

鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金

[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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会及本基金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。本年度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及其更新。

本年度报告摘要自年度报告正文,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	鹏华深证民营ETF联接
场内简称	-
基金主代码	2006010
交易代码	2006010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年01月21日
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
报告期末基金份额总额	38,721,512份(2016年1月22日)
基金净值公告日期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证民营交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	160911
基金运作方式	股票型开放式
基金合同生效日	2011年01月21日
基金管理人名称	鹏华基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.2 基产品说明

投资目标	通过投资于深证民营ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,以深证民营ETF作为主要投资标的,通过买入并持有深证民营ETF,本基金力争在扣除相关费用后获得与深证民营ETF相似的收益。
业绩比较基准	深证民营指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金,其预期的风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,为证券投资基金中的高风险品种。本基金通过投资于深证民营ETF跟踪标的指数表现,具有与标的指数相似的风险和收益特征。

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。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,按照成份股在标的指数中的权重比例构建并定期调整投资组合,并通过每日定期再平衡的手段,确保投资组合与标的指数的表现相一致。当预期成份股发生增发或送股分配、增发、分红派息、停牌、暂停上市或因基金申赎波动等对基金净值产生影响时,基金管理人将采取适当的应对措施,以确保本基金的跟踪效果,并将其与标的指数及目标指数所代表的公司的风险相对应。
业绩比较基准	深证民营指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金,其预期的风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,为证券投资基金中的高风险品种。本基金通过投资于深证民营ETF跟踪标的指数表现,具有与标的指数及目标指数所代表的公司的风险相对应。

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	中国建设银行股份有限公司
姓名	张戈	田青
信息披露负责人员	0756-32625720	010-67969696
客户服务电话	4006789999	010-67969696
传真	0756-82021126	010-66759863

2.4 信息披露方式

基金管理年度报告正式的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金管理年度报告备地点	深圳市福田区福华路101号深国投国际商业中心第43层鹏华基金管理有限公司 北京市朝阳区来广营西路18号来广营SOHO14号楼中国建设银行股份有限公司

§ 3 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	2016年	2014年	2013年
本期已实现收益	13,376,762.30	7,463,326.75	1,422,004.77
本期利润	20,838,409.67	9,098,417.79	32,006,852.64
加权平均基金份额本期利润	0.5140	0.1077	0.2414
本期基金份额净值增长率	36.26%	13.79%	24.46%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供基金份额利润	0.3379	0.0066	-0.0163
期末基金份额净值	58,811,040.23	64,043,934.96	104,334,769.81
基金份额净值变动率	15.10%	1.14%	0.07%

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;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,开放式基金的申购赎回费,基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(3) 表中的“期末”均指报告期最后一日,即12月31日,无论该日是否为开放日或处于开放期的交易日。

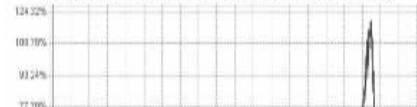
3.2 资金价值表现

3.2.1 基金份额净值增长率为基金份额累计净值增长率变与其同期业绩比较基准收益率变化的比较

阶段	份额净值增长 率(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率差 额(%)	①-③	②-④
过去三个月	21.26%	20.8%	22.72%	2.09%	-1.46%
过去六个月	-10.68%	2.8%	-8.07%	2.96%	-2.51%
过去一年	36.26%	2.62%	-40.76%	2.65%	-45.6%
过去两年	92.09%	1.84%	100.41%	1.86%	-7.42%
自基金合同生效日起至今	61.98%	1.72%	51.89%	1.74%	-0.01%
注:	本基金业绩比较基准为深证民强价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。				-0.02%

注:本基金业绩比较基准为深证民强价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

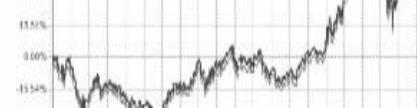
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变与其同期业绩比较基准收益率变化的比较



注:基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.截至基金建仓期结束,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。

3.2.3 本基金合同生效以来基金每年净值增长率变与其同期业绩比较基准收益率的比较



注:过去三年本基金未进行利润分配。

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日,业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理与中国证监会认可的其他业务。截止本报告期末,公司股东由国信证券股份有限公司、意大利裕信资本资产管理公司(Eurizon Capital SGR)、深圳平安金融发展有限公司组成,公司已完成增资扩股,增至15,000万元人民币。截至本报告期末,公司管理资产规模达人民币98亿元,其中开放式基金、10只社保组合,经过17年的努力,鹏华基金管理有限公司已逐步形成了较为完善的产品线。

4.1.2 基金经理及其管理基金的情况

截至本报告期末,公司共有基金经理10人,其中男性9人,女性1人,平均年龄35岁,平均从业年限10.5年,平均投资经验6.5年。

4.2 报告期内基金的运作情况

报告期内,公司严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定,认真履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,在合法合规的前提下,严格履行诚实守信、勤勉尽责的义务,坚持“规范运作、稳健经营”的管理理念,实现了良好的经营业绩。

4.3 报告期内基金的财务指标

报告期内,公司各项财务指标均符合有关法律法规及公司内部管理制度的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 报告期内基金的经营情况

报告期内,公司经营情况正常,没有发生可能影响公司持续经营的重大事件。

4.5 报告期内基金的管理情况

报告期内,公司严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定,认真履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,在合法合规的前提下,严格履行诚实守信、勤勉尽责的义务,坚持“规范运作、稳健经营”的管理理念,实现了良好的经营业绩。

4.6 报告期内基金的内部控制情况

报告期内,公司建立健全了内部控制制度,并严格执行,没有发现有损于基金份额持有人利益的违法违规行为。

4.7 报告期内基金的外部监督情况

报告期内,公司接受中国证监会的监督和检查,没有发现有损于基金份额持有人利益的违法违规行为。

4.8 报告期内基金的年度报告

报告期内,公司严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定,认真履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,在合法合规的前提下,严格履行诚实守信、勤勉尽责的义务,坚持“规范运作、稳健经营”的管理理念,实现了良好的经营业绩。

4.9 报告期内基金的年度报告

报告期内,公司严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定,认真履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,在合法合规的前提下,严格履行诚实守信、勤勉尽责的义务,坚持“规范运作、稳健经营”的管理理念,实现了良好的经营业绩。

4.10 报告期内基金的年度报告

报告期内,公司严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定,认真履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,在合法合规的前提下,严格履行诚实守信、勤勉尽责的义务,坚持“规范运作、稳健经营”的管理理念,实现了良好的经营业绩。

4.11 报告期内基金的年度报告

报告期内,公司严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定,认真履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,在合法合规的前提下,严格履行诚实守信、勤勉尽责的义务,坚持“规范运作、稳健经营”的管理理念,实现了良好的经营业绩。

4.12 报告期内基金的年度报告

报告期内,公司严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定,认真履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,在合法合规的前提下,严格履行诚实守信、勤勉尽责的义务,坚持“规范运作、稳健经营”的管理理念,实现了良好的经营业绩。

4.13 报告期内基金的年度报告

报告期内,公司严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定,认真履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,在合法合规的前提下,严格履行诚实守信、勤勉尽责的义务,坚持“规范运作、稳健经营”的管理理念,实现了良好的经营业绩。

4.14 报告期内基金的年度报告

报告期内,公司严格按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会的有关规定,认真履行诚实守信、勤勉尽责的基本义务,在合法合规的前提下,严格履行诚实守信、勤勉尽责的义务,坚持“规范运作、稳健经营”的管理理念,实现了良好的