

上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金

2016年度报告摘要

2016年 12月 31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

送出日期：2017年 3月 30日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会在履行了法定职责后保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性完整性和及时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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2017年3月27日复核了本报告中的财务指标、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。

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基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要能简要地反映投资状况，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介**2.1 基金基本情况**

基金简称	国企 ETF
场内简称	国企 ETF
基金主代码	510070
基金交易代码	-
基金运作方式	交易型开放式
基金合同期限	不定期
基金合同生效日	2010年8月5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
基金份额持有人账户	51,624,067,000
基金总资产	定性
基金资产净值	定性
基金资产净值公告的披露日	每工作日
基金交易时间	10:00-15:00
基金合同终止日	2010年10月29日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金净值表现，追求超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要通过投资于上证民营企业50指数中的高股息率股票，精选具有持续经营能力、盈利能力强、成长性好、估值合理的股票，构建股票组合，实现基金净值的长期稳定增长。本基金将根据宏观经济形势、政策环境变化以及市场运行情况，适时调整股票组合的行业配置比例，择机调整股票组合的行业配置比例，从而达到基金净值的长期稳定增长。
业绩比较基准	上证民营企业50指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金等其他类型基金。本基金为交易型开放式基金，投资者需按照证券交易规则买卖本基金，因此本基金的流动性风险相对较高。
基金管理人和基金托管人	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

项目	2016年 1月 1日	2016年 12月 31日	2016年 1月 1日至 2016年 12月 31日
一、收入	-12,246,379,53	48,874,731,61	
1.利息收入	5,440,21	9,128,90	
其中：存款利息收入	5,440,21	9,128,90	
2.买入返售金融资产收入	-	-	
3.其他收入	-	-	
减：利息支出	-	-	
4.手续费及佣金收入	-	-	
5.投资收益	-	-	
6.公允价值变动损益	-3,016,380,08	77,865,379,05	
7.汇兑损益	-4,388,92,97	76,414,024,2	
8.其他收入	-	-	
9.投资收益	-	-	
10.公允价值变动损益	-	-	
11.汇兑损益	-	-	
12.其他收入	-	-	
13.投资收益	-	-	
14.公允价值变动损益	-	-	
15.汇兑损益	-	-	
16.其他收入	-	-	
17.投资收益	-	-	
18.公允价值变动损益	-	-	
19.汇兑损益	-	-	
20.其他收入	-	-	
21.投资收益	-	-	
22.公允价值变动损益	-	-	
23.汇兑损益	-	-	
24.其他收入	-	-	
25.投资收益	-	-	
26.公允价值变动损益	-	-	
27.汇兑损益	-	-	
28.其他收入	-	-	
29.投资收益	-	-	
30.公允价值变动损益	-	-	
31.汇兑损益	-	-	
32.其他收入	-	-	
33.投资收益	-	-	
34.公允价值变动损益	-	-	
35.汇兑损益	-	-	
36.其他收入	-	-	
37.投资收益	-	-	
38.公允价值变动损益	-	-	
39.汇兑损益	-	-	
40.其他收入	-	-	
41.投资收益	-	-	
42.公允价值变动损益	-	-	
43.汇兑损益	-	-	
44.其他收入	-	-	
45.投资收益	-	-	
46.公允价值变动损益	-	-	
47.汇兑损益	-	-	
48.其他收入	-	-	
49.投资收益	-	-	
50.公允价值变动损益	-	-	
51.汇兑损益	-	-	
52.其他收入	-	-	
53.投资收益	-	-	
54.公允价值变动损益	-	-	
55.汇兑损益	-	-	
56.其他收入	-	-	
57.投资收益	-	-	
58.公允价值变动损益	-	-	
59.汇兑损益	-	-	
60.其他收入	-	-	
61.投资收益	-	-	
62.公允价值变动损益	-	-	
63.汇兑损益	-	-	
64.其他收入	-	-	
65.投资收益	-	-	
66.公允价值变动损益	-	-	
67.汇兑损益	-	-	
68.其他收入	-	-	
69.投资收益	-	-	
70.公允价值变动损益	-	-	
71.汇兑损益	-	-	
72.其他收入	-	-	
73.投资收益	-	-	
74.公允价值变动损益	-	-	
75.汇兑损益	-	-	
76.其他收入	-	-	
77.投资收益	-	-	
78.公允价值变动损益	-	-	
79.汇兑损益	-	-	
80.其他收入	-	-	
81.投资收益	-	-	
82.公允价值变动损益	-	-	
83.汇兑损益	-	-	
84.其他收入	-	-	
85.投资收益	-	-	
86.公允价值变动损益	-	-	
87.汇兑损益	-	-	
88.其他收入	-	-	
89.投资收益	-	-	
90.公允价值变动损益	-	-	
91.汇兑损益	-	-	
92.其他收入	-	-	
93.投资收益	-	-	
94.公允价值变动损益	-	-	
95.汇兑损益	-	-	
96.其他收入	-	-	
97.投资收益	-	-	
98.公允价值变动损益	-	-	
99.汇兑损益	-	-	
100.其他收入	-	-	
101.投资收益	-	-	
102.公允价值变动损益	-	-	
103.汇兑损益	-	-	
104.其他收入	-	-	
105.投资收益	-	-	
106.公允价值变动损益	-	-	
107.汇兑损益	-	-	
108.其他收入	-	-	
109.投资收益	-	-	
110.公允价值变动损益	-	-	
111.汇兑损益	-	-	
112.其他收入	-	-	
113.投资收益	-	-	
114.公允价值变动损益	-	-	
115.汇兑损益	-	-	
116.其他收入	-	-	
117.投资收益	-	-	
118.公允价值变动损益	-	-	
119.汇兑损益	-	-	
120.其他收入	-	-	
121.投资收益	-	-	
122.公允价值变动损益	-	-	
123.汇兑损益	-	-	
124.其他收入	-	-	
125.投资收益	-	-	
126.公允价值变动损益	-	-	
127.汇兑损益	-	-	
128.其他收入	-	-	
129.投资收益	-	-	
130.公允价值变动损益	-	-	
131.汇兑损益	-	-	
132.其他收入	-	-	
133.投资收益	-	-	
134.公允价值变动损益	-	-	
135.汇兑损益	-	-	
136.其他收入	-	-	
137.投资收益	-	-	
138.公允价值变动损益	-	-	
139.汇兑损益	-	-	
140.其他收入	-	-	
141.投资收益	-	-	
142.公允价值变动损益	-	-	
143.汇兑损益	-	-	
144.其他收入	-	-	
145.投资收益	-	-	
146.公允价值变动损益	-	-	
147.汇兑损益	-	-	
148.其他收入	-	-	
149.投资收益	-	-	
150.公允价值变动损益	-	-	
151.汇兑损益	-	-	
152.其他收入	-	-	
153.投资收益	-	-	
154.公允价值变动损益	-	-	
155.汇兑损益	-	-	
156.其他收入	-	-	
157.投资收益	-	-	
158.公允价值变动损益	-	-	
159.汇兑损益	-	-	
160.其他收入	-	-	
161.投资收益	-	-	
162.公允价值变动损益	-	-	
163.汇兑损益	-	-	
164.其他收入	-	-	
165.投资收益	-	-	
166.公允价值变动损益	-	-	
167.汇兑损益	-	-	
168.其他收入	-	-	
169.投资收益	-	-	
170.公允价值变动损益	-	-	
17			