

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

公告日期：2015年8月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的承诺：本基金管理人承诺以诚实信用、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。本基金为指数型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金，低于股票基金，与债券基金相比，本基金的预期风险和预期收益水平均较高。本基金投资于股票，因此所面临的风险也较高，包括市场风险、管理风险、操作风险等。

基金合同由基金管理人和基金托管人根据法律法规及基金合同的原则，经双方协商一致，于2015年6月18日在基金合同成立之日（即基金合同生效日）在基金合同中约定的基金合同成立之日（即基金合同生效日）起生效。基金合同的成立日为基金合同生效日。

基金合同的成立日并不表示未来出现。投资者风险，投资者应当仔细阅读基金合同、基金招募说明书及相关法律文件，了解基金的风险收益特征。

本年度报告摘要仅对年度报告正文进行简述，投资者欲了解详细情况，请阅读年度报告全文。

基金定期报告，基金年度报告摘要的披露时间不晚于6月30日。

§ 2 基金简介

1.1 基金概况

基金名称 中证中证中票50指数债券型证券投资基金(LOF)

基金简称 银华中证50

基金代码 161821

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2012年12月13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

报告期起至报告期止 479,802,486.00

基金资产净值总额 479,802,486.00

基金份额净值 不适用

基金总资产 2013年1月18日

下属分级基金的基金简称： 银华50A 银华50C

下属分级基金的基金代码： 161821 161822

报告期末下属分级基金的份额总额 4,507,422,699份

2.2 基金产品类型

本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市况下，本基金净值的增长将与业绩比较基准之间的差距控制在不超过2%的范围内，力争跟踪误差不超过1%。

本基金的被动式指数化投资，采用优化技术，主要依赖于指数成份股的构成基础，综合考虑跟踪效果、操作风险、交易成本等因素，选取适当的指数成份股作为投资对象，以获得与指数相似的回报。

本基金的投资组合比例为：基金资产中持有货币市场工具的比例不低于基金资产的5%，其中中证中票50债券指数成份券所占比例不低于基金资产的90%；本基金现金或到期日在一年以内的政府债券不高于基金资产的5%。

业绩比较基准 中证中票50指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

本基金基于证券市场的较低风险品种，其主要风险来自于指数跟踪误差的偏差，低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用指数复制策略跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相当，以及与指数代表的中证中票市场的风格收敛特征。

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

姓名 杨文斌 王永民

信息披负责人 联系电话 010-881613000 010-66594896

电子邮件 yh@yhfund.com.cn lei@bocchina.com

客户服务电话 4006733333,01095199668 95566

传真 010-88163027

2.4 报告期间披露方式

登载基金半年度报告正文本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

3.1 主要会计政策和财务制度

金额单位：人民币元

基金申购 银华50A 银华50C

3.1.1 期间数据和指标 报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

本期初余额 16,693,715.20

本期末余额 26,793,418.77

增加收入 0.0620

减少支出 0.1191

本期平均收益率 4.72% 10.4%

本期基金的申购费率 4.00% 4.75%

本期基金的赎回费率 4.00% 4.75%

3.1.2 利润数据和指标 报告期:2015年6月30日

本期利润 35,007,831.65

收入 0.0377

费用 0.0667

本期利润分配比例 5,026,118.41

1.115

3.1.3 期末未折价 报告期:2015年6月30日

12.30% 11.76%

3.2 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

0.40% 0.02%

3.3 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

0.40% 0.02%

3.4 基金净值的变动幅度及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.5 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.6 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.7 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.8 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.9 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.10 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.11 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.12 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.13 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.14 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.15 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.16 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.17 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.18 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.19 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.20 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.21 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.22 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.23 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.24 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.25 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.26 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.27 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.28 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.29 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.30 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.31 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.32 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.33 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.34 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.35 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.36 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.37 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.38 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.39 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.40 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

3.41 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50C

4.00% 0.02%

3.42 本期利润的摊薄增长比率及其与同期业绩比较基准收益率的比值 银华50A

4.00% 0.02%

</