

# 鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2016 年半年度报告

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。

## 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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
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.....	32
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
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.....	33
7.7 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.....	33
7.8 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.....	33
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.....	33
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	33
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	34
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	34

7.13 投资组合报告附注.....	34
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>35</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
8.3 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.....	35
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>35</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	38
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>40</b>
11.1 备查文件目录.....	40
11.2 存放地点.....	40
11.3 查阅方式.....	40

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	鹏华深证民营 ETF 联接
场内简称	-
基金主代码	206010
交易代码	206010
基金运作方式	契约型开放式
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	38,205,018.93 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证民营交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 10 月 14 日
基金管理人名称	鹏华基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于深证民营 ETF，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	本基金为被动式指数基金，以深证民营 ETF 作为主要投资标的，方便特定客户群通过本基金投资深证民营 ETF。本基金不参与深证民营 ETF 的管理。
业绩比较基准	深证民营价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
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 ETF 联接基金，通过投资于深证民营 ETF 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。
--	---------------

### 2.2.1 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
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	北京市西城区金融街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	王洪章

## 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	http://www.phfund.com
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

## § 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	-88,846.72
本期利润	-9,317,632.23
加权平均基金份额本期利润	-0.2406
本期加权平均净值利润率	-19.45%
本期基金份额净值增长率	-15.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	10,690,439.91
期末可供分配基金份额利润	0.2798
期末基金资产净值	48,895,458.84
期末基金份额净值	1.2798
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	27.98%

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	2.11%	1.55%	2.15%	1.53%	-0.04%	0.02%
过去三个月	0.68%	1.46%	0.60%	1.47%	0.08%	-0.01%
过去六个月	-15.74%	2.27%	-15.91%	2.31%	0.17%	-0.04%
过去一年	-24.65%	2.60%	-22.70%	2.65%	-1.95%	-0.05%
过去三年	48.47%	1.97%	54.00%	1.99%	-5.53%	-0.02%
自基金合同生效起至今	27.98%	1.78%	27.73%	1.81%	0.25%	-0.03%

注：基金业绩比较基准=深证民营价格指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

#### 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

鹏华深证民营ETF联接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 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 月起兼任鹏华医药分级基金基金经理。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

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 1.2798 元，累计净值 1.2798 元；本报告期基金份额净值增长率为 -15.74%。

报告期内，本基金日均跟踪偏离度的绝对值 0.001%，年化跟踪误差 0.721%，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：基金申购赎回的现金流转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 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。

#### 4.6.1.2 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

#### 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。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

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，本基金可供分配利润为 10,690,439.91 元，期末基金份额净值 1.2798 元。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

4.7.3 根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

### 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

本报告期内，本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形；截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

## § 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：鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	2,419,647.51	3,198,490.98
结算备付金		5,482.83	-
存出保证金		502.40	5,905.96
交易性金融资产	6.4.7.2	46,907,317.40	55,773,626.04
其中：股票投资		-	42,048.00
基金投资		46,907,317.40	55,731,578.04
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		428.98	251,105.47

应收利息	6.4.7.5	487.10	713.38
应收股利		-	-
应收申购款		698.33	5,083.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		49,334,564.55	59,234,925.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		66,327.77	77,369.99
应付管理人报酬		853.07	1,174.81
应付托管费		170.60	234.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	32.57	-
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	371,721.70	345,097.67
负债合计		439,105.71	423,877.42
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	38,205,018.93	38,721,512.28
未分配利润	6.4.7.10	10,690,439.91	20,089,536.05
所有者权益合计		48,895,458.84	58,811,048.33
负债和所有者权益总计		49,334,564.55	59,234,925.75

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2798 元，基金份额总额 38,205,018.93 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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>		-9,137,587.63	27,183,663.95
1.利息收入		10,577.42	15,038.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,577.42	15,038.49
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）		76,529.45	11,752,866.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,688.00	230,841.45
基金投资收益	6.4.7.13	63,841.45	11,522,008.55
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	16.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-9,228,785.51	15,383,913.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	4,091.01	31,845.80
<b>减：二、费用</b>		180,044.60	205,605.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,229.22	8,523.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,245.87	1,704.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	130.68	20,399.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	172,438.83	174,977.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-9,317,632.23	26,978,058.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-9,317,632.23	26,978,058.16

