

鹏华环保产业股票型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	鹏华环保产业股票
场内简称	—
基金主代码	000409
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	2014 年 03 月 07 日
报告期末基金份额总额	153,421,888.06 份
投资目标	在有效控制风险前提下，精选优质的环保产业上市公司，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定量及定性相结合的手段，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、股票投资策略 本基金通过定性

	与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的环保产业股票构建投资组合。 3、债券投资策略 本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等，采取积极主动的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。 4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 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	-617,255.13
2. 本期利润	-24,827,006.22
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1596
4. 期末基金资产净值	228,686,128.31
5. 期末基金份额净值	1.491

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

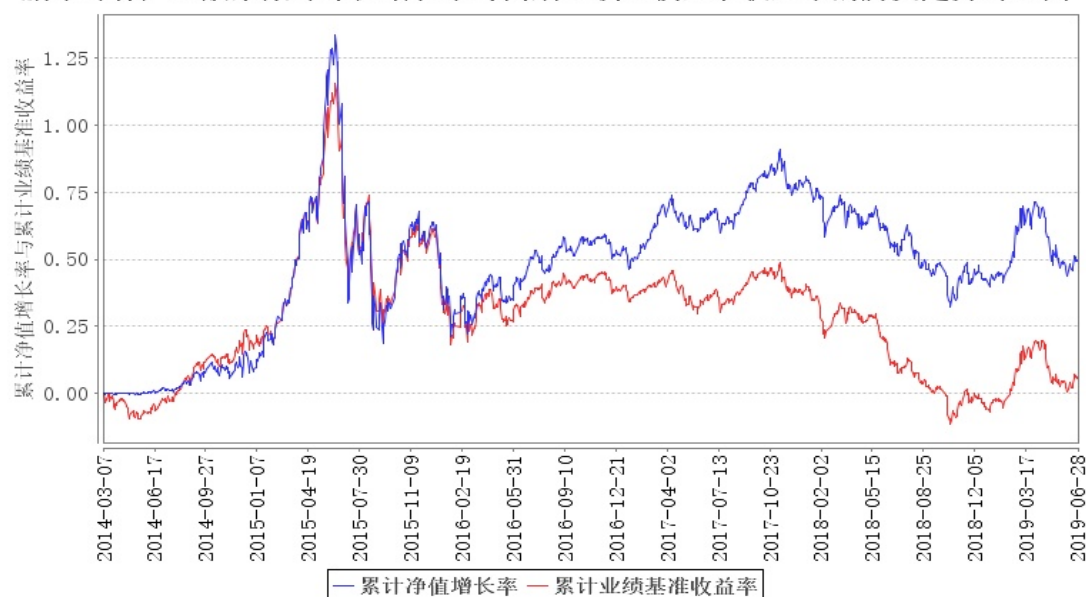
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-9.80%	1.43%	-8.70%	1.50%	-1.10%	-0.07%

注：业绩比较基准=中证环保产业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

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

鹏华环保产业股票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 2014 年 03 月 07 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		
郑川江	本基金基金 经理	2015-06-05	-	10 年	郑川江先生，国籍中国，经济学硕士，10 年证券基金从业经验。历任鹏华基金管理有限公司研究员，长城证券研究所研究员、所长助理；2015 年 2 月加盟鹏华基金管理有限公司，任职于研究部，从事行业研究工作。2015 年 06 月担

					任鹏华环保产业股票基金基金经理，2016 年 01 月至 2017 年 03 月担任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016 年 06 月至 2019 年 04 月担任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理，2017 年 04 月至 2017 年 09 月担任鹏华新能源产业混合基金基金经理，2017 年 07 月至 2019 年 04 月担任鹏华优质治理混合（LOF）基金基金经理，2019 年 04 月担任鹏华优选回报混合基金基金经理。郑川江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

