

鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资 基金 2015 年半年度报告

2015 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	32
7.3 期末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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
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	36
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	36
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	36
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	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	36
7.12 投资组合报告附注	36

§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末上市基金前十名持有人	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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的情况	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录	54
11.2 存放地点	54
11.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金		
基金简称	鹏华证券保险分级		
场内简称	证保分级		
基金主代码	160625		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 5 月 5 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		
报告期末基金份额总额	13,703,608,611.19 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	2014-05-19		
下属分级基金的基金简称	鹏华证保	证保 A	证保 B
下属分级基金场内简称:	证保分级	证保 A	证保 B
下属分级基金的交易代码	160625	150177	150178
报告期末下属分级基金份额总额	3,005,684,777.19 份	5,348,961,917.00 份	5,348,961,917.00 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。 本基金力争鹏华证保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 800 证券保险指数收益率×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。	鹏华证保 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。	鹏华证保 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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层	北京市西城区金融街 25 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
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 43 层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行股份有

	限公司
--	-----

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,006,122,426.82
本期利润	-669,946,057.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0686
本期加权平均净值利润率	-5.98%
本期基金份额净值增长率	-4.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,525,905,658.93
期末可供分配基金份额利润	0.1114
期末基金资产净值	12,788,694,789.03
期末基金份额净值	0.933
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	119.71%

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）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。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

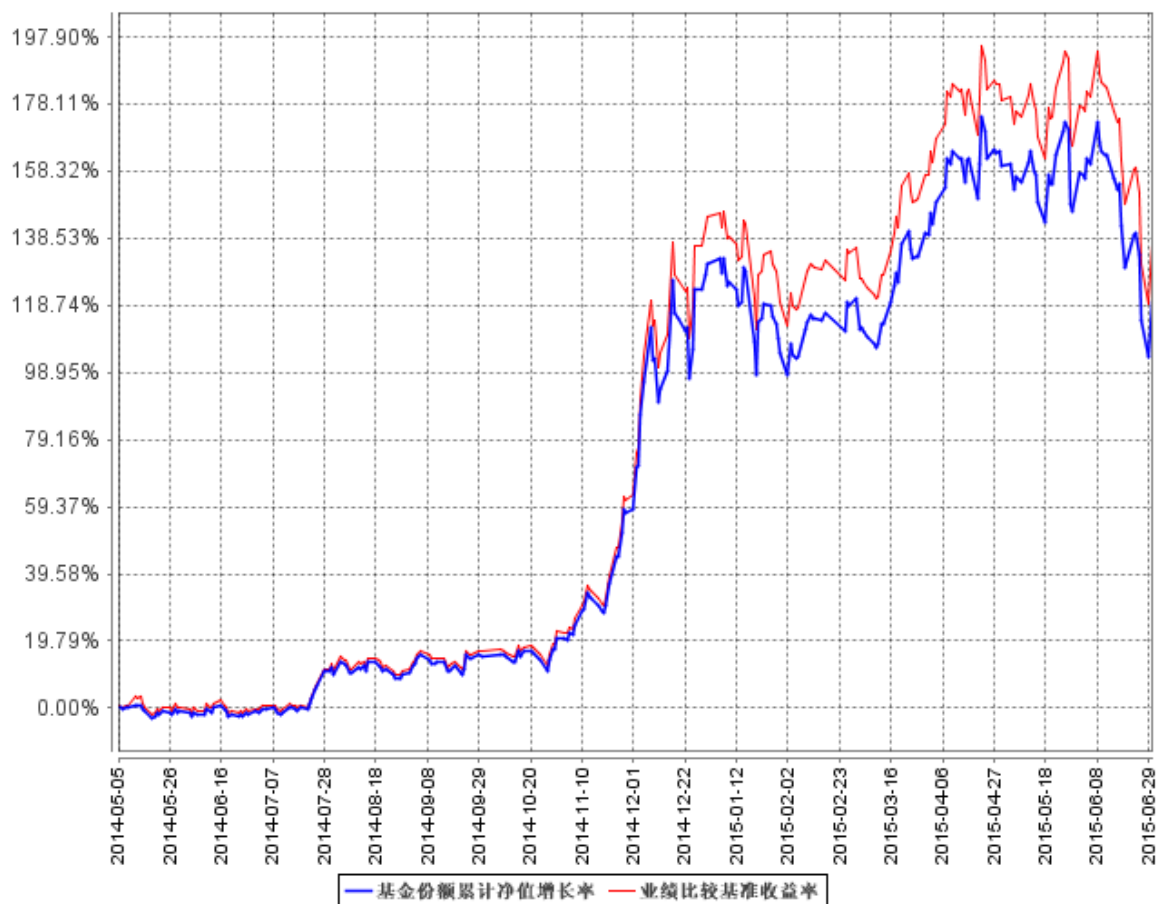
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-10.89%	3.78%	-10.82%	3.75%	-0.07%	0.03%
过去三个月	-8.26%	3.08%	-7.80%	3.06%	-0.46%	0.02%
过去六个月	-4.98%	2.87%	-3.26%	2.84%	-1.72%	0.03%
过去一年	122.15%	2.72%	137.24%	2.69%	-15.09%	0.03%
自基金合同生效起至今	119.71%	2.55%	136.93%	2.53%	-17.22%	0.02%

