

## 深证民营交易型开放式指数证券投资基金

## [2015] 第二季度报告

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  
报告送达日期:2016年7月1日  
§ 1 基金提示  
基金管理人的声明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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。本公司在任何时候,均未在任何情况下,通过本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息,向任何个人或机构透露任何可能损害投资者利益的信息。  
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。投资人应认真阅读基金的招募说明书。  
本报告公告的基金于2015年1月1日起至2015年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	深证RTF
场内简称	深证RTF
基金代码	160911
交易代码	160911
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年1月6日
报告期末基金份额总额	13,772,540,000份
投资目标	紧密跟踪标的指数,力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股票投资组合。并根据成份股的股息率变化进行相应的调整。 当期股息率较高的股票在成份股中的权重比例会增加,股息率较低的股票在成份股中的权重比例会降低。本基金在投资管理中将综合考虑股息率、市盈率、市净率等指标,并结合成份股的股息率变化,对成份股的权重进行适时调整,力求跟踪误差最小化。 本基金在投资管理中将综合考虑股息率、市盈率、市净率等指标,并结合成份股的股息率变化,对成份股的权重进行适时调整,力求跟踪误差最小化。
业绩比较基准	深证成份指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险特征与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金在投资管理中将综合考虑股息率、市盈率、市净率等指标,并结合成份股的股息率变化,对成份股的权重进行适时调整,力求跟踪误差最小化。
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

§ 3 主要财务指标  
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日~2015年6月30日)
1.本期已实现收益	29,148,-003.82
2.本期利润	12,020,-889.42
3.期初至报告期末的累计净值	0.8126
4.期末基金份额净值	0.79,034,606.52
5.期末基金份额总额	5,7396

注:1.本公司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)和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.本期利润不包括持有人认购或申购基金产生的费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本期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变动的比较

§ 3.1 本期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变动的比较

§ 3.2 本期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变动的比较

§ 3.3 本期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变动的比较

§ 3.4 本期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变动的比较

§ 3.5 本期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变动的比较

§ 3.6 本期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变动的比较

§ 3.7 本期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变动的比较

§ 3.8 本期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变动的比较

§ 3.9 本期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变动的比较

§ 3.10 本期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变动的比较

§ 3.11 本期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变动的比较

§ 3.12 本期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变动的比较

§ 3.13 本期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变动的比较

§ 3.14 本期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变动的比较

§ 3.15 本期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变动的比较

§ 3.16 本期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变动的比较

§ 3.17 本期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变动的比较

§ 3.18 本期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变动的比较

§ 3.19 本期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变动的比较

§ 3.20 本期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变动的比较

§ 3.21 本期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变动的比较

§ 3.22 本期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变动的比较

§ 3.23 本期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变动的比较

§ 3.24 本期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变动的比较

§ 3.25 本期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变动的比较

§ 3.26 本期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变动的比较

§ 3.27 本期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变动的比较

§ 3.28 本期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变动的比较

§ 3.29 本期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变动的比较

§ 3.30 本期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变动的比较

§ 3.31 本期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变动的比较

§ 3.32 本期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变动的比较

§ 3.33 本期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变动的比较

§ 3.34 本期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变动的比较

§ 3.35 本期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变动的比较

§ 3.36 本期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变动的比较

§ 3.37 本期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变动的比较

§ 3.38 本期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变动的比较

§ 3.39 本期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变动的比较

§ 3.40 本期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变动的比较

§ 3.41 本期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变动的比较

§ 3.42 本期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变动的比较

§ 3.43 本期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变动的比较

§ 3.44 本期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变动的比较

§ 3.45 本期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变动的比较

§ 3.46 本期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变动的比较

§ 3.47 本期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变动的比较

§ 3.48 本期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变动的比较

§ 3.49 本期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变动的比较

§ 3.50 本期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变动的比较

§ 3.51 本期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变动的比较

§ 3.52 本期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变动的比较

§ 3.53 本期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变动的比较

§ 3.54 本期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变动的比较

§ 3.55 本期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变动的比较

§ 3.56 本期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变动的比较

§ 3.57 本期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变动的比较

§ 3.58 本期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变动的比较

§ 3.59 本期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变动的比较

§ 3.60 本期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变动的比较

§ 3.61 本期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变动的比较

§ 3.62 本期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变动的比较

§ 3.63 本期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变动的比较

§ 3.64 本期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变动的比较

§ 3.65 本期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变动的比较

§ 3.66 本期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变动的比较

§ 3.67 本期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变动的比较

§ 3.68 本期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变动的比较

§ 3.69 本期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变动的比较

§ 3.70 本期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变动的比较

§ 3.71 本期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变动的比较

§ 3.72 本期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变动的比较

§ 3.73 本期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变动的比较

§ 3.74 本期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变动的比较

§ 3.75 本期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变动的比较

§ 3.76 本期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变动的比较

§ 3.77 本期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变动的比较

§ 3.78 本期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变动的比较

§ 3.79 本期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变动的比较

§ 3.80 本期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变动的比较

§ 3.81 本期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变动的比较

§ 3.82 本期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变动的比较

§ 3.83 本期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变动的比较

§ 3.84 本期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变动的比较

§ 3.85 本期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变动的比较

§ 3.86 本期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变动的比较

§ 3.87 本期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变动的比较

§ 3.88 本期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变动的比较

§ 3.89 本期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变动的比较

§ 3.90 本期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变动的比较

§ 3.91 本期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变动的比较

§ 3.92 本期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变动的比较

§ 3.93 本期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变动的比较

§ 3.94 本期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变动的比较

§ 3.95 本期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变动的比较

§ 3.96 本期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变动的比较

§ 3.97 本期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变动的比较

§ 3.98 本期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变动的比较

§ 3.99 本期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变动的比较

§ 3.100 本期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变动的比较

§ 3.101 本期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变动的比较

§ 3.102 本期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变动的比较

§ 3.103 本期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变动的比较

§ 3.104 本期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变动的比较

§ 3.105 本期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变动的比较