二季度宏观经济环境相对平稳，去年底开始的地产和基建等刺激政策开始逐渐减弱，宽松货

币政策在季度初期有所恢复，后期随着包商银行事件出来后货币政策再次放松。五月份中美贸易战冲突爆发后，市场的风险偏好迅速下降，对于政治、经济和科技的担忧显著提升。在这样的环境下，我们组合保持一定的均衡，加大了环保、新能源和新能源汽车龙头和优秀个股的配置，同时重点关注了项目储备丰富，市场关注度不高的民营上市公司。由于资金面比较充裕，经营业绩稳定、估值低、分红率高的企业的长期价值我们也比较看好。

往后看，市场行情还是会围绕公司经营业绩展开。从 6 月份一些龙头公司的经营数据看，总体情况还是比较超预期的，龙头公司的优势更加明显。基金整体将维持二季度的持仓结构不变，个股上做一些微调。

4.5 报告期内基金的业绩表现

鹏华环保产业股票组合净值增长率-9.80%，业绩比较基准增长率-8.70%，同期上证综指涨跌幅为-3.6198%，深证成指涨跌幅为-7.3540%，沪深 300 指数涨跌幅为-1.2074%。

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	188,980,839.76	82.15
	其中：股票	188,980,839.76	82.15
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	40,799,169.51	17.74
8	其他资产	253,278.56	0.11
9	合计	230,033,287.83	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	5,696,371.60	2.49
C	制造业	79,933,241.42	34.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,740,281.69	21.31
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	6,859,896.51	3.00
J	金融业	36,066,952.20	15.77
K	房地产业	7,762,824.00	3.39
L	租赁和商务服务业	33,165.74	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,865,000.00	1.69
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	188,980,839.76	82.64

5.2.2 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

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	601318	中国平安	193,120	17,112,363.20	7.48
2	002250	联化科技	1,279,858	14,193,625.22	6.21
3	600027	华电国际	3,460,007	13,044,226.39	5.70
4	600900	长江电力	693,387	12,411,627.30	5.43
5	601398	工商银行	1,936,500	11,405,985.00	4.99
6	600438	通威股份	636,700	8,952,002.00	3.91
7	300750	宁德时代	128,016	8,817,742.08	3.86
8	600674	川投能源	983,400	8,752,260.00	3.83
9	603301	振德医疗	406,000	8,444,800.00	3.69
10	600236	桂冠电力	1,313,900	7,962,234.00	3.48

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

联化科技 联化科技本次公告原因为 2018 年 9 月公司子公司联化科技（盐城）有限公司（以下简称“盐城联化”）收到江苏省环境保护厅出具的《行政处罚决定书》（苏环罚[2018]11 号）。具体情况说明如下：

2018 年 5 月 21 日，江苏省环境保护厅执法人员检查发现盐城联化有以下环境违法行为：1、年产 300 吨 E9260、350 吨 J290、2000 吨 DFEE 和 1000 吨联苯醇生产项目（年产 350 吨 J290、1000 吨联苯醇未建设）为编制环境影响报告书的建设项目，该项目需要配套建设的环境保护设

施已建成，但至今未经验收。该行为违反了《建设项目环境保护管理条例》第十九条第一款规定。

2、年产 500 吨 JG303 生产线技术改造项目为编制环境影响报告书的建设项目，该项目需要配套建设的环境保护设施已建成，但至今未经验收。该行为违反了《建设项目环境保护管理条例》第十九条第一款规定。

依据《建设项目环境保护管理条例》第二十三条第一款及环保部门自由裁量基准，江苏省环境保护厅对盐城联化作出如下决定：1、对需要配套建设的环境保护设施未经验收，年产 300 吨 E9260、350 吨 J290、2000 吨 DFEE 和 1000 吨联苯醇生产项目（年产 350 吨 J290、1000 吨联苯醇未建设）即投入生产的行为，责令在收到本处罚决定书之日起 3 个月内改正，罚款陆拾万元。2、对需要配套建设的环境保护设施未经验收，年产 500 吨 JG303 生产线技术改造项目即投入生产的行为，责令在收到本处罚决定书之日起 3 个月内改正，罚款陆拾万元。