注：业绩比较基准=中证 800 证券保险指数收益率×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

基金份额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 5 月 5 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。

§ 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。截止本报告期末，公司管理资产总规模达到 3575.13 亿元，管理 81 只开放式基金、10 只全国社保投资组合。经过近 17 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		
余斌	本基金基金经理	2014 年 5 月 5 日	-	8	余斌先生，国籍中国，经济学硕士，8 年证券从业经验。曾任职于招商证券股份有限公司，担任风险控制部市场风险分析师；2009 年 10 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任机构理财部大客户经理、量化投资部量化研究员，先后从事特定客户资产管理业务产品设计、量化研究等工作；2014 年 5 月起至今担任鹏华中证信息技术指数分级证券投资基金基金经理，2014 年 5 月起至今兼任鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金经理，2014 年 11 月起至今兼任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 4 月起兼任鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 5 月起兼任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 6 月起兼任鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理。余斌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 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

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，面对股票长期停牌以及较为频繁的申购赎回，基金经理都提出了合理的解决方案。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，基金份额净值为 0.933，累计净值 2.004。本报告期基金份额净值增长率为-4.98%。

报告期内，本基金日均跟踪偏离度的绝对值为 0.07%，年化跟踪误差为 1.97%，均符合基金合同的相关要求。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，证券保险板块未取得正收益，大幅跑输市场其他中小市值的板块。市场发生了较大的风格切换。但从基本面的角度看，证券保险增长势头仍然明显。截至 2015 年 5 月份，上市券商前 5 个月的净利润已达到 2014 年全年利润的 1.24 倍。在利率下行周期内，证券公司的经纪、自营、资管、两融等业务全面向好，动态业绩有望持续高增。自 6 月份以来，受市场系统性风险

集中释放的影响，中证 800 证券保险指数发生了大幅回调。由于证券保险板块仍然具备较高的增长速度，资本市场的繁荣和政策支持为证券保险板块打开了增长空间，证券保险板块的投资价值仍然存在。

6 月份是 A 股市场系统性风险集中爆发的阶段。市场情绪的企稳和市场信心的恢复必然是一个渐进的过程。在市场恐惧的阶段，投资者更需要保持理性思考，对有基本面业绩支撑和长期发展空间的证券保险板块保持关注，在板块反弹趋势确立后做好资产配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 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

4.6.1.1 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。

4.6.1.2 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范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。

4.6.2 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。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

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

无。

§ 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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 800 证券保险指数分级证券投资基金
报告截止日： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	687,070,469.77	624,554,616.66

结算备付金		1,057,262.79	7,519,239.76
存出保证金		4,660,355.71	269,614.90
交易性金融资产	6.4.7.2	12,197,702,443.94	5,489,286,466.93
其中：股票投资		12,197,702,443.94	5,489,286,466.93
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	39,493,435.01
应收利息	6.4.7.5	147,795.42	99,860.25
应收股利		-	-
应收申购款		176,216,267.84	182,054,229.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,066,854,595.47	6,343,277,462.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		147,962,122.49	-
应付赎回款		102,864,552.94	539,440,441.17
应付管理人报酬		11,404,500.65	3,530,510.18
应付托管费		2,508,990.17	776,712.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,516,173.60	4,484,087.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,903,466.59	2,363,130.09
负债合计		278,159,806.44	550,594,881.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,819,800,032.02	2,505,862,047.15
未分配利润	6.4.7.10	6,968,894,757.01	3,286,820,534.12
所有者权益合计		12,788,694,789.03	5,792,682,581.27
负债和所有者权益总计		13,066,854,595.47	6,343,277,462.55

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，鹏华证保分级份额净值 0.933 元，鹏华证保 A 份额净值 1.015 元，鹏华证保 B 份额净值 0.851 元；基金份额总额 13,703,608,611.19 份，其中鹏华证保分级份额 3,005,684,777.19 份，鹏华证保 A 份额 5,348,961,917.00 份，鹏华证保 B 份额

