

# 鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资 基金 2019 年第 2 季度报告

2019 年 06 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

报告送出日期：2019 年 07 月 16 日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 7 月 15 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华资源分级
场内简称	资源分级
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 09 月 27 日
报告期末基金份额总额	154,838,332.24 份
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	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。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。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。		
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。		
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		
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
下属分级基金的场内简称	资源分级	资源 A	资源 B
下属分级基金的交易代码	160620	150100	150101
下属分级基金的前端交易代码	-	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	67,904,530.24 份	43,466,901.00 份	43,466,901.00 份
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	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。

	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。		
--	---	--	--

注：无。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
1. 本期已实现收益	-10,523,647.72
2. 本期利润	-5,935,877.93
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0374
4. 期末基金资产净值	156,723,935.04
5. 期末基金份额净值	1.012

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。

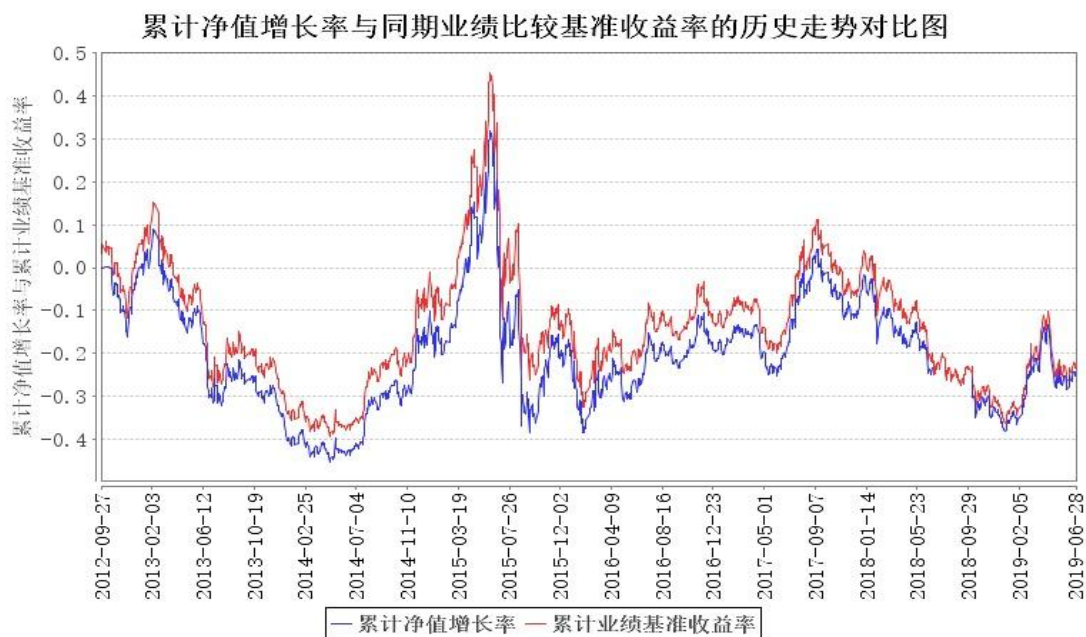
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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	-3.89%	1.79%	-4.79%	1.80%	0.90%	-0.01%

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累计份额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



注：1、本基金基金合同于 2012 年 09 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2014-12-06	-	11 年	崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，11 年证券基金从业经验。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、量化及衍生品投资部量化研究员，先后从事产品设计、量化研究工作，现任量

				<p>化及衍生品 投资部副总 经理、基金经 理。2013 年 03 月担任鹏 华深证民营 ETF 基金基 金经理,2013 年 03 月担任 鹏华深证民 营 ETF 联接 基金基金经 理,2013 年 03 月担任鹏 华上证民企 50ETF 联接 基金基金经 理,2013 年 03 月担任鹏 华上证民企 50ETF 基金 基金经理, 2013年07月 至2018年02 月担任鹏华 沪深 300ETF 基金基金经 理,2014 年 12 月担任鹏 华资源分级 基金基金经 理,2014 年 12 月担任鹏 华传媒分级 基金基金经 理,2015 年 04 月担任鹏 华银行分级 基金基金经 理,2015 年 08 月至 2016 年 07 月担任 鹏华医药分 级基金基金 经理,2016</p>
--	--	--	--	---

