

鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资
基金
2020 年第 4 季度报告

2020 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：2021 年 1 月 22 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。

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 2021 年 01 月 21 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 01 日起至 2020 年 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 | 115,106,238.86 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 | 鹏华资源分级 A | 鹏华资源分级 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额总额 | 115,106,238.86 份 | 一份 | 一份 |
| 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。 |

注：鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金取消分级运作变更为鹏华中证 A 股资源产业指数型证券投资基金（LOF）。《鹏华中证 A 股资源产业指数型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2021 年 1 月 1 日正式生效，《鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金基金合同》自同一日失效。

§ 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（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -2,060,660.26 |
| 2. 本期利润 | 21,910,669.53 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1773 |
| 4. 期末基金资产净值 | 145,969,514.35 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.268 |

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。

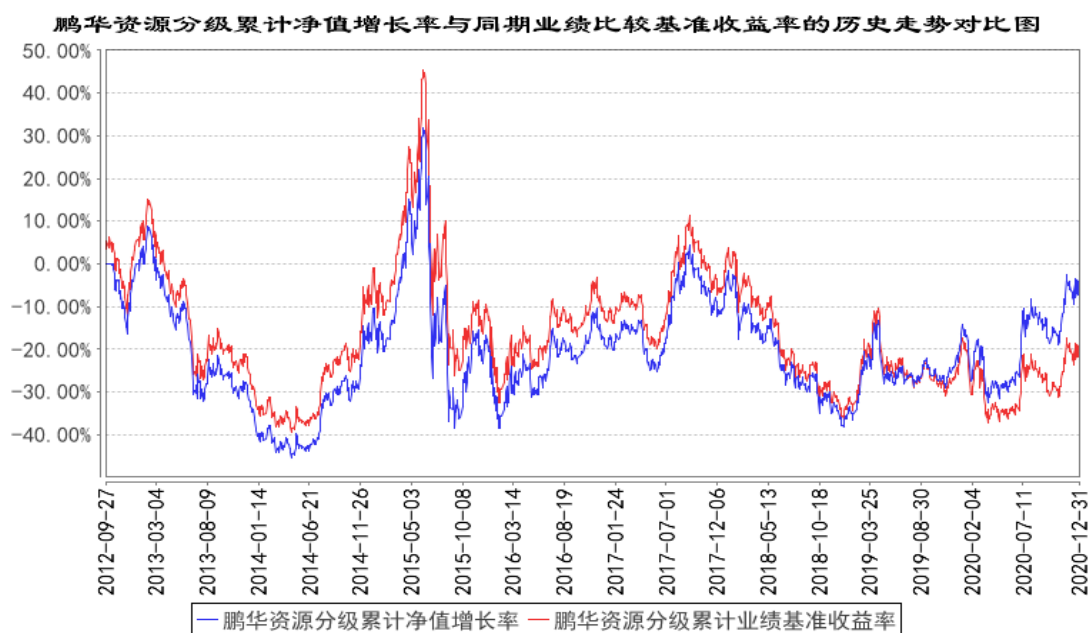
3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 16.87% | 1.58% | 15.96% | 1.60% | 0.91% | -0.02% |
| 过去六个月 | 28.73% | 1.70% | 21.71% | 1.71% | 7.02% | -0.01% |
| 过去一年 | 16.04% | 1.67% | 1.53% | 1.68% | 14.51% | -0.01% |
| 过去三年 | 2.60% | 1.50% | -18.07% | 1.51% | 20.67% | -0.01% |
| 过去五年 | 19.91% | 1.57% | -7.11% | 1.57% | 27.02% | 0.00% |
| 自基金合同 生效起至今 | -4.76% | 1.80% | -19.70% | 1.74% | 14.94% | 0.06% |

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

| 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 | | |
| 闫冬 | 本基金基金经理 | 2019-11-20 | - | 10 年 | 闫冬先生，国籍中国，理学硕士，10 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资经理；2018 年 5 月加盟鹏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 月至 2020 年 12 月担任鹏华酒分级基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华环保分级基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华信息分级基金基金经理，2019 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华地产分级基金基金经理，2019 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华资源分级基金基金经理，2019 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华银行分级基金基金经理。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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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

本报告期基金份额净值增长率为 16.87%，业绩比较基准增长率 15.96%。本报告期，基金年化跟踪误差 0.84%。

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 | 137,800,915.31 | 92.83 |
| | 其中：股票 | 137,800,915.31 | 92.83 |
| 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 | 9,478,628.94 | 6.39 |
| 8 | 其他资产 | 1,168,312.94 | 0.79 |
| 9 | 合计 | 148,447,857.19 | 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 | 66,761,513.70 | 45.74 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业 | 65,089,893.89 | 44.59 |
| 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 | 2,137,512.00 | 1.46 |
| 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 | 2,643,667.40 | 1.81 |
| | 合计 | 136,632,586.99 | 93.60 |