5,348,961,917.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 5 月 5 日(基金 合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		-576,317,392.30	-2,013,244.87
1.利息收入		2,663,810.09	193,165.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,663,810.09	65,646.24
债券利息收入		-	56.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	127,462.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,079,957,222.54	-722,809.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,041,480,755.88	-1,579,221.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	16,603.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	38,476,466.66	839,808.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,676,068,484.81	-1,818,190.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	17,130,059.88	334,589.22
减：二、费用		93,628,665.69	1,047,544.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	54,661,583.92	343,995.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,025,548.51	75,679.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	25,596,975.42	518,848.64
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	1,344,557.84	109,020.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-669,946,057.99	-3,060,789.35
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-669,946,057.99	-3,060,789.35
-------------------	--	-----------------	---------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	2,505,862,047.15	3,286,820,534.12	5,792,682,581.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-669,946,057.99	-669,946,057.99
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）	3,313,937,984.87	4,352,020,280.88	7,665,958,265.75
其中：1.基金申购款	8,943,745,094.41	12,425,624,116.15	21,369,369,210.56
2.基金赎回款	-5,629,807,109.54	-8,073,603,835.27	-13,703,410,944.81
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）	5,819,800,032.02	6,968,894,757.01	12,788,694,789.03
项目	上年度可比期间 2014 年 5 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 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）	388,527,933.70	-	388,527,933.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,060,789.35	-3,060,789.35
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）	-223,664,031.68	1,267,894.22	-222,396,137.46
其中：1.基金申购款	10,921,008.74	-250,760.50	10,670,248.24

2. 基金赎回款	-234,585,040.42	1,518,654.72	-233,066,385.70
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）	164,863,902.02	-1,792,895.13	163,071,006.89

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	_____ 高鹏	_____ 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 800 非银行金融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[2014]第 149 号《关于核准鹏华中证 800 非银行金融指数分级证券投资基金募集的批复》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 800 非银行金融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 388,452,557.12 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(2014)第 204 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证 800 非银行金融指数分级证券投资基金基金合同》于 2014 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 388,527,933.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 75,376.58 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华中证 800 非银行金融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 800 非银行金融指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“基础份额”）、鹏华中证 800 非银行金融指数分级证券投资基金之 A 份额（以下简称“A 份额”）、鹏华中证 800 非银行金融指数分级证券投资基金之 B 份额（以下简称“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。基础份额为可以申购、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。A 份额与 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额，其中 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，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。A 份额与 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。本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基础份额;场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为 A 份额与 B 份额。本基金基金合同生效后,基础份额与 A 份额、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基础份额按照 2 份基础份额对应 1 份 A 份额与 1 份 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 A 份额与 B 份额按照 1 份 A 份额与 1 份 B 份额对应 2 份基础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:基础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基础份额、A 份额、B 份额的份额数之和。A 份额的基金份额净值为 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份基础份额所对应的基金资产净值等于 1 份 A 份额与 1 份 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 A 份额、基础份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)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,A 份额与 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于 A 份额的约定应得收益,即 A 份额每个会计年度 12 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分,将折算为场内基础份额分配给 A 份额持有人。基础份额持有人持有的每 2 份基础份额将按 1 份 A 份额获得新增基础份额的分配。持有场外基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外基础份额的分配;持有场内基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内基础份额的分配。经过上述份额折算,A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元,基础份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外,本基金还将在基础份额的基金份额净值达到 1.500 元时或 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,本基金将分别对基础份额、A 份额、B 份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保 A 份额与 B 份额的比例为 1:1,份额折算后基础份额的基金份额净值、A 份额与 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[2014]第 170 号文审核同意,本基金 A 份额 110,201,626.00 份基金份额和 B 份额 110,201,626.00 份基金份额于 2014 年 5 月 19 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的基础份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其

分拆为证保 A 份额和证保 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的基础份额，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证保 A 份额和证保 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 800 非银行金融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、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且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续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%。本基金的业绩比较基准为：中证 800 非银行金融指数收益率 $\times 95\%$ + 商业银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

根据本基金的基金管理人于 2014 年 12 月 2 日发布的《关于鹏华中证 800 非银行金融指数分级证券投资基金标的指数名称变更的公告》，本基金更名为鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金，并相应的将跟踪标的指数名称由“中证 800 非银行金融指数”调整为“中证 800 证券保险指数”。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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

本基金本报告期的会计估计发生变更。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下

简称“估值处理标准”),对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除以上会计估计的变更,本报告期所采用的其他会计政策、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

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本报告期税项未发生变化。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	687,070,469.77
定期存款	—
其中:存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计:	687,070,469.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	12,565,662,776.24	12,197,702,443.94	-367,960,332.30
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	12,565,662,776.24	12,197,702,443.94	-367,960,332.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截止本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	145,222.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	475.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2,097.20
合计	147,795.42

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：截止本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	11,516,173.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,516,173.60

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	387,127.90
预提费用	423,107.06
指数使用费	1,093,231.63
合计	1,903,466.59

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,973,742,530.77	2,505,862,047.15
本期申购	75,442,038.12	47,582,618.82
本期赎回(以“-”号填列)	-123,682,793.52	-78,008,915.11
2015 年 1 月 5 日 基金拆分/份额折算前	3,925,501,775.37	2,475,435,750.86
基金拆分/份额折算变动份额	7,499,067.19	-
本期申购	21,209,395,216.60	8,896,162,475.59
本期赎回(以“-”号填列)	-11,438,787,447.97	-5,551,798,194.43
本期末	13,703,608,611.19	5,819,800,032.02

