

上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金

2013第四季度 报告

2013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
报告书日期:2014年1月20日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及监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责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金管理规定,于2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述及重大遗漏。
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。

本报告期无财务会计报告。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	上证企50 ETF
基金代码	510070
基金管理方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年6月5日
报告期末基金总额	230,624,067.00元

投资目标

紧密跟踪上证企50指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金采取被动指数投资方法,通过成份股在上证民营企业50指数中的权重配置和成份股买卖操作,力争在扣除相关费用后的净值增长率与上证企50指数在扣除相关费用后的净值增长率相一致。

投资策略

当期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为,或因基金的申购赎回等行为导致基金的资产配置偏离指数的成份股,基金管理人将对成份股进行适当的调整,并辅以金融衍生产品投资等,以期使基金的净值增长率与上证企50指数在扣除相关费用后的净值增长率相一致,从而保持基金的净值增长率与上证企50指数在扣除相关费用后的净值增长率相一致。

业绩比较基准

上证民营企业50指数

风险收益特征

本基金是被动型指数基金,风险收益特征与上证企50指数风险收益特征一致。

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

注:本基金在交易所行情系统净值揭示及其他信息显示净值下,即称为“净值T+0”。

1.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-256,148.88
2.本期利润	-15,842,461.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0667
4.期末基金份额净值	259,384,195.79
5.期末可供分配基金份额净值	1.125

注:1.本期利润即收入款项扣除相关费用后的金额,本期利润为本期已实现收益加上本期利润。

2.本期已实现收益指不包含持有人认购或交易基金份额的任何费用,即费用后实际收益水平将有所列示。

3.2 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长①	净值增长标准差②	业绩比较基准收益	业绩比较基准标准差③	①-③	②-④
过去三个月	-5.94%	1.28%	-5.86%	1.27%	-0.14%	0.01%

注:业绩比较基准=上证民营企业50指数。

3.2 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.4 基金管理人报告

注:1.本基金成立于2010年6月5日,即为正式生效日。

2.本基金在交易所行情系统净值揭示及其他信息显示净值下,即称为“净值T+0”。

3.2 本报告期无财务会计报告。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
崔俊杰	本基金基金经理	2013年3月30日	-	5

注:1.任本基金的基金经理日期即公司作出决定后正式对外公告之日,即为成立新基金基金经理的任职日期,即基金合同生效日。

2.证券从业的年限从证券业从业资格取得之日起计算,不包括基金管理人任职期间。

4.2 管理人报告报告期内本基金运作无异常情况的说明

报告期内,本基金运作无异常情况,不存在基金管理人认为可能影响投资者决策的重要因素,但,由于宏观经济数据好,短期估价模型会转为流动性平衡状态,“调仓”会有一个有利的环境,本基金将根据产品的基本风格进行操作,但,在市场波动较大时,投资者需注意参与度和风险控制,从而,我们对短期操作的决策会根据宏观经济数据。

