



Disclosure 信息披露

2014年1月21日 星期二
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B166

鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,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预示其未来表现,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。

本报告自2014年1月16日起至12月31日止。

2.1 基金产品情况	
基金名称	鹏华深证民营ETF联接
基金代码	260610
交易代码	260610
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
报告期末基金份额总额	186,516,011.31份
投资目标	通过投资于深证民营ETF,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为主要投资标的,方便投资者通过本基金投资深证民营ETF,本基金不参与深证民营ETF的申购。
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风险品种,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。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况	
基金名称	鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
2.1.2 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投资组合,并跟踪标的指数成份股及其权重变化,进行相应调整。
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风险品种,较高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式基金,采用完全复制跟踪标的指数的方法,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。

3.1 主要财务指标	
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	2632,491.80
2.本期利润	-4,641,511.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0408
4.期末基金资产净值	104,334,708.81
5.期末基金份额净值	0.9795

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

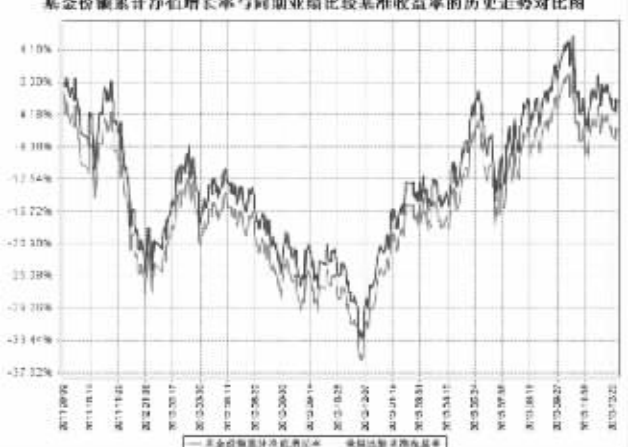
5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.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%。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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。

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介	
姓名	职务
崔俊杰	鹏华基金基金经理
崔俊杰	鹏华基金基金经理

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,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预示其未来表现,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。

本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

5.2 基金产品情况	
基金名称	鹏华丰泽分级债券,简内简称“鹏华丰泽”
交易代码	160618
基金运作方式	契约型基金,本基金合同生效后三年内(含三年)为基金分级运作期,丰泽A自基金合同生效日起于丰泽A的开放日接受申购赎回,丰泽B封闭运作并在深圳证券交易所上市交易,基金分级运作届满,本基金转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2011年12月8日
报告期末基金份额总额	1,430,585,746.7份
投资目标	在有效控制风险的基础上,通过严格的信息分析和信用利差变动趋势的判断,力争取得信用溢价,以最大限度上取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金债券投资主要采取信用策略,同时辅以久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严格的信用分析和信用利差变动趋势的判断,力争获取信用溢价,以最大限度上取得超越基金业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中债总指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金、高于货币市场基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	丰泽A
下属两级基金的交易代码	160619
报告期末下属两级基金的份额总额	530,493,210.38份
下属两级基金的风险收益特征	丰泽A的份额将表现出低风险、低收益的特征,其预期收益和预期风险要低于普通债券型基金份额,要高于普通货币型基金份额。

注:本基金在交易所行情系统净值净值等其他信息披露场合下,上市交易并封闭运作的基金份额简称可简称为“丰泽B”。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标	
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	-42,147,039.70
2.本期利润	-33,917,952.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0183
4.期末基金资产净值	1,609,296,684.12
5.期末基金份额净值	1.125

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

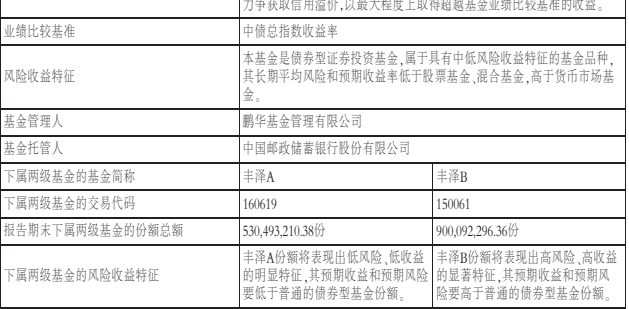
5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.业绩比较基准=中债总指数收益率。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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.本基金基金合同于2011年12月8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。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标	
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	-42,147,039.70
2.本期利润	-33,917,952.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0183
4.期末基金资产净值	1,609,296,684.12
5.期末基金份额净值	1.125

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.业绩比较基准=中债总指数收益率。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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