注：1、根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2015 年 1 月 5 日为基准日办理定期份额折算业务。

2、根据本基金的基金合同关于不定期份额折算的相关规定，当鹏华证保基础份额的基金份额净值达到 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。截至 2015 年 3 月 23 日，本基金鹏华证保基础份额的基金份额净值为 1.513 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2015 年 3 月 24 日为基准日办理不定期份额折算业务。2015 年 3 月 26 日，本基金管理人对外披露了折算结果，本基金的申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括场外转托管和跨系统转托管）和配对转换业务及鹏华证保 A、鹏华证保 B 份额的二级市场交易已于当日恢复。

3、本期申购基金份额中包括上述不定期折算中鹏华证保分级份额的份额净增加数。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	154,837,394.39	3,131,983,139.73	3,286,820,534.12

本期利润	1,006,122,426.82	-1,676,068,484.81	-669,946,057.99
本期基金份额交易产生的变动数	364,945,837.72	3,987,074,443.16	4,352,020,280.88
其中：基金申购款	1,164,509,825.20	11,261,114,290.95	12,425,624,116.15
基金赎回款	-799,563,987.48	-7,274,039,847.79	-8,073,603,835.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,525,905,658.93	5,442,989,098.08	6,968,894,757.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,331,403.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	181,915.88
其他	150,491.11
合计	2,663,810.09

注：其他为结算保证金利息收入以及申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,246,473,648.21
减：卖出股票成本总额	5,204,992,892.33
买卖股票差价收入	1,041,480,755.88

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期没有发生债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期没有发生衍生工具收益的买卖权证差价收入。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	38,476,466.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	38,476,466.66

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,676,068,484.81
——股票投资	-1,676,068,484.81
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,676,068,484.81

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15,002,040.23
其他	61.32
转换费收入	2,127,958.33
合计	17,130,059.88

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	25,596,975.42
银行间市场交易费用	-
合计	25,596,975.42

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
指数使用费	1,093,231.63
银行汇划费用	23,219.15
合计	1,344,557.84

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 5 月 5 日(基金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	54,661,583.92	343,995.80
其中:支付销售机构的客户维护费	9,166,398.86	15,148.44

注:(1)支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 1.00%,逐日计提,按月支付。
日管理费=前一日基金资产净值 $\times$ 1.00% $\div$ 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 5 月 5 日(基金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,025,548.51	75,679.07

注:支付基金托管人中国建设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 $\times$ 0.22% $\div$ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间,本基金管理人未投资、持有本基金。

6.4.10.4.2 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

份额单位:份

证保 B				
关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
国信证券股份有	2,213,367.00	0.0414%	-	-

限公司				
-----	--	--	--	--

6.4.10.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 5 月 5 日(基金合同生效日)至 2014 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
中国建设银行	687,070,469.77	2,331,403.10	9,099,747.00	55,489.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600643	爱建股份	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	16.73	-	-	6,736,206	93,486,191.61	112,696,726.38	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，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。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控

制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2014 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	687,070,469.77	-	-	-	687,070,469.77
结算备付金	1,057,262.79	-	-	-	1,057,262.79
存出保证金	4,660,355.71	-	-	-	4,660,355.71
交易性金融资产	-	-	-	12,197,702,443.94	12,197,702,443.94
应收利息	-	-	-	147,795.42	147,795.42
应收申购款	-	-	-	176,216,267.84	176,216,267.84
资产总计	692,788,088.27	-	-	12,374,066,507.20	13,066,854,595.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	147,962,122.49	147,962,122.49
应付赎回款	-	-	-	102,864,552.94	102,864,552.94
应付管理人报酬	-	-	-	11,404,500.65	11,404,500.65
应付托管费	-	-	-	2,508,990.17	2,508,990.17
应付交易费用	-	-	-	11,516,173.60	11,516,173.60
其他负债	-	-	-	1,903,466.59	1,903,466.59
负债总计	-	-	-	278,159,806.44	278,159,806.44
利率敏感度缺口	692,788,088.27	-	-	12,095,906,700.76	12,788,694,789.03
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	624,554,616.66	-	-	-	624,554,616.66
结算备付金	7,519,239.76	-	-	-	7,519,239.76
存出保证金	269,614.90	-	-	-	269,614.90
交易性金融资产	-	-	-	5,489,286,466.93	5,489,286,466.93
应收证券清算款	-	-	-	39,493,435.01	39,493,435.01
应收利息	-	-	-	99,860.25	99,860.25
应收申购款	-	-	-	182,054,229.04	182,054,229.04
资产总计	632,343,471.32	-	-	5,710,933,991.23	6,343,277,462.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	539,440,441.17	539,440,441.17
应付管理人报酬	-	-	-	3,530,510.18	3,530,510.18
应付托管费	-	-	-	776,712.25	776,712.25

应付交易费用	-	-	-	4,484,087.59	4,484,087.59
其他负债	-	-	-	2,363,130.09	2,363,130.09
负债总计	-	-	-	550,594,881.28	550,594,881.28
利率敏感度缺口	632,343,471.32	-	-	5,160,339,109.95	5,792,682,581.27

