

上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 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..... | 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..... | 10 |
| 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 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 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..... | 16 |
| §7 投资组合报告 | 31 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 31 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 31 |
| 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..... | 34 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 35 |
| 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..... | 36 |
| 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..... | 36 |
| 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..... | 36 |
| 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..... | 36 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 36 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 36 |

| | |
|--|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注..... | 36 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 38 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 38 |
| 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..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 39 |
| §10 重大事件揭示..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 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 |
| §11 备查文件目录..... | 42 |
| 11.1 备查文件目录..... | 42 |
| 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 | 54,124,067.00 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 | <p>本基金属股票型基金，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。</p> |

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 | 洪渊 |
| | 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 | 易会满 |

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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -3,424,692.85 |
| 本期利润 | -16,850,214.68 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.3064 |

| | |
|----------------------|-------------------------|
| 本期加权平均净值利润率 | -20.36% |
| 本期基金份额净值增长率 | -17.08% |
| 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 | 18,834,948.01 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3480 |
| 期末基金资产净值 | 81,981,247.10 |
| 期末基金份额净值 | 1.515 |
| 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 | 29.85% |

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 | 0.53% | 1.19% | 0.04% | 1.21% | 0.49% | -0.02% |
| 过去三个月 | -3.01% | 1.15% | -3.73% | 1.15% | 0.72% | 0.00% |
| 过去六个月 | -17.08% | 1.94% | -17.61% | 1.94% | 0.53% | 0.00% |
| 过去一年 | -29.57% | 2.24% | -29.88% | 2.26% | 0.31% | -0.02% |
| 过去三年 | 45.53% | 1.78% | 41.91% | 1.79% | 3.62% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.85% | 1.62% | 32.06% | 1.64% | -2.21% | -0.02% |

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

民企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、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 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 30 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。 |
| 张羽翔 | 本基金基金经理 | 2015 年 9 月 17 日 | - | 9 | 张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，9 年金融证券从业经验。曾任招商银行软件中心（原深圳市融博技术公司）数据分析师；2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员，先后从事金融工程、量化研究等工作；2015 年 9 月起担任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 接基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华新丝路分级基金基金经理，2016年7月兼任鹏华高铁产业分级基金基金经理。张羽翔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遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《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》的规定。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，基金份额净值为 1.28, 累计净值为 1.28, 本报告期基金份额净值增长率为-17.08%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年国内上半年资本市场风雨变幻，政策面以防范金融风险、保障金融安全成为首要问题。

股市表现更加动荡，当前中国经济正处于新旧动能接续转换、经济转型升级的关键时期，今年以来，经济增速在合理区间稳定运行，上半年中国经济基本上可以描述为“由落转稳”。受益于过去一段时间国家稳增长政策的支撑，推进城镇化、简政放权等具体措施开始逐渐显现成效，“稳”成为中国经济的重要特征。

英国脱欧，使得西方国家政治不确定性大幅上升，中国相对稳定、确定性相对较高。但由于欧盟是中国最大的贸易伙伴，欧盟经济下行也将拖累中国增长，且中国作为新兴市场之一，也将受到全球风险偏好下降的冲击。对中国 A 股市场有负面冲击，但估计不会很大。

2 季度 A 股市场经历了很多次压力测试，但均未跌破前期底部，说明短期内存在一定的机会。现在的行情更多是股市资金面相对改善。总体来说，维持下半年市场延续震荡走势的判断，市场投资机会更多以结构性行情展开。

本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击，本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击，努力使得跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争为投资者带来超越指数收益回报。