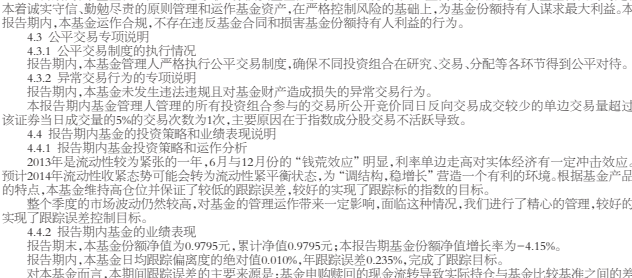


注:1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

2.基金经理离任日期指基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.2 自基金合同生效后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

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.本基金基金合同于2011年12月8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。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标	
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	11,250,470.75
2.本期利润	-23,660,736.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0237
4.期末基金资产净值	868,411,308.06
5.期末基金份额净值	0.987

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

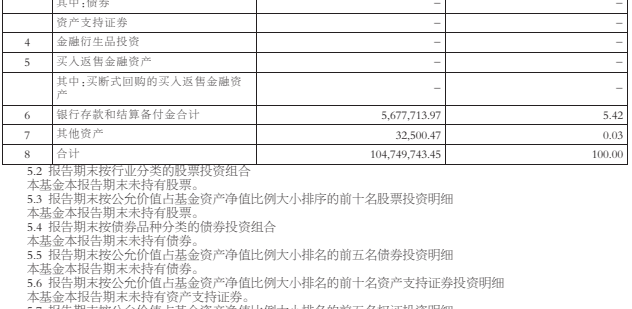
5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.业绩比较基准=中债总指数收益率。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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.本基金基金合同于2012年9月18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。

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介	
姓名	职务
崔俊杰	鹏华基金基金经理
崔俊杰	鹏华基金基金经理

注:1.本基金基金合同于2011年12月8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。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标	
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	2632,491.80
2.本期利润	-4,641,511.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0408
4.期末基金资产净值	104,334,708.81
5.期末基金份额净值	0.9795

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

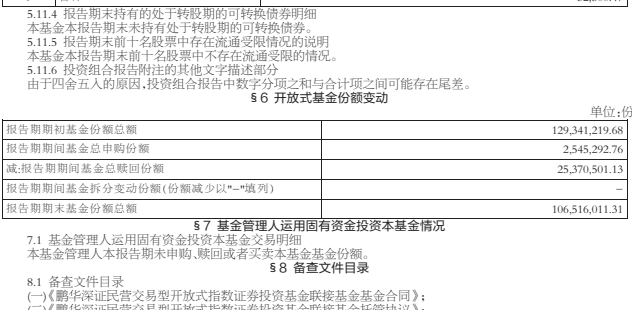
5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.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%。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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。

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介	
姓名	职务
崔俊杰	鹏华基金基金经理
崔俊杰	鹏华基金基金经理

注:1.本基金基金合同于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。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标	
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	2632,491.80
2.本期利润	-4,641,511.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0408
4.期末基金资产净值	104,334,708.81
5.期末基金份额净值	0.9795

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

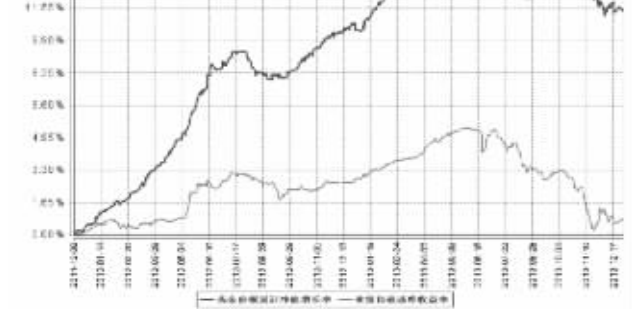
5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.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%。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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.本基金基金合同于2011年12月8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。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标	
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	11,250,470.75
2.本期利润	-23,660,736.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0237
4.期末基金资产净值	868,411,308.06
5.期末基金份额净值	0.987

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

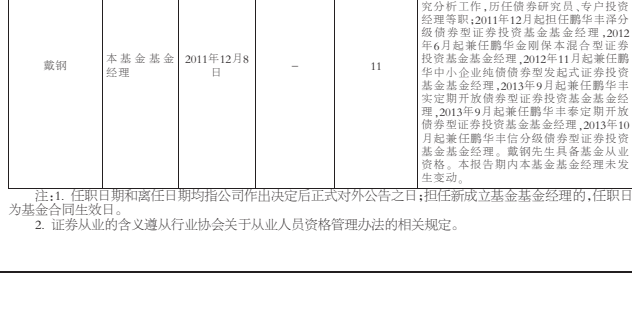
5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.业绩比较基准=中债总指数收益率。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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