另外，联化科技子公司联化科技（盐城）有限公司（以下简称“盐城联化”）于 2018 年 9 月收到收到响水县环境保护局出具的《行政处罚决定书》（响环罚字[2018]76 号）。具体说明如下：

2018 年 5 月 21 日，响水县环境保护局执法人员调查发现盐城联化 E9260、DFEE 和 JG303 项目需要配套建设的环保设施未经验收即投入生产，上述行为已构成“需要配套建设的环境保护设施未经验收，建设项目即投入生产”，违反了《建设项目环境保护管理条例》第十九条第一款之规定。

依据《建设项目环境保护管理条例》第二十三条第一款之规定，响水县环境保护局决定对盐城联化作出如下处罚：对 E9260、DFEE 和 JG303 项目负责人黄桂林，处罚款（人民币）十万元。

针对上述情况，盐城联化已经按照有关规程提交已建成的环境保护设施验收申请；公司及盐城联化诚恳接受环境保护部门的行政处罚，认真吸取教训，增加环保意识，严格履行相关程序。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述环境违法行为主要涉及非核心环节，且公司已经按照有关规程提交已建成的环境保护设施验收申请，本次行政处罚未影响盐城联化的正常生产经营，也未对公司经营业绩产生重大不利影响，对公司并未产生实质性影响。上述行政处罚对该公司股票的投资价值不产生重大影响。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。振德医疗 振德医疗用品股份有限公司（以下简称“公司”）控股子公司苏州美迪斯医疗运动用品有限公司（以下简称“苏州美迪斯”，公司持有其 70%股权）收到苏州市市场监督管理局出具的《行政处罚决定书》，现将有关情况说明如下：

一、《行政处罚决定书》的主要内容

2018 年 9 月 13 日，苏州美迪斯收到苏州市市场监督管理局送达的江苏省医疗器械检验所检验报告（编号：（2018）SJ 类第 0169 号），报告显示苏州美迪斯生产的退热贴（型号规格：50mm×120mm/片，批号：180601）被抽样检测不合格，其中检测项目“包装密封性”的检验结果为“气泡溢出不符合要求”，单项结论为“不符合”，检验报告结论为检验项目不符合苏苏械备 20150924 号《退热贴》规定的要求，判定该样品未通过本次监督检验。

苏州美迪斯生产销售批号 180601 退热贴情况如下：苏州美迪斯于 2018 年 6 月生产上述退热贴（型号规格：50mm×120mm/片，批号：180601）768 片，已全部进行了销售，上述退热贴货值金额合计为 768 元。

苏州市市场监督管理局认为：苏州美迪斯生产不符合经备案的产品技术要求的医疗器械的行为违反了《医疗器械监督管理条例》第二十四条第一款及《医疗器械生产监督管理办法》第四十条之规定，依据《医疗器械监督管理条例》第六十六条第一款第（一）项及《医疗器械生产监督管理办法》第六十六条第（一）项的规定，责令苏州美迪斯改正，并决定给予以下行政处罚：罚款 35,000 元。

二、公司核查及整改情况

苏州美迪斯在收到有关检验不合格报告后高度重视，立即组织生产、品质、销售等相关部门对退热贴的原材料、生产、存储和流通环节进行核查，发现本次退热贴“包装密封性”的检验结果为“气泡溢出不符合要求”主要原因系偶发性包装材料异常。苏州美迪斯立即联系供应商采取整改措施，同时将库存退热贴包装材料全部报废处理，并对包装密封性测试方法重新定义并对检测人员进行培训，加强内部产品和包装材料的检测，避免类似事件再次发生。