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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）	38,721,512.28	20,089,536.05	58,811,048.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,317,632.23	-9,317,632.23





## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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“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[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《鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 288,321,667.28 元,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(2011)第 327 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 288,440,241.65 份基金份额,其中认购资金利息折合 118,574.37 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。

本基金为深证民营交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金,主要以目标 ETF 作为其主要投资标的实现对标的指数的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,本基金以目标 ETF、深证民营价格指数成份股及其备选成份股为主要投资对象,其中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;本基金将少量投资于非深证民营价格指数成份股(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)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:深证民营价格指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

### 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》、《鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	2,419,647.51
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	2,419,647.51

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	37,894,655.65	46,907,317.40	9,012,661.75
其他	-	-	-
合计	37,894,655.65	46,907,317.40	9,012,661.75

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按目标 ETF 于估值日的份额净值确定公允价值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 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：无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	485.96
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	0.94
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	0.20
合计	487.10

注：其他为应收结算保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	32.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	32.57

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	166.68
预提费用	371,555.02
合计	371,721.70

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	38,721,512.28	38,721,512.28
本期申购	3,096,917.47	3,096,917.47
本期赎回(以“-”号填列)	-3,613,410.82	-3,613,410.82
本期末	38,205,018.93	38,205,018.93

注：申购含红利再投、转换入份额。赎回含转换出份额。

#### 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	13,084,040.06	7,005,495.99	20,089,536.05
本期利润	-88,846.72	-9,228,785.51	-9,317,632.23
本期基金份额交易产生的变动数	-172,873.31	91,409.40	-81,463.91
其中：基金申购款	1,040,298.16	-207,581.11	832,717.05
基金赎回款	-1,213,171.47	298,990.51	-914,180.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,822,320.03	-2,131,880.12	10,690,439.91

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,415.57
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	41.80
其他	120.05
合计	10,577.42

注：其他为申购款利息收入和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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,688.00
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	12,688.00

**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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	34,960.00
减：卖出股票成本总额	22,272.00
买卖股票差价收入	12,688.00

**6.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	455,514.50
减：卖出/赎回基金成本总额	391,673.05
基金投资收益	63,841.45

**6.4.7.14 债券投资收益**

注：无。

**6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益**

注：无。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

注：无。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

注：无。

**6.4.7.17 股利收益**

注：无。

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-9,228,785.51
——股票投资	-19,776.00

——债券投资	-
——基金投资	-9,209,009.51
——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	-9,228,785.51

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	3,637.80
转换费收入	453.21
合计	4,091.01

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	130.68
银行间市场交易费用	-
合计	130.68

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	149,178.12
银行汇划费用	883.81
合计	172,438.83

## 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
深证民营交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

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

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 基金交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：无。



#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：无。

#### 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
	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	6,229.22	8,523.95
其中：支付销售机构的客户维护费	22,423.40	43,485.20

注：（1）本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提，逐日计提，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.5% / 当年天数。

（2）根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

##### 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
	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	1,245.87	1,704.81

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提，逐日计提，按月支付。其计算公式为：日托管费 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.1% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

**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：无。

**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自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

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
基金合同生效日（2011年9月2日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	26,438,583.86	20,002,150.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	26,438,583.86	20,002,150.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	69.2019%	58.8664%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

**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**

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

**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		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	
	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	2,419,647.51	10,415.57	3,441,154.05	13,470.39

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。

**6.4.10.6 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。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

于2016年6月30日，本基金持有10,923,158.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为79.31%。

## 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2016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：无。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

### 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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 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，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。本基金主要投资于标的 ETF 基金。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。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建设银行股份有限公司，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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2015 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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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约

