

# 深证民营交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	民营 ETF
场内简称	民营 ETF
基金主代码	159911
交易代码	159911
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 2 日
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
报告期末基金份额总额	13,772,540.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011-10-14

### 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	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。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、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，力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	深证民营价格指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型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。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司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	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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 43 层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,327,123.63
本期利润	-12,142,275.68
加权平均基金份额本期利润	-0.8562
本期基金份额净值增长率	-16.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.9940
期末基金资产净值	59,142,898.46
期末基金份额净值	4.2943

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）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	2.28%	1.61%	2.25%	1.61%	0.03%	0.00%
过去三个月	0.81%	1.53%	0.59%	1.55%	0.22%	-0.02%
过去六个月	-16.40%	2.40%	-16.83%	2.43%	0.43%	-0.03%
过去一年	-25.17%	2.75%	-24.12%	2.79%	-1.05%	-0.04%
过去三年	54.38%	2.08%	56.16%	2.10%	-1.78%	-0.02%
自基金合同生效起至今	30.12%	1.88%	27.87%	1.90%	2.25%	-0.02%

注：基金业绩比较基准=深证民营价格指数

#### 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

民营ETF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、本基金合同于 2011 年 9 月 2 日正式生效。

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。

## §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 2016 年 6 月，公司管理资产总规模达到 3609.67 亿元，管理 99 只公募基金、10 只全国社保投资组合。经过近 18 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 16 日	-	8	崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，8 年证券从业经验。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 月起兼任鹏华资源分级基金基金经理，2014 年 12 月起兼任鹏华传媒分级基金基金经理，2015 年 4 月起兼任鹏华银行分级基金基金经理，2015 年 8 月至 2016 年 7 月兼任鹏华医药分级（2016 年 7 月已转型为鹏华中证医药卫生（LOF））基金基金经理，2016 年 7 月起兼任鹏华中证医药卫生

					(LOF) 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。
--	--	--	--	--	---

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

2016 年上半年，整个 A 股市场呈现震荡走势，先抑后扬，波动率和成交量环比降低。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。

2016 年上半年，本基金申购赎回较为频繁，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。

##### 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 4.2943 元，累计净值 1.3012 元；本报告期基金份额净值增

长率为-16.4%。

报告期内，本基金日均跟踪偏离度的绝对值 0.004%，年化跟踪误差 0.647%，较好的完成了跟踪目标。

对本基金而言，本期间跟踪误差的主要来源是基金为应对申购赎回的必要现金留存导致实际持仓与基金比较基准之间的差异。

#### 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，2016 年以来，虽然经济总量增速下调已是既定事实，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，汇率风险逐渐释放等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。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。

2016 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，房地产去库存如何执行，经济增速趋缓的刺激政策，注册制和退市制的推出，深港通的推出，美元加息，资产荒等。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，也许随着人民币汇率的企稳，大类资产配置或许会逐步向股市转移，房地产去库存有效执行，银行坏账率持续降低，A 股市场整体估值将可能在未来一段时间平稳提升。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政策信息。

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。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金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

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 13,689,302.19 元，期末基金份额净值 4.2943 元。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人复核审查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。

# §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：深证民营交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	643,156.84	564,977.96
结算备付金	9,927.20	1,435.19
存出保证金	1,023.24	7,941.43
交易性金融资产	58,833,920.98	73,285,182.87
其中：股票投资	58,833,920.98	73,285,182.87
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	150,663.12	-
应收利息	126.06	153.87
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	59,638,817.44	73,859,691.32
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	33,133.78
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	23,764.69	31,885.53
应付托管费	4,752.94	6,377.11
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	16,011.07	18,263.08
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	451,390.28	455,000.00
负债合计	495,918.98	544,659.50
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	45,453,596.27	47,103,749.27
未分配利润	13,689,302.19	26,211,282.55
所有者权益合计	59,142,898.46	73,315,031.82
负债和所有者权益总计	59,638,817.44	73,859,691.32

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.2943 元，基金份额总额 13,772,540.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：深证民营交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-11,637,503.01	42,908,277.20
1.利息收入		2,209.95	3,942.89
其中：存款利息收入		2,209.95	3,942.89
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）		-1,824,560.91	41,964,304.14
其中：股票投资收益		-2,298,827.20	41,541,683.52

基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		474,266.29	422,620.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-9,815,152.05	761,648.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	178,382.11
<b>减：二、费用</b>		504,772.67	635,936.03
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	146,028.30	230,621.71
2. 托管费	6.4.8.2.2	29,205.65	46,124.33
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		27,998.44	55,766.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		301,540.28	303,423.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-12,142,275.68	42,272,341.17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-12,142,275.68	42,272,341.17

