鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告

2019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: 中国工商银行股份有限公司

报告送出日期: 2020年1月20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 2020 年 01 月 17 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 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华资源分级
场内简称	资源分级
基金主代码	160620
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
报告期末基金份额总额	140, 246, 384. 13 份
	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
投资目标	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。
	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
投资策略	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

	T				
	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	免跟踪偏离度、跟		
	踪误差进一步扩大。				
	中证 A 股资源产业指数收益	率×95%+银行活期	用存款利率(税后)		
业绩比较基准	×5%				
	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	的公司相似的风险		
风险收益特征	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		
报告期末下属分级基金的份	CO CA2 OFO 12 #\	20 001 007 00 4	20 001 007 00 //		
额总额	60, 643, 850. 13 份	39, 601, 201. 00 m	39, 801, 267. 00 份		
	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	mp /レ. /欠 が云	mp / レ / 欠 が五 D / 八 岩石 斗・		
	市场基金,为证券投资基金		鹏华资源 B 份额为		
下属分级基金的风险收益特	中较高预期风险、较高预期		积极收益类份额,		
征	收益的品种。同时本基金为	具有低风险且预	具有高风险且预		
	指数基金,通过跟踪标的指	期收益相对较低	期收益相对较高		
	数表现,具有与标的指数以	的特征。	的特征。		
	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10月1日-2019年12月31日)
1. 本期已实现收益	-2, 819, 513. 41
2. 本期利润	16, 099, 898. 08
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 1105
4. 期末基金资产净值	156, 415, 194. 12
5. 期末基金份额净值	1. 115

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

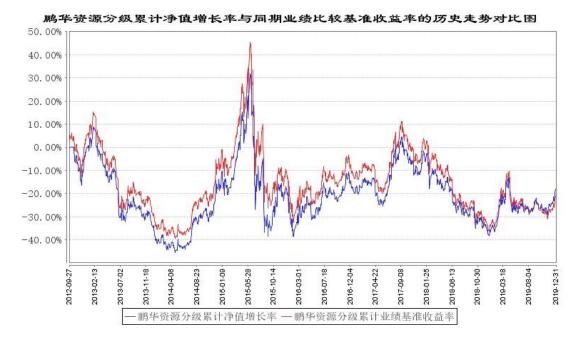
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11. 17%	0.90%	8.60%	0.89%	2. 57%	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

#4 友	加夕	任本基金的	基金经理期限	江光月小左阳	2월 미미
姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
崔俊杰	本基金基金 经理	2014-12-06	2019-11-20	11 年	崔俊楚年业年华限产品化资员产化现金、国理年业年华限产品设施,是2008年基公司规计衍量先设定,是对第一个人的,是对第一个人的,是对第一个人的,是对第一个人的,是对第一个人的,是对第一个人的,是对第一个人的,是对第一个人的,是不是对的,是是对第一个人的。



