

鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资 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	鹏华证券保险分级
场内简称	证保分级
基金主代码	160625
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 05 月 05 日
报告期末基金份额总额	1,054,767,937.32 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%+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。		
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		
下属分级基金的基金简称	鹏华证保	证保 A	证保 B
下属分级基金的场内简称	证保分级	证保 A	证保 B
下属分级基金的交易代码	160625	150177	150178
下属分级基金的前端交易代码	—	—	—
下属分级基金的后端交易代码	—	—	—
报告期末下属分级基金的份额总额	925,253,753.32 份	64,757,092.00 份	64,757,092.00 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风险、较高预期收益的品种。同时本基	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。

	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。		
--	---	--	--

§ 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	29,466,596.83
2. 本期利润	-36,330,636.76
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0335
4. 期末基金资产净值	1,302,361,769.16
5. 期末基金份额净值	1.235

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，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

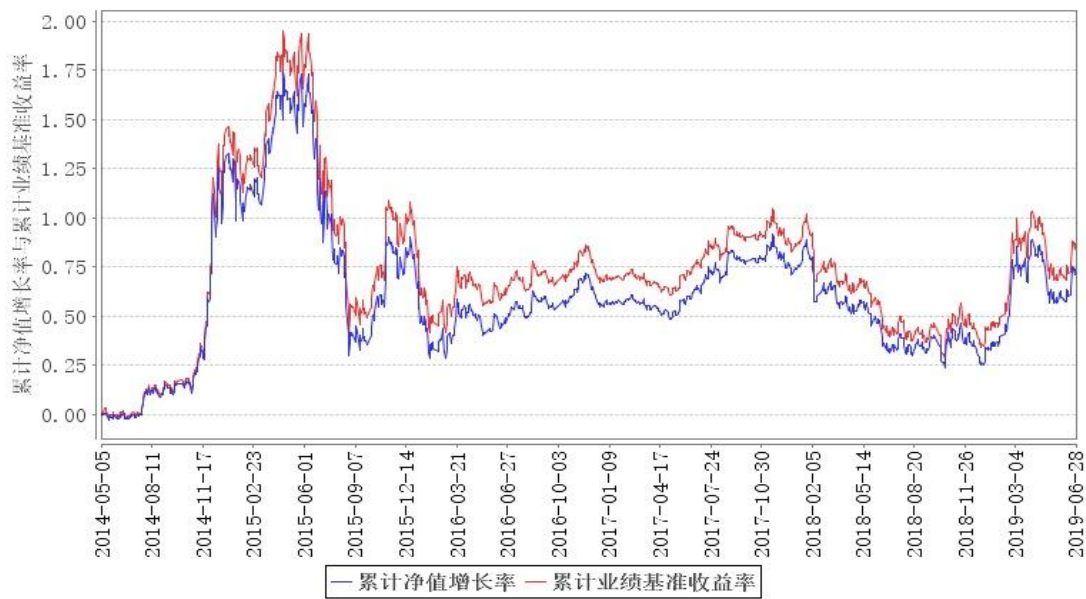
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.45%	1.99%	-2.75%	2.02%	0.30%	-0.03%

注：业绩比较基准=中证 800 证券保险指数收益率×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

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 04 月 30 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		
陈龙	本 基 金 基 金 经 理	2019-03-19	—	10 年	陈龙先生, 国籍中国, 经济学硕士, 10 年证券基金从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师, 2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究

					总监助理,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量化研究副总监、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理, 2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华香港中小企业指数(LOF)基金基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理, 2019 年 03 月担任鹏华国防分级基金基金经理, 2019 年 03 月担任鹏华空天一体军工指数(LOF)基金基金经理,
--	--	--	--	--	--

					2019 年 03 月担任鹏华证券分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券保险分级基金基金经理。陈龙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 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

本基金秉承指数基金的投资策略，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2019 年 2 季度，A 股呈现宽幅震荡格局。报告期内上证指数下跌 3.62%，深证成指下跌 7.35%，

本基金跟踪的中证 800 证保指数下跌 2.97%。

本报告期内，组合净值增长率为-2.45%，业绩比较基准增长率为 -2.75%，基金年化跟踪误差为 1.06%。

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	1,231,286,995.85	94.09
	其中：股票	1,231,286,995.85	94.09
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	74,722,541.34	5.71
8	其他资产	2,547,790.85	0.19
9	合计	1,308,557,328.04	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	-	-
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	1,230,683,946.96	94.50
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	1,230,683,946.96	94.50

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	363,431.25	0.03
C	制造业	176,907.28	0.01
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	39,603.76	0.00
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	603,048.89	0.05

