

# 鹏华中证新能源指数分级证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华新能源分级		
场内简称	新能源		
基金主代码	160640		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日		
基金管理人	鹏华基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	32,010,145.29 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	2015 年 6 月 5 日		
下属分级基金的基金简称	新能源	新能 A	新能 B
下属分级基金的场内简称	新能源	新能 A	新能 B
下属分级基金的交易代码	160640	150279	150280
报告期末下属分级基金的份额总额	29,708,589.29 份	1,150,778.00 份	1,150,778.00 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	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。本基金力争鹏华新能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	中证新能源指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(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。	鹏华新能源 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。	鹏华新能源 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:无。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201

### 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	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
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(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	-794,621.11

本期利润	4,547,483.13
加权平均基金份额本期利润	0.1363
本期基金份额净值增长率	14.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-1.6412
期末基金资产净值	34,408,912.38
期末基金份额净值	1.075

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

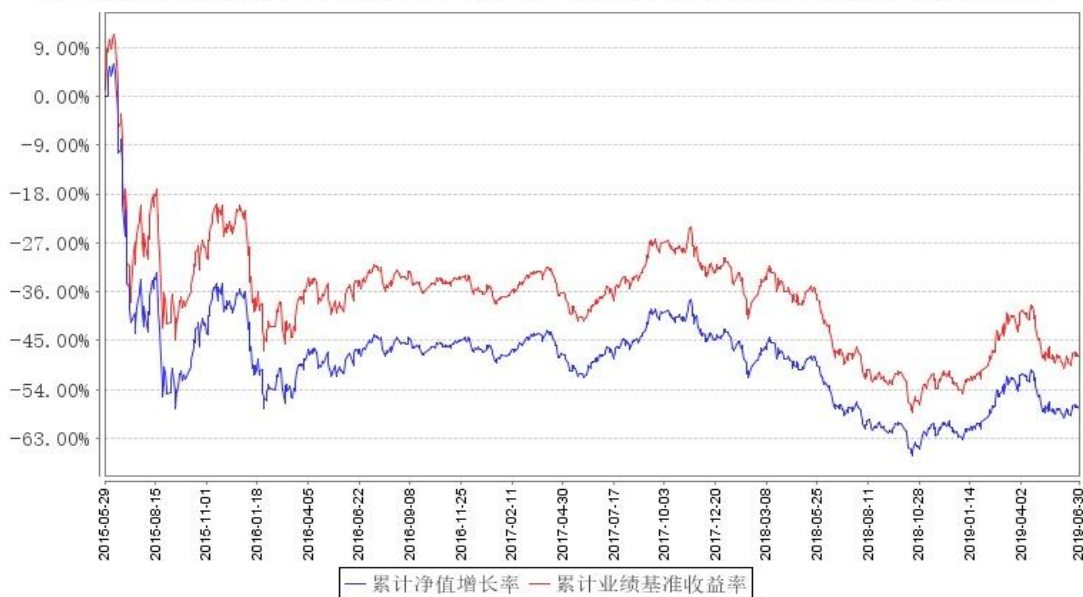
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.37%	1.21%	0.03%	1.25%	0.34%	-0.04%
过去三个月	-9.05%	1.71%	-10.00%	1.72%	0.95%	-0.01%
过去六个月	14.00%	1.70%	13.23%	1.73%	0.77%	-0.03%
过去一年	-1.31%	1.60%	-2.38%	1.62%	1.07%	-0.02%
过去三年	-20.46%	1.29%	-21.20%	1.30%	0.74%	-0.01%
自基金成立起至今	-57.43%	1.99%	-47.88%	1.94%	-9.55%	0.05%

注:业绩比较基准=中证新能源指数收益率\*95%+商业银行活期存款利率(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

鹏华新能源分级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 2015 年 05 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。截止到 2019 年 6 月,公司管理资产总规模达到 5,644.95 亿元,管理 159 只公募基金、10 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。