生品投资部副 总经理、2013年 2019年 11月担任 聯华深证民营 11月担任 聯华深证民营 11月担任 聯华深证民营 11月担任 野华深证民营 11月担任 野华深证民营 11月担任 野华深证民营 11月担任 野华深证民意 2019年 11月担任 野华上 证 11月担任 野华上 证 11月担任 野华上 证 11月担任 11月日 11月日 11月日 11月日 11月日 11月日 11月日 11月			
经理。2013年 03月至。2019年11月担任 11月担任 11日 11日 11日 11日 11日 11日 11日 11日 11日 11			生品投资部副
03 月至 2019 年11 月担任 鹏华深证民营 ETF 基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年11 月担任 鹏华深证民营 ETF 联接基金 基金经理, 2013 年 03 月 至 2019 年11 月担任鹏华上 证民全 50ETF 联接基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年11 月担任 民金 ETF 基金 基金经理, 2013 年 07 月 至 2018 年 07 月 至 2018 年 07 月 至 2018 年 07 月 至 2018 年 12 月 至 2019 年 11 月 担任縣华德 源分级基金基金 经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任縣华传媒 分级基金基基。 经可理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任縣华传媒 分级基金基金 经可理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 縣华银金全经 理, 2015 年 08			总经理、基金
年 11 月担任 關华深证民营 ETF 基金金 经理,2013 年 2019 年 11 月担任 關华深证民营 ETF 联接基金 经理,2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 關华深证民营 ETF 联接基金 基金经理,2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 哪华上证民金 50ETF 联接基金基金 经理,2013 年 07 月至 2019 年 11 月担任 民仓 ETF 基金基金经理,2013 年 07 月至 2018 年 02 月担任 明华沪深 300ETF 基金基金经理,2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任 明华资源分级基金基金经理,2014年 12 月至 2019 年 11 月担任 邮华传媒分级基金基金经理,2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 邮华银行分级基金基金经理,2015 年 08 月至 2016 年 08 月至 2016 年			经理。2013年
關\$P深证民营 ETF 基金基金 经理, 2013年 63月至 2019年11月担任 期\$P深证民营 ETF 联接基金 基金经理, 2013年03月至 2019年11 月担任勝\$P上 证民企 50ETF 联接基金基金 经理, 2013年03月至 2019年11月担任 民企 ETF 基金 基金经理, 2013年07月至 2018年07月至 2018年07月至 2018年02月担任鹏\$P沪深 300ETF基金基金经理, 2014年12月至 2019年11月担任鹏\$P张子 源分级基金基金 经理, 2014年12月至 2019年11月担任鹏\$P张子 2019年11月担任鹏\$P\$ 2019年11月担任鹏\$P\$ 2019年11月担任鹏\$P\$ 2019年11月担任鹏\$P\$ 2015年08月至 2016年			03 月至 2019
ETF 基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 鹏华深证民营 ETF 联接基金 基金经理, 2013 年 03 月 至 2019 年 11 月担任鹏华上 证民企 50ETF 联接基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 基金 基金经理, 2013 年 07 月 至 2018 年 07 月 至 2018 年 07 月 至 2018年 67 月 至 2018年 11 月 担任 明华资 源分级王金基金 经理, 2014年 12 月 至 2019年 11 月 担任鹏华资 源分级基金基金 经理,2016年 11 月 担任鹏华传媒 分级基金基金 经理,2013年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金 经理,2015年 08 月至 2015年 08			年 11 月担任
经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 鹏华深证民营 ETF 联接基金 基金经理, 2013 年 03 月 至 2019 年 11 月担任 阿华上 证民企 50ETF 联接基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 基金 基金经理, 2013 年 07 月 至 2018 年 02 月担任 同学。 深 300ETF 基 金基金经理, 2014 年 12 月 至 2019 年 11 月担任 哪华资 源分级基金基金 经理, 2014年 12 月至 2019年 11 月担任 哪华传媒 分级基金基金 经理, 2015年 10 月 至 2019年 11 月担任 明华传统 分级基金基金 经理, 2015年 08 月 至 2016年			鹏华深证民营
经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 鹏华深证民营 ETF 联接基金 基金经理, 2013 年 03 月 至 2019 年 11 月担任 阿华上 证民企 50ETF 联接基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 基金 基金经理, 2013 年 07 月 至 2018 年 02 月担任 同学。 深 300ETF 基 金基金经理, 2014 年 12 月 至 2019 年 11 月担任 哪华资 源分级基金基金 经理, 2014年 12 月至 2019年 11 月担任 哪华传媒 分级基金基金 经理, 2015年 10 月 至 2019年 11 月担任 明华传统 分级基金基金 经理, 2015年 08 月 至 2016年			
03 月至 2019 年11 月担任 鹏华深证代营 ETF 联接基金 基金经理, 2013 年 03 月 至 2019 年 11 月担任鹏华上 证民企 50ETF 联接基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 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 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任၏华传媒 分级基金基 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任			经理,2013年
年 11 月担任 鹏华深证民营 ETF 联接基金 基金经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任鹏华上 证民企 50ETF 联接基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 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 月至 2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒 分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 哪华银行分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 哪年银行分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 哪年银行分级基金经理, 2015 年 08 月至 2016 年 08 月至 2016 年			
勝华深证民营 ETF 联接基金基金经理, 2013 年 03 月 至 2019 年 11 月担任鹏华上 证民企 50ETF 联接基金基金经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任民企 ETF 基金基金经理, 2013 年 07 月 至 2018 年 02 月担任鹏华沙深 300ETF 基金基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒分级基金基金经理, 2015 年 10 4 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级基金基金经理, 2015 年 08 月至 2015 年 08 月至 2016 年 10 5 年 08 月至 2016 年 10 5 年 08 月至 2016 年 10 5			年 11 月担任
ETF 联接基金基金经理, 2013 年 03 月 至 2019 年 11 月担任鹏华上 证 長左 50ETF 联接基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 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 至 2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒 分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级基金基金经理, 2015 年 08 月至 2016 年 08 月至 2016 年			
基金经理, 2013 年 03 月 至 2019 年 11 月担任鹏华上证民企 50ETF 联接基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任民企 ETF 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 至 2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒 分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒 分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经理, 2015 年 08 月至 2016 年 08 月至 2016 年 08			