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2014 年 12 月 31 日：未持有）因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	12,197,702,443.94	95.38	5,489,286,466.93	94.76
交易性金融资产—基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	12,197,702,443.94	95.38	5,489,286,466.93	94.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	703,438,005.41	288,757,406.55
	业绩比较基准下降 5%	-703,438,005.41	-288,757,406.55

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	12,197,702,443.94	93.35
	其中：股票	12,197,702,443.94	93.35
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—

6	银行存款和结算备付金合计	688,127,732.56	5.27
7	其他各项资产	181,024,418.97	1.39
8	合计	13,066,854,595.47	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
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	-	-
J	金融业	12,197,702,443.94	95.38
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	12,197,702,443.94	95.38

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.3 期末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

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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	24,955,066	2,044,818,108.04	15.99
2	600030	中信证券	53,383,217	1,436,542,369.47	11.23
3	600837	海通证券	54,888,216	1,196,563,108.80	9.36
4	601601	中国太保	21,321,919	643,495,515.42	5.03
5	601688	华泰证券	22,218,151	513,905,832.63	4.02
6	000166	申万宏源	30,226,987	491,188,538.75	3.84
7	000776	广发证券	20,073,003	454,653,517.95	3.56
8	600999	招商证券	15,759,192	416,988,220.32	3.26
9	601377	兴业证券	28,211,853	386,220,267.57	3.02
10	601628	中国人寿	11,298,680	353,874,657.60	2.77
11	600705	中航资本	15,191,879	351,691,998.85	2.75
12	601336	新华保险	5,658,530	345,509,841.80	2.70
13	601901	方正证券	27,916,738	331,930,014.82	2.60
14	000783	长江证券	22,520,707	314,163,862.65	2.46
15	000728	国元证券	7,992,338	303,548,997.24	2.37
16	600109	国金证券	12,309,435	300,350,214.00	2.35
17	601788	光大证券	9,275,454	249,973,485.30	1.95
18	601099	太平洋	16,760,314	216,543,256.88	1.69
19	002673	西部证券	7,585,404	215,197,911.48	1.68
20	002736	国信证券	8,344,493	209,363,329.37	1.64
21	600958	东方证券	7,163,245	205,012,071.90	1.60
22	600369	西南证券	9,573,225	188,113,871.25	1.47
23	601555	东吴证券	9,154,451	187,391,611.97	1.47
24	000750	国海证券	9,402,800	157,967,040.00	1.24
25	000686	东北证券	7,963,638	155,052,031.86	1.21
26	002500	山西证券	8,538,496	154,461,392.64	1.21
27	600643	爱建股份	6,736,206	112,696,726.38	0.88
28	600816	安信信托	2,157,266	107,474,992.12	0.84
29	000712	锦龙股份	3,038,600	106,654,860.00	0.83
30	000563	陕国投 A	3,294,584	46,354,796.88	0.36

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601318	中国平安	2,044,363,488.99	35.29
2	600030	中信证券	1,735,200,139.22	29.96
3	600837	海通证券	1,340,377,986.37	23.14
4	000166	申万宏源	744,539,640.05	12.85
5	601601	中国太保	743,302,094.82	12.83
6	000776	广发证券	543,965,938.11	9.39
7	601688	华泰证券	537,339,521.24	9.28
8	600999	招商证券	491,088,950.82	8.48
9	601628	中国人寿	453,391,026.64	7.83
10	601901	方正证券	397,176,976.71	6.86
11	601377	兴业证券	393,947,118.28	6.80
12	600705	中航资本	361,412,879.50	6.24
13	000783	长江证券	359,358,216.66	6.20
14	600109	国金证券	358,634,843.14	6.19
15	601788	光大证券	327,195,668.48	5.65
16	601336	新华保险	301,496,235.60	5.20
17	600958	东方证券	278,614,839.56	4.81
18	002736	国信证券	266,520,162.42	4.60
19	000728	国元证券	252,168,471.83	4.35
20	601099	太平洋	232,378,570.87	4.01
21	601555	东吴证券	214,963,676.81	3.71
22	600369	西南证券	196,380,563.52	3.39
23	002673	西部证券	180,446,308.98	3.12
24	000686	东北证券	172,774,557.67	2.98
25	000750	国海证券	165,199,977.52	2.85
26	002500	山西证券	140,531,897.59	2.43
27	000712	锦龙股份	131,514,127.97	2.27