					<p>年 07 月担任鹏华医药指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 11 月担任鹏华香港银行指数 (LOF) 基金基金经理, 2018 年 02 月至 2018 年 03 月担任鹏华量化先锋混合基金基金经理。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。</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, 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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年第二季度，整个 A 股市场波动剧烈，市场先扬后抑，波动率和成交量均环比下降。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。

2019 年第二季度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。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，鹏华资源分级组合净值增长率-3.89%；基金年化跟踪误差 0.87%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	148,069,136.24	92.94
	其中：股票	148,069,136.24	92.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持 证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回 购的买入返售金 融资产	-	-
7	银行存款和结算 备付金合计	11,008,297.86	6.91
8	其他资产	232,242.40	0.15
9	合计	159,309,676.50	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	76,692,620.78	48.93
C	制造业	61,729,639.05	39.39



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	3,266,943.96	2.08
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	-	-
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	6,044,781.00	3.86
	合计	147,733,984.79	94.26

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	104,835.05	0.07
C	制造业	167,606.04	0.11
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	39,603.76	0.03
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	335,151.45	0.21

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 5.3 报告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

#### 5.3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000723	美锦能源	353,600	3,695,120.00	2.36
2	002353	杰瑞股份	154,500	3,568,950.00	2.28
3	600188	兖州煤业	316,024	3,435,180.88	2.19
4	601225	陕西煤业	370,921	3,427,310.04	2.19
5	601088	中国神华	167,750	3,418,745.00	2.18
6	601808	中海油服	353,100	3,400,353.00	2.17
7	600547	山东黄金	81,815	3,368,323.55	2.15
8	600348	阳泉煤业	579,730	3,368,231.30	2.15
9	600028	中国石化	606,545	3,317,801.15	2.12
10	600777	新潮能源	1,592,100	3,311,568.00	2.11

#### 5.3.2 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600968	海油发展	29,531	104,835.05	0.07
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.05
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.03
4	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
5	603863	松炆资源	1,209	27,903.72	0.02

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

### 5.5 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债券投资明细

注：无。

### 5.6 报告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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：无。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1

美锦能源 美锦能源本次公告原因为收到此前违规情况的《行政处罚决定书》，具体情况说明如下。

山西美锦华盛化工新材料有限公司作为山西美锦能源股份有限公司的全资子公司，是清徐精细化工循环产业园建设主体之一。根据《山西省焦化产业布局意见》、《山西省人民政府办公厅关于印发山西省焦化产业打好污染防治攻坚战推动转型升级实施方案的通知》，为加快推进清徐精细化工循环产业园建设和产业转型发展，华盛化工 400 万吨/年新焦化项目已报送清徐县经信局审批，并于 2018 年 12 月 29 日获得清徐县经信局《关于山西美锦华盛化工新材料有限公司化工新材料生产项目备案的批复》（清经信政务字【2018】45 号），工期要求比较紧。华盛化工在取得批复后，华盛化工一方面积极申请办理环评等有关手续，一方面进行工程建设准备工作。华盛化工项目环评报告书已编制完毕，具备开工条件，但由于清徐精细化工循环产业园扩区，需进行园区的整体环评，因此华盛化工的环评手续需进一步完善。

近日，华盛化工收到清徐县环境保护局出具的行政处罚决定书（清环罚【2019】QYS036 号）。根据《中华人民共和国环境影响评价法》第三十一条第一款的规定，对华盛化工处以罚款人民币 1509749.62 元。

公司高度重视此事项，立即成立了专项工作组按照相关部门要求整改；并全面排查各子公司环保管理现状，强化相关工作人员及责任人的环保意识，进一步提高公司的环保水平。目前正在加快完善环评等有关手续。

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，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。

新潮能源 本基金前十大持仓中的新潮能源于 2019 年 6 月 17 日公告上交所因信息披露不及时相关处罚信息、2019 年 3 月 30 日公告信息披露证监会行政监管措施：

因以下四个事项，中国证监会对公司及时任公司董事长黄万珍、卢绍杰，时任总经理胡广军，时任董事会秘书何再权采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案；因以下一、二事项，上海证券交易所对山东新潮能源股份有限公司和时任董事长黄万珍、卢绍杰，董事会秘书何再权予以公开谴责；对时任副董事长胡广军，董事杨晓云、韩汉，时任独立董事王东宁、张宝生、余璇予以通报批评。