三、对公司及苏州美迪斯的影响

1、苏州美迪斯生产销售的退热贴 2018 年度销售收入为 6,528 元，占本公司 2018 年度经审计营业收入（14.29 亿元）比例非常低。苏州美迪斯本次检验不符合标准规定的退热贴（型号规格：50mm×120mm/片，批号：180601）货值 768 元，占本公司 2018 年度经审计营业收入比例也非常低。苏州市市场监督管理局对苏州美迪斯的处罚款 35,000 元，占本公司 2018 年度经审计归属于母公司股东的净利润的 0.03%，不会对公司生产经营造成重大影响。目前公司及苏州美迪斯生产经营情况正常。

2、经公司第一届董事会第二十三次会议审议通过，公司以现金方式收购钟明南、徐天骥、苏州工业园区辉凯咨询管理合伙企业（有限合伙）、盛梅珍、卞培培、王松樵、孙刚、何文钊（以下合称“原股东”）合计持有的苏州美迪斯医疗运动用品有限公司 70%股权，公司于 2018 年 12 月 29 日与苏州美迪斯、苏州美迪斯原股东以及业绩补偿方（钟明南、徐天骥、钟明芸）签署了《关于苏州美迪斯医疗运动用品有限公司之股权转让协议》，苏州美迪斯于 2019 年 1 月 28 日（本次交易交接日）完成了上述股权收购工商变更登记手续。根据《关于苏州美迪斯医疗运动用品有限公司之股权转让协议》约定，“因本次股权转让交接日之前原因或行为致使苏州美迪斯受到损伤、赔偿责任或处罚，原股东承担赔偿责任。”因此，本次苏州美迪斯收到行政处罚决定书事项不会对公司生产经营及业绩产生重大影响。

振德医疗用品股份有限公司（以下简称“公司”）收到绍兴市越城区市场监督管理局出具的《行政处罚决定书》（绍越市监罚字[2019]136 号），现将有关情况说明如下：

一、《行政处罚决定书》的主要内容

根据绍兴市市场监督管理局转绍兴市越城区市场监督管理局的转办函（绍市监稽支函【2019】22 号），广东省药品监督管理局在器械抽验中发现标示振德医疗用品股份有限公司生产的医用纱布块（规格型号：灭菌型 不带 X 光线，8cm*10cm-8P；批号：20180305）所检项目不符合粤食药监办稽【2018】77 号监督抽检（验）方案的要求，综合判定为不合格（表面活性物质不符合标准要求）。

公司生产销售批号为 20180305 医用纱布块情况如下：该批次医用纱布块由振德医疗用品股份有限公司委托全资子公司许昌振德医用敷料有限公司生产，批号为 20180305，规格型号：灭菌型 不带 X 光线、8cm*10cm-8P，共计生产 30,000 件，并已全部进行销售。

绍兴市越城区市场监督管理局认为：公司生产不符合强制性标准的医用纱布块的行为，违反了《医疗器械监督管理条例》第六条第一款的规定。根据《医疗器械监督管理条例》第六十六条的规定，绍兴市越城区市场监督管理局决定对公司责令改正，并处罚款 2 万元整。

二、公司核查及整改情况

公司在收到有关产品检验不合格报告后高度重视，立即组织生产、品质、销售等相关部门对该批次医用纱布块的原材料、生产、存储和流通各环节进行核查，发现本次医用纱布块检验结果为“表面活性物质不符合标准要求”主要原因系在生产过程中误将检验不合格的医用纱布块混入。

基于此原因，公司立即开展了内部流程自查和梳理，并对相关员工进行培训，加强不合格品的标识隔离处置的管理，避免类似事件再次发生，通过更加严格的控制产品质量，提供更安全有效的产品。

三、对公司的影响

本次抽检不符合标准规定的 20180305 批次医用纱布块货值 9604.80 元，占公司 2018 年度经审计营业收入 0.00067%，占比较小；公司生产销售的“规格型号：灭菌型 不带 X 光线，8cm*10cm-8P”的医用纱布块 2018 年度销售收入为 819.87 万元，占公司 2018 年度经审计营业收入 0.57%，占比较小。绍兴市越城区市场监督管理局对公司的处罚款 2 万元，占公司 2018 年度经审计归属于母公司股东的净利润 0.015%，不会对公司生产经营造成重大影响。目前公司生产经营情况正常，医用纱布块其他批次产品生产、销售情况正常。

