

鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数
证券投资基金
2020 年第 2 季度报告

2020 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

报告送出日期：2020 年 7 月 21 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 2020 年 07 月 20 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 2020 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	证保 ETF
场内简称	证保 ETF
基金主代码	515630
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 28 日
报告期末基金份额总额	363,217,720.00 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的最小化。
投资策略	<p>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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。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。</p> <p>1、股票投资策略（1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份</p>

股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。（2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票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，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，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

1) 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2) 不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整； 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金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。

2、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

3、衍生品投资策略 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。 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。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

4、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

5、参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券业务法律法规的实施进展，待允许本基金参与融券业务的相关规定颁布后，将在届时相应法律法规的框架内，参与融券业务。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。

业绩比较基准	中证 800 证券保险指数收益率
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

	券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年4月1日-2020年6月30日）
1. 本期已实现收益	1,049,759.49
2. 本期利润	48,979,975.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0872
4. 期末基金资产净值	374,704,335.66
5. 期末基金份额净值	1.0316

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

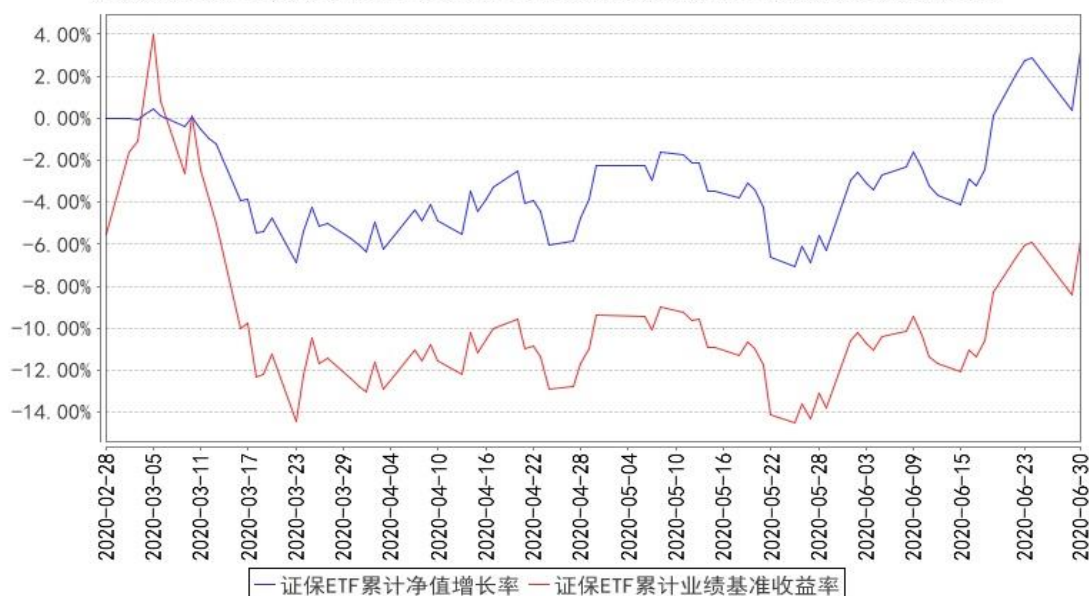
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.76%	1.22%	7.97%	1.26%	1.79%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	3.16%	1.17%	-5.82%	1.78%	8.98%	-0.61%

注：业绩比较基准=中证 800 证券保险指数收益率

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

证保ETF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 2020 年 02 月 28 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

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		
张羽翔	本基金基金经理	2020-02-28	-	13 年	张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，13 年证券基金从业经验。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 月至 2020 年 06 月担任鹏华上证民企 50ETF 联接基金基金经理，2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任民企 ETF 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 月担任鹏华中证 500 指数（LOF）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 11 月担任鹏华新能源分级基金基金经理，2016 年 11 月担任鹏华一带一路分级基金基金经理，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，2019 年 11 月担任鹏华香港银行指数（LOF）基金基金经理，2019 年 12 月担任银行 FUND 基金基金经理，2020 年 02 月担任证保 ETF 基金基金经理，2020 年 03 月担任传媒 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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发

