

深证民营交易型开放式指数证券投资基金 清算报告

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

公告日期：2020年7月10日

一、重要提示

深证民营交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[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联接基金募集的批复》核准募集,于2011年9月2日成立并正式运作。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,本基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为维护基金份额持有人利益,基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”),提议终止基金合同。本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,会议已于2020年6月11日表决通过了《关于终止深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金合同相关事项的议案》,自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。

本基金从2020年6月12日起进入清算期,由本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、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所组成基金财产清算组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、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
基金简称	民营 ETF
场内简称	民营 ETF
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
最后运作日(2020 年 6 月 11 日) 基金份额总额	7,372,540.00 份
最后运作日(2020 年 6 月 11 日) 基金份额净值	4.7846

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。

三、基金运作情况

1、基金基本情况

深证民营交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[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有限公司普华永道中天验字(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。

自 2011 年 9 月 2 日至 2020 年 6 月 11 日期间,本基金按基金合同约定正常运作。

2、清算原因

基金合同“二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“(二)本基金合同的终止”约定:“有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止: 1. 基金份额持有人大会决定终止的; 2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务; 3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务; 4. 中国证监会规定的其他情况。”。

根据市场环境变化,为维护基金份额持有人利益,基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”),提议终止基金合同。本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,会议已于 2020 年 6 月 11 日表决通过了《关于终止深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金合同相关事项的议案》,自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。

3、清算起始日

本基金从 2020 年 6 月 12 日起进入清算期,清算期间为 2020 年 6 月 12 日至 2020 年 6 月 15 日。

4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价，由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

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：2020年6月11日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2020年6月11日
资 产：	
银行存款	1,663,578.83
结算备付金	41,047.22
存出保证金	355.04
交易类金融资产	34,060,332.32
其中：股票投资	34,060,332.32
债券投资	
资产支持证券投资	
基金投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	1,211.92
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	35,766,525.33
负债和所有者权益	最后运作日 2020年6月11日
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	311,451.91
应付赎回款	
应付管理人报酬	7,601.57

应付托管费	1,520.31
应付销售服务费	
应付交易费用	4,982.40
应付税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	165,992.31
负债合计	491,548.50
所有者权益：	
实收基金	24,331,637.91
未分配利润	10,943,338.92
所有者权益合计	35,274,976.83
负债和所有者权益总计	35,766,525.33

五、清算情况

在清算期间，基金财产清算组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《基金合同》第二十一部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 备付金、保证金、应收款和其他资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价值（元）	清算金额（元）	清算期末账面价值（元）
1	结算备付金	41,047.22	-20,278.32	20,768.90
2	存出保证金	355.04	-	355.04
3	应收证券清算款	-	-	-
4	应收利息（注）	1,211.92	789.46	2,001.38
5	应收股利	-	-	-
6	应收申购款	-	-	-
7	递延所得税资产	-	-	-

8	其他资产	-	-	-
---	------	---	---	---

注：应收利息不含应收债券利息、应收资产证券化利息和应收买入返售金融资产利息。

(2) 金融资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价值(元)(注1)	运作终止日数量(股/份/张)	清算期内最后处置日	清算金额(元)	清算期末账面价值(元)(注2)	清算期末数量(股/份/张)
1	股票投资	34,060,332.32	1,473,575.00	2020年6月12日	33,785,970.21	0.00	0.00
2	基金投资	-	-	-	-	-	-
3	债券投资	-	-	-	-	-	-
4	资产支持证券投资	-	-	-	-	-	-
5	贵金属投资	-	-	-	-	-	-
6	衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-

注 1：债券投资、资产支持证券投资和买入返售金融资产运作终止日公允价值包含相应的应收利息。

注 2：债券投资、资产支持证券投资和买入返售金融清算期末公允价值包含相应的应收利息。

3、负债清偿情况

序号	项目	运作终止日金额 (元)	清算期变动金额(元)(账面 价值减少以“-”填列)	清算期期末金额 (元)
1	短期借款	-	-	-
2	交易性金融负债	-	-	-
3	衍生金融负债	-	-	-
4	卖出回购金融资 产款	-	-	-
5	应付证券清算款	311,451.91	-295,205.79	16,246.12
6	应付赎回款	-	-	-
7	应付管理人报酬	7,601.57	-	7,601.57
8	应付托管费	1,520.31	-	1,520.31
9	应付销售服务费	-	-	-
10	应付交易费用	4,982.40	30,851.60	35,834.00
11	应交税费	-	-	-
12	应付利息	-	-	-
13	应付利润	-	-	-
14	递延所得税负债	-	-	-
15	其他负债	165,992.31	-50,000.00	115,992.31

4、清算期的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2020年6月12日 至2020年6月15日
一、收入	-215,523.37
1. 利息收入	789.46
其中：存款利息收入	789.46
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“-”号填列）	5,406,732.31
其中：股票投资收益	5,416,395.43
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	-9,663.12
3. 公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-5,623,045.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-
二、费用	67,712.40
1. 管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	67,712.40
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-283,235.77
减：所得税费用	-
四、净利润总额（净亏损以“-”号填列）	-283,235.77

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2020年6月11日基金净资产	35,274,976.83
加：清算期间净收益	-283,235.77
加：应付利润结转实收基金金额	-
减：净赎回金额（含费用）	-
二、2020年6月15日基金净资产	34,991,741.06

根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份

额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息归份额持有人所有。如于清算划款日的应收利息余额、备付金、保证金等由基金管理人以自有资金先行垫付的，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

6、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 深证民营交易型开放式指数证券投资基金资产负债表及审计报告；
- (2) 《深证民营交易型开放式指数证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

深证民营交易型开放式指数证券投资基金财产清算组

2020年7月10日