

鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资 基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 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 8 月 28 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。本半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 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华资源分级		
场内简称	中证资源		
基金主代码	160620		
前端交易代码	-		
后端交易代码	-		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 9 月 27 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	246,820,364.20 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 10 月 18 日		
下属分级基金的基金简称	鹏华资源分级	鹏华资源 A	鹏华资源 B
下属分级基金场内简称:	鹏华资源分级	鹏华资源 A	鹏华资源 B
下属分级基金的交易代码	160620	150100	150101
报告期末下属分级基金份额总额	74,192,306.20 份	86,314,029.00 份	86,314,029.00 份

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，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数化投资方法，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。</p> <p>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。</p> <p>本基金力争鹏华资源份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	中证 A 股资源产业指数收益率 × 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预期风险、较高

	预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，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。		
下属分级基金的风险收益特征	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。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，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。	鹏华资源 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征。	鹏华资源 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,143,916.65
本期利润	5,449,187.48
加权平均基金份额本期利润	0.0146

本期基金份额净值增长率	2.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.4327
期末基金资产净值	287,774,905.54
期末基金份额净值	1.166

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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），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6月30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

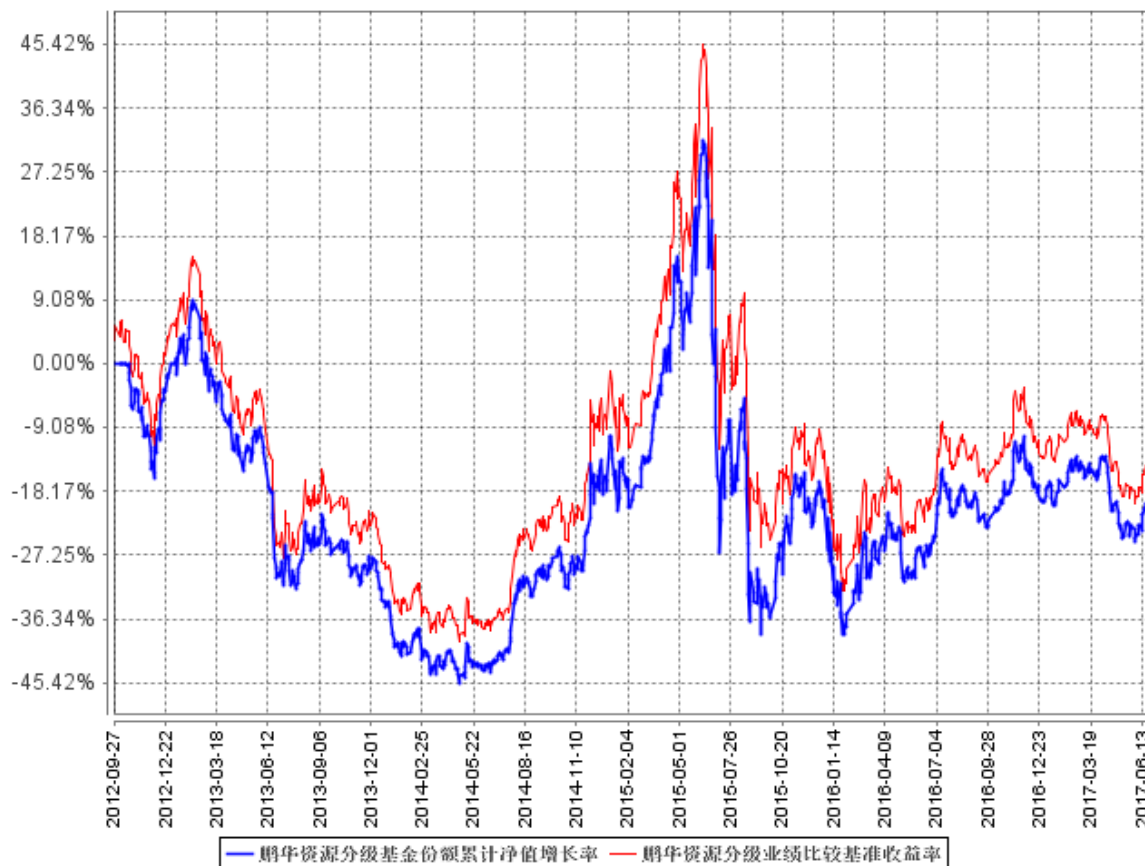
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	7.56%	1.04%	7.30%	1.00%	0.26%	0.04%
过去三个月	-2.35%	1.16%	-2.53%	1.11%	0.18%	0.05%
过去六个月	2.40%	1.04%	1.56%	1.00%	0.84%	0.04%
过去一年	9.57%	1.15%	7.47%	1.13%	2.10%	0.02%
过去三年	42.04%	2.26%	37.27%	2.11%	4.77%	0.15%
自基金合同生效起至今	-17.82%	2.01%	-12.22%	1.90%	-5.60%	0.11%