至 2019 年 11 月担任鹏华上 证民企 50ETF 联接基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 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 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华传媒 分 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2015 年 08 月至 2016 年			
至 2019 年 11 月担任鹏华上 证民企 50ETF 联接基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 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 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华传媒 分 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2015 年 08 月至 2016 年			2013年03月
证民企 50ETF 联接基金基金 经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 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 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任縣华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2015 年 08 月至 2016 年			至 2019 年 11
联接基金基金 经理,2013年 03月至2019年11月担任 民企ETF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月至2019年11 月担任鹏华资源分级基金基金 金经理,2014年12月至 2019年11月担任鹏华传媒 分级基金基。 经理,2015年11月担任鹏华传媒 分级基金基金 经理,2015年04月至2019年11月担任鹏华银行分级 基金基金经理,2015年08月至2016年08月至2016年			月担任鹏华上
经理, 2013 年 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 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 月至 2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传源 分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒 分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级基金基金经理, 2015 年 08 月至 2016 年 08			证民企 50ETF
03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 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 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2016 年 08 月至 2016 年			联接基金基金
年 11 月担任 民企 ETF 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 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2015 年 08 月至 2016 年			经理,2013年
民企 ETF 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 月至 2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理, 2015 年 08 月至 2016 年 08 月至 2016 年			03 月至 2019
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 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒 分级基金基金经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2015 年 08 月至 2016 年 08 月至 2016 年			年 11 月担任
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 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理,2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传媒 分级基金基金 经理,2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理,2015 年 08 月至 2016 年			民企 ETF 基金
至 2018 年 02 月担任鹏华沪深 300ETF 基金基金经理,2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理,2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传媒分级基金基金经理,2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理,2015 年 08 月至 2016 年 08 月至 2016 年			基金经理,
月担任鹏华沪 深 300ETF 基 金基金经理, 2014 年 12 月 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2015 年 08 月至 2016 年			2013年07月
深 300ETF 基金基金经理, 2014年12月至 2019年11月担任鹏华资源分级基金基金经理, 2014年12月至 2019年11月担任鹏华传媒分级基金基金经理, 2015年04月至 2019年11月担任鹏华银行分级基金基金经理, 2015年08月至 2016年			至 2018 年 02
金基金经理, 2014年12月至2019年11月担任鹏华资源分级基金基金经理, 2014年12月至2019年11月担任鹏华传媒分级基金基金经理, 2015年04月至2019年11月担任鹏华银行分级基金基金经理, 2015年08月至2016年			月担任鹏华沪
2014 年 12 月 至 2019 年 11 月担任鹏华资 源分级基金基 金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2015 年 08 月至 2016 年			深 300ETF 基
至 2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理,2014年 12 月至2019年 11 月担任鹏华传媒分级基金基金经理,2015年 04 月至 2019年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理,2015年 08 月至 2016年			金基金经理,
月担任鹏华资源分级基金基金经理,2014年12月至2019年11月担任鹏华传媒分级基金基金经理,2015年04月至2019年11月担任鹏华银行分级基金基金经理,2015年08月至2016年			2014年12月
源分级基金基金经理,2014年12月至2019年11月担任鹏华传媒分级基金基金经理,2015年08月至2016年			至 2019 年 11
金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2015 年 08 月至 2016 年			月担任鹏华资
年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传媒 分级基金基金 经理, 2015 年 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理, 2015 年 08 月至 2016 年			源分级基金基
2019年11月 担任鹏华传媒 分级基金基金 经理,2015年 04月至2019 年11月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理,2015年08 月至2016年			金经理,2014
担任鹏华传媒 分级基金基金 经理,2015年 04月至2019 年11月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理,2015年08 月至2016年			年 12 月至
分级基金基金 经理,2015年 04月至2019 年11月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理,2015年08 月至2016年			2019年11月
经理,2015年 04月至2019 年11月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理,2015年08 月至2016年			担任鹏华传媒
04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理,2015 年 08 月至 2016 年			分级基金基金
年 11 月担任 鹏华银行分级 基金基金经 理,2015 年 08 月至 2016 年			经理,2015年
鵬华银行分级 基金基金经 理,2015年08 月至2016年			04 月至 2019
基金基金经 理,2015年08 月至2016年			年 11 月担任
理,2015年08 月至2016年			鹏华银行分级
月至 2016 年			基金基金经
07 月担任鹏华			月至 2016 年
			07 月担任鹏华