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证民营交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	47,103,749.27	26,211,282.55	73,315,031.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,142,275.68	-12,142,275.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,650,153.00	-379,704.68	-2,029,857.68



(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 969 号《关于核准深证民营交易型开放式指数证券投资基金及其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《深证民营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 568,507,072.00 元(含募集股票市值),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(2011)第 330 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 568,552,096.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 45,024.00 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证民营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 2011 年 9 月 28 日为本基金的基金份额折算日。当日深证民营价格指数收盘值为 3,081.393 点,本基金资产净值为 530,847,693.43 元,折算前基金份额总额为 568,552,096.00 份,折算前基金份额净值为 0.9337 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.30300694,折算后基金份额总额为 172,272,540.00 份,折算后基金份额净值为 3.0814 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 2011 年 9 月 29 日进行了变更登记。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上【2011】303 号文审核同意,本基金 172,272,540.00 份基金份额于 2011 年 10 月 14 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的标的指数为深证民营价格指数,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成份股及其备选成份股(投资比例不低于基金资产净值的 95%)。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非标的指数成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股(首次发行或增发等)、债券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为:深证民营价格指数。

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,于 2011 年 9 月 2 日募集成立了鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“鹏华深证民营 ETF 联接基金”)。鹏华深证民营 ETF 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》、《深证民营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 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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关联方没有发生变化。

### 6.4.7.2 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“鹏华深证民营 ETF 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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：无。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	146,028.30	230,621.71
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,205.65	46,124.33

注：支付基金托管人中国建设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。

##### 6.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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。

### 6.4.8.4.2 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 2016年6月30日		上年度末 2015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
中国建设银行—鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金	10,923,158.00	79.3100%	10,849,474.00	76.0200%

### 6.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
	中国建设银行	643,156.84	2,074.60	812,295.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.8.6 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。

### 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

#### 6.4.9.2 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
002065	东华软件	2015年12月22日	重大事项	25.10	2016年7月4日	22.59	34,430	868,051.06	864,193.00	-
000718	苏宁环球	2016年	重大事项	13.09	2016年	11.78	38,300	509,783.50	501,347.00	-

		1月 4日			7月 18日					
000547	航天 发展	2016 年 4月 19日	重大 事项	15.36	-	-	26,600	666,680.64	408,576.00	-
000511	*ST 烯碳	2016 年 4月 26日	重大 事项	8.92	-	-	41,700	508,741.31	371,964.00	-
002266	浙富 控股	2016 年 5月 25日	重大 事项	5.35	-	-	56,760	555,932.41	303,666.00	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## §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	58,833,920.98	98.65
	其中：股票	58,833,920.98	98.65
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	653,084.04	1.10
7	其他各项资产	151,812.42	0.25
8	合计	59,638,817.44	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	432,706.04	0.73
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,338,485.46	47.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	304,422.00	0.51
E	建筑业	831,791.38	1.41
F	批发和零售业	2,348,399.52	3.97
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,423,111.22	22.70
J	金融业	3,254,395.12	5.50
K	房地产业	2,659,639.34	4.50
L	租赁和商务服务业	1,434,060.78	2.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,682,197.13	2.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	343,651.60	0.58
R	文化、体育和娱乐业	3,123,529.89	5.28
S	综合	657,531.50	1.11
	合计	58,833,920.98	99.48

### 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前十名股票投资明细

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	000333	美的集团	125,574	2,978,615.28	5.04
2	300104	乐视网	34,231	1,811,162.21	3.06
3	000776	广发证券	102,622	1,719,944.72	2.91
4	300059	东方财富	71,655	1,590,741.00	2.69
5	002450	康得新	87,441	1,495,241.10	2.53
6	002024	苏宁云商	133,872	1,453,849.92	2.46
7	000783	长江证券	102,214	1,185,682.40	2.00
8	000063	中兴通讯	79,482	1,139,771.88	1.93
9	002594	比亚迪	18,614	1,135,640.14	1.92
10	002739	万达院线	14,100	1,126,590.00	1.90

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com> 的半年度报告正文。

### 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前五名股票投资明细

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	002466	天齐锂业	819,179.00	1.12
2	002739	万达院线	706,592.00	0.96
3	300408	三环集团	589,592.60	0.80
4	002074	国轩高科	521,068.65	0.71
5	002460	赣锋锂业	498,539.00	0.68
6	002176	江特电机	475,539.00	0.65
7	300383	光环新网	400,232.00	0.55
8	300418	昆仑万维	397,355.00	0.54
9	002273	水晶光电	379,354.00	0.52
10	002075	沙钢股份	320,112.00	0.44
11	300001	特锐德	279,115.86	0.38
12	000333	美的集团	265,400.99	0.36
13	002161	远望谷	248,478.16	0.34
14	002489	浙江永强	247,677.00	0.34