生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内：鹏华证保 ETF 组合净值增长率 9.76%；鹏华证保 ETF 业绩比较基准增长率 7.97%；

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	368,106,213.87	96.51
	其中：股票	368,106,213.87	96.51
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	12,586,242.95	3.30
8	其他资产	738,123.62	0.19
9	合计	381,430,580.44	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

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	21,642,045.54	5.78
J	金融业	344,615,740.00	91.97
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	366,257,785.54	97.75

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,644,930.24	0.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
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	190,731.77	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	1,848,428.33	0.49

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	682,832	48,754,204.80	13.01
2	600030	中信证券	1,558,800	37,582,668.00	10.03
3	300059	东方财富	1,183,340	23,903,468.00	6.38
4	601688	华泰证券	1,080,700	20,317,160.00	5.42
5	600837	海通证券	1,485,600	18,688,848.00	4.99
6	600570	恒生电子	152,259	16,398,294.30	4.38
7	601211	国泰君安	827,900	14,289,554.00	3.81
8	601601	中国太保	496,900	13,540,525.00	3.61
9	600999	招商证券	524,900	11,521,555.00	3.07
10	000166	申万宏源	1,655,000	8,357,750.00	2.23

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688505	复旦张江	22,688	562,208.64	0.15
2	688558	国盛智科	8,488	376,018.40	0.10
3	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.05
4	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
5	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.03

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

恒生电子 关于恒生电子股份有限公司（以下简称“恒生电子”或“公司”）控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司（以下简称“恒生网络”）涉及的行政处罚事项，公司曾陆续发布 2015-060 号、2015-061 号、2016-062 号、2016-064 号、2016-065 号、2017-029 号、2017-031 号、2018-008 号、2018-030 号公告，并在公司定期报告中予以披露和作影响及风险提示。收到本次《执行裁定书》之前，恒生网络执行行政处罚的情况以及财务现状如下（本公告币种均为人民币）：截至 2019 年 9 月 30 日，恒生网络净资产余额为-423,571,032.62 元，恒生网络已缴纳罚没相关款项 25,297,395.61 元，尚未缴纳余额为 414,170,095.07 元。目前恒生网络部分银行账户已被冻结。恒生网络已无法正常持续运营，处于净资产不足以偿付中国证券监督管理委员会[2016]123 号《行政处罚决定书》所涉罚没款的状态。恒生网络于 2019 年 11 月 18 日收到北京市西城区人民法院（以下简称“西城法院”或“本院”）送达的《执行裁定书》，文号：（2018）京 0102 执 2080 号。《执行裁定书》主要内容如下：申请执行人中国证券监督管理委员会与被执行人杭州恒生网络技术服务有限公司行政处罚一案，中国证券监督管理委员会于 2016 年 11 月 25 日作出的[2016]123 号行政处罚决定书及北京市西城区人民法院于 2017 年 8 月 16 日作出的（2017）京 0102 行审 87 号行政裁定书均已经发生法律效力。申请执行人中国证券监督管理委员会于 2018 年 2 月 6 日依法向本院申请执行，要求被执行人杭州恒生网络技术服务有限公司交纳罚款 41896.7490 万元。1、本案在执行过程中，本院通过司法专邮形式向被执行人邮寄送达执行通知、报告财产令、财产申报表、执行裁定书等，被执行人未实际履行。2、本案在执行过程中，本院通过司法专邮形式向被执行人邮寄送达限制消费令，对其适用限制高消费措施。3、本案在执行过程中，本院将被执行人纳入全国法院失信被执行人名单，并在中国执行信息公开网上公布。4、本案在执行过程中，本院通过全国网络查控系统及北京法院执行办案系统查询了被执行