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 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	601318	中国平安	2,085,584	184,803,598.24	14.19
2	600030	中信证券	5,806,300	138,248,003.00	10.62
3	600837	海通证券	5,969,564	84,708,113.16	6.50
4	601601	中国太保	2,318,874	84,662,089.74	6.50
5	601211	国泰君安	3,326,795	61,046,688.25	4.69
6	601688	华泰证券	2,686,175	59,955,426.00	4.60
7	600999	招商证券	2,109,515	36,051,611.35	2.77
8	601628	中国人寿	1,228,982	34,804,770.24	2.67
9	601336	新华保险	615,392	33,865,021.76	2.60
10	000166	申万宏源	6,649,840	33,315,698.40	2.56

5.3.2 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	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.03
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
5	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

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

广发证券 2018 年 9 月 5 日，广东证监局向广发信德智胜投资管理有限公司出具[2018]54 号《关于对广发信德智胜投资管理有限公司采取责令改正措施的决定》，指出信德智胜存在以下问题：1) 部分基金产品在募集说明书或基金合同中约定预期收益率或业绩基准收益率，并按照约定的收益率向投资者支付收益；2) 作为珠海广发信德新三板股权投资基金（有限合伙）和珠海广发信德厚维投资企业（有限合伙）的基金管理人，未采取问卷调查等方式对一名投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估；3) 所管理的珠海横琴金投广发信德厚挚股权投资合伙企业（有限合伙）未对基金进行托管，且未在基金合同中明确保障私募财产安全的制度措施和纠纷解决机制，而对信德智胜采取责令改正的行政监管措施。对此，信德智胜管理层高度重视，立即组织了对相关问题的自查和整改，并形成报告及时完成向广东证监局的报备。2018 年 9 月 20 日，广东证监局向瑞元资本管理有限公司（以下简称“瑞元资本”）出具了《关于对瑞元资本管理有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]67 号），指出瑞元资本存在以下问题：1) 公司部分专户产品自成立以来，瑞元资本作为管理人未编制并向资产委托人报送委托财产的投资报告；2) 瑞元资本璟宸股权投资专项资产管理计划为高风险产品，其中一名资产委托人的风险承受能力测评结果为稳健型，瑞元资本未就该产品风险等级超越该委托人风险承受能力的情况要求委托人确认，而对瑞元资本采取责令改正的行政监管措施。瑞元资本管理层对广东证监局检查发现的问题高度重视，立即组织开展全面的业务自查，积极协调推进相关整改工作，形成整改报告并于近日完成向广东证监局的报备。2018 年 10 月 17 日，广东证监局向广发期货出具《关于对广发期货有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]77 号），指出广发期货资产管理业务存在第三方投顾或投资经理直接执行投资指令，未经交易员确认的问题，违反了《期货公司监督管理办法》第四十六条的规定。对此，广发期货高度重视，由公司高管牵头，组织资产管理部员工对相关问题进行整改。2019 年 3 月 25 日，广发证券收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》

(广东证监局行政监管措施决定书[2019]20 号),指出公司存在对境外子公司管控不到位,未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题,违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条、《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》第二十七条的规定;广东证监局依照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定,决定对公司采取责令改正的行政监管措施。对此,公司高度重视,将切实进行整改,采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。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。中国人寿 中国人寿收到《中国人民银行行政处罚决定书》(银反洗罚决字(2018)第 5 号)。中国人民银行认定,公司于 2015 年 7 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间,未按照规定保存客户身份资料和交易记录以及未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告,依据《中华人民共和国反洗钱法》,公司被合计处以人民币 70 万元罚款(“行政处罚”)。

公司高度重视行政处罚所指出的问题,在接受中国人民银行现场检查期间即立查立改、边查边改。公司已完善反洗钱制度,建立了新一代反洗钱系统,细化了客户身份识别、交易记录保存、大额交易和可疑交易报告等工作流程。

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。

招商证券

2019 年 5 月 29 日,公司披露《关于子公司被香港证监会采取纪律行动的公告》,内容如下:

近日,香港证券及期货事务监察委员会(简称“香港证监会”)发布新闻稿,因本公司的全资子公司招商证券(香港)有限公司(以下简称“招证香港”)在担任中国金属再生资源(控股)有限公司上市申请的联席保荐人时(2008 年 11 月至 2009 年 6 月)没有履行其应尽的尽职审查责任,对招证香港采取纪律行动,包括处以罚款 2,700 万元港币。

公司对以上决定无异议,并已采取措施,深化招证香港投行业务改革,强化勤勉、尽责、审慎、合规的原则,全面完善投行业务制度流程,提升投行业务内部控制水平,严控业务质量。预计上述事项不会对公司经营、财务状况及偿债能力造成重大影响,敬请广大投资者注意投资风险。

