

深证民营交易型开放式指数证券投资基金



配置错位的概率和机会成本相对较高,建议投资者从中长期投资的角度来考虑战略资产配置,避免短期频繁操作带来的风险。

本基金积极应对外部各种因素对指数跟踪效果带来的冲击,努力将跟踪误差控制在基金合同约定的范围内,力争为投资者带来较好的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

1.1 估值业务估值流程

根据《中国证券投资基金业协会公告》(2016年3月1日)关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见,本公司成立估值委员会,成员由基金经理、行业研究员、风控合规部、金融工程、登记结算部相关人员组成。

2. 估值委员会参与或决定基金日常估值

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论,发表相关意见和建议,与估值小组成员共同商定估值和限售。

3. 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 本公司没有与任何估值服务机构签订任何估值服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.截止本报告期末,本基金期末可供分配利润为26,211,282.5元,期末基金份额净值1.368元。

2. 本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守信情况

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人职责。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

5.6 审计报告

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。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

5.7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:深证民营交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产

负债和所有者权益

7.2 利润表

会计主体:深证民营交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

深证民营交易型开放式指数证券投资基金

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

2015年12月31日

7.4.5 差错更正说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]186号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税收法规和实际操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从事证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂减按20%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股期限自解禁日起计算,解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳印花税,买入股票不征收印花税和印花税。

7.4.7 关联方关系

7.4.8 关联方交易

7.4.9 关联方交易

7.4.10 关联方交易

7.4.11 关联方交易

7.4.12 关联方交易

7.4.13 关联方交易

7.4.14 关联方交易

7.4.15 关联方交易

7.4.16 关联方交易

7.4.17 关联方交易

7.4.18 关联方交易

7.4.19 关联方交易

7.4.20 关联方交易

7.4.21 关联方交易

7.4.22 关联方交易

7.4.23 关联方交易

7.4.24 关联方交易

7.4.25 关联方交易

7.4.26 关联方交易

7.4.27 关联方交易

7.4.28 关联方交易

7.4.29 关联方交易

7.4.30 关联方交易

7.4.31 关联方交易

7.4.32 关联方交易

7.4.33 关联方交易

7.4.34 关联方交易

7.4.35 关联方交易

7.4.36 关联方交易

7.4.37 关联方交易

7.4.38 关联方交易

7.4.39 关联方交易

7.4.40 关联方交易

7.4.41 关联方交易

7.4.42 关联方交易

7.4.43 关联方交易

7.4.44 关联方交易

7.4.45 关联方交易

7.4.46 关联方交易

7.4.47 关联方交易

7.4.48 关联方交易

7.4.49 关联方交易

7.4.50 关联方交易

7.4.51 关联方交易

7.4.52 关联方交易

7.4.53 关联方交易

7.4.54 关联方交易

7.4.55 关联方交易

7.4.56 关联方交易

7.4.57 关联方交易

7.4.58 关联方交易

7.4.59 关联方交易

7.4.60 关联方交易

7.4.61 关联方交易

7.4.62 关联方交易

7.4.63 关联方交易

7.4.64 关联方交易

7.4.65 关联方交易

7.4.66 关联方交易

7.4.67 关联方交易

7.4.68 关联方交易

7.4.69 关联方交易

7.4.70 关联方交易

7.4.71 关联方交易

7.4.72 关联方交易

7.4.73 关联方交易

7.4.74 关联方交易

7.4.75 关联方交易

7.4.76 关联方交易

7.4.77 关联方交易

7.4.78 关联方交易

7.4.79 关联方交易

7.4.80 关联方交易

7.4.81 关联方交易

7.4.82 关联方交易

7.4.83 关联方交易

7.4.84 关联方交易

7.4.85 关联方交易

7.4.86 关联方交易

7.4.87 关联方交易

7.4.88 关联方交易

7.4.89 关联方交易

7.4.90 关联方交易

7.4.91 关联方交易

7.4.92 关联方交易

7.4.93 关联方交易

7.4.94 关联方交易

7.4.95 关联方交易

7.4.96 关联方交易

7.4.97 关联方交易

7.4.98 关联方交易

7.4.99 关联方交易

7.4.100 关联方交易

7.4.101 关联方交易

7.4.102 关联方交易

7.4.103 关联方交易

7.4.104 关联方交易

7.4.105 关联方交易

7.4.106 关联方交易

7.4.107 关联方交易

7.4.108 关联方交易

7.4.109 关联方交易

7.4.110 关联方交易

2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

2.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

25 期末按债券品种分类的债券投资组合

26 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

27 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

29 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

30 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

31 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

32 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

33 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

34 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

35 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

36 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

37 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

38 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

39 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

40 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况

41 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况