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

4.7.1 截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 18,834,948.01 元，基金份额净值 1.515 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本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：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 |
|-----------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 628,858.24 | 782,692.06 |
| 结算备付金 | | 3,386.88 | 11,509.11 |
| 存出保证金 | | 1,172.82 | 3,617.46 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 81,649,262.88 | 99,461,127.83 |
| 其中：股票投资 | | 81,649,262.88 | 99,461,127.83 |
| 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 | | 112,584.15 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 141.00 | 171.30 |
| 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 | | 82,395,405.97 | 100,259,117.76 |
| 负债和所有者权益 | | | |
| | | 本期末 | 上年度末 |
| | | 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 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 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 33,288.13 | 41,868.44 |
| 应付托管费 | | 6,657.63 | 8,373.70 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 22,821.01 | 23,636.05 |
| 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 | 351,392.10 | 395,000.00 |
| 负债合计 | | 414,158.87 | 468,878.19 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 63,146,299.09 | 63,729,646.80 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 18,834,948.01 | 36,060,592.77 |
| 所有者权益合计 | | 81,981,247.10 | 99,790,239.57 |
| 负债和所有者权益总计 | | 82,395,405.97 | 100,259,117.76 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.515 元，基金份额总额 54,124,067.00 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：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 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | -16,259,397.78 | 68,524,531.38 |
| 1.利息收入 | | 2,800.13 | 4,228.36 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 2,800.13 | 4,228.36 |
| 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） | | -2,835,902.08 | 109,411,612.59 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -3,911,884.59 | 108,384,216.36 |
| 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 | 1,075,982.51 | 1,027,396.23 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -13,425,521.83 | -41,314,646.05 |
| 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 | -774.00 | 423,336.48 |
| 减：二、费用 | | 590,816.90 | 937,601.34 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 205,954.25 | 419,140.69 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 41,190.87 | 83,828.15 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------|---------------|
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 42,077.68 | 131,089.01 |
| 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 | 301,594.10 | 303,543.49 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -16,850,214.68 | 67,586,930.04 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -16,850,214.68 | 67,586,930.04 |

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：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） | 63,729,646.80 | 36,060,592.77 | 99,790,239.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -16,850,214.68 | -16,850,214.68 |
| 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） | -583,347.71 | -375,430.08 | -958,777.79 |
| 其中：1. 基金申购款 | 14,583,692.25 | 3,701,784.11 | 18,285,476.36 |
| 2. 基金赎回款 | -15,167,039.96 | -4,077,214.19 | -19,244,254.15 |
| 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） | 63,146,299.09 | 18,834,948.01 | 81,981,247.10 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 | 143,648,280.42 | 37,535,714.58 | 181,183,995.00 |

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 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 | 628,858.24 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 628,858.24 |

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 | 89,172,947.22 | 81,649,262.88 | -7,523,684.34 |
| 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 | 89,172,947.22 | 81,649,262.88 | -7,523,684.34 |

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 2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 139.20 |
| 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 | 1.35 |
| 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 | 0.45 |
| 合计 | 141.00 |

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 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 22,821.01 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 22,821.01 |

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 | - |
| 预提费用 | 301,392.10 |
| 指数使用费 | 50,000.00 |
| 合计 | 351,392.10 |

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 | 54,624,067.00 | 63,729,646.80 |
| 本期申购 | 12,500,000.00 | 14,583,692.25 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -13,000,000.00 | -15,167,039.96 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 54,124,067.00 | 63,146,299.09 |

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 | 57,999,851.80 | -21,939,259.03 | 36,060,592.77 |
| 本期利润 | -3,424,692.85 | -13,425,521.83 | -16,850,214.68 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -467,222.22 | 91,792.14 | -375,430.08 |
| 其中：基金申购款 | 12,966,662.22 | -9,264,878.11 | 3,701,784.11 |
| 基金赎回款 | -13,433,884.44 | 9,356,670.25 | -4,077,214.19 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 54,107,936.73 | -35,272,988.72 | 18,834,948.01 |

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 |
| 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 | 171.27 |
| 其他 | 10.64 |
| 合计 | 2,800.13 |

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 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 | -1,478,123.93 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -2,433,760.66 |
| 合计 | -3,911,884.59 |

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 | 13,783,009.75 |
| 减：卖出股票成本总额 | 15,261,133.68 |
| 买卖股票差价收入 | -1,478,123.93 |

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 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 赎回基金份额对价总额 | 19,244,254.15 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 1,284,961.15 |
| 减：赎回股票成本总额 | 20,393,053.66 |
| 赎回差价收入 | -2,433,760.66 |

