

# 鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资 基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 09 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 10 月 25 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 10 月 24 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 7 月 1 日起至 2019 年 9 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	147,707,478.62 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	62,624,598.62 份	42,541,440.00 份	42,541,440.00 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07月01日 - 2019年09月30日)
1. 本期已实现收益	4,846,194.61
2. 本期利润	-1,257,129.83
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0082
4. 期末基金资产净值	148,095,843.21
5. 期末基金份额净值	1.003

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。

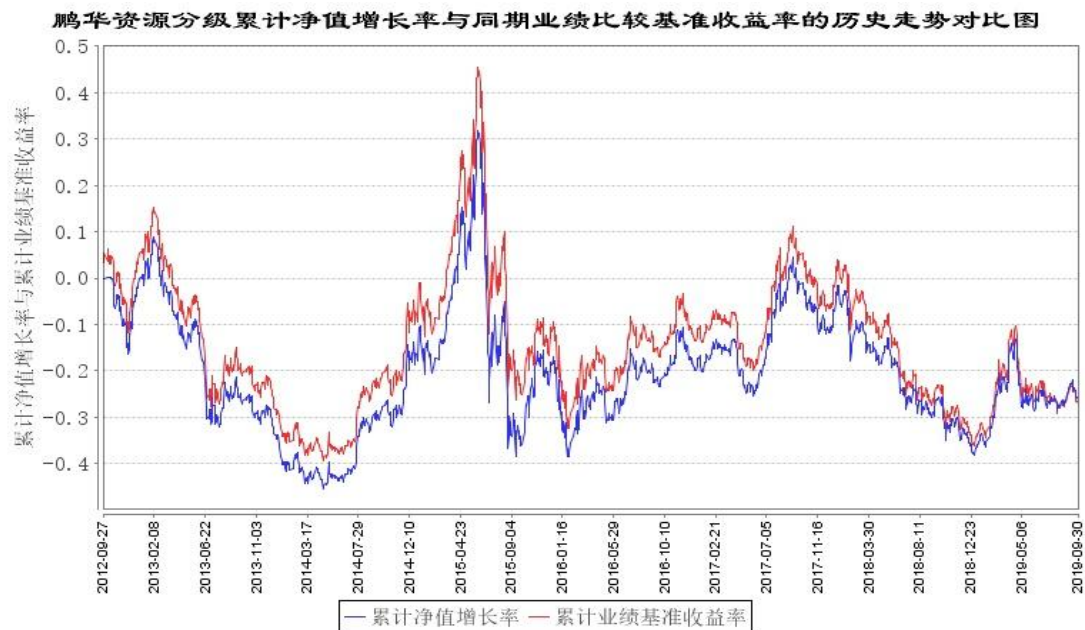
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-0.89%	0.93%	-4.52%	1.00%	3.63%	-0.07%

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% 的交易次数为 2 次, 主要原因在于指数基金或量化基金

成分股交易不活跃导致。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年三季度，整个 A 股市场波动剧烈，市场震荡为主，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 年三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-0.89%。

#### 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	139,271,357.91	93.27
	其中：股票	139,271,357.91	93.27
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	9,369,115.62	6.27
8	其他资产	684,532.56	0.46
9	合计	149,325,006.09	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	72,204,381.94	48.76
C	制造业	58,067,661.56	39.21
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	2,959,034.04	2.00
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	5,693,096.00	3.84
	合计	138,924,173.54	93.81

### 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	-	-
C	制造业	124,054.97	0.08
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	223,129.40	0.15
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	347,184.37	0.23

### 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	601808	中海油服	349,900	4,286,275.00	2.89
2	002353	杰瑞股份	152,600	4,121,726.00	2.78
3	300618	寒锐钴业	61,660	3,866,082.00	2.61
4	603799	华友钴业	128,464	3,456,966.24	2.33
5	600547	山东黄金	101,941	3,454,780.49	2.33
6	601898	中煤能源	681,128	3,351,149.76	2.26
7	600188	兖州煤业	312,424	3,327,315.60	2.25
8	601225	陕西煤业	366,121	3,196,236.33	2.16
9	600777	新潮能源	1,580,200	3,176,202.00	2.14
10	601088	中国神华	166,250	3,122,175.00	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	688368	晶丰明源	2,557	144,930.76	0.10
2	603927	中科软	884	78,198.64	0.05
3	002962	五方光电	1,597	71,018.59	0.05
4	300790	宇瞳光学	671	31,094.14	0.02
5	603786	科博达	816	21,942.24	0.01

### 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**

新潮能源 新潮能源本组合投资的前十名证券之一

山东新潮能源股份有限公司关于收到行政监管措施决定书的公告说明如下：

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

山东新潮能源股份有限公司（以下简称“公司”）于 2019 年 3 月 29 日收到中国证券监督管理委员会山东监管局发给公司的行政监管措施决定书（2019）12 号《关于对山东新潮能源股份有限公司及黄万珍、卢绍杰、胡广军、何再权采取出具警示函措施的决定》。现将上述行政监管措施决定书的相关内容公告如下：