注：业绩比较基准=中证A股资源产业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

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

鹏华资源分级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 27 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。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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 2017 年 6 月，公司管理资产总规模达到 4509.30 亿元，管理 149 只公募基金、10 只全国社保投资组合、2 只基本养老保险投资组合。经过近 19 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

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	2014 年 12 月 6 日	-	9	崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，9 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，2016 年 11 月起兼任鹏华香港银行指数（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。
--	--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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，本基金运作合规，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，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。

4.3.2 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对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生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% 的情况。

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

2017 年上半年，整个 A 股市场风格分化明显，资金偏向大盘蓝筹股，呈现震荡上行走势，波

动率和成交量环比持平。本基金秉承指数基金的投资策略，在应对申购赎回的基础上，力争跟踪指数收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

2017 年上半年本基金申购赎回较为频繁，对基金的管理运作带来一定影响，面临这种情况，我们进行了精心的管理，较好的实现了跟踪误差控制目标。

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 1.166 元，累计净值 0.822 元，资源 A 净值为 1.022 元，资源 B 净值为 1.310 元。本报告期基金份额净值增长率为 2.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，预计 2017 年的经济增速前高后低，但刺激政策频发，混改持续推进，地产销量超预期，稳保就业底线，汇率风险逐渐释放等已经逐渐得到大家的接受和认可。本质来讲，调结构与稳增长很难并行，若不破旧立新，经济结构的调整很难到位。促进改革、稳定增长和防范风险三者涵盖了中国经济的短期和长期、速度和效益之间的辩证关系，我们不可能只要长期不要短期，只要效益不要速度，因此我们预期在经济增长相对稳定之中，加快推动结构的调整，随着改革红利逐步释放，生产效率的逐渐提升，金融去杠杆的逐步推进，我国经济将健康稳步发展。

2017 年上半年以来宏观经济面临的问题较多，诸如货币政策的松紧，人民币汇率风险，房地产去库存如何执行，经济增速趋缓的刺激政策，IPO 加速，美元加息，资产荒等。这些问题及衍生的新问题的出现和解决将决定未来 A 股市场的走势，也许随着人民币汇率的逐步企稳，大类资产配置或许会逐步向股市转移，房地产去库存有效执行，银行坏账率持续降低，A 股市场整体估值将可能在未来一段时间平稳提升。但在市场波动中尤其要注意参与力度和风险控制，因此，我们建议继续密切关注与实体经济相关的宏观数据变化和政策信息。

我们仍然强调前期的观点：反复的经济形势势必带来资产之间轮动演绎的复杂化和高频率化，资产配置犯错的概率和机会成本相对较高，建议投资者从中长期投资的角度来考虑战略资产配置，避免短期频繁操作带来的风险。

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，力争为投资者带来较好的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

(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。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

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。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

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、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

1、根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括鹏华资源份额、鹏华资源 A 份额、鹏华资源 B 份额）不进行收益分配。

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，本基金托管人在对鹏华中证 A 股资源产业指数分级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，鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华中证 A 股资源产业指数分级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，鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	15,858,328.84	22,804,582.70
结算备付金	-	1,904,623.56
存出保证金	115,509.20	195,642.78
交易性金融资产	272,946,831.16	417,004,497.93
其中：股票投资	272,946,831.16	417,004,497.93
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	1,276,146.09	58,822.90
应收利息	2,774.12	5,782.85
应收股利	-	-
应收申购款	102,229.01	551,270.02
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	290,301,818.42	442,525,222.74
负债和所有者权益	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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	1,567,174.97	340,066.98
应付管理人报酬	229,676.47	402,554.12
应付托管费	50,528.81	88,561.89
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	217,035.68	494,502.34
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	462,496.95	567,835.19
负债合计	2,526,912.88	1,893,520.52
所有者权益：		
实收基金	350,434,612.98	549,641,034.54
未分配利润	-62,659,707.44	-109,009,332.32
所有者权益合计	287,774,905.54	440,631,702.22
负债和所有者权益总计	290,301,818.42	442,525,222.74