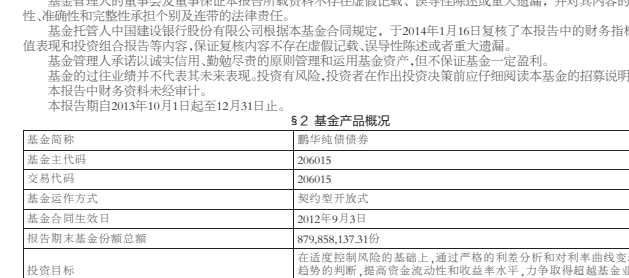


注:1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

2.基金经理离任日期指基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.2 自基金合同生效后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

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.本基金基金合同于2012年9月18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。

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介	
姓名	职务
崔俊杰	鹏华基金基金经理
崔俊杰	鹏华基金基金经理

注:1.本基金基金合同于2012年9月18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。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标	
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	11,250,470.75
2.本期利润	-23,660,736.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0237
4.期末基金资产净值	868,411,308.06
5.期末基金份额净值	0.987

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

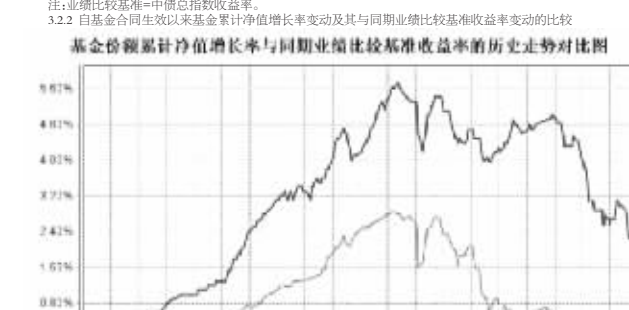
5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.业绩比较基准=中债总指数收益率。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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.本基金基金合同于2012年9月18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。

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介	
姓名	职务
崔俊杰	鹏华基金基金经理
崔俊杰	鹏华基金基金经理

注:1.本基金基金合同于2012年9月18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。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标	
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	11,250,470.75
2.本期利润	-23,660,736.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0237
4.期末基金资产净值	868,411,308.06
5.期末基金份额净值	0.987

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

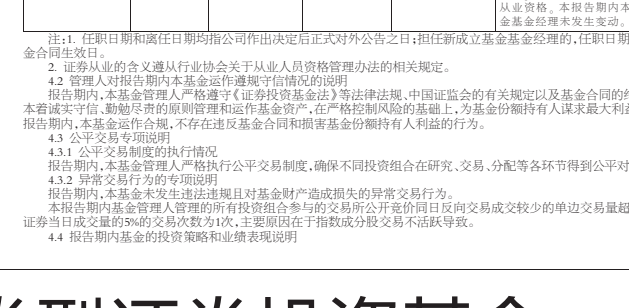
5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.业绩比较基准=中债总指数收益率。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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.本基金基金合同于2012年9月18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。

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介	
姓名	职务
崔俊杰	鹏华基金基金经理
崔俊杰	鹏华基金基金经理

注:1.本基金基金合同于2012年9月18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。

3.1 主要财务指标

3.1 主要财务指标	
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	11,250,470.75
2.本期利润	-23,660,736.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0237
4.期末基金资产净值	868,411,308.06
5.期末基金份额净值	0.987

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。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.加权平均基金份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,再除以基金期初份额与期末份额的平均值。

4.期末基金资产净值=基金资产净值-公允价值变动收益。

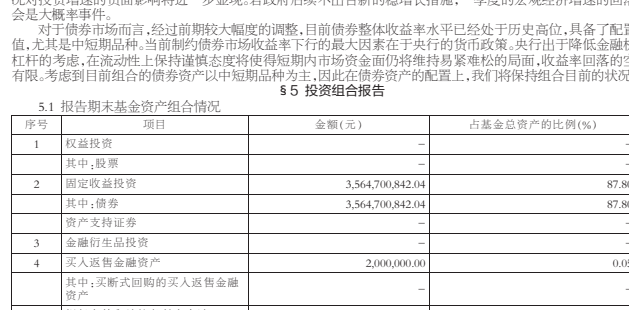
5.期末基金份额净值=基金资产净值/期末基金份额总额。

注:1.业绩比较基准=中债总指数收益率。

2.2.截至本报告期末,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。

3.2.2 自基金合同生效后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

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.本基金基金合同于2012年9月18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。

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介

4.1 基金经理(或基金投资小组)简介	
姓名	职务
崔俊杰	鹏华基金基金经理
崔俊杰	鹏华基金基金经理

注:1.本基金基金合同于2012年9月18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。

3.1 主要财务指标

8	其他	--	--
9	合计	3,564,700,842.04	221.5