#### 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		
张羽翔	本基金基金经理	2016-11-23	-	12	张羽翔先生,国籍中国,工学硕士,12

				<p>年证券投资基金从业经验。曾任招商银行软件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师; 2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员, 先后从事金融工程、量化研究等工作; 现任量化及衍生品投资部基金经理。2015 年 09 月担任鹏华上证民企 50ETF 联接基金基金经理, 2015 年 09 月担任鹏华上证民企 50ETF 基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路分级基金基金经理, 2016 年 07 月担任鹏华高铁分级基金基金经理, 2016 年 09 月担任鹏华沪深 300 指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 09 月担任鹏华中证 500 指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 11 月担任鹏华一带一路分级基金基金经理, 2016 年 11 月担任鹏华新能源分级基金基金经理。2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理, 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理, 2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪</p>
--	--	--	--	--

					深 300 指数增强基金基金经理，2018 年 05 月担任鹏华香港中小企业指数（LOF）基金基金经理，2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理，2019 年 04 月担任酒 ETF 基金基金经理，2019 年 07 月担任国防 ETF 基金基金经理。张羽翔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合规守信情况的说明

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 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

本基金秉承指数基金的投资策略，在应对基金申购赎回的基础上，力争跟踪指数的收益，并



将基金跟踪误差控制在合理范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内，鹏华新能源分级组合净值增长率 14.00%，业绩比较基准增长率 13.23%；

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年权益市场受金融去杠杆和贸易战的影响，指数震荡盘整。上半年，积极的财政政策发力，支撑基建投资增速稳定，但财政支出节奏相对较块，下半年的财政支出受空间影响，节奏可能放缓，会对基建资金形成一定影响，地方政府专项债加速发行将在三季度末前发力，预计四季度地方政府又将受到资金方面的压力。地产投资增速可能回落至两位数以下，受销售走低影响，投资保持加速增长的可能性不大。总的来看，固定资产投资增速可能三季度将仍保持稳定。

“国际经济金融形势错综复杂，外部不确定不稳定因素增多”，国际风险因素主要指的是短期内全球经济增长动能偏弱，中美贸易摩擦，各经济体存在脆弱性，地缘政治冲突多点爆发等。国内方面的风险则是出口增速下行，民间投资动能不足，制造业投资上行乏力，综合体现为 2 季度 GDP 增速创 1992 年 1 季度以来新低。“科创板”是定位为支持我国“新经济”公司发展的一个股权市场，是我国产业升级、经济转型之国家战略在资本市场的体现。随着全球技术和产业的变迁，“新经济”公司已经站在了全球企业界的巅峰。“科创板”作为一个变局者，有望成为我国“新经济”公司发展的沃土，在推进我国产业升级的同时，给投资者带来丰厚回报。“科创板”也会改变我国金融格局。

#### 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[2017]13号《中国证监会关于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、定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括鹏华新能源分级份额、鹏华新能 A 份额、鹏华新能 B 份额）不进行收益分配。

## 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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

# § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：鹏华中证新能源指数分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	2,173,130.31	3,091,477.89
结算备付金	-	-
存出保证金	7,358.27	5,679.48
交易性金融资产	32,681,200.91	29,032,643.86
其中：股票投资	32,681,200.91	29,032,643.86
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	-	-
应收利息	431.10	671.80
应收股利	-	-
应收申购款	43,081.95	29,006.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	34,905,202.54	32,159,479.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
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	1.20	725,660.31
应付赎回款	71,751.10	71,115.31

应付管理人报酬	28,175.66	27,365.07
应付托管费	6,198.64	6,020.32
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	11,145.33	6,229.11
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	379,018.23	395,213.49
负债合计	496,290.16	1,231,603.61
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	80,847,486.18	82,838,963.04
未分配利润	-46,438,573.80	-51,911,087.11
所有者权益合计	34,408,912.38	30,927,875.93
负债和所有者权益总计	34,905,202.54	32,159,479.54