15	002284	亚太股份	247,032.01	0.34
16	002095	生意宝	194,178.00	0.26
17	002010	传化股份	182,657.00	0.25
18	002027	分众传媒	112,316.00	0.15
19	002285	世联行	111,446.00	0.15
20	002195	二三四五	99,979.00	0.14

注：买入金额按买入成交金额（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	000982	中银绒业	630,498.41	0.86
2	002038	双鹭药业	454,999.43	0.62
3	300055	万邦达	409,089.25	0.56
4	002422	科伦药业	383,511.26	0.52
5	002294	信立泰	342,884.25	0.47
6	002410	广联达	339,530.50	0.46
7	300273	和佳股份	339,374.30	0.46
8	300104	乐视网	335,650.00	0.46
9	002022	科华生物	328,648.13	0.45
10	002223	鱼跃医疗	314,811.63	0.43
11	001696	宗申动力	301,477.00	0.41
12	000592	平潭发展	298,162.00	0.41
13	000516	国际医学	295,368.00	0.40
14	002024	苏宁云商	291,126.78	0.40
15	002375	亚厦股份	288,975.85	0.39
16	300134	大富科技	268,581.30	0.37
17	000783	长江证券	248,971.00	0.34
18	002219	恒康医疗	247,668.38	0.34
19	000776	广发证券	177,837.00	0.24
20	002252	上海莱士	141,351.94	0.19

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	8,771,974.27
卖出股票收入（成交）总额	9,431,106.91

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：无。

## 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：无。

## 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：无。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

## 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：无。

## 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长江证券股份有限公司（以下简称长江证券）于 2015 年 5 月 6 日受到中国证监会对长江证券相关研究报告的制作、审批和发布等情况的合规性核查。从检查情况看，媒体转载内容来源于 5 月 4 日长江证券发布的题为《上证成交可上 1.4 万亿，创业板已达巅峰——从交易成本看当前市场系列之二》的研究报告。检查中发现，长江证券未与转载机构签订协议，未明确转载责任，致使转载机构篡改了研究报告标题；研报报送审核人员不符合公司内部规定，未能严格执行其内部管理制度。上述行为反映出公司内部控制制度未能有效执行，并违反了中国证监会《发布证券研究报告暂行规定》（证监会公告[2010]28 号）第二十一条，“证券公司、证券投资咨询机构授权其他机构刊载或者转发证券研究报告或者摘要，应当与相关机构作出协议约定，明确刊载或者转发责任”之规定。根据《发布证券研究报告暂行规定》（证监会公告[2010]28 号）第二十二条的规定，中国证监会对长江证券采取了出具警示函的行政监管措施。长江证券已按照相关规定和中国证监会的要求，采取了措施，严格执行内部控制制度，加强研报刊载或者转发管理，确保业务开展依法合规。

长江证券于 2016 年 1 月 21 日收到中国证监会湖北监管局（以下简称湖北证监局）下发的《关于对长江证券股份有限公司采取责令增加内部合规检查的次数监管措施的决定》（[2016]1 号），湖北证监局认为长江证券在开展研究报告业务时，存在内部控制不完善的情形，违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条关于“证券公司应当按照审慎经营的原则，建立健全风险管理与内部控制制度，防范和控制风险”的规定。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，湖北证监局责令长江证券在 2016 年 2 月 1 日至 2017 年 1 月 31 日期间，每 3 个月对公司研究报告业务增加一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内向湖北证监局报送合规检查报告。长江证券于 2016 年 3 月 16 日收到中国证监会湖北监管局（以下简称湖北证监局）下发了《关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》（[2016]3 号），认为长江证券作为武汉四方交通物流有限责任公司（以下简称四方物流）2014 年中小企业私募债项目的受托管理人，在履行受托管理职责的过程中未勤勉尽责，未按照《四方物流 2014 年中小企业私募债券受托管理协议》的约定，如实披露募集资金使用情况。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条关于“为公司债券发行提供服务的承销机构、资信评级机构、受托管理人、会计师事务所、资产评估机构、律师事务所等专业机构和人员应当勤勉尽责，严格遵守执业规范和监管规则，按规定和约定履行义务”的规定。按照《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条的规定，湖北证监局决定对长江证券采取出具警示函的监管措施。

本组合投资的前十名证券之一的广发证券的发行主体广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）在证监会 2014 年四季度两融检查时，存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，受到采取责令限期改正的行政监管措施。

