

上证民营企业 50 交易型开放式指数证券 投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 30 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 2017 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|------------------|
| 基金简称 | 民企 ETF |
| 场内简称 | 民企 ETF |
| 基金主代码 | 510070 |
| 前端交易代码 | - |
| 后端交易代码 | - |
| 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 | 51,624,067.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2010 年 10 月 29 日 |

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 | 郭明 |
| | 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 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.phfund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2016 年 | 2015 年 | 2014 年 |
|---------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期已实现收益 | -4,192,656.46 | 76,728,772.38 | 28,971,753.98 |
| 本期利润 | -13,424,700.32 | 47,276,538.18 | 54,174,901.99 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2502 | 0.6481 | 0.2788 |
| 本期基金份额净值增长率 | -13.68% | 24.12% | 30.84% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4104 | 0.6602 | 0.1875 |
| 期末基金资产净值 | 81,415,787.27 | 99,790,239.57 | 181,183,995.00 |
| 期末基金份额净值 | 1.577 | 1.827 | 1.472 |

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 12 月 31 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

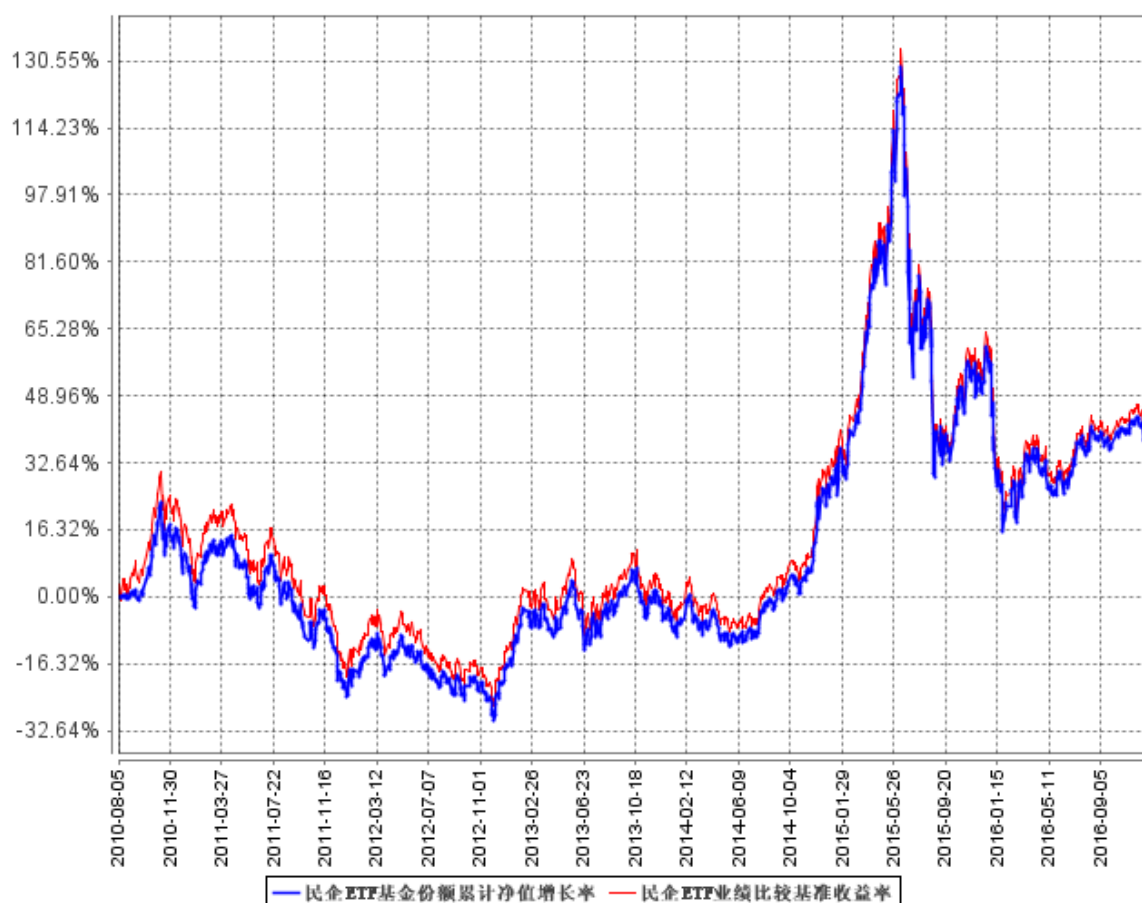
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -1.38% | 0.62% | -0.95% | 0.63% | -0.43% | -0.01% |
| 过去六个月 | 4.09% | 0.73% | 4.57% | 0.74% | -0.48% | -0.01% |
| 过去一年 | -13.68% | 1.45% | -13.84% | 1.46% | 0.16% | -0.01% |
| 过去三年 | 40.18% | 1.71% | 37.65% | 1.73% | 2.53% | -0.02% |
| 过去五年 | 71.04% | 1.60% | 64.52% | 1.61% | 6.52% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 35.17% | 1.56% | 38.10% | 1.59% | -2.93% | -0.03% |

