

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
送出日期:2013年3月29日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、董事会、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、完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已尽三分之一以上独立董事签字确认，并报中国证监会备案。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置情况、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摘要。

本基金年度报告摘要年度报告正文、投资者对基金了解详细内容，应阅读年度报告全文。

普华永道中天会计师事务所对本报告出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本基金报告期自2012年1月1日至2012年12月31日。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	民营ETF
基金主代码	159911
交易代码	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
报告期基金份额总额	120,272,540.00份
基金合同存续期间	不定期
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年10月14日

注:本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下,可简称“民营ETF”。

2.2 基金产品说明

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权重基准构造指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化定期进行调整。

本基金通过股票的买卖、现金的申购与赎回、现金的配发、增发、回购等行为,或因基金的申购和赎回对本基金金融标的可能带来影响时,或在某些特定情况下导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数,基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整,力求降低跟踪误差。

业绩比较基准 深证民营价格指数

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。本基金为股票型基金,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。本基金投资于股票,因此本基金的预期风险和预期收益均高于股票型基金。

风险收益特征 本基金通过股票型开放式指数基金,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公司相拟的风险收益特征。

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	中国建设银行股份有限公司
姓名	张弢	田青
信息披露负责人联系电话	0755-82825720	010-67505096
电子邮箱	zhangt@phfund.com.cn	tianqing.lzh@ccb.com
客户服务电话	4006788999	010-67505096
传真	0755-8201126	010-66275853

2.4 信息披露方式
基金年度报告书面报告的管理人互联网网址
http://www.phfund.com.cn
基金管理人报告备置地点
深圳市福田区福华一路16号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司
北京市西城区闹市口大街1号院1号中银中国建设银行股份有限公司

§ 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

项目	2012年	2011年9月2日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	-62,995,283.31	-38,707,970.33
本期利润	2,695,276.16	-130,561,889.25
平均基金份额本期利润	0.0196	-0.7366
本期加权平均净值利润率	0.76%	-24.50%

3.2 期末数据和指标

期末可供分配基金份额利润 -0.7806 -0.7590

期末基金资产净值 303,048,100.28 427,639,240.00

期末基金份额净值 2.5197 2.5413

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时扣除相关费用的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收入。

②本基金绩效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”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。

④本基金合同于2011年9月2日生效,至2011年12月31日未满1年,故2011年的数据和指标为非完整会计年度数据。

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(②)	业绩比较基准收益率(③)	业绩比较基准收益率(④)	①-③	②-④
过去三个月	2.80%	1.36%	3.09%	1.37%	-0.29%	-0.01%
过去六个月	-3.99%	1.42%	-3.91%	1.43%	-0.08%	-0.01%
过去一年	-0.85%	1.49%	-1.05%	1.49%	0.20%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 -23.65%	1.50%	-25.47%	1.52%	1.82%	-0.02%	-

注:本基金业绩比较基准为深证民营价格指数。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金合同生效以来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

注:本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.4 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.5 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.6 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.7 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.8 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.9 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.10 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.11 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.12 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.13 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.14 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.15 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.16 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.17 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

2.按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。

3.2.18 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

基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金合同于2011年9月2日正式生效。

</