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 32,010,145.29 份，其中新能源基金份额总额为 29,708,589.29 份，基金份额净值 1.075 元；新能 A 基金份额总额为 1,150,778.00 份，基金份额净值 1.040 元；新能 B 基金份额总额为 1,150,778.00 份，基金份额净值 1.110 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华中证新能源指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		4,966,231.98	-10,966,163.40
1. 利息收入		9,770.49	15,743.03
其中：存款利息收入		9,770.49	15,743.03
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）		-436,874.29	-1,220,429.05
其中：股票投资收益		-558,024.44	-1,439,948.61
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		121,150.15	219,519.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		5,342,104.24	-9,792,392.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		51,231.54	30,914.73
减：二、费用		418,748.85	627,644.94
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	181,086.53	229,316.76
2. 托管费	6.4.8.2.2	39,839.01	50,449.65
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		37,947.09	68,474.86
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		159,876.22	279,403.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,547,483.13	-11,593,808.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,547,483.13	-11,593,808.34

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证新能源指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	82,838,963.04	-51,911,087.11	30,927,875.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,547,483.13	4,547,483.13
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）	-1,991,476.86	925,030.18	-1,066,446.68
其中：1. 基金申	44,448,240.23	-24,117,428.48	20,330,811.75

购款			
2. 基金赎回款	-46,439,717.09	25,042,458.66	-21,397,258.43
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）	80,847,486.18	-46,438,573.80	34,408,912.38
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	91,506,126.35	-40,450,154.49	51,055,971.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,593,808.34	-11,593,808.34
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）	49,229.67	-23,179.61	26,050.06
其中：1. 基金申购款	48,841,780.56	-24,524,071.94	24,317,708.62
2. 基金赎回款	-48,792,550.89	24,500,892.33	-24,291,658.56
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）	91,555,356.02	-52,067,142.44	39,488,213.58

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

苏波

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

鹏华中证新能源指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2015]第 768 号《关于核准鹏华中证新能源指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 211,446,100.80 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 565 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 211,461,467.83 份基金份额,其中认购资金利息折合 15,367.03 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《鹏华中证新能源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新能源指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“鹏华新能源份额”)、鹏华中证新能源指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“鹏华新能源 A 份额”)、鹏华中证新能源指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“鹏华新能源 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。鹏华新能源份额为可以申购、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。鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额,其中鹏华新能源 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风险收益特征,鹏华新能源 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风险收益特征。鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。本基金的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鹏华新能源份额;场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额。本基金基金合同生效后,鹏华新能源份额与鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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鹏华新能源份额按照 2 份场内鹏华新能源份额对应 1 份鹏华新能源 A 份额与 1 份鹏华新能源 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鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额按照 1 份鹏华新能源 A 份额与 1 份鹏华新能源 B 份额对应 2 份场内鹏华新能源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:鹏华新能源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鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额的份额数之和。鹏华新能源 A 份额的基金份额净值为鹏华新能源 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份鹏华新能源份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华新能源 A 份额与 1 份鹏华新能源 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。在鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源份额存续期内的每个会计年度 9 月第一个工作日，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，鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。对于鹏华新能源 A 份额的约定应得收益，即鹏华新能源 A 份额每个会计年度 8 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内鹏华新能源份额分配给鹏华新能源 A 份额持有人。鹏华新能源份额持有人持有的每 2 份鹏华新能源份额将按 1 份鹏华新能源 A 份额获得新增鹏华新能源份额的分配。持有场外鹏华新能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华新能源份额的分配；持有场内鹏华新能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华新能源份额的分配。经过上述份额折算，鹏华新能源 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，鹏华新能源份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在鹏华新能源份额的基金份额净值达到 1.500 元时或鹏华新能源 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，本基金将分别对鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后鹏华新能源份额的基金份额净值、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 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[2015]第 244 号文审核同意，本基金鹏华新能源 A 份额 63,569,903.00 份基金份额和鹏华新能源 B 份额 63,569,903.00 份基金份额于 2015 年 6 月 5 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的鹏华新能源份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为鹏华新能源 A 份额和鹏华新能源 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的鹏华新能源份额，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鹏华新能源 A 份额和鹏华新能源 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的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、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或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)。本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证新能源指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年上半年内，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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
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
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、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

