

## 鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2016 年年度报告摘要

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

S 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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，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本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

鹏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 2016 年 12 月 31 日止。

## S 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华上证企 50 ETF 联接
场内简称	-
基金代码	200055
基金运作方式	-
基金交易代码	-
基金合同终止日	-
基金资产估值方法	份额净值法
基金净值披露日	2016 年 8 月 5 日
基金托管人	鹏华基金管理有限公司
基金管理人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	54,973,884.08 元
基金业总资产	不定
基金业总负债	-
上管基金	-

## 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
场内简称	-
基金代码	500200
基金运作方式	-
基金交易代码	-
基金合同终止日	-
基金资产估值方法	份额净值法
基金净值披露日	2016 年 8 月 5 日
基金托管人	鹏华基金管理有限公司
基金管理人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	54,973,884.08 元
基金业总资产	不定
基金业总负债	-
上管基金	-

## 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪偏离最小化。
基金类型	股票型基金
基金规模	交易开放型
基金经理	王伟
基金合同终止日	2016 年 8 月 5 日
基金资产估值方法	基金份额净值法
基金净值披露日	2016 年 8 月 5 日
基金托管人	鹏华基金管理有限公司
基金管理人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	54,973,884.08 元
基金业总资产	不定
基金业总负债	-
上管基金	-

## 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪偏离最小化。
基金类型	股票型基金
基金规模	交易开放型
基金经理	王伟
基金合同终止日	2016 年 8 月 5 日
基金资产估值方法	基金份额净值法
基金净值披露日	2016 年 8 月 5 日
基金托管人	鹏华基金管理有限公司
基金管理人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	54,973,884.08 元
基金业总资产	不定
基金业总负债	-
上管基金	-

## 2.2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪偏离最小化。
基金类型	股票型基金
基金规模	交易开放型
基金经理	王伟
基金合同终止日	2016 年 8 月 5 日
基金资产估值方法	基金份额净值法
基金净值披露日	2016 年 8 月 5 日
基金托管人	鹏华基金管理有限公司
基金管理人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	54,973,884.08 元
基金业总资产	不定
基金业总负债	-
上管基金	-

## 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
住所	深圳市福田区福华一路 111 号深国投广场 28 层	北京市西城区复兴门内大街 1号
法定代表人	陈春晨	陈东
信息披露负责人	黄海	陈东
联系电话	0755-82827270	010-66105797
电子邮箱	zhangh@phsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4008889999	95588
客户服务邮箱	0755-20212126	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

信息披露方式	网站
网址	http://www.phfund.com

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

基金名称	鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
场内简称	-
基金代码	200055
基金运作方式	交易开放型
基金交易代码	-
基金合同终止日	-
基金资产估值方法	份额净值法
基金净值披露日	2016 年 8 月 5 日
基金托管人	鹏华基金管理有限公司
基金管理人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	54,973,884.08 元
基金业总资产	不定
基金业总负债	-
上管基金	-

## § 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元	
报告期损益	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
2016 年	2015 年
70,767.68	32,245,575.58
-11,574,153.99	36,082,637.51
-0.2040	0.4907
-13.32%	16.65%
0.3288	0.4398
0.3288	0.4398
72,066,080.80	87,541,873.13
1,327	1,531

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交易基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计人费用后实际收益水平将低于所列示。

(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

期间	份额净值增长 率	同期业绩比较基 准收益率
过去三个月	-0.05%	-0.08%
过去六个月	-0.06%	-0.07%
过去一年	-0.32%	-0.38%
过去三年	-37.64%	-36.26%
过去五年	-65.67%	-55.15%
过去十年	-32.40%	-34.39%

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

3.2.2 基金自成立以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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 过去五年基金每年净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.3 其他指标

注：无。

## 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：过去三年本基金未进行利润分配。

## 3.5 管理人对报告期内基金报告中财务信息等的说明

3.5.1 管理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

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的规定，履行诚实守信、勤勉尽责的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

3.5.2 管理人对本基金投资运作的监督情况

本报告期内，本基金托管人中国工商银行股份有限公司对本基金的投资运作实施了有效的监督。

3.5.3 管理人对本基金投资运作的评价

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及《鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的规定，履行诚实守信、勤勉尽责的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

3.5.4 管理人及其高级管理人员的诚信记录

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无诚信方面的记录。