注：本基金业绩比较基准为上证民营企业 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

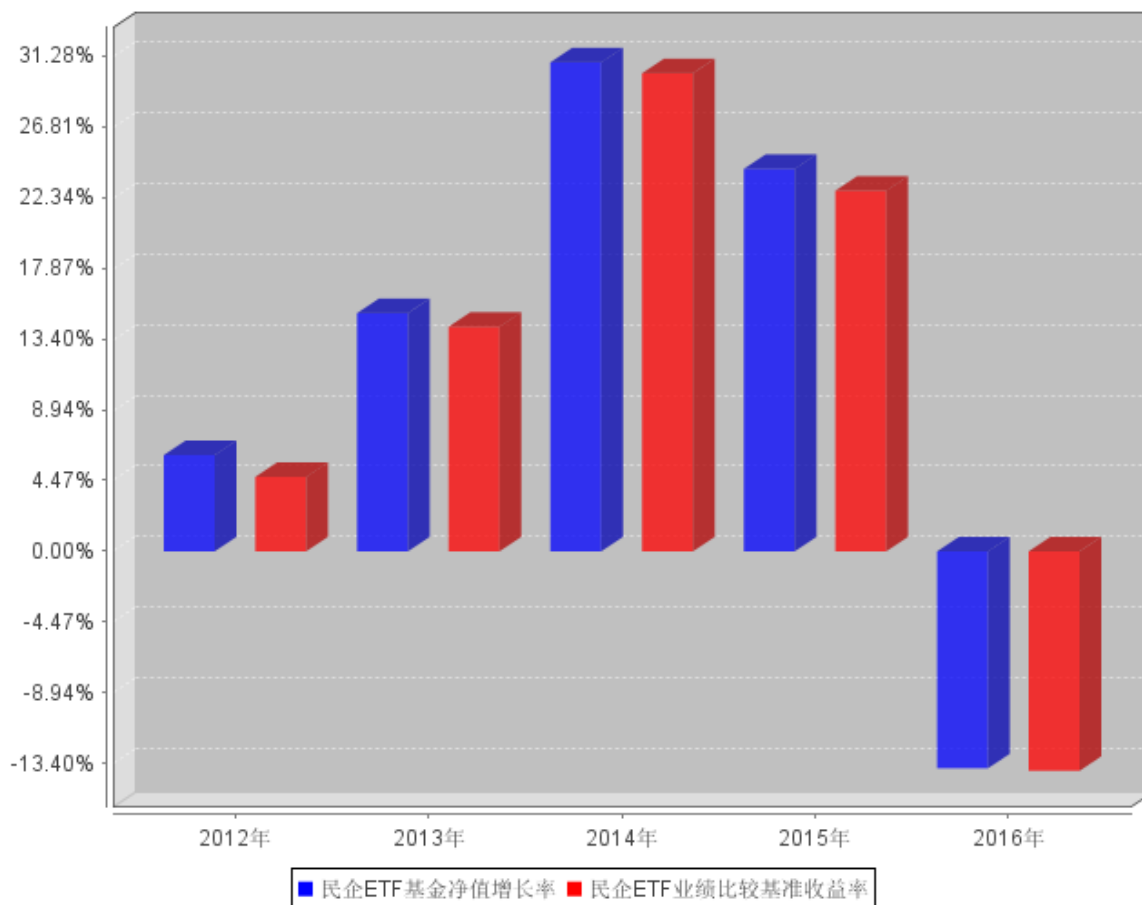


注：1、本基金合同于 2010 年 8 月 5 日生效。

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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

民企ETF过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：过去三年本基金未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本8,000万元人民币，后于2001年9

月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止本报告期末，公司管理 129 只基金和 10 只全国社保投资组合，经过 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的经验。

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，现同时担任量化及衍生品投资部副总经理。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 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师；</p> <p>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；</p> <p>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月起兼任鹏华高铁产业分级基金基金经理，2016年9月起兼任鹏华中证500指数(LOF)、鹏华沪深300指数(LOF)基金基金经理，2016年11月起兼任鹏华一带一路分级、鹏华新能源分级基金基金经理。</p> <p>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。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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，本基金运作合法合规，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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管

