

Disclosure

银华-道琼斯88 精选证券投资基金 2007年半年度报告摘要

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

第一节 重要提示 基金管理人的董事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...

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...

第二节 基金简介 基金名称:银华-道琼斯88 精选证券投资基金 基金代码:180003 基金运作方式:契约型开放式

(二) 投资目标:本基金将运用增强型指数化投资策略,通过严格的投资流程和数量化风险管理,在对标的指数有效跟踪的基础上力求取得高于指数的投资收益...

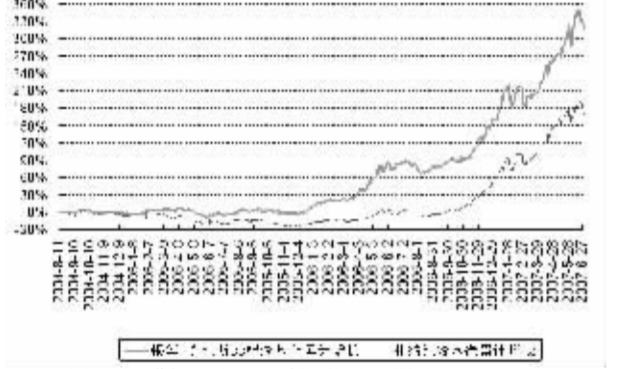
投资范围:本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括道琼斯中国88指数的成份A股及其备选的股、新股及增发股、债券资产(国债、金融债、企业债、可转债等债券资产)以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具...

业绩比较基准:道琼斯中国88指数 (三) 基金管理人名称:银华基金管理有限公司 注册地址:深圳市福田区益田路5033号 办公地址:深圳市深南大道6008号报业大厦十九层

Table with 2 columns: 基金本期净收益, 基金本期净收益增长率, 基金本期净收益增长率与业绩比较基准收益率比较表

Table with 2 columns: 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, 净值比较基准收益率标准差④

三、基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1.根据《银华-道琼斯88 精选证券投资基金基金合同》的规定: 1. 本基金股票资产投资比例上限调整为96%,且不低于基金资产5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

第四节 管理人报告 银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日,是经中国证监会批准注册基金字[2001]7号文设立的全国性基金管理公司...

二、基金情况简介 本基金管理人管理有银华-道琼斯88 精选证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯88 精选证券投资基金、银华核心价值优选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华优质增长股票证券投资基金、银华货币市场证券投资基金

三、遵守法律法规情况 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施细则、《银华-道琼斯88 精选证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定...

四、投资策略 2007年上半年,市场经历了对题材股、低价股等的追捧—成长品种的挖掘—价值蓝筹的回归过程。2007年5月30日前期股的单边快速上涨积累了调整的压力,低价股、题材股等过度炒作带来了市场的阶段性回调...

五、投资组合报告 (一) 基金投资组合报告 银华道琼斯88 精选证券投资基金 截止2007年6月30日 资产负债表 单位:人民币元

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

A. 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,计算方法如下: H=E×0.25%/当年天数 H为每日应支付的基金托管费 E为前一日基金资产净值

六、投资组合报告 (一) 基金投资组合报告 银华道琼斯88 精选证券投资基金 截止2007年6月30日 资产负债表 单位:人民币元

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Assets include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, 应收股利, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产. Liabilities include 应付利息, 应付股利, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债.