44% | 122.42% | 1.50% | -16.49% | -0.06% |

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：根据合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期内基金的各项投资比例应达到基金合同的规定。本基金的持有的股票市值和买入、卖出股指期货的价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为80%-95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的80%，投资于中证800等权重指数成分股和备选成分股的资产不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于2004年5月24日，是经中国证监会批准设立基金字[2004]19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，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司49%、第一创业证券股份有限公司28%、东方证券股份有限公司15%及江西赣南采业股份有限公司8%。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。

截至2015年6月30日，本基金管理人管理基金种类涵盖股票型基金、债券型基金、货币市场型基金、混合型基金、QDII基金、股票型指数基金、债券型指数基金、银华中证中小盘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、银华深证100指数分级证券投资基金、银华沪深300指数证券投资基金（LOF）、银华沪深300指数证券投资基金（ETF）、银华沪深300指数证券投资基金（ETF联接）、银华沪深300指数证券投资基金（LOF联接）、银华中证中小盘指数证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华中证800等权重指数证券投资基金（LOF）、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、银华中证800等权重指数交易型开放式指数证券投资基金（LOF）、银华永利债券型证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华信用双债债券型证券投资基金、银华中证国债指数增强分级证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华信用季利债券型证券投资基金、银华信用增利债券型证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华信用年利债券型证券投资基金、银华多利定期开放债券型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、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、银华中证500指数增强型交易型证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证国债指数证券投资基金、银华信用增利债券型证券投资基金、银华信用年利债券型证券投资基金、银华多利定期开放债券型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、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、银华中证500指数增强型交易型证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证国债指数证券投资基金、银华信用增利债券型证券投资基金、银华信用年利债券型证券投资基金、银华多利定期开放债券型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、银华长利混合型证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级