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 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,075,982.51 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |

| | |
|----|--------------|
| 合计 | 1,075,982.51 |
|----|--------------|

6.4.7.16 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 | -13,425,521.83 |
| ——股票投资 | -13,425,521.83 |
| ——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 | -13,425,521.83 |

6.4.7.17 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 | - |
| 替代损益 | -774.00 |
| 合计 | -774.00 |

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 |
|-----------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 42,077.68 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 42,077.68 |

6.4.7.19 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 | 149,179.94 |
| 上市年费 | 29,835.26 |
| 指数使用费 | 100,000.00 |
| 银行汇划费用 | 202.00 |
| 合计 | 301,594.10 |

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较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。

6.4.10.2 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 | 205,954.25 | 419,140.69 |

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 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 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 | 41,190.87 | 83,828.15 |

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。

6.4.10.2.3 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：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 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 |
| 中国工商银行一 | 45,472,626.00 | 84.0200% | 45,489,626.00 | 83.2800% |

| | | | | |
|----------------------------|--|--|--|--|
| 鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金 | | | | |
|----------------------------|--|--|--|--|

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 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 |
| 中国工商银行 | 628,858.24 | 2,618.22 | 1,492,192.38 | 3,318.36 |

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

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：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 |
|--------|------|-----------------|------|--------|-----------------|--------|--------|------------|------------|----|
| 600759 | 洲际油气 | 2016 年 6 月 27 日 | 重大事项 | 7.58 | 2016 年 7 月 11 日 | 8.10 | 93,214 | 809,901.50 | 706,562.12 | - |

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，将风险控制可在承受的范围之内。

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 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 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 | 628,858.24 | - | - | - | 628,858.24 |
| 结算备付金 | 3,386.88 | - | - | - | 3,386.88 |
| 存出保证金 | 1,172.82 | - | - | - | 1,172.82 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -81,649,262.88 | 81,649,262.88 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 112,584.15 | 112,584.15 |
| 应收利息 | - | - | - | 141.00 | 141.00 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 633,417.94 | - | - | -81,761,988.03 | 82,395,405.97 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 33,288.13 | 33,288.13 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,657.63 | 6,657.63 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 22,821.01 | 22,821.01 |
| 其他负债 | - | - | - | 351,392.10 | 351,392.10 |
| 负债总计 | - | - | - | 414,158.87 | 414,158.87 |
| 利率敏感度缺口 | 633,417.94 | - | - | -81,347,829.16 | 81,981,247.10 |
| 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 | 782,692.06 | - | - | - | 782,692.06 |
| 结算备付金 | 11,509.11 | - | - | - | 11,509.11 |
| 存出保证金 | 3,617.46 | - | - | - | 3,617.46 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -99,461,127.83 | 99,461,127.83 |
| 应收利息 | - | - | - | 171.30 | 171.30 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 797,818.63 | - | - | -99,461,299.13 | 100,259,117.76 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 41,868.44 | 41,868.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | 8,373.70 | 8,373.70 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 23,636.05 | 23,636.05 |
| 其他负债 | - | - | - | 395,000.00 | 395,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 468,878.19 | 468,878.19 |
| 利率敏感度缺口 | 797,818.63 | - | - | -98,992,420.94 | 99,790,239.57 |

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 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 | 81,649,262.88 | 99.60 | 99,461,127.83 | 99.67 |
| 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 | 81,649,262.88 | 99.60 | 99,461,127.83 | 99.67 |

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% | 4,255,261.08 | 4,690,320.39 |
| | 业绩比较基准下降5% | -4,255,261.08 | -4,690,320.39 |

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 | 81,649,262.88 | 99.09 |
| | 其中：股票 | 81,649,262.88 | 99.09 |
| 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 | 632,245.12 | 0.77 |
| 7 | 其他各项资产 | 113,897.97 | 0.14 |
| 8 | 合计 | 82,395,405.97 | 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境内股票投资组合

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 | 4,297,956.24 | 5.24 |
| C | 制造业 | 37,232,300.85 | 45.42 |
| 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 | 4,562,316.88 | 5.57 |
| 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 | 8,501,889.29 | 10.37 |
| J | 金融业 | 17,625,146.19 | 21.50 |
| K | 房地产业 | 7,737,638.91 | 9.44 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 892,556.00 | 1.09 |
| 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 | 799,458.52 | 0.98 |
| | 合计 | 81,649,262.88 | 99.60 |