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，鹏华资源分级份额净值 1.166 元，鹏华资源 A 份额净值 1.022 元，鹏华资源 B 份额净值 1.310 元；基金份额总额 246,820,364.20 份，其中鹏华资源分级份额 74,192,306.20 份，鹏华资源 A 份额 86,314,029.00 份，鹏华资源 B 份额 86,314,029.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		9,151,710.98	-33,334,633.53
1.利息收入		97,416.06	156,961.27
其中：存款利息收入		97,416.06	156,961.27
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）		-916,695.28	-63,540,611.19
其中：股票投资收益		-1,904,867.64	-64,864,421.22
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		988,172.36	1,323,810.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		9,593,104.13	29,123,644.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		377,886.07	925,371.61

减：二、费用		3,702,523.50	5,719,216.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,183,591.95	2,925,130.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	480,390.26	643,528.77
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用		731,351.03	1,821,413.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		307,190.26	329,143.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,449,187.48	-39,053,849.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,449,187.48	-39,053,849.55

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	549,641,034.54	-109,009,332.32	440,631,702.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,449,187.48	5,449,187.48
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）	-199,206,421.56	40,900,437.40	-158,305,984.16
其中：1.基金申购款	178,661,846.49	-31,501,446.42	147,160,400.07
2.基金赎回款	-377,868,268.05	72,401,883.82	-305,466,384.23
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）	350,434,612.98	-62,659,707.44	287,774,905.54
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	585,539,741.28	-120,980,888.66	464,558,852.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,053,849.55	-39,053,849.55
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）	143,568,143.35	-22,886,581.03	120,681,562.32
其中：1.基金申购款	1,178,428,083.44	-317,014,734.91	861,413,348.53
2.基金赎回款	-1,034,859,940.09	294,128,153.88	-740,731,786.21
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）	729,107,884.63	-182,921,319.24	546,186,565.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2012]358 号文《关于核准鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由鹏华基金管理有限公司于 2012 年 8 月 27 日至 2012 年 9 月 20 日向社会公开募集，募集期结束经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具普华永道中天验字(2012)第 386 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2012 年 9 月 27 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 643,316,982.66 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 68,561.87 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 643,385,544.53 元，折合 643,385,544.53 份基金份额。根据《基金合同》的约定，场外认购的全部份额确认为鹏华资源分级份额；场内认购的全部份额按 1:1 的比例确认为鹏华资源 A 份额和鹏华资源 B 份额。本基金的基金管理人为鹏

华基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金基金合同》并报中国证监会备案，本基金的基金份额包括鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“基础份额”)、鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“A 份额”)、鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“B 份额”)。根据对基金财产及收益分配的不同安排，本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。基础份额为可以申购、赎回但不能上市交易的基金份额，具有与标的指数相似的风险收益特征。A 份额与 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额，其中 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的风险收益特征，B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的风险收益特征。A 份额与 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。本基金份额初始公开发售结束后，场外认购的全部份额将确认为基础份额；场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为 A 份额与 B 份额。本基金基金合同生效后，基础份额与 A 份额、B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的基础份额按照 2 份基础份额对应 1 份 A 份额与 1 份 B 份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的 A 份额与 B 份额按照 1 份 A 份额与 1 份 B 份额对应 2 份基础份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：基础份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为基础份额、A 份额、B 份额的份额数之和。A 份额的基金份额净值为 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份基础份额所对应的基金资产净值等于 1 份 A 份额与 1 份 B 份额所对应的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在 A 份额、基础份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，A 份额与 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于 A 份额的约定应得收益，即 A 份额每个会计年度 12 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内基础份额分配给 A 份额持有人。基础份额持有人持有的每 2 份基础份额将按 1 份 A 份额获得新增基础份额的分配。持有场外基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外基础份额的分配；持有场内基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内基础份额的分配。经过上述份额折算，A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基础份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在基础份额的基金份额净值达到 2.000 元时或 B 份额的基金

