

深证民营交易型开放式指数证券投资基金  
[2015]第四季度报告基金管理人:鹏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:2016年1月21日  
重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告期间不存虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、持有人信息等数据,保证复核内容不存在虚假记载、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。

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。

本报告期财务数据未经审计。

2.2 基金产品概况

基金简称:深证民营ETF  
基金代码:160911  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
基金合同生效日:2011年01月20日  
报告期末基金份额总额:14,272,460,400份报告期末基金份额净值:0.9950元  
基金类别:股票型基金  
报告期期间费率:0.50%

基金投资目标:本基金主要投资于深证民营指数成份股,跟踪深证民营指数,力求在风险调整后收益最大化。

基金投资范围:本基金主要投资于深证民营指数成份股,并根据深证民营指数成份股的构成比例,投资于深证民营指数成份股、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股票期权、股指期货等金融工具,但本基金不投资于股票期权、股指期货等金融工具。

基金投资策略:本基金主要投资于深证民营指数成份股,并根据深证民营指数成份股的构成比例,投资于深证民营指数成份股、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股票期权、股指期货等金融工具,但本基金不投资于股票期权、股指期货等金融工具。

基金业绩比较基准:深证民营指数(深证)。跟踪深证民营指数成份股,并根据深证民营指数成份股的构成比例,投资于深证民营指数成份股、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股票期权、股指期货等金融工具,但本基金不投资于股票期权、股指期货等金融工具。

基金费率:本基金主要投资于深证民营指数成份股,并根据深证民营指数成份股的构成比例,投资于深证民营指数成份股、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股票期权、股指期货等金融工具,但本基金不投资于股票期权、股指期货等金融工具。

基金管理人:鹏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

报告期期间费率:0.50%

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 382,424.48

2.本期利润 14,590,778.13

3.期初平均基金份额利润 0.0574

4.期末基金份额净值 73.315,031.82

5.期末基金份额净值 51.3698

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 22.95% 2.10% 22.80% -2.00% -1.20% -0.02%

注:1.业绩比较基准=深证民营指数(深证)×75%+中证综合债指数(收益)×25%;

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.2 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 27.28% 1.85% 22.80% -2.55% 4.43% 0.60%

注:1.业绩比较基准=深证民营指数(深证)×75%+中证综合债指数(收益)×25%;

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3 本基金净值表现

3.2.1.1 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.2.1 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.2.2 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.1 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.2 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.3 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.4 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.5 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.6 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.7 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.8 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.9 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.10 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.11 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.12 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.13 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.14 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.2.3.15 本基金报告期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 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.90% - - - -

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;