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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 | 1,354,278 | 12,093,702.54 | 14.75 |
| 2 | 600276 | 恒瑞医药 | 115,858 | 4,647,064.38 | 5.67 |
| 3 | 600518 | 康美药业 | 254,398 | 3,864,305.62 | 4.71 |
| 4 | 600570 | 恒生电子 | 40,703 | 2,717,739.31 | 3.32 |
| 5 | 601099 | 太平洋 | 373,800 | 2,291,394.00 | 2.80 |
| 6 | 600066 | 宇通客车 | 109,213 | 2,162,417.40 | 2.64 |
| 7 | 600703 | 三安光电 | 104,785 | 2,092,556.45 | 2.55 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 8 | 600109 | 国金证券 | 149,248 | 2,011,863.04 | 2.45 |
| 9 | 600535 | 天士力 | 53,275 | 1,905,114.00 | 2.32 |
| 10 | 600089 | 特变电工 | 213,458 | 1,818,662.16 | 2.22 |
| 11 | 600196 | 复星医药 | 94,233 | 1,792,311.66 | 2.19 |
| 12 | 600340 | 华夏幸福 | 72,890 | 1,777,058.20 | 2.17 |
| 13 | 600177 | 雅戈尔 | 126,249 | 1,740,973.71 | 2.12 |
| 14 | 600485 | 信威集团 | 96,200 | 1,716,208.00 | 2.09 |
| 15 | 600804 | 鹏博士 | 92,904 | 1,693,639.92 | 2.07 |
| 16 | 600867 | 通化东宝 | 78,468 | 1,623,502.92 | 1.98 |
| 17 | 600352 | 浙江龙盛 | 187,294 | 1,614,474.28 | 1.97 |
| 18 | 600208 | 新湖中宝 | 375,100 | 1,586,673.00 | 1.94 |
| 19 | 600031 | 三一重工 | 313,242 | 1,572,474.84 | 1.92 |
| 20 | 600446 | 金证股份 | 41,200 | 1,481,140.00 | 1.81 |
| 21 | 600522 | 中天科技 | 149,973 | 1,469,735.40 | 1.79 |
| 22 | 601933 | 永辉超市 | 334,580 | 1,381,815.40 | 1.69 |
| 23 | 603993 | 洛阳钼业 | 319,700 | 1,326,755.00 | 1.62 |
| 24 | 600079 | 人福医药 | 74,036 | 1,241,583.72 | 1.51 |
| 25 | 600816 | 安信信托 | 72,803 | 1,228,186.61 | 1.50 |
| 26 | 600503 | 华丽家族 | 131,800 | 1,208,606.00 | 1.47 |
| 27 | 600157 | 永泰能源 | 306,603 | 1,208,015.82 | 1.47 |
| 28 | 600588 | 用友网络 | 60,212 | 1,178,950.96 | 1.44 |
| 29 | 601012 | 隆基股份 | 87,500 | 1,141,875.00 | 1.39 |
| 30 | 600074 | 保千里 | 75,900 | 1,132,428.00 | 1.38 |
| 31 | 600978 | 宜华生活 | 97,600 | 1,087,264.00 | 1.33 |
| 32 | 600699 | 均胜电子 | 28,372 | 1,086,647.60 | 1.33 |
| 33 | 600256 | 广汇能源 | 257,713 | 1,056,623.30 | 1.29 |
| 34 | 601258 | 庞大集团 | 373,100 | 1,026,025.00 | 1.25 |
| 35 | 600490 | 鹏欣资源 | 121,700 | 972,383.00 | 1.19 |
| 36 | 600873 | 梅花生物 | 153,400 | 952,614.00 | 1.16 |
| 37 | 600143 | 金发科技 | 147,269 | 948,412.36 | 1.16 |
| 38 | 600655 | 豫园商城 | 82,800 | 897,552.00 | 1.09 |
| 39 | 600645 | 中源协和 | 25,400 | 892,556.00 | 1.09 |
| 40 | 601633 | 长城汽车 | 99,158 | 836,893.52 | 1.02 |
| 41 | 600410 | 华胜天成 | 73,880 | 828,933.60 | 1.01 |
| 42 | 600770 | 综艺股份 | 64,162 | 799,458.52 | 0.98 |
| 43 | 600811 | 东方集团 | 117,478 | 782,403.48 | 0.95 |
| 44 | 601216 | 君正集团 | 104,140 | 777,925.80 | 0.95 |
| 45 | 600516 | 方大炭素 | 84,841 | 775,446.74 | 0.95 |
| 46 | 600565 | 迪马股份 | 115,700 | 747,422.00 | 0.91 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 47 | 600759 | 洲际油气 | 93,214 | 706,562.12 | 0.86 |
| 48 | 601155 | 新城控股 | 73,100 | 676,906.00 | 0.83 |
| 49 | 601519 | 大智慧 | 65,450 | 601,485.50 | 0.73 |
| 50 | 600998 | 九州通 | 27,100 | 474,521.00 | 0.58 |