理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析

和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 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并对基金财产造成损失的异常交易行为。

本报告期内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%的交易次数为 4 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

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

本基金秉承指数基金的投资策略，在报告期内连续遭遇一定比例申购赎回，对基金净值造成一定影响，管理人尽力降低影响，

在力争跟踪指数收益的基础上，将基金跟踪误差控制在合理范围内，同时实现了 0.16% 的超额收益。

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 1.577 元；本报告期基金份额净值增长率为-13.68%，业绩比较基准收益率-13.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济的“筑底回稳”趋势较为明显。在三大需求中，消费需求保持稳中有升，进出口增长较为反复，PPP 项目的加快推进和加速实施，使得投资需求增速小幅回升，总体来看，2016 年全年经济波动由“弱”转“稳”，全年 GDP 同比增长回稳、转暖。2016 年 A 股市场成交活跃度较去年腰斩，风格特征方面大盘股表现更佳，行业表现方面只有食品饮料取得较大绝对正收益。2017 预计行情整体呈平衡震荡市，行业轮动加速、个股表现日趋分化，看好“一带一路”，“混改”主题类个股表现。

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，力争为投资者带来超越指数收益的投资回报。

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

4.7.1 截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 21,186,226.63 元，基金份额净值 1.577 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 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-----|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 678,145.70 | 782,692.06 |
| 结算备付金 | | 122.83 | 11,509.11 |
| 存出保证金 | | 246.24 | 3,617.46 |
| 交易性金融资产 | | 81,292,663.03 | 99,461,127.83 |
| 其中：股票投资 | | 81,292,663.03 | 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 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | | 135.80 | 171.30 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 81,971,313.60 | 100,259,117.76 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |
| | | 2016年12月31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 | | - | - |
| 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 | | 35,425.99 | 41,868.44 |
| 应付托管费 | | 7,085.17 | 8,373.70 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 13,015.17 | 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 | | 500,000.00 | 395,000.00 |
| 负债合计 | | 555,526.33 | 468,878.19 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 60,229,560.64 | 63,729,646.80 |
| 未分配利润 | | 21,186,226.63 | 36,060,592.77 |
| 所有者权益合计 | | 81,415,787.27 | 99,790,239.57 |
| 负债和所有者权益总计 | | 81,971,313.60 | 100,259,117.76 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.577 元，基金份额总额 51,624,067.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016年1月1日至 2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日 |
|----------------------------|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 一、收入 | | -12,246,376.53 | 48,874,731.61 |
| 1.利息收入 | | 5,440.21 | 9,128.80 |
| 其中：存款利息收入 | | 5,440.21 | 9,128.80 |
| 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） | | -3,016,389.88 | 77,865,375.92 |
| 其中：股票投资收益 | | -4,388,962.97 | 76,414,032.42 |
| 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 | | 1,372,573.09 | 1,451,343.50 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -9,232,043.86 | -29,452,234.20 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | -3,383.00 | 452,461.09 |
| 减：二、费用 | | 1,178,323.79 | 1,598,193.43 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.8.2.1 | 418,739.59 | 675,431.78 |
| 2. 托管费 | 7.4.8.2.2 | 83,747.94 | 135,086.35 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.8.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | | 65,442.26 | 182,223.30 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 610,394.00 | 605,452.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -13,424,700.32 | 47,276,538.18 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -13,424,700.32 | 47,276,538.18 |

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31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) | - | -13,424,700.32 | -13,424,700.32 |
| 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) | -3,500,086.16 | -1,449,665.82 | -4,949,751.98 |
| 其中：1.基金申购款 | 19,833,821.46 | 5,659,654.57 | 25,493,476.03 |
| 2.基金赎回款 | -23,333,907.62 | -7,109,320.39 | -30,443,228.01 |
| 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) | 60,229,560.64 | 21,186,226.63 | 81,415,787.27 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 143,648,280.42 | 37,535,714.58 | 181,183,995.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 47,276,538.18 | 47,276,538.18 |
| 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) | -79,918,633.62 | -48,751,659.99 | -128,670,293.61 |
| 其中：1.基金申购款 | 758,935,346.76 | 646,214,122.41 | 1,405,149,469.17 |
| 2.基金赎回款 | -838,853,980.38 | -694,965,782.40 | -1,533,819,762.78 |
| 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) | 63,729,646.80 | 36,060,592.77 | 99,790,239.57 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 747 号《关于核准上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,006,987,117.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2010)第 196 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 8 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,007,002,863.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 15,746.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资