“山东新潮能源股份有限公司及黄万珍、卢绍杰、胡广军、何再权：

根据中国证监会《上市公司现场检查办法》（证监会公告〔2010〕12 号）的相关规定，我局前期对你公司进行了现场检查，发现你公司存在以下问题：

一、未及时披露参股公司核心资产关停事项

2016 年 12 月 22 日，你公司董事会审议通过了向哈密合盛源矿业有限责任公司（以下简称合

盛源) 增资 6 亿元的议案, 增资后公司持有合盛源 45.59% 的股权。公告同时披露合盛源核心资产为雅西铁矿, 但雅西铁矿采矿权仍在哈密宏源资源开发有限责任公司(以下简称哈密宏源) 名下, 2013 年 6 月合盛源已与哈密宏源签订了采矿权转让合同并支付转让费用, 截止披露日变更手续仍在办理中。合同约定, 如 2017 年 6 月 30 日前相关手续未办理完毕, 你公司有权要求合盛源其他 3 名股东回购股份并按 12% 利率支付利息。2018 年 6 月 21 日, 你公司披露已于 2018 年 4 月 8 日以雅西铁矿采矿权未按期在 2017 年 6 月 30 日前过户至合盛源名下为由, 向深圳市华瑞矿业有限公司(以下简称深圳华瑞)、张国玺、石永兵发出告知函, 要求对方按照《增资扩股协议》对公司持有的合盛源股权进行回购, 但上述各方至今未履行回购义务; 6 月 20 日公司向山东省高级人民法院提起诉讼, 请求法院判令深圳华瑞、张国玺、石永兵向公司支付 7.86 亿回购价款, 并要求深圳华瑞原股东及现股东在深圳华瑞 2 亿元注册资本不到位的范围内承担连带责任。

经查, 哈密市野骆驼自然保护区矿山企业清理退出工作领导小组办公室于 2017 年 9 月 15 日下发通知, 要求保护区内所有矿山生产、生活设施和人员按期撤离, 9 月 30 日前完成环境恢复和生态治理任务。哈密市国土资源局 10 月 2 日向雅西铁矿下发《限期完成生态环境恢复治理的通知》, 明确雅西铁矿属于自然保护区内必须退出关闭的矿山, 要求雅西铁矿于 10 月 25 日前完成全部恢复治理工程并提交竣工验收报告。2018 年 6 月 11 日, 哈密市政府网站关于退出野骆驼自然保护区的 24 家矿山环境恢复治理验收情况的公示显示, 雅西铁矿生产及通讯设施已拆除, 并于 2018 年 5 月 22 日通过验收。

在雅西铁矿采矿权手续未按协议规定在 2017 年 6 月 30 日前完成变更手续, 且 2017 年下半年哈密市政府要求雅西铁矿限时完成关闭和环境治理的情况下, 公司对合盛源的投资面临重大损失风险, 你公司未及时履行信息披露义务。

## 二、未及时披露重大资产重组涉及关联交易事项

2018 年 3 月 3 日, 你公司公告称, 正在筹划收购深圳汉莎企业管理有限公司 100% 股权, 该收购事项的交易对方深圳市集诚信投资有限公司为独立第三方, 该事项构成重大资产重组。5 月 4 日, 公司发布终止重大资产重组事项的公告中披露, 深圳汉莎的实际控制人为杜拉和方武权、林赛璃夫妇, 且根据尽职调查结果, 方武权、林赛璃夫妇为公司董事李敏配偶的父母, 该次重大资产重组涉及关联交易。你公司未及时、准确披露该次重大资产重组涉及关联交易。

## 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, 你公司披露全资子公司浙江彝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。对于该事项你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, 你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。

你公司上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条规定, 相关责任人违反了《上市公司信息披露管理办法》第三条的规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十八条、第五十九条的规定, 我局决定对你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。你公司及相关责任人员应引以为戒, 严格遵守相关法律法规和证监会的有关规定, 提高自身规范运作水平, 切实保障信息披露质量, 杜绝类似行为再次发生。

如对本监督管理措施不服的, 可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请, 也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间, 上述监督管理措施不停止执行。”

特此公告。

山东新潮能源股份有限公司

## 董 事 会

2019 年 3 月 30 日

关于对山东新潮能源股份有限公司及有关责任人予以纪律处分的决定说明如下：

当事人：

山东新潮能源股份有限公司，A 股证券简称：新潮能源，A 股股票代码：600777；

黄万珍，时任山东新潮能源股份有限公司董事长；

卢绍杰，时任山东新潮能源股份有限公司董事长；

何再权，时任山东新潮能源股份有限公司董事会秘书；

胡广军，时任山东新潮能源股份有限公司副董事长；

杨晓云，时任山东新潮能源股份有限公司董事；

韩汉，时任山东新潮能源股份有限公司董事；

王东宁，时任山东新潮能源股份有限公司独立董事；

张宝生，时任山东新潮能源股份有限公司独立董事；

余璇，时任山东新潮能源股份有限公司独立董事。

经查明，山东新潮能源股份有限公司（以下简称公司）在信息披露方面，有关责任人在职责履行方面存在以下违规行为。

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。

公司及时任董事会秘书何再权对上述违规事实的认定无异议，但提出以下申辩理由：一是在合盛源主要股东未履行回购义务的情况下，公司已提起诉讼，积极维护公司合法权益。二是针对重大资产重组信息披露事项，在知悉关联关系后即发布终止交易的公告，实际未对投资者造成损失。