#### 一、公司董事会审议增资参股子公司事项未勤勉尽责，相关信息披露不及时

2016 年 12 月 23 日，公司董事会审议通过投资 6 亿元人民币参股哈密合盛源矿业有限责任公司（以下简称合盛源公司）的议案（持股比例 45.5927%）。合盛源公司的主要资产为雅西铁矿采矿权。而公司公告显示，当时合盛源公司尚未完成上述采矿权相关过户手续办理，采矿权仍归属于哈密宏源资源开发有限责任公司。同时，合盛源公司及主要股东深圳市华瑞矿业有限公司（以下简称华瑞矿业）、张国玺、石永兵承诺将在 2017 年 6 月 30 日前完成环保审批、安全生产许可、采矿权人变更等手续办理，否则公司有权利要求合盛源公司主要股东对公司通过本次增资扩股所认购的合盛源公司股权进行收购。

2018 年 6 月 22 日，公司公告显示，因合盛源公司股东未能在 2017 年 6 月 30 日前完成合盛源公司铁矿相关手续办理，公司申请股东华瑞矿业、张国玺、石永兵 3 方对公司通过本次增资扩股所认购的合盛源公司股权进行收购，但公司至今未收到回购款项。因此，公司向法院提起诉讼，要求交易对方支付公司 7.86 亿元收购价款，并承担诉讼费用。

雅西铁矿采矿权系合盛源公司核心资产，是合盛源公司日常经营生产得以正常开展的重要基础，也是公司选择开展本次参股投资的主要驱动因素。在前期进行投资决策时，公司理应审慎评估采矿权过户手续无法顺利完成的可能性，积极采取措施确保合盛源公司能在承诺期内完成采矿权的相关过户手续，以保证参股资产的权属完整。然而，公司董事会成员未勤勉尽责，也未能充分评估、审慎决策，在合盛源公司尚未取得采矿权且后续取得采矿权存在较大不确定性的情况下审议通过参股合盛源公司的议案，最终因雅西铁矿采矿权未能顺利完成过户导致投资未达到预期目的，对公司利益造成损害。

同时，截至 2017 年 6 月 30 日，在合盛源公司股东仍未完成雅西铁矿相关手续办理、相关增资协议已产生重大变故并可能对合盛源公司后续正常生产经营造成重大负面影响的情况下，公司本应就上述进展及时、准确进行信息披露，以明确投资者预期。

但公司未就上述事项及时履行信息披露义务，直至 2018 年 6 月公司起诉交易对方要求回购股

权时才进行披露。公司有关参股投资事项重大进展披露不及时，损害了投资者的知情权。

## 二、重大资产重组信息披露不真实、不准确，且前后不一致

2018 年 3 月 3 日，公司公告称，正在筹划收购深圳汉莎企业管理有限公司（以下简称深圳汉莎）100%股权，交易对方为深圳市集诚信投资有限公司（以下简称集诚信投资），为独立第三方。经初步测算，上述收购事项对公司构成重大资产重组，公司股票于 2018 年 3 月 5 日起停牌。2018 年 5 月 4 日，公司公告称，由于交易双方就交易价格和交易方式等相关细节未能达成一致意见，公司决定终止筹划此次重大资产重组事项。

自 2018 年 3 月 3 日发布重大资产重组停牌公告起，公司始终披露本次交易对方集诚信投资为独立第三方，直至 2018 年 5 月 4 日发布终止重大资产重组事项公告时方才披露，深圳汉莎的实际控制人为杜拉和方武权、林赛璃夫妇；同时，根据尽职调查结果，方武权、林赛璃夫妇为公司董事李敏配偶的父母，本次重大资产重组涉及关联交易。针对上述情况，公司在重大资产重组信息披露过程中存在前后信息披露不一致的行为。交易对手方为公司董事亲属，公司存在隐瞒关联关系及关联交易的行为，致使信息披露不真实、不准确，损害了投资者的知情权。

## 三、未及时披露子公司认购私募基金份额事项

2018 年 5 月 30 日，公司披露全资子公司浙江犇宝实业投资有限公司于 2017 年 6 月，出资 1.7 亿元认购长沙泽洺创业投资合伙企业（有限合伙）有限合伙份额。对于该事项公司未及时履行信息披露义务。

