

# 上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资 基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 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：2015 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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规定，于 2015 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	37
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	37
7.12 投资组合报告附注 .....	37
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	40
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8 其他重大事件 .....	42
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>43</b>
11.1 备查文件目录 .....	43
11.2 存放地点 .....	43
11.3 查阅方式 .....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 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
基金简称	民企 ETF
场内简称	民企 ETF
基金主代码	510070
交易代码	510070
基金运作方式	交易型开放式
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
报告期末基金份额总额	62,624,067.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010-10-29

### 2.2 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	<p>本基金采用被动式指数投资方法，原则上按照成份股在上证民营企业 50 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力求降低跟踪误差。</p>
业绩比较基准	上证民营企业 50 指数
风险收益特征	本金属股票型基金，其预期的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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
信息披露负责人	姓名	张戈	蒋松云
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	姜建清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	108,901,576.09
本期利润	67,586,930.04
加权平均基金份额本期利润	0.7548
本期加权平均净值利润率	40.04%

本期基金份额净值增长率	46.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	61,628,353.25
期末可供分配基金份额利润	0.9841
期末基金资产净值	134,691,563.10
期末基金份额净值	2.151
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	84.37%

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30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

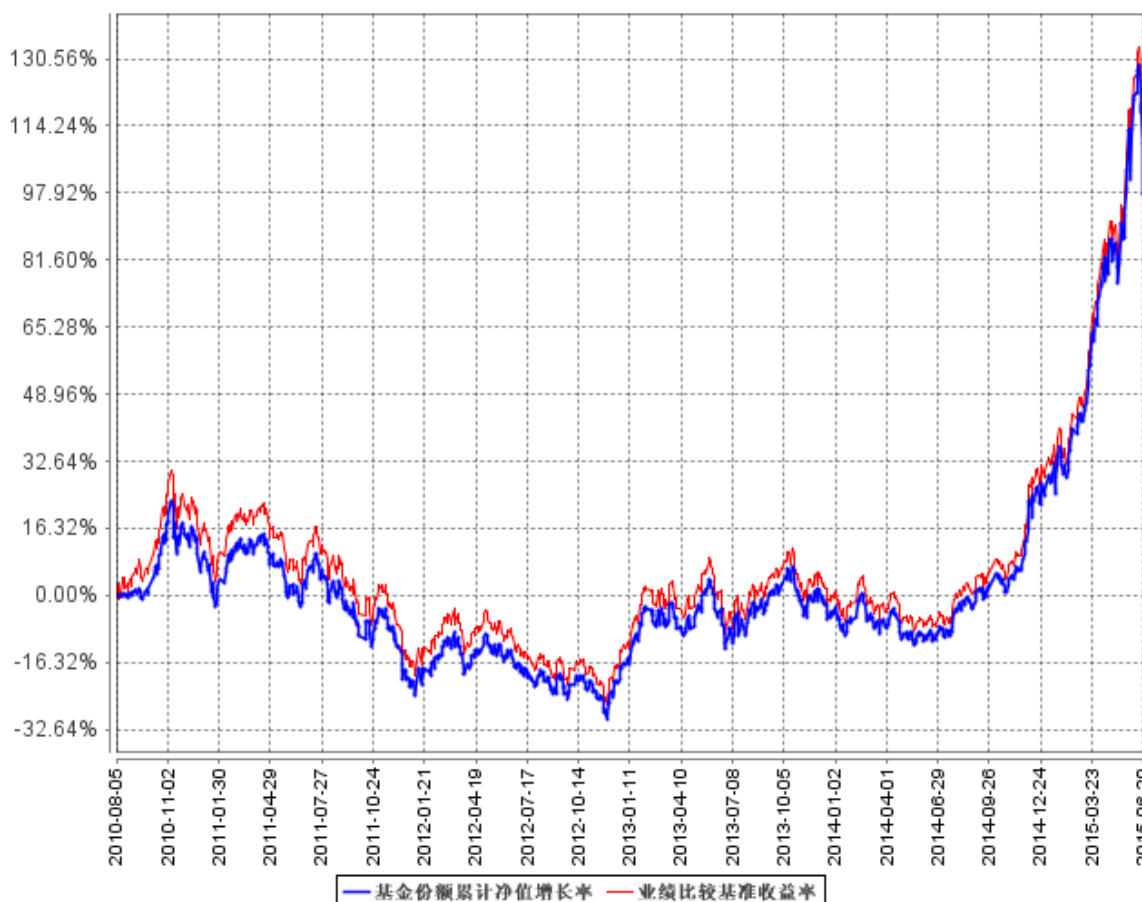
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.39%	3.55%	-9.30%	3.54%	-0.09%	0.01%
过去三个月	11.05%	2.63%	10.51%	2.64%	0.54%	-0.01%
过去六个月	46.13%	2.15%	44.24%	2.16%	1.89%	-0.01%
过去一年	102.16%	1.69%	99.46%	1.70%	2.70%	-0.01%
过去三年	121.75%	1.47%	115.31%	1.48%	6.44%	-0.01%
自基金合同生效起至今	84.37%	1.45%	88.35%	1.48%	-3.98%	-0.03%