公司时任董事长黄万珍对上述违规事实的认定无异议，但提出以下申辩理由：一是针对参股增资子公司事项，公司未参与子公司日常管理，未能及时掌握项目进展情况。二是其未深度参与本次重大资产重组事宜。

公司时任董事长卢绍杰对上述违规事实的认定无异议，但提出以下申辩理由：一是其于 2017 年 12 月 22 日起任职，未参与此次参股增资子公司事项决策。2018 年 3 月知晓相关情况后，积极处理，已尽最大努力。二是针对重大资产重组信息披露违规事项，其不存在刻意隐瞒的主观故意。

公司时任董事杨晓云对上述违规事实的认定无异议，但提出以下申辩理由：针对参股增资子公司事项，是否取得采矿权非公司投资前置条件，公司已通过约定回购等方式对投资权益进行保护；而因环保政策规划导致合盛源公司无法办理采矿证的情况超出其知识及职责范畴，已勤勉尽责。

针对公司及时任董事会秘书何再权的申辩理由，上海证券交易所（以下简称本所）认为：一是提起诉讼为事后补救措施，不影响违规行为的认定。二是公司在筹划重大资产重组事项并办理股票停牌时理应审慎评估，对交易对手方的情况进行充分详尽的调查，并予以披露。但何再权直至尽职调查过程中才知悉相关情况，说明其未能尽职。三是公司未披露重组事项涉及关联交易的行为，已构成违规，交易预案是否披露、交易行为最终是否实施，不影响违规性质的认定。

针对公司时任董事长黄万珍的申辩理由，本所认为：一是黄万珍负有主动了解项目进展并及时、准确进行信息披露的职责，未派专人参与合盛源公司日常管理等不影响对违规性质的认定。二是虽然其在重大资产重组信息披露事项发生期间不担任公司董事长，但鉴于其在参股增资子公司事项中负有直接、主要责任，综合考虑不对其减轻处分。

针对公司时任董事长卢绍杰的申辩理由，本所认为：卢绍杰自 2017 年底就任董事长，而在合盛源主要股东承诺回购事项逾期近 6 个月的情况下，其迟至 2018 年 3 月才知晓相关情况并采取措 施，直至 2018 年 6 月才予以披露，说明其未勤勉尽责；其在重大资产重组信息披露事项中负有直接、主要责任，综合考虑不对其减轻处分。

针对公司时任董事杨晓云的申辩理由，本所认为：杨晓云作为公司董事会成员，应当审慎决策相关参股事项，环保政策规划情况无法作为其减轻或者免除责任的理由。

综上，公司董事会审议增资参股子公司事项决策不审慎，相关信息披露不及时；公司重大资产重组披露信息披露前后不一致，未如实披露公司董事长、董事与交易对方的关联关系。公司前述行为严重违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 2.1 条、第 2.3 条、第 2.5 条、第 2.6 条、第 7.5 条等相关规定。

公司时任董事长黄万珍、卢绍杰作为公司的主要负责人及信息披露的第一责任人，对公司在重大资产重组及对外投资等重大事项决策中的违规行为负有直接、主要责任。时任董事会秘书何再权作为公司信息披露事务的具体负责人，对公司重组信息披露前后不一致、对外投资信息披露不及时等违规行为负有主要责任。公司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、余璇作为公司董事会全体成员，在审议公司对外投资相关事项过程中未能勤勉尽责，决策不审慎，对相关违规行为负有责任。前述人员的行为违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.1.5 条、第 3.2.2 条的规定及其在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

鉴于上述违规事实和情节，经本所纪律处分委员会审核通过，根据《股票上市规则》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定，本所做出如下纪律处分决定：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。

对于上述纪律处分，本所将通报中国证监会和山东省人民政府，并记入上市公司诚信档案。当事人如对上述公开谴责的纪律处分决定不服，可于 15 个交易日内向本所申请复核，复核期间不停止本决定的执行。

公司应当引以为戒，严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定，规范运作，认真履行信息披露义务；董事、监事、高级管理人员应当履行忠实勤勉义务，促使公司规范运作，并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地披露所有重大信息。

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	14,967.71
2	应收证券清算款	609,328.82
3	应收股利	-
4	应收利息	1,760.75
5	应收申购款	58,475.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	684,532.56

### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688368	晶丰明源	144,930.76	0.10	新股未上市
2	603786	科博达	21,942.24	0.01	新股未上市

### 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	67,904,530.24	43,466,901.00	43,466,901.00
报告期期间基金总申购份额	5,629,602.68	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	12,760,456.30	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	1,850,922.00	-925,461.00	-925,461.00
报告期期末基金份额总额	62,624,598.62	42,541,440.00	42,541,440.00

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 3 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 10 月 25 日