

鹏华上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金融接基金

[2015] 年度报告摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016年3月30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。本基金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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月25日核对了本基金的财务指标、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，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚信义务、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。

本年度报告摘要须自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华上证民企50ETF联接
场内简称	-
基金代码	200006
交易代码	200006
基金的运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月16日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	57,193,232.00
基金份额净值	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金融接基金
基金代码	610070
基金的运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年5月16日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	57,193,232.00
基金份额净值	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
本基金为被动式指数基金，以上证民营企业50ETF为投资对象，主要投资于股票，方便特定客户通过本基金间接投资于上证民营企业50指数成份股，从而达到与该指数相似的收益水平。	
投资策略	本基金通过完全复制法，即完全按照标的指数的构成比例，投资于标的指数所包含的全部股票，使基金的收益与标的指数的表现相一致。
业绩比较基准	上证民营企业50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益水平高于混合型基金、债券基金与货币市场基金，为证券投资基金中的高风险品种。本基金为指数型基金，具有与标的指数一致的风险特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
本基金采用完全复制法指数投资策略，原则上按照所选股票在上证民营企业50指数中的权重比例，投资于标的指数所包含的全部股票，使基金的收益与标的指数的表现相一致。	
投资策略	当预期成份股发生分红、派息、增发、送股等情况时，将根据成份股的除权除息系数调整投资组合；当成份股因停牌等原因不能正常进行交易时，或因某些特殊情形导致指数编制机构无法正常计算成份股的实时价格时，将根据指数编制机构的有关规定进行处理，或通过其他方法调整投资组合，以保证基金的跟踪效果。
业绩比较基准	上证民营企业50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，其预期的风险与收益水平高于混合型基金、债券基金与货币市场基金，为证券投资基金中的高风险品种。本基金为指数型基金，具有与标的指数一致的风险特征。

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	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	张戈	洪洲
信息披露负责人	赵晓东	0755-82262720
联系电话	0755-82262720	010-66105799
电子邮箱	zhangg@phfund.com.cn	caustdy@chic.com.cn
客户服务电话	4006789551	95588
传真	0755-82021126	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载年度报告正文的管理人互联网址	http://www.phfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区企业街1号深业上城16栋10楼深业上城16栋10楼鹏华基金管理有限公司

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元		
3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年
本期已实现收益	32,224,572.60	-1,094,201.32
本期利润	36,082,637.51	41,010,970.45
加权平均基金份额本期利润	0.4097	0.2202
本期份额净值增长率	23.07%	29.06%
3.1.2 期末数据	2015年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.4398	0.0328
期末基金资产净值	97,541,817.13	144,213,822.59
基金份额净值	1.531	1.244
3.1.3 总计	1,531	1,046

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各项费用(例如，开放式基金的申购费用、基金转换费用等)，计费费用后实际收益水平将低于票面。

(3)表中的“期末”即指报告期最后一日，即12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

注：本基金会业绩比较基准为上证民营企业50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

3.2.2 基金合同生息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：本基金会业绩比较基准为上证民营企业50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.4 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.5 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.6 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.7 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.8 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.9 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.10 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.11 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.12 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.13 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.14 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.15 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.16 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.17 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.18 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.19 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：(1)本基金合同于2010年8月5日生效。

2.截至本基金持仓结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

<p