份额参考净值跌至 0.250 元时进行不定期份额折算。当达到不定期折算条件时，本基金将分别对基础份额、A 份额、B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保 A 份额与 B 份额的比例为 1:1，份额折算后基础份额的基金份额净值、A 份额与 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2012]第 344 号文审核同意，本基金 A 份额 232,207,735.00 份基金份额和 B 份额 232,207,736.00 份基金份额于 2012 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为资源 A 份额和资源 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为资源 A 份额和资源 B 份额即可上市流通。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板及创业板股票）、新股（首次发行或增发等）、债券（含货币市场工具）和中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，同时保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或监管机构允许，基金管理人可以在履行适当程序后调整上述投资范围，或将新出现的允许基金投资的其他品种纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为：中证 A 股资源产业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 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》、《鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年上半年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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》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。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国信证券	19,339,507.01	4.44%	645,248,768.28	51.81%

6.4.8.1.2 债券交易

注：无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国信证券	17,912.48	4.51%	868.14	0.40%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国信证券	597,716.89	52.22%	491,991.81	99.97%

注：（1）佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=股票买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=股票买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,183,591.95	2,925,130.81
其中：支付销售机构的客户维护费	194,002.39	195,797.41

注：（1）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 1.00%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。

（2）根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	480,390.26	643,528.77

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费年费率为 0.22%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.22%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

6.4.8.4.2 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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资及持有本基金份额。

6.4.8.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	15,858,328.84	89,539.41	32,933,722.97	128,729.04

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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的债券及权证等其他证券。

6.4.9.2 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
600673	东阳光	2016年11月15日	重大事	6.54	-	-	1,623,380	11,938,709.81	10,616,905.20	-

	科	日	项							
600490	鹏欣资源	2017年2月21日	重大事件	7.71	-	-	1,170,618	10,696,958.51	9,025,464.78	-
002128	露天煤业	2017年3月17日	重大事件	8.17	-	-	1,032,000	9,254,643.38	8,431,440.00	-
000693	ST华泽	2016年3月1日	重大事件	13.90	-	-	551,704	11,047,938.53	7,668,685.60	-
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事件	22.29	-	-	310,550	5,083,155.42	6,922,159.50	-
600172	黄河旋风	2017年6月30日	重大事件	8.23	2017年7月14日	8.00	321,580	3,236,813.97	2,646,603.40	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	272,946,831.16	94.02
	其中：股票	272,946,831.16	94.02
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	15,858,328.84	5.46
7	其他各项资产	1,496,658.42	0.52
8	合计	290,301,818.42	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	152,628,341.89	53.04
C	制造业	115,011,573.28	39.97
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	4,561,863.76	1.59
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
	合计	272,201,778.93	94.59

7.2.2 期末积极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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	522,293.60	0.18
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	-	-
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	34,815.14	0.01
J	金融业	187,943.49	0.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
	合计	745,052.23	0.26

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末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

7.3.1 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	600673	东阳光科	1,623,380	10,616,905.20	3.69
2	600490	鹏欣资源	1,170,618	9,025,464.78	3.14
3	002128	露天煤业	1,032,000	8,431,440.00	2.93
4	000693	ST 华泽	551,704	7,668,685.60	2.66
5	601088	中国神华	310,550	6,922,159.50	2.41
6	603799	华友钴业	110,000	6,685,800.00	2.32
7	600516	方大炭素	423,655	6,024,374.10	2.09
8	002466	天齐锂业	106,000	5,761,100.00	2.00

9	603993	洛阳钼业	1,119,057	5,662,428.42	1.97
10	002340	格林美	912,716	5,521,931.80	1.92

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> 的半年度报告正文。

7.3.2 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

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	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.07
2	300660	江苏雷利	946	74,979.96	0.03
3	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
4	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
5	300658	延江股份	1,110	43,101.30	0.01