					医药分级基金
					基金经理,
					2016年07月
					至 2019 年 11
					月担任鹏华医
					药指数(LOF)
					基金基金经
					理,2016年11
					月至 2019 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
					经理发生变
					动,增聘闫冬
					为本基金基金
					经理,崔俊杰
					不再担任本基
					金基金经理。
					闫冬先生,国
					籍中国,理学
					硕士,9年证
					券基金从业经
					验。曾任招商
					期货有限公司
					资产管理部投
	Λ ++ Λ ++ .1				资经理; 2018
闫冬	本基金基金	2019-11-20	_	9年	年5月加盟鹏
	经理				华基金管理有
					限公司,现任
					量化及衍生品
					投资部基金经
					理。2019年03
					月担任鹏华信
					息分级基金基
					金经理,2019

		年 03 月担任
		鹏华环保分级
		基金基金经
		理, 2019年 03
		月担任鹏华酒
		分级基金基金
		经理,2019 年
		04 月担任鹏华
		地产分级基金
		基金经理,
		2019年11月
		担任鹏华银行
		分级基金基金
		经理,2019年
		11 月担任鹏华
		资源分级基金
		基金经理。闫
		冬先生具备基
		金从业资格。
		本报告期内本
		基金基金经理
		发生变动,增
		聘闫冬为本基
		金基金经理,
		崔俊杰不再担
		任本基金基金
		经理。

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,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 第8页共15页



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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,基金运作严格按照基金合同的各项要求,依据被动化指数投资方法进行投资管理。报告期内,基金日均跟踪偏离度和跟踪误差都有较好的控制,较好地实现了基金运作目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金份额净值增长率为11.17%。

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 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	147, 791, 576. 17	93. 38
	其中: 股票	147, 791, 576. 17	93. 38
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, 508, 643. 52	6. 01
8	其他资产	965, 152. 48	0.61
9	合计	158, 265, 372. 17	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

|--|



A	农、林、牧、渔业	_	-
В	采矿业	72, 019, 396. 92	46. 04
С	制造业	67, 267, 034. 89	43. 01
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	_	_
Е	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	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	_	_
0	居民服务、修理和其他服务业	-	_
Р	教育	-	_
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	5, 949, 879. 20	3. 80
	合计	145, 236, 311. 01	92. 85

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	-	_
В	采矿业	_	
С	制造业	519, 457. 85	0. 33
D	电力、热力、燃气及水生产和		
D	供应业	-	_
Е	建筑业	-	
F	批发和零售业	-	
G	交通运输、仓储和邮政业	-	
Н	住宿和餐饮业	-	
Ι	信息传输、软件和信息技术服		
1	务业	2, 029, 229. 27	1. 30
Ј	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	6, 578. 04	
0	居民服务、修理和其他服务业	_	_
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作		-

R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	_	_
	合计	2, 555, 265. 16	1. 63

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 报告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

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	002466	天齐锂业	116, 037	3, 501, 996. 66	2. 24
2	601808	中海油服	180, 400	3, 463, 680. 00	2. 21
3	002353	杰瑞股份	92, 400	3, 415, 104. 00	2. 18
4	000723	美锦能源	354, 100	3, 339, 163. 00	2. 13
5	600188	兖州煤业	312, 724	3, 302, 365. 44	2. 11
6	600583	海油工程	442, 591	3, 266, 321. 58	2. 09
7	600985	淮北矿业	321, 900	3, 215, 781. 00	2. 06
8	000983	西山煤电	511, 870	3, 137, 763. 10	2. 01
9	601088	中国神华	170, 050	3, 103, 412. 50	1.98
10	601699	潞安环能	427, 365	3, 102, 669. 90	1.98

5.3.2 报告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

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	688111	金山办公	14, 659	1, 885, 587. 17	1. 21
2	688166	博瑞医药	8, 041	206, 171. 24	0. 13
3	688078	龙软科技	2,811	143, 642. 10	0.09
4	688089	嘉必优	3, 383	107, 139. 61	0. 07
5	688181	八亿时空	2,033	89, 411. 34	0.06

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

第 12 页 共 15 页



5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	10, 508. 56
2	应收证券清算款	511, 886. 17
3	应收股利	_
4	应收利息	1, 800. 26
5	应收申购款	440, 957. 49
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	965, 152. 48

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 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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

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	002466	天齐锂业	837, 404. 46	0. 54	配股未上市

5.11.5.2 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

克口 机蛋化 石	叽面勾勒	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况	
序号	股票代码	股票名称	允价值(元)	值比例 (%)	说明
1	688111	金山办公	1, 885, 587. 17	1. 21	锁定期股票
2	688166	博瑞医药	206, 171. 24	0. 13	锁定期股票
3	688089	嘉必优	107, 139. 61	0.07	锁定期股票
4	688181	八亿时空	89, 411. 34	0.06	新股未上市

5.11.6 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。

§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	62, 624, 598. 62	42, 541, 440. 00	42, 541, 440. 00
报告期期间基金总申购份额	7, 026, 734. 57	_	_
减:报告期期间基金总赎回份额	14, 487, 829. 06	_	_
报告期期间基金拆分变动份额(份额减	5, 480, 346. 00	-2, 740, 173. 00	-2, 740, 173. 00

少以"-"填列)			
报告期期末基金份额总额	60, 643, 850. 13	39, 801, 267. 00	39, 801, 267. 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 4 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 2020年1月20日