## 四、未能合理估计子公司商誉减值事项

在 2017 年年报编制过程中，公司利用中介机构的工作辅助开展对美国子公司蓝鲸能源北美有限公司的商誉减值测试时，未恰当利用中介机构的工作成果，未能合理估计相关资产或资产组的可收回金额。

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，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。

## 杰瑞股份

本基金前十大持仓中的烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司于 2018 年 12 月 9 日公告：

2016 年 3 月 21 日（美国时间），美国商务部工业安全局（BIS）将烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司及子公司杰瑞国际（香港）有限公司（以下统称“公司”）加入实体名单，对公司实施出口管制措施。详见公司披露于巨潮资讯网的 2016-023、2016-024、2016-026、2016-037、2016-038 号公告。近日，公司就上述事项与美国财政部外国资产控制办公室（以下简称“OFAC”）签署了和解协议，鉴于公司被认为在 2014 年 10 月至 2016 年 3 月期间违反了美国出口管制及相关法律法规，公司同意向 OFAC 支付 2,774,972 美元民事罚款，同时考虑到公司在该协议中的承诺，OFAC 同意豁免并永久免除公司（无任何过错判定）因 OFAC 依法行使职权产生的与明显违规相关的所有民事责任，该协议在 OFAC 和公司签署后即生效。公司也在积极推动与美国商务部工业安全局（以

下简称“BIS”) 签署和解协议, 公司已按 BIS 的要求签署了该协议并发给了 BIS, 并同意向 BIS 支付 600,000 美元民事罚款, 该协议被 BIS 签署并生效后, BIS 会按约定条件发起流程将公司从实体名单中移除。 为确保公司遵守美国出口管制法律法规及和解协议的规定, 公司已健全了合规组织架构并实施了严密的制度流程管控, 未来违反美国出口管制法规或和解协议的风险极小。 公司已在 2018 年全年预测中预计上述费用, 本事项不影响公司在《2018 年第三季度报告全文》中对 2018 年度经营业绩的预计。

烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司于 2018 年 12 月 11 日公告: 2016 年 3 月 21 日(美国时间), 美国商务部工业安全局 (BIS) 将烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司及子公司杰瑞国际 (香港) 有限公司 (以下统称“公司”) 加入实体名单, 对公司实施出口管制措施。 详见公司披露于巨潮资讯网的 2016-023、2016-024、2016-026、2016-037、2016-038 号公告。 2018 年 12 月 10 日, 公司披露了《关于与 OFAC 签署和解协议的公告》, 公司与 OFAC 就上述事项达成和解, 详见公司披露于巨潮资讯网的 2018-075 号公告。 2018 年 12 月 11 日, 公司收到了美国商务部工业安全局 (以下简称“BIS”) 签署的和解协议, 该协议已经美国商务部授权代表批准并签发命令生效。 根据该协议, 鉴于公司被认为在 2014 年 7 月至 2015 年 3 月期间违反了美国出口管制及相关法律法规, 公司同意向 BIS 支付 600,000 美元民事罚款, BIS 将按约定条件发起流程将公司从实体名单中移除。 此外, BIS 将对公司设置 5 年的观察期, 期内若公司违反了美国出口管制法规或和解协议, 可能受到更严厉的处罚。 为确保公司遵守美国出口管制法律法规及和解协议的规定, 公司已健全了合规组织架构并实施了严密的制度流程管控, 未来违反美国出口管制法规或和解协议的风险极小。 公司已在 2018 年全年预测中预计上述费用, 本事项不影响公司在《2018 年第三季度报告全文》中对 2018 年度经营业绩的预计。

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, 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。

### 5.11.2

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (人民币元)
1	存出保证金	18,604.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,059.12
5	应收申购款	211,579.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	232,242.40

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: 无。

### 5.11.5 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 5.11.6 报告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。

#### 5.11.7 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。

### §6 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
报告期期初基金份额总额	68,985,812.48	47,050,360.00	47,050,360.00
报告期期间基金总申购份额	13,514,019.09	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	21,762,219.33	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	7,166,918.00	-3,583,459.00	-3,583,459.00
报告期期末基金份额总额	67,904,530.24	43,466,901.00	43,466,901.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 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

注：无。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金 2019 年第 2 季度报告》（原文）。

## 9.2 存放地点

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。

## 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司  
2019 年 07 月 16 日