人名下相关财产信息，未发现被执行人名下有可供执行的房产、车辆、股票、投资。 5、本案在执行过程中，冻结、扣划被执行人银行存款 48.6367 万元，交纳本案执行费 48.6367 万元。 6、本案在执行过程中，执行到位 0 万元。未发现被执行人有其他可供执行的财产。故本案的申请标的尚有 41896.7490 万元未执行。 7、本案在执行过程中，已将上述执行情况及信息，通过谈话方式告知申请执行人，并要求其提供财产线索，申请执行人认可法院的调查结果。现暂时不能提供财产线索和被执行人的确切住址，并同意终结本次执行程序。 综上所述，本案经过财产调查未发现可供执行的财产，在合议庭审查核实并经院长批准后，依照《最高人民法院关于适用〈中华人民共和国民事诉讼法〉的解释》第五百一十九条的规定，裁定如下： 终结本次执行程序。 本次执行程序终结后，被执行人仍有继续履行债务的义务，申请执行人如发现被执行人有可供执行的财产或财产线索，有权向本院申请恢复执行。 本裁定书送达后即发生法律效力。 事项对公司的影响如下： 1、《执行裁定书》终结对恒生网络的本次执行程序后，恒生网络仍负有继续履行未缴纳的[2016]123 号行政处罚决定所决定的罚没款金额的义务，中国证券监督管理委员会如发现恒生网络有可供执行的财产或财产线索，有权向法院申请恢复强制执行程序。 2、因《执行裁定书》将恒生网络前期缴纳的 48.6367 万元明确为法院执行费用，不计入恒生网络缴纳的罚没款额，故恒生网络已缴纳的罚没款金额应补正为 24,811,028.61 元，未缴纳的罚没款金额应补正为 414,656,462.07 元。上述补正的罚没款金额，对公司本年度利润不产生较大影响。具体以公司经审计的财务报告为准。 根据中国证券监督管理委员会行政处罚决定书（[2016]123 号），恒生网络已于 2016 年度补提罚没支出 381,576,571.94 元计入营业外支出。本次收到的《执行裁定书》对上述会计处理无影响。 3、基于恒生网络目前所处的如上状态，导致公司存在不确定的各项风险包括但不限于恒生网络未来因未及时足额缴纳罚没款而被加处罚款的风险、公司声誉的损失、潜在的业务监管风险、潜在的各项准入资格的限制以及再融资受阻的风险、恢复强制执行带来的相关风险、被纳入失信被执行人名单带来的相关风险等，受影响的程度视具体情况而定。 对上述股票的投资决策程序的说明：本基金管理人经过研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。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 9 月 11 日，中国证监会北京监管局向公司北京朝外大街证券营业部下发了《关于对招商证券股份有限公司北京朝外大街证券营业部采取责令改正并增加合规检查次数措施的决定》，认为该营业部在为某客户开立融资融券账户时，由于员工操作失误，该营业部将融资融券账户错误关联到另一客户股东账户下；在代销产品过程中，该营业部向某客户进行风险提示

的留痕缺失。因此，北京证监局对该营业部作出责令改正并增加合规检查次数的监督管理措施决定。公司收到上述决定书后，高度重视，将严格按照监管要求进行整改并提交整改报告，并将按照监管要求对该营业部内部控制和合规风控管理开展合规检查。公司将持续采取优化系统流程、加强培训等措施，防止此类问题的再次发生。 对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。 华泰证券 关于华泰证券 2020 年 2 月 10 日处罚：未按规定履行客户识别义务；未按规定报送可疑交易报告；与不明的客户进行交易，中国人民银行对公司做出 1010 万元的处罚。 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。