注：无。

## 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

注：无。

## 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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	181,086.53	229,316.76
其中：支付销售机构的客户维护费	81,724.04	86,580.15

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	39,839.01	50,449.65

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费年费率为 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：无。

##### 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没有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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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
招商银行	2,173,130.31	9,533.96	7,480,092.39	14,822.60

#### 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：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人

及委托人控股股东承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末(2019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

注:无。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

##### 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

无。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	32,681,200.91	93.63
	其中：股票	32,681,200.91	93.63
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	2,173,130.31	6.23
8	其他各项资产	50,871.32	0.15
9	合计	34,905,202.54	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	-	-
C	制造业	26,719,715.05	77.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,868,867.12	8.34
E	建筑业	241,958.00	0.70
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	1,950,024.40	5.67
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	324,060.00	0.94
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	484,208.00	1.41
	合计	32,588,832.57	94.71

### 7.2.2 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	22,365.00	0.06
C	制造业	54,162.62	0.16
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	15,840.72	0.05
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	92,368.34	0.27

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601012	隆基股份	100,120	2,313,773.20	6.72
2	002594	比亚迪	35,800	1,815,776.00	5.28
3	600406	国电南瑞	72,910	1,359,042.40	3.95
4	002202	金风科技	108,954	1,354,298.22	3.94
5	600438	通威股份	76,600	1,076,996.00	3.13
6	600089	特变电工	146,488	1,062,038.00	3.09
7	601985	中国核电	184,200	1,024,152.00	2.98
8	300124	汇川技术	39,400	902,654.00	2.62
9	601877	正泰电器	34,000	785,060.00	2.28
10	601727	上海电气	139,048	748,078.24	2.17

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.cn> 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所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300782	卓胜微	223	24,289.16	0.07
2	600968	海油发展	6,300	22,365.00	0.06
3	603867	新化股份	696	17,963.76	0.05
4	601698	中国卫通	4,041	15,840.72	0.05
5	300594	朗进科技	270	11,909.70	0.03

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.cn> 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	601012	隆基股份	818,069.00	2.65
2	002202	金风科技	807,608.28	2.61
3	002594	比亚迪	539,095.00	1.74
4	600089	特变电工	365,299.97	1.18
5	300450	先导智能	299,679.00	0.97
6	601985	中国核电	290,168.00	0.94
7	002466	天齐锂业	277,984.00	0.90
8	002506	协鑫集成	254,848.00	0.82
9	300124	汇川技术	242,954.00	0.79
10	002340	格林美	242,710.00	0.78
11	002460	赣锋锂业	230,980.00	0.75
12	600406	国电南瑞	216,552.00	0.70
13	600483	福能股份	202,095.00	0.65
14	002074	国轩高科	200,373.00	0.65
15	002129	中环股份	195,934.00	0.63
16	300750	宁德时代	190,726.00	0.62
17	000035	中国天楹	180,499.00	0.58
18	603659	璞泰来	175,432.00	0.57
19	002610	爱康科技	175,177.00	0.57
20	300014	亿纬锂能	172,013.00	0.56

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	002202	金风科技	724,471.00	2.34
2	601012	隆基股份	688,239.00	2.23
3	002594	比亚迪	619,627.00	2.00



4	600089	特变电工	388,870.00	1.26
5	601985	中国核电	328,166.00	1.06
6	600478	科力远	318,262.00	1.03
7	002466	天齐锂业	310,266.00	1.00
8	300118	东方日升	289,755.00	0.94
9	600770	综艺股份	284,588.25	0.92
10	002460	赣锋锂业	274,031.00	0.89
11	300124	汇川技术	273,326.00	0.88
12	600482	中国动力	270,896.00	0.88
13	600151	航天机电	265,282.00	0.86
14	600406	国电南瑞	246,293.00	0.80
15	600416	湘电股份	214,323.00	0.69
16	002129	中环股份	213,023.00	0.69
17	002108	沧州明珠	208,509.74	0.67
18	300450	先导智能	206,841.00	0.67
19	600989	宝丰能源	206,780.10	0.67
20	002610	爱康科技	199,544.00	0.65