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

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

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

7.4.4.1 本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

7.4.5 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至2016年12月31日，本基金没有计提有关增值税费用。

(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，股票的股息、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，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。

7.4.7 关联方关系

| 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 |

| | |
|--|-------------------|
| 国信证券股份有限公司(“国信证券”) | 基金管理人的股东、基金的一级交易商 |
| 意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.) | 基金管理人的股东 |
| 深圳市北融信投资发展有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 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 |
| 鹏华资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注：无。

7.4.8.1.2 债券交易

注：无。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.8.1.4 权证交易

注：无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付 的管理费 | 418,739.59 | 675,431.78 |

| | | |
|-----------------|---|---|
| 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。

7.4.8.2.2 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 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 83,747.94 | 135,086.35 |

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金本年度及上年度可比报告期管理人未投资、持有本基金。

7.4.8.4.2 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 | | 上年度末 | |
|-----------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 2016 年 12 月 31 日 | | 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—鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金 | 43,850,926.00 | 84.9400% | 45,489,626.00 | 83.2800% |

7.4.8.5 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12月31日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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 | 678,145.70 | 5,084.56 | 782,692.06 | 6,094.99 |

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：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。

7.4.9.2 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 |
|--------|------|-------------|---------|--------|------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 600485 | 信威集团 | 2016年12月26日 | 重大事项未公告 | 14.60 | - | - | 111,100 | 2,583,259.78 | 1,622,060.00 | - |
| 600654 | 中安消 | 2016年12月14日 | 重大资产重组 | 17.43 | - | - | 55,700 | 1,069,332.00 | 970,851.00 | - |
| 600655 | 豫园商城 | 2016年12月20日 | 重大事项未公告 | 11.42 | - | - | 79,500 | 1,144,375.27 | 907,890.00 | - |
| 600645 | 中源协和 | 2016年12月13日 | 重大资产重组 | 26.80 | - | - | 24,400 | 1,021,007.90 | 653,920.00 | - |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

§8 投资组合报告

8.1 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 | 81,292,663.03 | 99.17 |
| | 其中：股票 | 81,292,663.03 | 99.17 |
| 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 | 678,268.53 | 0.83 |
| 7 | 其他各项资产 | 382.04 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 81,971,313.60 | 100.00 |

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 4,573,584.22 | 5.62 |
| C | 制造业 | 39,061,438.17 | 47.98 |

| | | | |
|---|------------------|---------------|-------|
| 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 | 3,322,041.80 | 4.08 |
| 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 | 7,480,427.58 | 9.19 |
| J | 金融业 | 18,615,317.54 | 22.86 |
| K | 房地产业 | 6,971,537.02 | 8.56 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 653,920.00 | 0.80 |
| 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 | 614,396.70 | 0.75 |
| | 合计 | 81,292,663.03 | 99.85 |

8.2.2 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。

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

8.3 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

8.3.1 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 | 600016 | 民生银行 | 1,350,078 | 12,258,708.24 | 15.06 |
| 2 | 600276 | 恒瑞医药 | 107,158 | 4,875,689.00 | 5.99 |
| 3 | 600518 | 康美药业 | 225,798 | 4,030,494.30 | 4.95 |
| 4 | 601099 | 太平洋 | 518,400 | 2,669,760.00 | 3.28 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 5 | 600089 | 特变电工 | 246,558 | 2,251,074.54 | 2.76 |
| 6 | 600109 | 国金证券 | 160,948 | 2,097,152.44 | 2.58 |
| 7 | 600703 | 三安光电 | 155,156 | 2,077,538.84 | 2.55 |
| 8 | 600535 | 天士力 | 49,375 | 2,048,568.75 | 2.52 |
| 9 | 600066 | 宇通客车 | 101,013 | 1,978,844.67 | 2.43 |
| 10 | 600804 | 鹏博士 | 86,104 | 1,888,260.72 | 2.32 |