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> 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	603799	华友钴业	5,173,475.00	1.17
2	002018	华信国际	4,667,244.06	1.06
3	000975	银泰资源	4,628,521.37	1.05
4	000059	华锦股份	4,627,131.55	1.05
5	600758	红阳能源	4,626,932.70	1.05
6	000519	江南红箭	3,865,682.76	0.88
7	601020	华钰矿业	3,837,075.11	0.87
8	600759	洲际油气	3,606,703.97	0.82
9	600497	驰宏锌锗	3,204,986.11	0.73
10	000758	中色股份	2,724,563.00	0.62
11	002353	杰瑞股份	2,635,446.00	0.60
12	000937	冀中能源	2,569,748.40	0.58
13	601699	潞安环能	2,548,360.65	0.58

14	600395	盘江股份	2,547,211.94	0.58
15	600338	西藏珠峰	2,533,341.71	0.57
16	000983	西山煤电	2,525,496.00	0.57
17	002466	天齐锂业	2,524,100.51	0.57
18	000878	云南铜业	2,492,899.35	0.57
19	600547	山东黄金	2,489,577.00	0.57
20	000960	锡业股份	2,427,812.62	0.55

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。

7.4.2 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	000519	江南红箭	12,536,034.67	2.85
2	002460	赣锋锂业	10,367,602.57	2.35
3	600331	宏达股份	9,542,304.99	2.17
4	000723	美锦能源	8,602,090.28	1.95
5	002466	天齐锂业	8,576,396.28	1.95
6	600175	美都能源	8,432,065.03	1.91
7	603993	洛阳钼业	7,550,506.09	1.71
8	600219	南山铝业	7,310,016.52	1.66
9	600028	中国石化	7,176,830.20	1.63
10	601225	陕西煤业	6,897,726.73	1.57
11	600338	西藏珠峰	6,861,201.87	1.56
12	600172	黄河旋风	6,743,827.40	1.53
13	600516	方大炭素	6,591,183.56	1.50
14	002340	格林美	6,482,147.60	1.47
15	600688	上海石化	6,461,720.00	1.47
16	601857	中国石油	6,235,030.00	1.42
17	601899	紫金矿业	6,222,163.50	1.41
18	000878	云南铜业	6,219,084.63	1.41
19	601600	中国铝业	5,959,529.93	1.35
20	601088	中国神华	5,733,146.00	1.30

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。

7.4.3 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	143,932,505.62
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	295,678,408.88
--------------	----------------

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 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：无。

7.7 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：无。

7.8 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：无。

7.9 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：无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券之一的成都华泽钴镍材料股份有限公司（以下简称“st 华泽”）于 2016 年 6 月 29 日接到中国证券监督管理委员会调查通知书（编号：成稽调查通字 16032 号），

因 st 华泽关联交易和关联担保涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对 st 华泽立案调查。

St 华泽于 2016 年 7 月 8 日收到由深圳证券交易所（以下简称“深交所”）送达的《关于对成都华泽钴镍材料股份有限公司及相关当事人给予公开谴责处分的决定》（文号：深证上【2016】433 号，以下简称“《处分决定》”），主要内容如下：

- 1、公司与关联方发生巨额非经营性资金往来，未履行审议程序和信息披露义务
- 2、业绩预告存在重大差异未及时修正
- 3、存在前期重大会计差错
- 4、关联交易未及时履行审批程序和信息披露义务

St 华泽的上述行为，违反了深交所《股票上市规则（2014 年修订）》第 1.4 条、第 2.1 条、第 10.2.5 条、第 11.3.3 条以及深交所《主板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》第 2.1.4 条的规定。公司实际控制人兼时任董事长王涛、实际控制人兼时任董事王辉、实际控制人兼副董事长王应虎违反了深交所《股票上市规则（2014 年修订）》第 1.4 条、第 2.2 条、第 2.3 条、第 3.1.5 条和深交所《主板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》第 4.1.1 条、第 4.2.11 条和 4.2.12 条的规定，对 st 华泽上述违规行为负有主要责任。关联方星王集团作为资金直接占用方，违反了深交所《股票上市规则（2014 年修订）》第 1.4 条和深交所《主板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》第 4.1.1 条的规定。公司董事陈健，董事、时任副总经理朱若甫，独立董事雷华锋、赵守国、宁连珠，监事朱小卫、阎建明、芦丽娜，总经理、时任副总经理赵强，副总经理金涛，时任总经理陈胜利，时任副总经理兼时任财务总监郭立红，未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务，违反了深交所《股票上市规则（2014 年修订）》第 1.4 条和第 3.1.5 条的规定，对 st 华泽上述违规行为负有责任。公司时任董事、董事会秘书吴锋未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务，违反了《股票上市规则（2014 年修订）》第 1.4 条、第 3.1.5 条和第 3.2.2 条的规定，对 st 华泽上述违规行为负有责任。鉴于上述违规事实及情节，依据深交所《股票上市规则（2014 年修订）》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条以及《主板上市公司公开谴责标准》第四条、第五条和第六条的规定，经深交所纪律处分委员会审议通过，深交所作出如下处分决定：