我们仍强调前期的观念,反复的经济形势会带来资产之间动态的复杂的多样化的变化,资产配置调整的大概率和机会成本相对较低

4.3 公司公平交易专项说明

报告期内,本基金在公平交易方面无异常情况,交易行为符合公平交易制度的规定。

4.4 报告期内本基金无关联交易。

4.5 报告期内本基金无关联交易。

4.6 公平交易专项的说明

报告期内,本基金在公平交易方面无异常情况,交易行为符合公平交易制度的规定。

4.7 报告期内本基金无关联交易。

4.8 报告期内本基金无关联交易。

4.9 报告期内本基金无关联交易。

4.10 报告期内持有的处于转股期的可转债债券明细

本基金在报告期未持有任何的外部期权,期权的行权日未到,期权的公允价值为0。

4.11 报告期内本基金无关联交易。

4.12 报告期内本基金无关联交易。

4.13 报告期内本基金无关联交易。

4.14 报告期内本基金无关联交易。

4.15 报告期内本基金无关联交易。

4.16 报告期内本基金无关联交易。

4.17 报告期内本基金无关联交易。

4.18 报告期内本基金无关联交易。

4.19 报告期内本基金无关联交易。

4.20 报告期内本基金无关联交易。

4.21 报告期内本基金无关联交易。

4.22 报告期内本基金无关联交易。

4.23 报告期内本基金无关联交易。

4.24 报告期内本基金无关联交易。

4.25 报告期内本基金无关联交易。

4.26 报告期内本基金无关联交易。

4.27 报告期内本基金无关联交易。

4.28 报告期内本基金无关联交易。

4.29 报告期内本基金无关联交易。

4.30 报告期内本基金无关联交易。

4.31 报告期内本基金无关联交易。

4.32 报告期内本基金无关联交易。

4.33 报告期内本基金无关联交易。

4.34 报告期内本基金无关联交易。

4.35 报告期内本基金无关联交易。

4.36 报告期内本基金无关联交易。

4.37 报告期内本基金无关联交易。

4.38 报告期内本基金无关联交易。

4.39 报告期内本基金无关联交易。

4.40 报告期内本基金无关联交易。

4.41 报告期内本基金无关联交易。

4.42 报告期内本基金无关联交易。

4.43 报告期内本基金无关联交易。

4.44 报告期内本基金无关联交易。

4.45 报告期内本基金无关联交易。

4.46 报告期内本基金无关联交易。

4.47 报告期内本基金无关联交易。

4.48 报告期内本基金无关联交易。

4.49 报告期内本基金无关联交易。

4.50 报告期内本基金无关联交易。

4.51 报告期内本基金无关联交易。

4.52 报告期内本基金无关联交易。

4.53 报告期内本基金无关联交易。

4.54 报告期内本基金无关联交易。

4.55 报告期内本基金无关联交易。

4.56 报告期内本基金无关联交易。

4.57 报告期内本基金无关联交易。

4.58 报告期内本基金无关联交易。

4.59 报告期内本基金无关联交易。

4.60 报告期内本基金无关联交易。

4.61 报告期内本基金无关联交易。

4.62 报告期内本基金无关联交易。

4.63 报告期内本基金无关联交易。

4.64 报告期内本基金无关联交易。

4.65 报告期内本基金无关联交易。

4.66 报告期内本基金无关联交易。

4.67 报告期内本基金无关联交易。

4.68 报告期内本基金无关联交易。

4.69 报告期内本基金无关联交易。

4.70 报告期内本基金无关联交易。

4.71 报告期内本基金无关联交易。

4.72 报告期内本基金无关联交易。

4.73 报告期内本基金无关联交易。

4.74 报告期内本基金无关联交易。

4.75 报告期内本基金无关联交易。

4.76 报告期内本基金无关联交易。

4.77 报告期内本基金无关联交易。

4.78 报告期内本基金无关联交易。

4.79 报告期内本基金无关联交易。

4.80 报告期内本基金无关联交易。

4.81 报告期内本基金无关联交易。

4.82 报告期内本基金无关联交易。

4.83 报告期内本基金无关联交易。

4.84 报告期内本基金无关联交易。

4.85 报告期内本基金无关联交易。

4.86 报告期内本基金无关联交易。

4.87 报告期内本基金无关联交易。

4.88 报告期内本基金无关联交易。

4.89 报告期内本基金无关联交易。

4.90 报告期内本基金无关联交易。

4.91 报告期内本基金无关联交易。

4.92 报告期内本基金无关联交易。

4.93 报告期内本基金无关联交易。

4.94 报告期内本基金无关联交易。

4.95 报告期内本基金无关联交易。

4.96 报告期内本基金无关联交易。

4.97 报告期内本基金无关联交易。

4.98 报告期内本基金无关联交易。

4.99 报告期内本基金无关联交易。

4.10 报告期内本基金无关联交易。