2019 年 6 月 1 日,公司披露《关于子公司被香港证监会采取纪律行动的公告》,内容如下:

近日,香港证券及期货事务监察委员会(简称“香港证监会”)发布新闻稿,因本公司的全资子公司招商证券(香港)有限公司(以下简称“招证香港”)错误处理客户款项(发生于 2011 年 10 月至 2014 年 9 月期间),香港证监会对招证香港采取纪律行动,包括处以罚款 500 万元港币。

上述问题系因招证香港在程序及监控方面有所缺失,包括员工对于相关规则理解有偏差等所致,处理不当的客户款项均在日内转回客户账户,未造成客户损失。招证香港经自查发现问题,并主动报告香港证监会。招证香港已于 2015 年委聘一家独立检讨机构完成了独立的合规及监控检讨,并及时进行内部回顾检讨,切实加强内部监控,保障客户利益。

公司对以上决定无异议。上述事项预计不会对公司经营、财务状况及偿债能力造成重大影响,敬请广大投资者注意投资风险。

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。

新华保险

本基金前十大持仓中的新华人寿保险股份有限公司处罚公告：

中国保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监保罚决字〔2018〕1 号）对新华人寿保险股份有限公司做出如下处罚规定，一是新华人寿欺骗投保人的行为违反《保险法》第一百一十六条，根据该法第一百六十一条，决定对新华人寿罚款 30 万元；二是新华人寿编制提供虚假资料的行为违反《保险法》第八十六条，根据该法第一百七十条，决定对新华人寿罚款 50 万元；三是新华人寿未按照规定使用经批准或者备案的保险费率的行违反《保险法》第一百三十五条，根据该法第一百七十条，决定对新华人寿罚款 30 万元。

新华人寿欺骗投保人的行为：市场部制作的《健康福星增额（2014）重大疾病保险产品培训课程》培训课件含有夸大保险责任的表述，并将之挂于内网，供公司内外勤及销售人员使用。2016 年 10 月至 2017 年 10 月期间，累计销售该保险保单 98260 件，涉及保费 33042 万元；新华人寿银行业务管理部制作的《华实人生终身年金保险培训课件》部分表述与华实人生终身年金保险条款规定不一致，并于内网下发，供各分公司内外勤及销售人员使用。2017 年 9 月至 10 月期间，累计销售该保险保单 217 件，涉及保费 566 万元；新华人寿银行业务管理部制作的惠添宝年金保险计划种子讲师传承课程（外训）课件没有明确说明保单利益的不确定性，并于内网下发，供各分公司内外勤及销售人员使用。2017 年 4 月至 10 月期间，累计销售该保险保单 73277 件，涉及保费 159434.7 万元。

新华人寿编制提供虚假资料的行为：2016 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 31 日，新华人寿业务系统中个险业务和银代业务承保数据存在信息不真实的问题。其中，客户电话号码不真实涉及个险业务 17788 件，银代业务 5020 件；身份证号码不真实涉及个险业务 570 件，银代业务 7 件；地址不真实涉及个险业务 5170 件，银代业务 237 件；保单完成回访号码不真实涉及 498 件。二是新华人寿报送的 2016 年个人医疗理赔数据中，180959 件小额理赔数据中“赔款支付指令发出时间”以及 193124 件赔案中“理赔业务结案时间”存在不真实问题。三是新华人寿人力资源部于 2017 年 12 月 5 日 11:09 提供的材料内容存在与事实不符的情况。

新华人寿未按照规定使用经批准或者备案的保险费率：根据新华人寿出台的相关规定，2016 年 12 月 21 日至 2017 年 3 月 31 日期间，与主险新单附加投保的《附加个人（2014）意外伤害保险》，费率按条款所附标准费率 70%执行。该费率浮动未按照公司在我会备案的费率执行。上述期间，新华人寿共计承保与主险新单附加投保的上述附加险 166844 件，涉及保费 2089.2 万元。其中，166298 件费率按照条款所附标准费率 70%收取，涉及保费 2079.8 万元。

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

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	451,397.31
2	应收证券清算款	988,771.96
3	应收股利	—
4	应收利息	15,007.16
5	应收申购款	1,092,614.42
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,547,790.85

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。

5.11.6 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

注：无。

5.11.7 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华证保	证保 A	证保 B
报告期期初基金份额总额	868,698,281.17	70,322,037.00	70,322,037.00
报告期期间基金总申购份额	343,759,792.40	—	—
减：报告期期间基金总赎回份额	298,334,210.25	—	—
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	11,129,890.00	-5,564,945.00	-5,564,945.00
报告期期末基金份额总额	925,253,753.32	64,757,092.00	64,757,092.00

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不定期折算变动的份额

§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 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 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