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 | 1,458,340.00 | 1.46 |
| 2 | 600446 | 金证股份 | 1,455,289.00 | 1.46 |
| 3 | 600074 | 保千里 | 1,148,100.34 | 1.15 |
| 4 | 600978 | 宜华生活 | 1,097,698.00 | 1.10 |
| 5 | 600565 | 迪马股份 | 765,076.00 | 0.77 |
| 6 | 601155 | 新城控股 | 677,900.22 | 0.68 |
| 7 | 600208 | 新湖中宝 | 615,759.00 | 0.62 |
| 8 | 601099 | 太平洋 | 543,770.00 | 0.54 |
| 9 | 603993 | 洛阳钼业 | 479,236.00 | 0.48 |
| 10 | 600699 | 均胜电子 | 410,752.00 | 0.41 |
| 11 | 600490 | 鹏欣资源 | 389,445.00 | 0.39 |
| 12 | 600276 | 恒瑞医药 | 345,540.00 | 0.35 |
| 13 | 601258 | 庞大集团 | 304,952.00 | 0.31 |
| 14 | 600518 | 康美药业 | 292,655.00 | 0.29 |
| 15 | 600588 | 用友网络 | 249,820.00 | 0.25 |
| 16 | 600503 | 华丽家族 | 249,608.00 | 0.25 |
| 17 | 600177 | 雅戈尔 | 230,790.00 | 0.23 |
| 18 | 600570 | 恒生电子 | 191,124.00 | 0.19 |
| 19 | 601216 | 君正集团 | 171,607.00 | 0.17 |
| 20 | 600066 | 宇通客车 | 161,883.00 | 0.16 |

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 | 600016 | 民生银行 | 4,163,038.00 | 4.17 |
| 2 | 600660 | 福耀玻璃 | 1,625,092.44 | 1.63 |
| 3 | 600252 | 中恒集团 | 1,025,397.87 | 1.03 |
| 4 | 601021 | 春秋航空 | 993,866.02 | 1.00 |
| 5 | 600499 | 科达洁能 | 730,428.42 | 0.73 |
| 6 | 600340 | 华夏幸福 | 460,922.00 | 0.46 |
| 7 | 600276 | 恒瑞医药 | 370,022.00 | 0.37 |
| 8 | 600518 | 康美药业 | 307,667.00 | 0.31 |
| 9 | 600177 | 雅戈尔 | 277,991.00 | 0.28 |
| 10 | 601099 | 太平洋 | 209,740.00 | 0.21 |
| 11 | 600570 | 恒生电子 | 206,541.00 | 0.21 |
| 12 | 601969 | 海南矿业 | 186,858.00 | 0.19 |
| 13 | 600066 | 宇通客车 | 178,614.00 | 0.18 |
| 14 | 600109 | 国金证券 | 174,968.00 | 0.18 |
| 15 | 600352 | 浙江龙盛 | 173,983.00 | 0.17 |
| 16 | 600703 | 三安光电 | 172,710.00 | 0.17 |
| 17 | 600089 | 特变电工 | 159,315.00 | 0.16 |
| 18 | 600485 | 信威集团 | 158,848.00 | 0.16 |
| 19 | 600535 | 天士力 | 158,680.00 | 0.16 |
| 20 | 600196 | 复星医药 | 153,572.00 | 0.15 |