注：业绩比较基准=上证民营企业 50 指数

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同于 2010 年 8 月 5 日起正式生效。

2、截至建仓期结束，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。

## § 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经验

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、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止本报告期末，公司管理资产总规模达到 3575.13 亿



元，管理 81 只开放式基金、10 只全国社保投资组合。经过近 17 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔俊杰	本基金基金经理	2013 年 3 月 30 日	-	7	崔俊杰先生，国籍中国，金融工程专业管理学硕士，7 年证券基金从业经验。2008 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员，先后从事产品设计、量化研究工作，2013 年 3 月起担任鹏华深证民营 ETF 基金及其联接基金基金经理，2013 年 3 月起兼任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联

					<p>接基金基金经理，2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华中证A股资源产业指数分级证券投资基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金经理，2015年4月起兼任鹏华中证银行指数分级证券投资基金基金经理。崔俊杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，整个 A 股市场呈现先扬后抑的局面，6 月中下旬开始出现大幅回调。本基金秉承指数基金的投资策略，在应对申购赎回的基础上，力争跟踪指数收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

2015 年上半年市场波动仍然较高，对基金的管理运作带来一定影响，面临这种情况，我们进行了精心的管理，较好的实现了跟踪误差控制目标。

基金投资运作方面，2015 年 5 月 28 日，本公司发布了《鹏华基金管理有限公司关于旗下按照指数构成比例投资的基金修订基金合同条款的公告》，根据该公告，本基金可以投资关联方发行、承销证券。报告期内，本基金严格按照基金合同要求，在指数权重及成份股变动时，努力降低成本、减少市场冲击，逐步调整组合至目标结构。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金份额净值为 2.151 元，累计净值 1.844 元；本报告期基金份额净值增长率为 46.13%。

报告期内，本基金日均跟踪偏离度的绝对值 0.011%，年化跟踪误差 0.729%，完成了跟踪目标。

对本基金而言，本期间跟踪误差的主要来源主要有两个方面：一是基金必要现金留存导致实

际持仓与基金比较基准之间的差异；二是目前的份额净值计算精度（基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入）所带来的跟踪误差，是本期跟踪误差的主要来源之一。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，2015 年以来，虽然经济总量增速略微下调，但刺激政策频发，深化国企改革，一带一路稳步推进，房地产松绑政策推出，稳保就业底线，同时“新经济”、“新常态”已经逐渐得到大家的接受和认可。本质来讲，调结构与稳增长很难并行，若不破旧立新，经济结构的调整很难到位，“新经济”、“新常态”将两者很好阐释和结合起来。促进改革、稳定增长和防范风险三者涵盖了中国经济的短期和长期、速度和效益之间的辩证关系，我们不可能只要长期不要短期，只要效益不要速度，因此我们预期在经济增长相对稳定之中，加快推动结构的调整，随着改革红利逐步释放，生产效率的逐渐提升，势必能改变经济潜在下沉的局面。