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 | 1,026,675.86 | 0.70 |
| 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 | 18,716.24 | 0.01 |
| 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 | 122,936.22 | 0.08 |
| 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 | 1,168,328.32 | 0.80 |
|----|--------------|------|

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 | 603799 | 华友钴业 | 53,264 | 4,223,835.20 | 2.89 |
| 2 | 300618 | 寒锐钴业 | 42,260 | 4,010,896.60 | 2.75 |
| 3 | 603993 | 洛阳钼业 | 636,257 | 3,976,606.25 | 2.72 |
| 4 | 688122 | 西部超导 | 47,500 | 3,776,725.00 | 2.59 |
| 5 | 002460 | 赣锋锂业 | 36,400 | 3,683,680.00 | 2.52 |
| 6 | 600219 | 南山铝业 | 1,066,545 | 3,370,282.20 | 2.31 |
| 7 | 600549 | 厦门钨业 | 192,566 | 3,244,737.10 | 2.22 |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 329,326 | 3,059,438.54 | 2.10 |
| 9 | 600516 | 方大炭素 | 431,048 | 3,047,509.36 | 2.09 |
| 10 | 000960 | 锡业股份 | 271,128 | 3,036,633.60 | 2.08 |

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 | 688567 | 孚能科技 | 7,454 | 328,423.24 | 0.22 |
| 2 | 688390 | 固德威 | 1,451 | 321,715.72 | 0.22 |
| 3 | 688057 | 金达莱 | 4,282 | 122,936.22 | 0.08 |
| 4 | 688608 | 恒玄科技 | 398 | 108,256.00 | 0.07 |
| 5 | 688185 | 康希诺-U | 279 | 99,234.72 | 0.07 |

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：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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

赣锋锂业

江西赣锋锂业股份有限公司（以下简称“公司”）于 2020 年 4 月 13 日收到中国证券监督管理委员会江西监管局《关于对江西赣锋锂业股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（【2020】2 号）（以下简称“警示函”），内容如下：

“经查，我局发现你公司存在内幕信息知情人登记管理不规范问题，一是未对重大投资进行内幕信息知情人登记，如未对收购阿根廷 Minera Exar 公司 37.5%股权事项进行内幕信息知情人登记。二是内幕信息知情人登记不完整，2018 年定期报告内幕信息知情人登记中相关人员签名缺失。你的行为违反了中国证监会《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》

第六条的规定。

按照中国证监会《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定，我局决定对你公司采取出具警示函的行政监管措施。你公司应吸取教训，加强对相关法律法规的学习，认真执行内幕信息知情人登记管理制度。你公司于收到本决定书 30 日内向我局报送整改报告。

如果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。”

收到上述警示函后，公司对此高度重视，迅速组织证券部门对照警示函逐一落实整改，并对相关工作人员进行学习培训。现将整改情况说明如下：

一、证券部门立即补齐了收购阿根廷 Minera Exar 公司 37.5%股权事项的内幕信息知情人登记和 2018 年定期报告内幕信息知情人登记中相关人员的签名。

二、证券部门相关工作人员认真学习了《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》、《江西赣锋锂业股份有限公司内幕信息知情人登记管理制度》等相关法律法规和公司制度，要求工作人员树立规范运作意识，不断提高业务素质和责任意识，确保今后严格按照相关法律法规和公司制度的要求，真实、准确、完整地履行内幕信息知情人登记制度，杜绝类似事情的再次发生。

对于此次未按规定进行内幕信息知情人登记和内幕信息知情人登记不完整事项，公司深表歉意。公司将认真吸取教训，组织落实整改措施，进一步树立规范运作意识，确保真实、准确、完整地履行信息披露义务，维护公司及全体股东利益，促进公司健康持续稳定发展。

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。

华友钴业

浙江华友钴业股份有限公司（以下简称“公司”）于 2020 年 12 月 30 日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局（以下简称“浙江证监局”）下发的《关于对浙江华友钴业股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2020]110 号）（以下简称《责令改正决定书》）、《关于对陈雪华等四人采取出具警示函措施的决定》（[2020]111 号）（以下简称“《警示函决定书》”），现将以上监管措施决定书的主要内容公告如下：

一、《责令改正决定书》的主要内容

浙江华友钴业股份有限公司：

经查，我局发现你公司存在如下问题：

一、你公司存货跌价准备计提未区分不同合同与规格存货价格差异，2018 年、2019 年存货跌价准备计提不精确，未能反映不同规格存货价格波动的真实情况。

二、你公司将 2019 年飞机使用费跨期确认为 2020 年费用，导致 2019 年少确认费用 293.88 万元。

三、你公司向第一大股东浙江华友控股集团有限公司拆借资金，2019 年度发生 10 笔，2020 年 1-6 月发生 4 笔，但公司在 2019 年年报、2020 年半年报中仅披露了 2019 年 12 月 31 日、2020 年 6 月 30 日两个时点的拆借资金余额，未逐笔披露发生额，导致 2019 年年报和 2020 年半年报中关联方资金往来的信息披露不完整。