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 | 13,956,019.22 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 13,783,009.75 |

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

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投。

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恒生电子股份有限公司控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司（以下简称“恒生网络”）于2015年9月7日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）行政处罚事先告知书（处罚字[2015]68号）。恒生网络开发运营的HOMS系统，包含子账户开立、提供委托交易、存储、查询、清算等多种证券业务属性的功能。恒生网络明知客户经营

方式，仍向不具有经营证券资质的客户销售该系统、提供相关服务，并获取收益的行为违反了《证券法》第一百二十二条的规定，构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。时任恒生网络董事长刘曙峰为直接负责的主管人员，总经理官晓岚为其他直接责任人员。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第一百九十七条的规定，我会拟决定：

- 一、 没收恒生网络违法所得 132,852,384.06 元，并处以 398,557,152.18 元罚款；
- 二、 对刘曙峰给予警告，并处以 30 万元罚款；
- 三、 对官晓岚给予警告，并处以 30 万元罚款

本基金投资的前十名证券之一的太平洋证券股份有限公司董事会收到中国证券监督管理委员会云南监管局(以下简称“云南证监局”)于 2016-01-22 日做出的《关于对太平洋证券股份有限公司采取暂停新开证券账户 1 个月措施的决定》。公司温州瓯江路证券营业部个别经纪人涉嫌违规为客户间融资提供便利，公司内部检查时发现了该问题，但未能及时自纠，存在内部控制不完善情形。上述行为违反了《证券公司融资融券业务管理办法》第三条、《中国证监会关于加强证券经济业务管理的规定》第三条和《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款的规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，云南证监局责令公司在 2016 年 1 月 25 日至 2016 年 2 月 24 日期间暂停新开证券账户 1 个月，暂停期间公司不得新增经纪业务客户。同时要求公司按照相应法律、行政法规和中国证监会规定的要求落实整改，进一步梳理相关流程，强化有关人员合规守法意识。

公司高度重视上述决定，第一时间积极组织整改，进一步梳理内控制度和相关流程，完善相关工作程序，强化有关人员合规守法意识，依法合规开展业务。

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 | 1,172.82 |
| 2 | 应收证券清算款 | 112,584.15 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 141.00 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 113,897.97 |

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：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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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 |
|-----|------------|--------------|------------|-------------|------------|
| 463 | 116,898.63 | 47,076,032.0 | 86.98% | 7,048,035.0 | 13.02% |

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 | 45,472,626.00 | 84.02% |

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 | 1,101,235.00 | 2.03% |
| 2 | 王贺成 | 438,400.00 | 0.81% |
| 3 | 田磊 | 428,562.00 | 0.79% |
| 4 | 邵贵祥 | 320,000.00 | 0.59% |
| 5 | 国信证券股份有限公司客户信用交 易担保证券账户 | 289,559.00 | 0.53% |
| 6 | 万锐 | 257,137.00 | 0.48% |
| 7 | 杨永春 | 216,100.00 | 0.40% |
| 8 | 郑绍睿 | 214,281.00 | 0.40% |
| 9 | 黄禹嘉 | 180,000.00 | 0.33% |
| 10 | 吴礼生 | 165,654.00 | 0.31% |
| | 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 | 45,472,626.00 | 84.02% |

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：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（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 | 54,624,067.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 12,500,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 13,000,000.00 |
| 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 | 54,124,067.00 |

§ 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，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 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

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 | |
| 中泰证券 | 1 | 27,739,028.97 | 100.00% | 25,833.29 | 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 | 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 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤海银行基金定期定额申购及网上银行、手机银行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22日 |
| 5 | 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》 | 2016年3月17日 |
| 6 | 2015年年度度报告摘要 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016年3月30日 |
| 7 | 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 |
| 8 | 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 |

§ 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 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
2016 年 8 月 29 日