- 1、对成都华泽钴镍材料股份有限公司予以公开谴责处分；
- 2、对成都华泽钴镍材料股份有限公司实际控制人兼时任董事长王涛、实际控制人兼时任董事王辉、实际控制人兼副董事长王应虎和关联方陕西星王企业集团有限公司予以公开谴责处分；
- 3、对公司董事陈健，董事、时任副总经理朱若甫，独立董事雷华锋、赵守国、宁连珠，监事朱小卫、阎建明、芦丽娜，总经理、时任副总经理赵强，副总经理金涛，时任总经理陈胜利，

时任副总经理兼时任财务总监郭立红，时任董事 兼董事会秘书吴锋予以公开谴责处分。

对于成都华泽钴镍材料股份有限公司及相关当事人的上述违规行为和深交所给予的处分，深交所将记入上市公司诚信档案，并向社会公布。

St 华泽于 2016 年 11 月 10 日 收到中国证券监督管理委员会四川监管局（以下简称“四川监管局”）行政监管措施决定书（[2016]26 号）《关于对成都华泽钴镍材料股份有限公司采取责令改正措施的决定》，主要内容如下：

1、2016 年 4 月 29 日 st 华泽公告：2015 年 11 月 16 日，st 华泽子公司陕西华泽镍钴金属有限公司（以下简称陕西华泽）开具 3 亿元商业承兑汇票，为关联方陕西星王企业集团有限公司提供担保，承兑人为 st 华泽。该担保事项属于为实际控制人的关联方提供的担保，st 华泽公告该事项未经董事会、股东大会审批通过。

2、2016 年 6 月 8 日 st 华泽公告，2015 年 st 华泽为实际控制人王涛的 3500 万元债务及利息承担连带责任担保。该担保事项属于为实际控制人提供的担保，st 华泽公告该事项未履行相关审批程序。

3、2016 年 9 月 27 日 st 华泽公告，st 华泽为平安鑫海资源开发有限公司 7000 万元银行贷款提供连带责任担保。该担保事项属于 st 华泽对外担保总额超过最近一期经审计净资产 50%以后提供的担保，但 st 华泽公告无需将该事项提交股东大会审议。四、2016 年 9 月 30 日 st 华泽公告，st 华泽为陕西华泽新增 5 亿元连带责任保证担保。陕西华泽资产负债率超过 70%，该笔担保金额超过 st 华泽最近一期经审计净资产的 10%，该担保还属于 st 华泽对外担保总额超过最近一期经审计净资产 50%以后提供的担保，但 st 华泽公告该担保事项无需提交董事会和股东大会审议。

根据《关于规范上市公司对外担保行为的通知》（证监发[2005]120 号）第一条、《公司法》第十六条、st 华泽章程等相关规定，上述担保事项均属于应由股东大会审批的担保事项，必须经董事会审议通过后，提交股东大会审批。根据《上市公司股东大会规则》第四十八条，现对 st 华泽采取责令改正的措施，st 华泽应在收到本决定书之日起 30 个工作日之内整改，并向四川监管局报送整改报告。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，后来该证券长期停牌并在停牌期间被指数公司调出成分股，我们会在该股票复牌后卖出，对该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

基金投资的前十名证券中的其他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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	115,509.20
2	应收证券清算款	1,276,146.09
3	应收股利	-
4	应收利息	2,774.12
5	应收申购款	102,229.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,496,658.42