2015 年宏观经济面临的问题较多，诸如货币政策的松紧，人民币汇率的弹性控制，未来房地产市场能否企稳，经济增速保底下的刺激政策，国企改革顺利推进，企业 IPO 稳步推出等。这些问题及衍生的新问题的出现和解决将决定未来 A 股市场的走势，也许随着资金流动性的宽裕，降息、降准预期的实现，大类资产配置向股市的转移，房地产市场逐步企稳，人民币的国际化稳步推进等政策和措施的逐步明朗，A 股市场整体估值将可能在未来一段时间继续提升。但在市场波动中尤其要注意参与力度和风险控制，因此，我们建议继续密切关注与实体经济相关的宏观数据变化和 policy 信息。

我们仍然强调前期的观点：反复的经济形势势必带来资产之间轮动演绎的复杂化和高频率化，资产配置犯错的概率和机会成本相对较高，建议投资者从中长期投资的角度来考虑战略资产配置，避免短期频繁操作带来的风险。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争为投资者带来较好的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### 4.6.1.1 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会会计复核岗位，负责基金会会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

#### 4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度：

基金经理不参与或决定基金日常估值。

#### 4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1 截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 61,628,353.25 元，基金份额净值 2.151 元。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管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，上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，

在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金  
报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,492,192.38	545,043.88
结算备付金		378,200.44	27,802.50
存出保证金		3,233.04	1,295.75
交易性金融资产	6.4.7.2	133,604,025.28	181,153,752.74
其中：股票投资		133,604,025.28	181,153,752.74
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		15,036.31	-
应收利息	6.4.7.5	606.80	121.78
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		135,493,294.25	181,728,016.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,784.55	19,686.22
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		65,869.55	81,160.26
应付托管费		13,173.93	16,232.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	64,169.33	26,943.12
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	651,733.79	400,000.00
负债合计		801,731.15	544,021.65
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	73,063,209.85	143,648,280.42
未分配利润	6.4.7.10	61,628,353.25	37,535,714.58
所有者权益合计		134,691,563.10	181,183,995.00
负债和所有者权益总计		135,493,294.25	181,728,016.65

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.151 元，基金份额总额 62,624,067.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		68,524,531.38	-11,445,044.84
1.利息收入		4,228.36	2,990.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,228.36	2,990.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		109,411,612.59	2,214,545.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	108,384,216.36	7,483.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,027,396.23	2,207,061.97
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.16	-41,314,646.05	-13,648,202.59

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	423,336.48	-14,377.60
<b>减:二、费用</b>		937,601.34	1,061,055.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	419,140.69	583,226.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	83,828.15	116,645.39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	131,089.01	57,549.24
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	303,543.49	303,633.49
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		67,586,930.04	-12,506,099.95
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		67,586,930.04	-12,506,099.95

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	143,648,280.42	37,535,714.58	181,183,995.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	67,586,930.04	67,586,930.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-70,585,070.57	-43,494,291.37	-114,079,361.94
其中: 1. 基金申购款	460,844,676.36	461,628,018.13	922,472,694.49
2. 基金赎回款	-531,429,746.93	-505,122,309.50	-1,036,552,056.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以	-	-	-



“-”号填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	73,063,209.85	61,628,353.25	134,691,563.10
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	269,068,034.03	-9,683,838.24	259,384,195.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,506,099.95	-12,506,099.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-30,917,427.63	1,267,348.60	-29,650,079.03
其中：1. 基金申购款	28,000,689.16	-2,368,484.16	25,632,205.00
2. 基金赎回款	-58,918,116.79	3,635,832.76	-55,282,284.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	238,150,606.40	-20,922,589.59	217,228,016.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 邓召明 \_\_\_\_\_
\_\_\_\_\_ 高鹏 \_\_\_\_\_
\_\_\_\_\_ 郝文高 \_\_\_\_\_  
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 747 号《关于核准上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,006,987,117.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所（特殊