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> 的年度报告正文。

8.3.2 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 2,004,629.00 | 2.01 |
| 2 | 600446 | 金证股份 | 1,468,343.00 | 1.47 |
| 3 | 600584 | 长电科技 | 1,449,355.52 | 1.45 |
| 4 | 600487 | 亨通光电 | 1,335,985.00 | 1.34 |
| 5 | 600074 | 保千里 | 1,217,946.34 | 1.22 |
| 6 | 600978 | 宜华生活 | 1,106,135.00 | 1.11 |
| 7 | 600654 | 中安消 | 1,069,332.00 | 1.07 |
| 8 | 600565 | 迪马股份 | 772,713.00 | 0.77 |
| 9 | 601155 | 新城控股 | 684,691.22 | 0.69 |
| 10 | 600884 | 杉杉股份 | 637,072.00 | 0.64 |
| 11 | 600208 | 新湖中宝 | 617,567.00 | 0.62 |
| 12 | 600699 | 均胜电子 | 571,314.00 | 0.57 |
| 13 | 601099 | 太平洋 | 562,819.00 | 0.56 |
| 14 | 600089 | 特变电工 | 530,505.00 | 0.53 |
| 15 | 600157 | 永泰能源 | 495,955.00 | 0.50 |
| 16 | 603993 | 洛阳钼业 | 488,538.00 | 0.49 |
| 17 | 600485 | 信威集团 | 425,798.00 | 0.43 |
| 18 | 600109 | 国金证券 | 395,630.00 | 0.40 |
| 19 | 600490 | 鹏欣资源 | 394,767.00 | 0.40 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 20 | 601127 | 小康股份 | 391,493.90 | 0.39 |
|----|--------|------|------------|------|

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。

8.4.2 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 | 600016 | 民生银行 | 4,163,038.00 | 4.17 |
| 2 | 600867 | 通化东宝 | 1,854,710.11 | 1.86 |
| 3 | 600660 | 福耀玻璃 | 1,625,092.44 | 1.63 |
| 4 | 600143 | 金发科技 | 1,128,731.10 | 1.13 |
| 5 | 600252 | 中恒集团 | 1,025,397.87 | 1.03 |
| 6 | 601021 | 春秋航空 | 993,866.02 | 1.00 |
| 7 | 600811 | 东方集团 | 842,325.96 | 0.84 |
| 8 | 600499 | 科达洁能 | 730,428.42 | 0.73 |
| 9 | 600518 | 康美药业 | 608,303.00 | 0.61 |
| 10 | 600998 | 九州通 | 569,081.64 | 0.57 |
| 11 | 600276 | 恒瑞医药 | 565,448.00 | 0.57 |
| 12 | 601519 | 大智慧 | 546,147.40 | 0.55 |
| 13 | 600340 | 华夏幸福 | 523,166.00 | 0.52 |
| 14 | 600196 | 复星医药 | 468,890.00 | 0.47 |
| 15 | 600208 | 新湖中宝 | 461,825.00 | 0.46 |
| 16 | 600177 | 雅戈尔 | 342,483.00 | 0.34 |
| 17 | 601099 | 太平洋 | 318,940.00 | 0.32 |
| 18 | 600570 | 恒生电子 | 275,256.73 | 0.28 |
| 19 | 601933 | 永辉超市 | 263,897.00 | 0.26 |
| 20 | 600066 | 宇通客车 | 256,312.00 | 0.26 |

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。

8.4.3 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 | 21,582,117.64 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 21,498,703.61 |

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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

8.10.2 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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本组合投资的前十名证券之一太平洋证券股份有限公司（以下简称“公司”）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年1月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》（〔2016〕1号），主要内容如下：

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。

本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，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。

8.12.2

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。

8.12.3 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 | 246.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 135.80 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 382.04 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末股票投资中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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 |
| 427 | 120,899.45 | 44,802,237.00 | 86.79% | 6,821,830.00 | 13.21% |

9.1.2 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 | 43,850,926.00 | 84.94% |

9.2 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 | 911,778.00 | 1.77% |
| 2 | 王贺成 | 438,400.00 | 0.85% |
| 3 | 田磊 | 428,562.00 | 0.83% |
| 4 | 邵贵祥 | 320,000.00 | 0.62% |
| 5 | 万锐 | 257,137.00 | 0.50% |
| 6 | 杨永春 | 216,100.00 | 0.42% |
| 7 | 郑绍睿 | 214,281.00 | 0.42% |

| | | | |
|----|-------------------------------------|---------------|--------|
| 8 | 黄禹嘉 | 180,000.00 | 0.35% |
| 9 | 时珣 | 172,400.00 | 0.33% |
| 10 | 吴礼生 | 165,654.00 | 0.32% |
| | 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 | 43,850,926.00 | 84.94% |

注：持有人为场内持有人。

9.3 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。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§10 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 | 17,000,000.00 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 20,000,000.00 |
| 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 | 51,624,067.00 |

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

报告期内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。

经公司董事会审议通过，公司同意聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

报告期内基金托管人的重大人事变动：

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | 43,080,821.25 | 100.00% | 40,121.12 | 100.00% | - |
| 广发证券 | 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。

11.7.2 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 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 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 |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

注：本基金本报告期内未通过券商交易单元进行债券回购交易及权证交易。

鹏华基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日