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600673	东阳光科	10,616,905.20	3.69	重大事项
2	600490	鹏欣资源	9,025,464.78	3.14	重大事项
3	002128	露天煤业	8,431,440.00	2.93	重大事项
4	000693	ST 华泽	7,668,685.60	2.66	重大事项
5	601088	中国神华	6,922,159.50	2.41	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
鹏华资源分级	8,414	8,817.72	3,173,415.92	4.28%	71,018,890.28	95.72%
鹏华资源A	339	254,613.65	83,980,519.00	97.30%	2,333,510.00	2.70%
鹏华资源B	5,710	15,116.29	8,581,120.00	9.94%	77,732,909.00	90.06%
合计	14,463	17,065.64	95,735,054.92	38.79%	151,085,309.28	61.21%

8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华资源分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	银河资本—工商银行—银河资本资产管理有限公司	1,386,481.00	16.40%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	765,545.00	9.06%
3	王欣茵	654,148.00	7.74%
4	赖静禹	458,644.00	5.43%
5	谢叶强	387,000.00	4.58%
6	袁超	357,265.00	4.23%
7	中信证券股份有限公司	300,000.00	3.55%
8	林毅红	240,110.00	2.84%
9	强锦香	223,880.00	2.65%
10	于建华	202,000.00	2.39%

鹏华资源A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	11,714,005.00	13.57%
2	广东君之健投资管理有限公司—君之健翱翔稳进证券投资基金	9,221,200.00	10.68%
3	中国银河证券股份有限公司	8,750,438.00	10.14%
4	德邦基金—浙商银行—百年人寿保险—百年人寿保险股份有限公司—	8,266,947.00	9.58%

5	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —分红—个人分红	7,585,985.00	8.79%
6	中意人寿保险有限公司	6,707,231.00	7.77%
7	广发基金—工商银行—中国平安人 寿保险—债券委托投资 1 号	6,653,028.00	7.71%
8	北京快快网络技术有限公司	5,278,400.00	6.12%
9	南京持赢投资管理有限公司—持赢 复利增长基金	2,712,439.00	3.14%
10	太平洋资产管理有限责任公司	2,035,100.00	2.36%

鹏华资源 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	滕佩甬	2,635,100.00	3.05%
2	宋伟铭	2,617,748.00	3.03%
3	太平洋证券—兴业—红珊瑚 1 号稳 健成长限额特定集合资产管理	2,500,000.00	2.90%
4	安信农业保险股份有限公司	2,263,417.00	2.62%
5	赵芹	1,720,900.00	1.99%
6	张君钦	1,340,100.00	1.55%
7	叶礼为	834,500.00	0.97%
8	任凯	746,720.00	0.87%
9	太平洋证券—兴业银行—太平洋证 券红珊瑚大消费集合资产管理计	700,000.00	0.81%
10	胡清	648,569.00	0.75%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	鹏华资源分级	4,093.18	0.01%
	鹏华资源 A	—	—
	鹏华资源 B	—	—
	合计	4,093.18	0.00%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.4 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：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人及本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华资源分级	鹏华资源 A	鹏华资源 B
基金合同生效日（2012 年 9 月 27 日） 基金份额总额	178,970,073.53	232,207,735.00	232,207,736.00
本报告期期初基金份额总额	97,951,368.73	140,863,536.00	140,863,536.00
本报告期基金总申购份额	125,833,396.11	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	266,114,199.83	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	116,521,741.19	-54,549,507.00	-54,549,507.00
本报告期期末基金份额总额	74,192,306.20	86,314,029.00	86,314,029.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中调整的份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，经公司董事会审议通过，公司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。

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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
中金公司	1	196,428,046.16	45.12%	179,004.50	45.08%	-
兴业证券	1	99,220,800.18	22.79%	90,418.82	22.77%	-
中泰证券	1	45,655,551.44	10.49%	41,605.72	10.48%	-
西部证券	2	38,142,012.86	8.76%	34,758.81	8.75%	-
申万宏源	1	31,222,850.65	7.17%	28,453.49	7.17%	-
国信证券	2	19,339,507.01	4.44%	17,912.48	4.51%	-
招商证券	1	5,363,900.69	1.23%	4,888.22	1.23%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：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，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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期内未通过券商交易单元进行权证交易、债券交易及债券回购交易。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170414~20170511	59,058,934.79	17,226,442.72	76,285,377.51	-	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、场内卖出份额和指数分级基金拆份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司

2017年8月28日