普通合伙) 普华永道中天验字(2010)第 196 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 8 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,007,002,863.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 15,746.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司确定 2010 年 10 月 13 日为本基金的基金份额折算日。当日上证民营企业 50 指数收盘值为 1,249.525 点,本基金资产净值为 1,078,496,888.72 元,折算前基金份额总额为 1,007,002,863.00 份,折算前基金份额净值为 1.071 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.85712318,折算后基金份额总额为 863,124,067.00 份,折算后基金份额净值为 1.250 元。本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2010 年 10 月 14 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2010]第 191 号文审核同意,本基金 863,124,067.00 份基金份额于 2010 年 10 月 29 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数上证民营企业 50 指数的成份股及其备选成份股,该部分投资比例不低于基金资产净值的 95%;此外,为更好地实现投资目标,本基金将少量投资于非上证民营企业 50 指数成份股、新股(首次发行或增发等)以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为:上证民营企业 50 指数。

本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“鹏华上证民企 50ETF 联接基金”)。鹏华上证民企 50ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

本报告期税项未发生变化。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	1,492,192.38
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,492,192.38

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	139,564,599.64	133,604,025.28	-5,960,574.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计	139,564,599.64	133,604,025.28	-5,960,574.36	

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截止本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	452.27
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	153.18
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.35
合计	606.80

注：其他为应收结算保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

注：截止本报告期末，本基金未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	64,169.33

银行间市场应付交易费用	-
合计	64,169.33

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	503,315.49
指数使用费	50,000.00
可退替代款	88,903.90
应付退补款	9,514.40
合计	651,733.79

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,124,067.00	143,648,280.42
本期申购	395,000,000.00	460,844,676.36
本期赎回(以“-”号填列)	-455,500,000.00	-531,429,746.93
本期末	62,624,067.00	73,063,209.85

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,082,748.97	14,452,965.61	37,535,714.58
本期利润	108,901,576.09	-41,314,646.05	67,586,930.04
本期基金份额交易产生的变动数	-31,719,062.82	-11,775,228.55	-43,494,291.37
其中：基金申购款	524,899,870.79	-63,271,852.66	461,628,018.13
基金赎回款	-556,618,933.61	51,496,624.11	-505,122,309.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	100,265,262.24	-38,636,908.99	61,628,353.25

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	3,318.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	891.23
其他	18.77
合计	4,228.36

注：其他为应收结算保证金利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,295,738.53
股票投资收益——赎回差价收入	99,088,477.83
合计	108,384,216.36

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	42,754,903.31
减：卖出股票成本总额	33,459,164.78
买卖股票差价收入	9,295,738.53

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,036,552,056.43
减：现金支付赎回款总额	112,700,188.43
减：赎回股票成本总额	824,763,390.17
赎回差价收入	99,088,477.83

### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期没有发生债券投资收益。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期没有发生衍生工具收益

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,027,396.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,027,396.23

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-41,314,646.05
——股票投资	-41,314,646.05
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-41,314,646.05

### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	423,336.48
合计	423,336.48

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	131,089.01
银行间市场交易费用	-
合计	131,089.01

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,767.52
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	228.00
合计	303,543.49

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方没有发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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（“中国工商银行”）	基金托管人
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（“鹏华上证民企50ETF联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金



注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生股票交易、债券交易、债券回购交易和权证交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

##### 6.4.10.1.1 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生应支付关联方的佣金业务。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	419,140.69	583,226.99

注：支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为0.5%，逐日计提，按月支付。

日管理费=前一日基金资产净值×0.5%÷当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	83,828.15	116,645.39

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为0.1%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%÷当年天数。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

##### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
中国工商银行—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	50,195,326.00	80.1500%	93,027,526.00	75.5600%

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国工商银行	1,492,192.38	3,318.36	775,241.65

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证等其他证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600645	中源协和	2015-04-27	重大事项	79.34	-	-	36,900	1,627,026.59	2,927,646.00	-