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	12,238,698.27
卖出股票收入(成交)总额	13,374,221.02

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所有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:无。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。

## 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证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 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	7,358.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	431.10
5	应收申购款	43,081.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,871.32

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

## 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

注:无。

### 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(%)
新能源	5,480	5,421.28	14,263.00	0.05	29,694,326.29	99.95
新能A	73	15,764.08	414,347.00	36.01	736,431.00	63.99
新能B	708	1,625.39	36,952.00	3.21	1,113,826.00	96.79
合计	6,261	5,112.63	465,562.00	1.45	31,544,583.29	98.55

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

新能源

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	王惠梅	65,914.00	11.48
2	吴少斌	57,446.00	10.00
3	曾晓珠	39,605.00	6.90
4	李波	37,114.00	6.46
5	王立华	36,222.00	6.31
6	段明强	35,706.00	6.22
7	赵茜	33,996.00	5.92
8	王学军	26,159.00	4.55
9	王耀武	20,133.00	3.51
10	陈斐	19,792.00	3.45

新能A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	丁碧霞	614,238.00	53.38
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司一分红-个人分红	366,502.00	31.85
3	蔡小婉	46,200.00	4.01
4	厦门德莱科仪实业有限公司	36,452.00	3.17
5	黄晖	22,100.00	1.92
6	王嘉定	17,794.00	1.55
7	北京天演资本管理有限公司一天演教源投资基金	11,393.00	0.99
8	李波	10,874.00	0.94
9	王学军	7,298.00	0.63
10	黄伟青	3,000.00	0.26

## 新能 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	陈美龄	121,955.00	10.60
2	程瑾	39,045.00	3.39
3	张波	38,792.00	3.37
4	厦门德莱科仪实业有限公司	36,458.00	3.17
5	张四新	35,000.00	3.04
6	陈扬	29,890.00	2.60
7	覃湘云	29,034.00	2.52
8	秦来燕	25,812.00	2.24
9	李艳	25,304.00	2.20
10	谢送弟	23,964.00	2.08

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	新能源	6,062.59	0.0204
	新能 A	-	-
	新能 B	-	-
	合计	6,062.59	0.0189

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情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新能源	新能 A	新能 B
基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	84,321,661.83	63,569,903.00	63,569,903.00
本报告期期初基金份额总额	30,280,553.57	1,259,189.00	1,259,189.00
本报告期基金总申购份额	17,598,439.23	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	18,387,225.51	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	216,822.00	-108,411.00	-108,411.00
本报告期期末基金份额总额	29,708,589.29	1,150,778.00	1,150,778.00

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。

### § 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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

报告期内，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

无

#### 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
中泰证券	2	11,880,161.85	47.86%	10,826.31	48.40%	-
招商证券	1	7,352,061.12	29.62%	6,699.96	29.95%	-
天风证券	1	2,197,445.19	8.85%	2,002.60	8.95%	-
国盛证券	2	1,963,607.09	7.91%	1,593.04	7.12%	本报告期新增
广发证券	1	446,201.00	1.80%	406.60	1.82%	-
爱建证券	1	300,212.00	1.21%	243.60	1.09%	-
东方财富证券	1	221,392.68	0.89%	179.68	0.80%	-
国金证券	1	213,000.00	0.86%	194.11	0.87%	-
东北证券	1	206,780.10	0.83%	188.44	0.84%	-
安信证券	2	39,428.96	0.16%	35.93	0.16%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

川财证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	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要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(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：无。

## § 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

注：无。

## 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

2019 年 8 月 23 日