

2017年9月30日  
基金管理人:鹏华基金管理有限公司  
基金托管人:中建投建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2017年10月25日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人:中国建设银行股份有限公司根据基金合同的约定，于2017年10月20日复核了本报告中的财务数据、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:深证ETF

场内简称:深证ETF

交易代码:159911

前端交易代码: -

后端交易代码: -

基金投资方式:交易型开放式

基金的合同生效日:2011年9月2日

报告期末基金资产总额:12,272,540,000

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。

本基金采取被动式指数投资方法,按照行业分类和标的指数中的

基准指数构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权

重的变化进行调整。

当指数或其成份股发生调整时,基金管理人将根据调整的

具体情况,及时对投资组合进行调整,力争使投资组合的

跟踪误差控制在0.5%以内。

本基金的业绩评价标准为:净值增长率。

风险收益特征:本基金为股票型基金,其预期的收益与风险高于混合型基金、

债券型基金,低于股票型基金,为证券投资基金中较高预期风险、

较高预期收益的品种,同时本基金为交易型开放式指数基金,采

取完全复制法进行指数投资,具有与标的指数相似的风险特

征。

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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -468,994.60

2.本期利润 3,036,131.44

3.加权平均基金份额本期利润 0.2426

4.期末基金资产净值 55,678,092.02

5.期末基金份额净值 0.4536

注:1.本期已实现收益系本基金本期收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和

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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要

低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本期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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.77% 0.84% 6.04% 0.86% -0.27% -0.02%

注:业绩比较基准=深证民基指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的

比较

4.3.2 所涉及交易行为的专项说明

注:1.本期已实现收益系本基金本期收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和

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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要

低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本期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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 7.90% 0.69% 7.83% 0.68% 0.07% 0.01%

注:业绩比较基准=上证民基指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的

比较

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日-2017年9月30日

1.本期已实现收益 -377,865.98

2.本期利润 6,430,706.90

3.加权平均基金份额本期利润 0.1323

4.期末基金资产净值 87,410,596.69

5.期末基金份额净值 1.817

注:1.本期已实现收益系本基金本期收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和

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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要

低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本期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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 7.90% 0.69% 7.83% 0.68% 0.07% 0.01%

注:业绩比较基准=上证民基指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的

比较

5.4 重要提示

基金管理人的董事及董事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人:中国建设银行股份有限公司根据基金合同的约定，于2017年10月20日复核了本报告中的财务数据、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

5.5 基金产品概况

基金简称:深证ETF

场内简称:深证ETF

交易代码:159911

前端交易代码: -

后端交易代码: -

基金投资方式:交易型开放式

基金的合同生效日:2011年9月2日

报告期末基金资产总额:12,272,540.00

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。

本基金采取被动式指数投资方法,按照行业分类和标的指数中的

基准指数构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权

重的变化进行调整。

当指数或其成份股发生调整时,基金管理人将根据调整的

具体情况,及时对投资组合进行调整,力争使投资组合的

跟踪误差控制在0.5%以内。

本基金的业绩评价标准为:净值增长率。

风险收益特征:本基金为股票型基金,其预期的收益与风险高于混合型基金、

债券型基金,低于股票型基金,为证券投资基金中较高预期风险、

较高预期收益的品种,同时本基金为交易型开放式指数基金,采

取完全复制法进行指数投资,具有与标的指数相似的风险特

征。

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

§ 6 开放式基金净值变动

6.1 退出保证金

6.2 申购费用

6.3 其他收款

6.4 申购费用

6.5 其他

6.6 其他

6.7 订购费用

6.8 其他

6.9 其他

6.10 其他

6.11 其他

6.12 其他

6.13 其他

6.14 其他

6.15 其他

6.16 其他

6.17 其他

6.18 其他

6.19 其他

6.20 其他

6.21 其他

6.22 其他

6.23 其他

6.24 其他

6.25 其他

6.26 其他

6.27 其他

6.28 其他

6.29 其他

6.30 其他

6.31 其他

6.32 其他

6.33 其他

6.34 其他

6.35 其他

6.36 其他

6.37 其他

6.38 其他

6.39 其他

6.40 其他

6.41 其他

6.42 其他

6.43 其他

6.44 其他

6.45 其他

6.46 其他

6.47 其他

6.48 其他

6.49 其他</p