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	601318	中国平安	1,049,027,117.90	18.11
2	600030	中信证券	890,408,842.41	15.37
3	600837	海通证券	737,161,794.82	12.73
4	601601	中国太保	384,289,891.14	6.63
5	000776	广发证券	280,242,005.96	4.84
6	600999	招商证券	261,132,621.07	4.51
7	000166	申万宏源	232,130,020.94	4.01
8	601628	中国人寿	218,523,074.07	3.77
9	600109	国金证券	214,062,042.47	3.70
10	601901	方正证券	208,833,437.77	3.61
11	601688	华泰证券	202,010,382.87	3.49
12	000783	长江证券	195,969,586.53	3.38
13	601336	新华保险	157,276,563.73	2.72
14	601377	兴业证券	154,945,516.26	2.67
15	601099	太平洋	125,631,385.11	2.17
16	601555	东吴证券	118,149,703.07	2.04
17	600705	中航资本	96,725,758.78	1.67
18	000686	东北证券	95,040,499.91	1.64
19	000728	国元证券	88,886,474.18	1.53
20	002673	西部证券	74,698,025.90	1.29

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	13,589,477,354.15
卖出股票收入（成交）总额	6,246,473,648.21

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：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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：本基金本报告期末未持有权证。

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：本基金本报告期内未发生股指期货投资。

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

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

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

1、中国平安

根据中国证监会[2014]103 号文，本基金投资的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国

平安保险(集团)股份有限公司(简称“中国平安”)的控股子公司平安证券有限责任公司(简称“平安证券”)于 2014 年 12 月 08 日收到《中国证监会行政处罚决定书》，称平安证券在深圳海联讯科技股份有限公司(简称“海联讯”)首次公开发行股票并在创业板上市项目中作为海联讯的保荐机构和主承销商，因未勤勉尽责，未能发现海联讯在会计期末虚构收回应收账款，同时在相关会计期间虚增营业收入的事实，致使其所出具的保荐书中关于海联讯应收账款项目的财务数据和财务指标的陈述、海联讯最近三年财务会计文件无虚假记载的陈述、海联讯符合发行上市条件的结论意见存在虚假记载，中国证监会决定对平安证券给予警告，没收保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2,867 万元，并处以 440 万元罚款。

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股票，认为中国平安作为国内最大的保险机构之一将长期受益于我国保险行业的发展，平安证券投行业务对中国平安的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该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。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

2、中信证券

组合投资的前十名证券之一的中信证券的发行主体中信证券股份有限公司在证监会 2014 年四季度两融检查时，存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

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股票，认为中信证券作为国内资产规模领先的大型券商，未来将受益于券商行业的大发展。本次行政监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

3、海通证券

组合投资的前十名证券之一的海通证券的发行主体海通证券股份有限公司在证监会 2014 年四季度两融检查时，存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，对海通证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

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股票，认为海通证券作为国内资产规模领先的大型券商，未来将受益于券商行业的大发展。本次行政监管措施对该股票的投

资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

4、华泰证券

本基金投资的前十名证券之一的华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）于 2014 年 9 月 6 日发布公告称，华泰证券收到中国证监会《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定（[2014]62 号）》（以下简称《决定》）。《决定》的主要内容为：“你公司管理的华泰紫金增强债券集合资产管理计划、华泰紫金周期轮动集合资产管理计划等多个资产管理计划在 2013 年 1 月至 2014 年 3 月期间，存在同日或隔日通过交易对手实现不同计划之间间接进行债券买卖交易的情形。上述行为违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》第三条、第三十三条的规定。同时，中国人民银行南京分行于 2014 年 6 月就此事项对你公司进行行政处罚，但你公司并未及时向监管部门报告。按照《证券公司客户资产管理业务管理办法》第五十七条的规定，责令你公司予以改正。”

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股票，认为华泰证券是国内较大的证券公司，经营稳健，发展势头良好。从处罚公告中知悉，华泰证券违反的管理规定对华泰证券的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5、招商证券

本组合投资的前十名证券之一的招商证券的发行主体招商证券股份有限公司在证监会 2014 年四季度两融检查时，存在向不符合条件的客户融资融券问题，并且受过处理仍未改正，受到采取责令限期改正的行政监管措施。

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股票，认为招商证券作为国内资产规模领先的大型券商，未来将受益于券商行业的大发展。本次行政监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

6、广发证券

本组合投资的前十名证券之一的广发证券的发行主体广发证券股份有限公司在证监会 2014

年四季度两融检查时，存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，受到采取责令限期改正的行政监管措施。

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股票，认为广发证券作为国内资产规模领先的大型券商，未来将受益于券商行业的大发展。本次行政监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