振德医疗用品股份有限公司（以下简称“公司”）收到绍兴市市场监督管理局出具的《行政处罚决定书》（绍市监稽案字[2019]1 号），现将有关情况说明如下：

一、《行政处罚决定书》的主要内容

根据浙江省食品药品监督管理局转绍兴市市场监督管理局的“关于对抽检不合格医疗器械核查的函”（浙食药稽械核[2018]18 号），显示抽取标示生产单位为振德医疗用品股份有限公司，批号为 20180118，规格为 17cm×18cm-3P，型号为 I 型的医用外科口罩，经国家食品药品监督管理局广州医疗器械质量监督检验中心检验，不符合标准规定（口罩带断裂强度不符合）。

公司生产销售批号为 20180118 医用外科口罩情况如下：公司于 2018 年 01 月 18 日至 2018 年 01 月 19 日生产完成了批号为 20180118，规格为 17cm×18cm-3P，型号为 I 型的医用外科口罩 30000 只，并于 2018 年 03 月 06 日将该批号医用外科口罩进行了销售。

绍兴市市场监督管理局认为：公司生产销售不符合强制性国家标准的医用外科口罩的行为，违反了《医疗器械监督管理条例》第六条第一款的规定。鉴于公司在案发前主动召回涉案产品，主动减轻违法行为危害后果，分析不合格原因和整改。依照《医疗器械监督管理条例》第六十六条第一款第（一）项、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条第一款第（一）项等规定，绍兴市市场监督管理局决定对公司责令改正，并处罚款 3 万元整。

二、公司核查及整改情况

事件发生后，公司高度重视，立即组织生产、品质、销售等相关部门对该批次医用外科口罩的生产、储存和流通各环节进行核查，为避免该批次产品造成不良影响，公司已对该批次产品及时、主动启动了召回程序，并开展留样自检工作，检查结果为合格。同时，对抽检样品的内部质量控制与监测数据多次分析与验证，口罩带连接断裂强度出现异常的主要原因是偶发性设备异常。基于此原因，公司已对医用外科口罩生产的控制系统进行升级，提高生产设备的稳定性和异常停机的自动化控制，加强内部数据监测，避免类似事件再次发生。

针对出现的产品不良现象和异常现象，公司严格按国家相关法规要求进行处理，并及时向主管部门和客户端进行报告和说明，通过更加严格的控制产品质量，提供更安全有效的产品。

三、对公司的影响

公司生产销售的“规格为 17cm×18cm-3P，型号为 I 型的医用外科口罩”的口罩带分为长带式 and 橡筋式，其中橡筋式口罩带产品 2017 年度销售收入为 201.55 万元，占公司 2017 年度经审计营业收入 0.15%，占比较小。本次抽检不符合标准规定的 20180118 批次医用外科口罩（口罩带为橡筋式）货值 9,031.23 元，占公司 2017 年度经审计营业收入 0.00069%；绍兴市市场监督管理局对公司的处罚款 3 万元，占公司 2017 年度经审计归属于母公司股东的净利润 0.025%，不会对公司生产经营造成重大影响。目前公司生产经营情况正常，医用外科口罩其他批次产品生产、销售情况正常。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司股票的投资价值不产生重大影响。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	178,865.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,480.33
5	应收申购款	65,932.77
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	253,278.56

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 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

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

报告期期初基金份额总额	161,755,471.23
报告期期间基金总申购份额	4,924,834.21
减：报告期期间基金总赎回份额	13,258,417.38
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	153,421,888.06

§ 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）《鹏华环保产业股票型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华环保产业股票型证券投资基金托管协议》；

(三)《鹏华环保产业股票型证券投资基金 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