600499	科达洁能	2015-06-10	重大事项	29.64	-	-	65,114	1,745,790.05	1,929,978.96	-
601633	长城汽车	2015-06-19	重大事项	42.76	2015-7-13	38.50	40,786	1,887,993.09	1,744,009.36	-
600366	宁波韵升	2015-05-22	重大事项	35.09	2015-8-12	31.58	43,953	975,983.90	1,542,310.77	-
601021	春秋航空	2015-06-26	重大事项	126.09	2015-7-21	113.48	12,200	1,566,343.52	1,538,298.00	-
601216	内蒙君正	2015-06-29	重大事项	24.07	2015-7-2	24.20	63,300	1,743,361.46	1,523,631.00	-
601311	骆驼股份	2015-06-18	重大事项	28.20	2015-7-15	25.38	43,270	1,221,464.69	1,220,214.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具

的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2014 年 12 月 31 日：未持有）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全

部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,492,192.38	-	-	-	1,492,192.38
结算备付金	378,200.44	0.00	0.00	0.00	378,200.44
存出保证金	3,233.04	0.00	0.00	0.00	3,233.04
交易性金融资产	-	-	-	133,604,025.28	133,604,025.28
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	15,036.31	15,036.31
应收利息	0.00	0.00	0.00	606.80	606.80
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	1,873,625.86	0.00	0.00	133,619,668.39	135,493,294.25
负债					
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	6,784.55	6,784.55
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	65,869.55	65,869.55
应付托管费	0.00	0.00	0.00	13,173.93	13,173.93
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	64,169.33	64,169.33
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	651,733.79	651,733.79
负债总计	0.00	0.00	0.00	801,731.15	801,731.15
利率敏感度缺口	1,873,625.86	0.00	0.00	132,817,937.24	134,691,563.10
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	545,043.88	0.00	0.00	0.00	545,043.88
结算备付金	27,802.50	0.00	0.00	0.00	27,802.50
存出保证金	1,295.75	0.00	0.00	0.00	1,295.75
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	181,153,752.74	181,153,752.74
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	121.78	121.78
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	574,142.13	0.00	0.00	181,153,874.52	181,728,016.65
负债					
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	19,686.22	19,686.22
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	81,160.26	81,160.26
应付托管费	0.00	0.00	0.00	16,232.05	16,232.05
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	26,943.12	26,943.12
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	400,000.00	400,000.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	544,021.65	544,021.65
利率敏感度缺口	574,142.13	0.00	0.00	180,609,852.87	181,183,995.00

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2014 年 12 月 31 日：未持有），因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	133,604,025.28	99.19	181,153,752.74	99.98
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	133,604,025.28	99.19	181,153,752.74	99.98

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	5,895,964.95	9,001,655.71
	业绩比较基准下降5%	-5,895,964.95	-9,001,655.71

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	133,604,025.28	98.61
	其中：股票	133,604,025.28	98.61
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,870,392.82	1.38
7	其他各项资产	18,876.15	0.01
8	合计	135,493,294.25	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。



## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,637,946.84	4.19
C	制造业	62,421,505.55	46.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,658,783.92	4.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,538,298.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,919,245.13	10.33
J	金融业	36,617,252.34	27.19
K	房地产业	4,844,827.50	3.60
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,927,646.00	2.17
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	133,565,505.28	99.16

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	2,804,578	27,877,505.32	20.70
2	600518	康美药业	292,198	5,180,670.54	3.85