国泰君安 本基金持有的前十大证券之一的国泰君安证券股份有限公司在本报告期内有如下情形需要公告： 吉林证监局关于对国泰君安证券股份有限公司四平中央西路证券营业部采取责令改正行政监管措施的决定（20190920），具体如下：营业部员工王珏在替客户办理证券交易操作，与客户约定分享投资收益的行为，营业部未能有效防范员工违法违规风险，存在异常交易监控不到位，部分重要空白合同文本管理不到位的问题，反映公司营业部内控不完善。上述行为违反了《证券经纪人管理暂行规定》第十八条及《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款的规定，根据规定，吉林证监局对营业部采取责令整改的行政监管措施。 深圳证监局关于对国泰君安证券股份有限公司深圳红荔西路证券营业部采取出局警示函措施的决定（20200317），具体如下：营业部存在副总经理实际履行分支机构负责人职责 4 个月未向深圳证监局报备，违反了《证券公司分支机构监管规定》第十七条相关规定，因此对营业部采取出局警示函的行政监管措施，要求营业部加强综合管理，提升合规管理水平，依法稳健经营。 中国证券监督管理委员会上海监管局关于对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定（20191219），具体如下：公司分支机构员工存在替客户办理证券交易操作、为客户的融资活动提供便利等违规行为，公司未能有效动态监控客户交易活动，未及时报告、处置重大异常行为，在分支机构管理、异常交易和操作监控等方面存在不足。上述行为违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号）第六条第三项、《证券经纪人管理暂行规定》（证监会公告[2009]2 号）第十八条、《证券公司内部控制指引》（证监机构字[2003]260 号）第三十七条的有关规定。根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条第一款的规定，现决定对公司采取出具警示函的

行政监管措施。关于对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定（20200506），具体如下：经查，你公司作为富贵鸟股份有限公司公开发行 2014 年公司债券的承销机构和受托管理人，在尽职调查和受托管理过程中未严格遵守执业规范，未能勤勉尽责地履行相关责任，违反了中国证监会《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号，以下简称《管理办法》）第七条和第四十九条的规定。根据《管理办法》第五十八条的相关规定，我局决定对你公司采取出具警示函的监督管理措施，你公司应引以为戒，在开展业务时恪守勤勉尽责义务，严格遵守职业规范和监管规则，加强业务质量控制，提升合规水平。如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。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 关于对招商证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定（20191227），具体如下：招商证券股份有限公司： 经查，我会发现你公司存在以下问题：一是投行部门未配备专职合规人员；部分投行异地团队未配备专职合规人员；部分分支机构未配备合规人员；部分分支机构合规人员不具备 3 年以上相关工作经验。二是部分合规人员薪酬低于公司同级别平均水平。三是未见合规总监有权参加监事会的规定。四是部分重大决策、新产品和新业务未经合规总监合规审查。上述情况违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第十三条、第二十三条、第二十五条、第二十八条、《证券公司合规管理实施指引》第二十八条、第三十一条的规定。按照《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条的规定，我会决定对你公司采取出具警示函的行政监管措施。公司经营管理层应当按照《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》的要求，切实履行合规管理职责，为合规总监、合规部门、合规人员履职提供充分的人力、物力、财力、技术支持和保障。如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向我会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

华泰证券 关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正监督管理措施的决定（20190823），具体如下： 华泰证券股份有限公司： 经查，你公司在代销“聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A、B 专项资管计划”过程中，存在使用未经报备的宣传推介材料的情形。该行为违反《证券公司代销金融产品管理规定》第十条的规定，反映出你公司内部控制不完善。 根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的监督管理措施。你公司应采取切实有效措施，完善内部控制，并于收到本决定之日起 30 日内向我局提交书面整改报告。 如对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述行政监管措施不停止执行。 对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	187,699.85
2	应收证券清算款	546,567.89
3	应收股利	-
4	应收利息	3,855.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	738,123.62

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688505	复旦张江	562,208.64	0.15	锁定期股票
2	688568	中科星图	178,634.20	0.05	新股未上市
3	688377	迪威尔	129,619.48	0.03	新股未上市

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	685,717,720.00
报告期期间基金总申购份额	71,500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	394,000,000.00
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	363,217,720.00

§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 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金 2020 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

2020 年 7 月 21 日