7、兴业证券

本基金投资的前十名证券之一的兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）于 2015 年 5 月 9 日发布《兴业证券股份有限公司关于最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情况以及相应整改措施的公告》（以下简称《公告》）。《公告》称，经自查，兴业证券母公司在最近五年内不存在被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情形。公司的控股子公司兴业全球基金管理有限公司（以下简称“兴全基金”）和兴证期货有限公司（以下简称“兴证期货”）在最近五年存在被相关监管部门或行业自律性组织采取监管措施的情形。（1）兴全基金于 2013 年 5 月 24 日收到了中国证监会上海监管局下发的[2013]13 号行政监管措施决定书《关于对兴业全球基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。兴全基金在聘任兴全商业模式优选股票型证券投资基金的基金经理过程中违反了《证券投资基金运作管理办法》第八条的规定，被监管机构责令于 2013 年 5 月 30 日前予以改正。经整改，兴全基金对事件发生过程中的责任原因进行认真总结、深刻反省，并对相关责任人进行责任追究，进一步加强内控制度管理，强化业务人员合规培训机制。（2）兴全基金及其全资子公司上海兴全睿众资产管理有限公司（以下简称“兴全睿众”）于 2015 年 2 月 15 日收到中国证券投资基金业协会下发的[2015]3 号纪律处分决定书。纪律处分决定书认为兴全睿众旗下资产管理计划在参与大宗交易时存在异常情形，而未引起兴全基金足够警觉，也未向监管部门报告。经整改，兴全基金及兴全睿众对现有的特定客户资产管理计划业务进行了全面自查，对特定客户资产管理业务的制度建设、日常执行方面明确整改责任人和整改期限。（3）兴证期货于 2014 年 6 月 18 日收到中国证监会大连监管局下发的[2014]1 号行政监管措施决定书《关于对兴证期货有限公司采购责令整改措施的决定》，对营业部员工违反《期货从业人员管理办法》违规操作客户账户进行期货交易提出了整改说明和要求。经整改，兴证期货对该问题高度重视，组织人员进行合规培训，梳理和完善公司内控制度，切实防范风险，采取有效措施加强从业人员执业行为管理，有效执行居间关系审核流程，并对违反规定人员采取零容忍。

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股票，认为兴业证券是国内

运作良好的证券公司，经营稳健，发展势头良好。兴业证券的自查报告显示，兴业证券母公司不存在受监管处罚情形，对兴业证券的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	4,660,355.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	147,795.42
5	应收申购款	176,216,267.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	181,024,418.97

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.12.7 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。

§ 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
鹏华 证保	100,323	29,960.08	490,952,494.97	16.33%	2,514,732,282.22	83.67%
证保 A	2,962	1,805,861.55	4,800,036,897.00	89.74%	548,925,020.00	10.26%
证保 B	64,523	82,900.08	1,093,438,454.00	20.44%	4,255,523,463.00	79.56%
合计	167,808	81,662.43	6,384,427,845.97	46.59%	7,319,180,765.22	53.41%

8.2 期末上市基金前十名持有人

证保 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —分红—个人分红	313,678,248.00	5.86%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —传统—普通保险产品	311,996,640.00	5.83%
3	中国人民财产保险股份有限公司— 自有资金	291,308,216.00	5.45%
4	中国人寿再保险股份有限公司	241,570,639.00	4.52%
5	中国大地财产保险股份有限公司	224,233,949.00	4.19%
6	中国财产再保险股份有限公司	179,387,611.00	3.35%
7	中油财务有限责任公司	168,861,209.00	3.16%
8	宏源证券股份有限公司	154,448,229.00	2.89%
9	中意人寿保险有限公司—分红—团 体年金	133,633,402.00	2.50%
10	农银人寿保险股份有限公司—传统 —普通保险产品	102,241,452.00	1.91%

证保 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华融国际信托有限责任公司—华融·六禾 1 号证券投资单一资金	85,456,029.00	1.60%
2	中国对外经济贸易信托有限公司—睿远汇利精选证券投资集合资金	53,442,827.00	1.00%
3	平安信托有限责任公司—金英汇集合资金信托	51,900,050.00	0.97%
4	中国人寿保险股份有限公司	47,450,000.00	0.89%
5	海通资管—民生—海通季季升集合资产管理计划	45,492,627.00	0.85%
6	南方资本—工商银行—中国工商银行股份有限公司私人银行部	31,550,300.00	0.59%
7	五矿国际信托有限公司	30,300,000.00	0.57%
8	宋伟铭	29,690,000.00	0.56%
9	中国人寿保险股份有限公司	29,000,000.00	0.54%
10	工行统筹外基金工银瑞信组合	27,662,424.00	0.52%

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	鹏华证保	389,374.04	0.0130%
	证保 A	—	—
	证保 B	—	—
	合计	389,374.04	0.0028%

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的情况

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人本报告期末未持有本基金份额。
（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华证保	证保 A	证保 B
基金合同生效日（2014 年 5 月 5）	168,124,681.70	110,201,626.00	110,201,626.00

日) 基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	1,711,631,324.77	1,131,055,603.00	1,131,055,603.00
本报告期基金总申购份额	18,062,548,833.39	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	11,562,470,241.49	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-5,206,025,139.48	4,217,906,314.00	4,217,906,314.00
本报告期期末基金份额总额	3,005,684,777.19	5,348,961,917.00	5,348,961,917.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算、不定期折算变动的份额

§ 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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内经公司董事会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]217 号文核准，公司聘任高永杰先生担任公司督察长，任职日期自 2015 年 2 月 6 日起。