3	600570	恒生电子	44,403	4,975,356.15	3.69
4	600276	恒瑞医药	111,382	4,960,954.28	3.68
5	600703	三安光电	136,185	4,262,590.50	3.16
6	600109	国金证券	172,148	4,200,411.20	3.12
7	600089	特变电工	245,958	3,642,637.98	2.70
8	600031	三一重工	361,442	3,502,372.98	2.60
9	600804	鹏博士	105,804	3,159,307.44	2.35
10	600196	复星医药	108,533	3,140,945.02	2.33
11	600256	广汇能源	297,313	3,092,055.20	2.30
12	600352	浙江龙盛	216,194	3,063,468.98	2.27
13	600535	天士力	61,475	3,058,996.00	2.27
14	600340	华夏幸福	100,390	3,056,875.50	2.27
15	601099	太平洋	234,500	3,029,740.00	2.25
16	600588	用友网络	63,812	2,927,694.56	2.17
17	600645	中源协和	36,900	2,927,646.00	2.17
18	600177	雅戈尔	147,849	2,699,722.74	2.00
19	600066	宇通客车	126,213	2,593,677.15	1.93
20	601933	永辉超市	193,190	2,239,072.10	1.66
21	600157	永泰能源	318,903	2,194,052.64	1.63
22	600252	中恒集团	87,911	2,021,953.00	1.50
23	600499	科达洁能	65,114	1,929,978.96	1.43
24	600660	福耀玻璃	132,988	1,899,068.64	1.41
25	600873	梅花生物	177,000	1,847,880.00	1.37
26	600208	新湖中宝	231,600	1,787,952.00	1.33
27	601633	长城汽车	40,786	1,744,009.36	1.29
28	600143	金发科技	145,669	1,736,374.48	1.29
29	600867	通化东宝	75,240	1,650,013.20	1.23
30	600079	人福医药	42,868	1,588,259.40	1.18
31	600366	宁波韵升	43,953	1,542,310.77	1.15
32	601021	春秋航空	12,200	1,538,298.00	1.14
33	600816	安信信托	30,301	1,509,595.82	1.12
34	600811	东方集团	118,278	1,458,367.74	1.08
35	600770	综艺股份	73,962	1,445,217.48	1.07
36	601519	大智慧	75,450	1,411,669.50	1.05
37	600522	中天科技	57,149	1,298,996.77	0.96
38	600759	洲际油气	82,411	1,259,240.08	0.93
39	601311	骆驼股份	43,270	1,220,214.00	0.91
40	600516	方大炭素	97,841	1,165,286.31	0.87
41	600490	鹏欣资源	84,100	1,047,886.00	0.78

42	600557	康缘药业	34,015	946,637.45	0.70
43	600699	均胜电子	24,072	922,198.32	0.68
44	600216	浙江医药	62,164	825,537.92	0.61
45	603288	海天味业	25,720	821,496.80	0.61
46	600998	九州通	31,400	702,104.00	0.52
47	600485	信威集团	13,300	583,737.00	0.43
48	601969	海南矿业	19,300	351,839.00	0.26

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	16,119,939.71	8.90
2	601099	太平洋	4,121,623.61	2.27
3	600873	梅花生物	2,843,858.00	1.57
4	600109	国金证券	2,316,569.00	1.28
5	600031	三一重工	2,309,002.50	1.27
6	600196	复星医药	1,798,523.00	0.99
7	600518	康美药业	1,678,881.00	0.93
8	601021	春秋航空	1,650,116.67	0.91
9	600276	恒瑞医药	1,081,497.94	0.60
10	601311	骆驼股份	1,022,994.00	0.56
11	601933	永辉超市	687,369.00	0.38
12	600340	华夏幸福	666,791.00	0.37
13	601969	海南矿业	584,793.00	0.32
14	601633	长城汽车	483,095.00	0.27
15	600089	特变电工	480,649.00	0.27
16	600490	鹏欣资源	468,664.00	0.26
17	600588	用友网络	445,290.00	0.25
18	600352	浙江龙盛	395,728.00	0.22
19	600256	广汇能源	341,084.00	0.19

20	600066	宇通客车	318,782.00	0.18
----	--------	------	------------	------

注：买入金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600200	江苏吴中	2,880,188.00	1.59
2	601519	大智慧	2,770,208.00	1.53
3	600804	鹏博士	2,332,892.00	1.29
4	600572	康恩贝	1,971,897.93	1.09
5	600570	恒生电子	1,800,314.06	0.99
6	600109	国金证券	1,775,140.00	0.98
7	600759	洲际油气	1,693,380.42	0.93
8	600518	康美药业	1,499,537.00	0.83
9	600522	中天科技	1,449,646.00	0.80
10	600016	民生银行	1,412,621.15	0.78
11	600521	华海药业	1,349,548.70	0.74
12	600079	人福医药	1,202,699.00	0.66
13	600596	新安股份	1,167,268.00	0.64
14	600352	浙江龙盛	1,141,384.68	0.63
15	600196	复星医药	1,132,813.89	0.63
16	600177	雅戈尔	1,007,765.00	0.56
17	600089	特变电工	1,000,781.00	0.55
18	600256	广汇能源	994,000.50	0.55
19	600157	永泰能源	976,733.00	0.54
20	600516	方大炭素	867,074.00	0.48