2015 年 8 月 24 日，广发证券收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（鄂证调查字 2015023 号）。因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对广发证券立案调查。2015 年 9 月 10 日，广发证券收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]71 号），原文如下：

广发证券股份有限公司（以下简称广发证券）涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，已由我会调查完毕。我会依法拟对你们做出行政处罚，现将我会认定的事实、理由和依据，以及你们依法所享有的相关权利告知你们。

经查，广发证券涉嫌违法违规的事实如下：

2014 年 9 月，广发证券对杭州恒生网络技术服务有限责任公司 HOMS 系统（以下简称 HOMS 系统）开放接入。同年 12 月，广发证券上海分公司对该系统开放专线接入，2015 年 5 月 19 日，专线连通。2015 年 3 月 30 日，广发证券上海分公司为上海铭创软件技术有限公司系统（以下简称铭创系统）安装第三个交易网关。对于上述外部接入的第三方交易终端软件，广发证券未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解。

截止调查日，广发证券客户中有 123 个使用 HOMS 系统、铭创系统接入的主账户。对上述客户，广发证券未采集客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。

2015 年 5 月 25 日，广发证券已知悉并关注 HOMS 系统等系统存在引发违规配资及违反账户实名制管理有关规定等问题，广发证券在未采集上述客户身份识别信息的情况下，未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。

综上，广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条，《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（四）项，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身分信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为，获利 6,805,135.75 元。时任广发证券经纪业务总部总经理王新栋、信息技术部总经理林建何为直接负责的主管人员，广发证券上海分公司总经理梅纪元、上海分公司电脑部主管周翔为其他直

接责任人员。

广发证券在 2015 年 7 月 12 日我会发布《关于清理整顿违法从事证券业务活动的意见》（证监会公告[2015]19 号）之后，仍未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，新增下挂子账户 99 个，性质恶劣、情节严重。

以上事实有相关人员询问笔录、QQ 聊天记录、客户委托记录、广发证券相关说明、佣金计算数据等证据证明，足以认定。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，我会拟决定：

- 一、对广发证券责令整改，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款；
- 二、对王新栋给予警告，并处以 10 万元罚款；
- 三、对林建何给予警告，并处以 10 万元罚款；
- 四、对梅纪元给予警告，并处以 10 万元罚款；
- 五、对周翔给予警告，并处以 10 万元罚款。

根据《中华人民共和国行政处罚法》第三十二条、第四十二条及《中国证券监督管理委员会行政处罚听证规则》的规定，就上述拟对你们实施的行政处罚，你们享有陈述、申辩、要求听证的权利。你们提出的事实、理由和证据，经我会复核成立的，将予以采纳。如果你们放弃陈述、申辩和听证的权利，我会将按照上述事实、理由和依据作出正式的行政处罚决定。

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，对该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	1,023.24

2	应收证券清算款	150,663.12
3	应收股利	-
4	应收利息	126.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	151,812.42

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 7.12.6 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
432	31,880.88	11,066,168.00	80.35%	2,706,372.00	19.65%

#### 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
中国建设银行—鹏华深证民营交易 型开放式指数证券投资基金联接基 金	10,923,158.00	79.31%

## 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	归德忠	148,000.00	1.07%
2	魏小康	105,027.00	0.76%
3	刘家彬	91,511.00	0.66%
4	王宗武	90,000.00	0.65%
5	姚致远	80,600.00	0.59%
6	籍生才	79,981.00	0.58%
7	深圳市衍盛资产管理有限公司—衍盛稳进	78,166.00	0.57%
8	柴春敏	60,606.00	0.44%
9	陈颖	60,303.00	0.44%
10	陈伟	59,997.00	0.44%
11	中国建设银行—鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金	10,923,158.00	79.31%

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：本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本开放式基金。

## 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：本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本开放式基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月2日）基金份额总额	568,552,096.00
本报告期期初基金份额总额	14,272,540.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	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	13,772,540.00

## §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，因股东方更换董事代表，原董事 Alessandro Varaldo 先生不再担任公司董事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Andrea Vismara 先生担任本公司董事，Alessandro Varaldo 先生不再担任本公司董事职务。Andrea Vismara 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

报告期内，原监事 Andrea Vismara 先生辞去公司监事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Sandro Vesprini 先生担任本公司监事，Andrea Vismara 先生不再担任本公司监事职务。Sandro Vesprini 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

#### 10.2.2 基金托管人的重大人事变动：

基金托管人本报告期无重大人事变动。

### 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	
银河证券	2	18,203,081.18	100.00%	16,952.38	100.00%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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，最近二年未发生因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  
要，并能为本基金提供全面的信息服
- (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债券交易、债券回购交易及权证交易。

鹏华基金管理有限公司  
2016年8月29日