

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
基金合同生效日期:2014年4月9日

Table with 4 columns: 基金名称, 基金简称, 场内简称, 基金主代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日

2.1 基金基本情况
基金名称: 银华恒生前中国指数分级证券投资基金
基金简称: 银华恒生前中国指数分级(QDII)

2.2 基金产品说明
投资目标: 本基金力争对恒生前中国指数进行有效跟踪,并力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪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,以实现基金资产的长期增值。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 境外资产托管人
名称: JP Morgan Chase Bank, N.A.
地址: 1111 Pallas Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.

2.5 信息披露方式
基金管理人年度报告正文的披露网站: http://www.yhfund.com.cn
基金管理人基金托管人办公地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦37楼

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期主要会计数据和财务指标
3.1.2 本报告期末主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期
3.1.1 本期主要会计数据和财务指标
3.1.2 本报告期末主要会计数据和财务指标

3.2 基金业绩比较基准
3.2.1 基金业绩比较基准
3.2.2 基金业绩比较基准的说明

Table with 5 columns: 期间, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准, 超额收益, 跟踪误差

3.3 基金投资组合报告
3.3.1 基金投资组合报告
3.3.2 基金投资组合报告附注

3.3.1 基金投资组合报告
截至2015年6月30日,本基金资产组合如下:
股票投资: 9,373,882,868.94

3.3.2 基金投资组合报告附注
本基金本报告期末持有股票投资共1,135笔,持仓总市值人民币1,038.8亿元,持仓股票数量1,135,794,294股,持仓股票市值人民币1,038.8亿元,持仓股票数量1,135,794,294股,持仓股票市值人民币1,038.8亿元。

4. 基金管理人及基金托管人
4.1 基金管理人及其管理基金的情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况
银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日,是中国证监会批准设立的首批24家基金管理公司之一,注册资本12亿元人民币,股权结构为:银华国际信托有限公司10%,银华国际信托有限公司10%,银华国际信托有限公司10%。

4.1.2 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.3 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.4 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.5 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.6 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.7 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.8 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.9 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.10 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.11 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.12 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.13 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

4.1.14 基金管理人及其管理基金的情况
银华恒生前中国指数分级证券投资基金,基金合同于2014年4月9日生效,截至2015年6月30日,基金资产净值为人民币9,373,882,868.94元,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额为9,373,882,868.94份。

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

Table with 2 columns: 项目, 期末余额, 期初余额
资产总计: 9,373,882,868.94

7.1 基金的投资组合报告
7.1.1 报告期末基金资产组合情况
7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例
Health Care: 113,854,038.85

7.1.3 报告期末按公允价值计量的前十名股票投资组合
7.1.4 报告期末按公允价值计量的前十名债券投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(中文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.5 报告期末按公允价值计量的前十名权证投资组合
7.1.6 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.7 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.8 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.9 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.10 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.11 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.12 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.13 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.14 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.15 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.16 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.17 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.18 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.19 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.20 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.21 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.22 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.23 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.24 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.25 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.26 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.1.27 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.1.28 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 公司名称(英文), 公允价值, 占基金资产净值比例
1. Bank Of China Limited: 92,018,973.72

7.5.3 权益投资的买入或卖出总额及卖出总额
7.5.4 权益投资的买入或卖出总额及卖出总额

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.6 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.6.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.7 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.7.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.8 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.8.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.9 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.9.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.10 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.10.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.11 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.11.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.12 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.12.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.13 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.13.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.14 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.14.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.15 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.15.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.16 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.16.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.17 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.17.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.18 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.18.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.19 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.19.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合

Table with 2 columns: 序号, 衍生品类别, 衍生品名称, 公允价值, 占基金资产净值比例

7.20 期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合
7.20.1 报告期末按公允价值计量的前十名衍生品投资组合