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	44,113,515.79
卖出股票收入（成交）总额	42,754,903.31

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券之一的鹏博士电信传媒集团股份有限公司（以下简称“鹏博士”）于 2014 年 10 月 24 日收到中国证券监督管理委员会四川监管局《关于对鹏博士电信传媒集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（行政监管措施决定书[2014]15 号）（以下简称“《监管警示函》”）。《监管警示函》指出鹏博士披露的 2011、2012、2013 年年度财务报告中现金流量表及补

充资料的数据存在错误，要求鹏博士及时披露经审计的更正后的财务信息。根据鹏博士公告，鹏博士按照《企业会计准则》的规定，会同年审会计师，对公司 2011 年至 2013 年度财务报告进行了全面的梳理核查并进行差错更正，并按照证监会和上海证券交易所的相关规定，整理《关于公司前期会计差错更正的议案》提交公司董事会进行审议并履行了信息披露义务。

本基金投资的前十名证券之一的国金证券的发行主体国金证券股份有限公司（简称“国金证券”）于 2014 年 12 月 22 日收到中国证监会厦门监管局下发的“[2014]9 号”行政监管措施决定书，称国金证券 2010 年至 2013 年 2 月期间在金融产品销售过程中未制定相应的内控管理制度，内规管理缺失；国金证券未按照中国证监会厦门监管局证券营业部例行检查通知的要求报告 2011 年至 2013 年信托计划等产品的代销情况，同时责令国金证券完善内控合规管理，加强员工执业行为监督，认真履行监管报告义务。根据国金证券公告，公司进行了自查并采取了整改措施。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为 ETF 基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对上述证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合 ETF 基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,233.04
2	应收证券清算款	15,036.31
3	应收股利	-
4	应收利息	606.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,876.15

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 7.12.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
584	107,232.99	52,410,147.00	83.69%	10,213,920.00	16.31%

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
中国工商银行—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	50,195,326.00	80.15%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	方正证券股份有限公司	1,681,002.00	2.68%
2	王贺成	649,900.00	1.04%
3	于楠	535,161.00	0.85%
4	张军	432,903.00	0.69%
5	田磊	428,562.00	0.68%
6	国信证券股份有限公司客户信用交 易担保证券账户	331,159.00	0.53%

7	邵贵祥	320,000.00	0.51%
8	万锐	257,137.00	0.41%
9	郑绍睿	214,281.00	0.34%
10	吴阿里	211,000.00	0.34%
	中国工商银行-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	50,195,326.00	80.15%

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年8月5日）基金份额总额	1,007,002,863.00
本报告期期初基金份额总额	123,124,067.00
本报告期基金总申购份额	395,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	455,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	62,624,067.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动：

报告期内经公司董事会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]217号文核准，公司聘任高永杰先生担任公司督察长，任职日期自2015年2月6日起。

报告期内经公司股东会审议通过，公司聘任陈冰女士担任公司监事，并自陈冰女士担任公司监事之日起，李国阳先生不再担任公司监事。陈冰女士任职日期自2015年6月2日起。



10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
齐鲁证券	1	86,868,419.10	100.00%	79,085.77	100.00%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需

并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本报告期内交易单元未发生变化。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

注：本基金本报告期内未通过券商交易单元进行权证交易、债券交易及债券回购交易。

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	2014 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 22 日
2	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 9 日
3	上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 19 日
4	2014 年年度度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 26 日
5	2015 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 21 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下按照指数构成比例投资的基金修订基金合同条款的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 28 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一)《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
- (二)《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- (三)《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年半年度报告》(原文)。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

### 11.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(<http://www.phfund.com>)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司  
2015 年 8 月 25 日