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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，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 2016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	2,419,647.51	-	-	-	2,419,647.51
结算备付金	5,482.83	-	-	-	5,482.83
存出保证金	502.40	-	-	-	502.40
交易性金融资产	-	-	-	46,907,317.40	46,907,317.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	428.98	428.98
应收利息	-	-	-	487.10	487.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	698.33	698.33
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,425,632.74	-	-	46,908,931.81	49,334,564.55
负债					
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	66,327.77	66,327.77
应付管理人报酬	-	-	-	853.07	853.07
应付托管费	-	-	-	170.60	170.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	32.57	32.57
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	371,721.70	371,721.70
负债总计	-	-	-	439,105.71	439,105.71
利率敏感度缺口	2,425,632.74	-	-	46,469,826.10	48,895,458.84
上年度末 2015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	3,198,490.98	-	-	-	3,198,490.98
存出保证金	5,905.96	-	-	-	5,905.96
交易性金融资产	-	-	-	55,773,626.04	55,773,626.04
应收证券清算款	-	-	-	251,105.47	251,105.47
应收利息	-	-	-	713.38	713.38
应收申购款	-	-	-	5,083.92	5,083.92
资产总计	3,204,396.94	-	-	56,030,528.81	59,234,925.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	77,369.99	77,369.99
应付管理人报酬	-	-	-	1,174.81	1,174.81
应付托管费	-	-	-	234.95	234.95
其他负债	-	-	-	345,097.67	345,097.67
负债总计	-	-	-	423,877.42	423,877.42
利率敏感度缺口	3,204,396.94	-	-	55,606,651.39	58,811,048.33

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 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%。

（2015 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（2015 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。--本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金以目标 ETF、指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	-	-	42,048.00	0.07
交易性金融资产-基金投资	46,907,317.40	95.93	55,731,578.04	94.76
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	46,907,317.40	95.93	55,773,626.04	94.84

##### 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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,837,718.76	2,868,476.62
业绩比较基准下降 5%	-2,837,718.76	-2,868,476.62	

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	46,907,317.40	95.08
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,425,130.34	4.92
8	其他各项资产	2,116.81	0.00
9	合计	49,334,564.55	100.00

**7.2 期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合**

注：无。

**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**

注：无。

**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**

注：无。

**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	34,960.00	0.06
---	--------	------	-----------	------

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	-
卖出股票收入（成交）总额	34,960.00

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 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：无。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	深证民营 ETF	股票型基金	交易型开放式	鹏华基金管理有限公司	46,907,317.40	95.93

注：上述基金明细为本基金本报告期末持有的全部基金。

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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。

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1

本基金投资的前十名证券中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。

### 7.13.2

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。

### 7.13.3 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	502.40
2	应收证券清算款	428.98
3	应收股利	-
4	应收利息	487.10
5	应收申购款	698.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,116.81

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 7.13.6 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

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
1, 259	30, 345. 53	26, 438, 583. 86	69. 20%	11, 766, 435. 07	30. 80%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	14, 651. 70	0. 0384%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

### 8.3 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：（1）本公司高级管理人员、基金研究部门负责人本报告期末未持有本基金份额。

（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月2日）基金份额总额	288, 440, 241. 65
--------------------------	-------------------

本报告期期初基金份额总额	38,721,512.28
本报告期基金总申购份额	3,096,917.47
减:本报告期基金总赎回份额	3,613,410.82
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	38,205,018.93

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

## § 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	
广发证券	1	34,960.00	100.00%	32.57	100.00%	-

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。本报告期内上述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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	1,231,936.42	100.00%

## 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	鹏华基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月5日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
3	2015年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月21日
4	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与平安证券申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月29日
5	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购最低金额及赎回持有最低份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月24日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大证券网上交易和手机客户端申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月10日
7	2015年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与张家港农村商业银行基金申购（含定期定额申购）费	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月8日

	率优惠活动的公告		
10	鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 13 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海陆金所资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 18 日
12	2016 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
13	鹏华基金管理有限公司关于增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
14	鹏华基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为我司旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 3 日
15	鹏华基金管理有限公司关于增加天津银行为旗下部分开放式基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 11 日
16	鹏华基金关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行“基金通”申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 17 日
17	鹏华基金管理有限公司关于增加中国民族证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 30 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国民生银行股份有限公司开通定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 31 日
19	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户的证件类型公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 18 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- (二) 《鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- (三) 《鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2016 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 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

### 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  
2016 年 8 月 29 日