报告期内经公司股东会审议通过，公司聘任陈冰女士担任公司监事，并自陈冰女士担任公司监事之日起，李国阳先生不再担任公司监事。陈冰女士任职日期自 2015 年 6 月 2 日起。

基金托管人的重大人事变动：报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

本基金本报告期基金投资策略未改变。

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	
中金公司	1	2,982,894,911.39	15.29%	2,686,021.92	15.34%	本期新增
国泰君安	2	2,891,089,053.73	14.82%	2,599,044.09	14.84%	-
广发证券	2	2,474,023,360.19	12.68%	2,230,429.08	12.74%	本期新增
招商证券	1	2,073,558,351.25	10.63%	1,866,157.48	10.66%	本期新增
中信证券	1	1,858,642,223.90	9.53%	1,674,094.97	9.56%	-
方正证券	2	1,477,322,575.26	7.57%	1,307,284.88	7.47%	本期新增
平安证券	2	1,408,063,846.00	7.22%	1,266,937.03	7.23%	本期新增
华泰证券	1	997,260,221.97	5.11%	882,477.91	5.04%	本期新增
中航证券	1	975,264,029.38	5.00%	878,898.58	5.02%	本期新增
银河证券	2	595,001,680.02	3.05%	526,517.64	3.01%	本期新增
华西证券	1	477,473,336.26	2.45%	430,395.42	2.46%	本期新增
兴业证券	2	404,186,668.52	2.07%	360,250.17	2.06%	本期新增
安信证券	1	354,368,053.47	1.82%	318,966.87	1.82%	本期新增
光大证券	2	339,789,116.02	1.74%	300,679.36	1.72%	本期新增
中投证券	2	203,343,520.16	1.04%	183,240.91	1.05%	本期新增
华创证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	本期新增
中信建投	1	-	-	-	-	本期新增
中银国际	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：本基金本报告期内未通过券商交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金之鹏华证保 A 份额 2015 年度约定年基准收益率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 6 日
2	鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间证保 A 份额停复牌的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 6 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 6 日
4	鹏华基金管理有限公司关于增加中国工商银行作为鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 7 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 7 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 7 日
7	鹏华证保 A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 7 日
8	鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资	《中国证券报》、《上海	2015 年 1 月 7 日

	基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	证券报》、《证券时报》	
9	鹏华基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 12 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 14 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 21 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 21 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 21 日
14	2014 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 22 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 4 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 7 日
17	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 9 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 12 日
19	鹏华基金管理有限公司关于增加天风证券股份有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 13 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 14 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 14 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 17 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 17 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 17 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 25 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 27 日
27	鹏华基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 3 日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在邮储银行开通定投业务并参加定投费率	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 3 日

	优惠活动的公告		
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 3 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 3 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 3 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 5 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 6 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下指数分级基金开展网上直销与直销柜台转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 9 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 11 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 14 日
37	鹏华基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 16 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 19 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 21 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 21 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 21 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 24 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 24 日
44	鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金不定期份额折算公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 24 日
45	关于鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间证保 A 份额、证保 B 份额停复牌公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 25 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 25 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 25 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 25 日

49	2014 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 26 日
50	鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 26 日
51	关于鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金不定期份额折算前收盘价调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 26 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 27 日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 27 日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 31 日
55	鹏华基金管理有限公司关于参与中国工商银行电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 1 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 1 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 2 日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 2 日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 3 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 3 日
61	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 4 日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 4 日
63	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 7 日
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 7 日
65	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 9 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 13 日
67	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 13 日
68	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 14 日
69	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 15 日

70	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 16 日
71	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 18 日
72	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分指数分级基金单笔申购、定期定额投资最低金额与持有最低份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 20 日
73	2015 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 21 日
74	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 23 日
75	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 23 日
76	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 23 日
77	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 24 日
78	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 28 日
79	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 28 日
80	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 7 日
81	鹏华基金管理有限公司关于增加中国国际金融有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 8 日
82	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 8 日
83	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分分级指数基金申购费率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 8 日
84	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 9 日
85	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 12 日
86	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 12 日
87	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 12 日
88	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 12 日
89	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 13 日
90	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 15 日

	的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	证券报》、《证券时报》	
113	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 27 日
114	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 27 日
115	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 27 日
116	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 28 日
117	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 29 日
118	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 29 日
119	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 2 日
120	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 2 日
121	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 3 日
122	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 3 日
123	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 3 日
124	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 3 日
125	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 3 日
126	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 6 日
127	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 9 日
128	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 9 日
129	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 11 日
130	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与华鑫证券自助式交易系统投资费率优惠活动公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 11 日
131	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与平安证券网上交易申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 12 日
132	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 12 日
133	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有	《中国证券报》、《上海	2015 年 6 月 13 日

	的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	证券报》、《证券时报》	
177	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 30 日
178	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 30 日
179	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 30 日
180	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 30 日
181	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 30 日
182	鹏华基金旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告》(原文)。

11.2 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

北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行股份有限公司

11.3 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>)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
2015 年 8 月 25 日