四、2020 年 4 月 9 日，你公司披露《关于获得政府补助的公告》，2020 年 1 月 1 日至公告日，累计收到与收益相关的政府补助金额为 22,596,097.12 元，超过上一年度经审计后净利润的 10%，政府补助的信息披露不及时。此外，你公司还存在固定资产核算不规范、部分制度不完善、资金管理不规范等情况。

你公司上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条和第三十条相关规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。你公司应于 2020 年 12 月 31 日之前向我局提交整改报告，整改报告应当包括具体明确的整改措施、整改责任人、整改时间表等内容。整改报告经报我局无异议后进行公告披露，你公司应严格按照要求对存在的问题进行整改，未按照要求进行整改的，我局将依法采取进一步措施。

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。

二、《警示函决定书》的主要内容

陈雪华、陈红良、全昌胜、李瑞：

经查，我局发现公司存在如下问题：

一、公司存货跌价准备计提未区分不同合同与规格存货价格差异，2018 年、2019 年存货跌价准备计提不精确，未能反映不同规格存货价格波动的真实情况。

二、公司将 2019 年飞机使用费跨期确认为 2020 年费用，导致 2019 年少确认费用 293.88 万元。

三、公司向第一大股东浙江华友控股集团有限公司拆借资金，2019 年度发生 10 笔，2020 年 1-6 月发生 4 笔，但公司在 2019 年年报、2020 年半年报中仅披露了 2019 年 12 月 31 日、2020 年 6 月 30 日两个时点的拆借资金余额，未逐笔披露发生额，导致 2019 年年报和 2020 年半年报中关联方资金往来的信息披露不完整。

四、2020 年 4 月 9 日，公司披露《关于获得政府补助的公告》，2020 年 1 月 1 日至公告日，累计收到与收益相关的政府补助金额为 22,596,097.12 元，超过上一年度经审计后净利润的 10%，政府补助的信息披露不及时。

此外，公司还存在固定资产核算不规范、部分制度不完善、资金管理不规范等情况。

公司上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条和第三十条的相关规定。你们分别作为公司的董事长、总经理、财务总监和董事会秘书，违反了《上市公司信息披露管理办法》第三条的规定，对上述行为负有主要责任。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，我局决定对你们采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。你们应充分吸取教训，加强相关法律法规学习，提高公司规范运作水平和信息披露质量，采取切实有效措施杜绝此类违规行为再次发生。

如果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。

三、相关说明

公司全体董事、监事和高级管理人员高度重视上述监管措施决定书所提出的问题，深刻反思公司在信息披露、会计管理、公司治理和内控管理过程中存在的问题和不足，公司将严格按照浙江证监局的要求采取切实有效的措施进行整改，尽快形成整改报告，并根据相关规定履行信息披露义务。公司将进一步加强董事、监事、高级管理人员对《中华人民共和国证券法》、《股票上市规则》、《上市公司信息披露管理办法》等相关法律法规的学习，进一步规范公司运作水平，不断提高信息披露质量，增强规范运作意识、加强财务核算管理、完善内部控制、不断提高公司规范运作水平，维护公司及全体股东利益，促进公司健康、稳定、持续发展。

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 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 18,642.42 |
| 2 | 应收证券清算款 | 772,552.22 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,085.74 |
| 5 | 应收申购款 | 376,032.56 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,168,312.94 |

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

注：无。

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

| 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 | 688567 | 孚能科技 | 328,423.24 | 0.22 | 锁定期股票 |
| 2 | 688390 | 固德威 | 321,715.72 | 0.22 | 锁定期股票 |
| 3 | 688057 | 金达莱 | 122,936.22 | 0.08 | 锁定期股票 |
| 4 | 688608 | 恒玄科技 | 108,256.00 | 0.07 | 锁定期股票 |
| 5 | 688185 | 康希诺-U | 99,234.72 | 0.07 | 锁定期股票 |

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 | 鹏华资源分级 A | 鹏华资源分级 B |
|--------------------|---------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 63,098,039.91 | 33,666,895.00 | 33,666,895.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 51,609,814.88 | - | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 66,935,404.93 | - | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减） | 67,333,789.00 | -33,666,895.00 | -33,666,895.00 |

| | | | |
|-------------|----------------|---|---|
| 少以“-”填列) | | | |
| 报告期期末基金份额总额 | 115,106,238.86 | - | - |

注：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。

§ 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 2020 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

2021 年 1 月 22 日