

# 鹏华可转债债券型证券投资基金 2016 年 半年度报告摘要

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华可转债
基金主代码	000297
交易代码	000297
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 3 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	60,659,978.11 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以可转债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要投资于可转换债券等固定收益类品种，在有效控制风险的基础上，以可转换债券为主要投资标的，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×60%+中债总指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	林葛
	联系电话	0755-82825720	010-66060069
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006788999	95599
传真		0755-82021126	010-68121816

## 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	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 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东 座 F9 中国农业银行股份有限公司

## §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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-1,041,109.87
本期利润	-8,234,321.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1301
本期基金份额净值增长率	-13.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1604
期末基金资产净值	50,932,113.15
期末基金份额净值	0.840

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

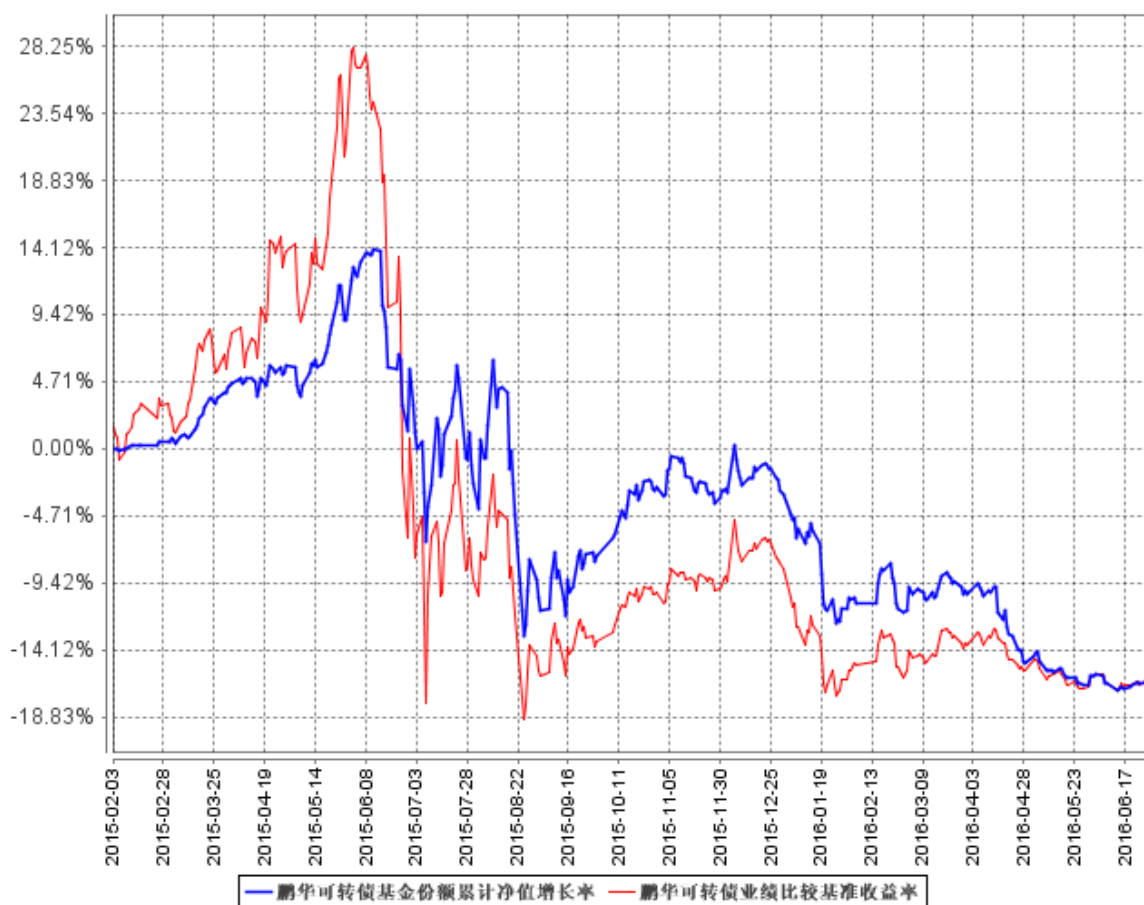
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.12%	0.25%	0.03%	0.27%	-0.15%	-0.02%
过去三个月	-6.46%	0.47%	-2.61%	0.38%	-3.85%	0.09%
过去六个月	-13.22%	0.66%	-8.29%	0.68%	-4.93%	-0.02%

过去一年	-20.45%	1.32%	-16.66%	1.61%	-3.79%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-16.00%	1.22%	-16.01%	1.75%	0.01%	-0.53%

注：业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×60%+中债总指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×10%

### 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

鹏华可转债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 2015 年 2 月 3 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 2016 年 6 月，公司管理资产总规模达到 3609.67 亿元，管理 99 只公募基金、10 只全国社保投资组合。经过近 18 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		
阳先伟	本 基 金 基 金 经 理	2015 年 2 月 2 日	-	14	阳先伟先生，国籍中国，经济学硕士，14 年证券从业经验。先后在民生证券、国海证券等机构从事债券研究及投资组合管理工作，历任研究员、高级经理等职务。2004 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券及宏观研究工作，曾任普天债券基金基金经理助理；2007 年 1 月至 2014 年 2 月担任普天债券基金基金经理，2010 年 12 月至 2014 年 2 月兼任鹏华丰润债券（LOF）基金基金经理，2008 年 5 月起兼任鹏华丰收债券基金基金经理，2013 年 9 月兼任鹏华双债保利债券基金基金经理，2015 年 2 月兼任鹏华可转债债券基金基金经理，现同时担任固定收益部执行总经理、投资决策委员会成员。阳先伟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。
伍旋	本 基 金 基 金 经 理	2015 年 2 月 2 日	-	10	伍旋先生，国籍中国，工商管理硕士，10 年证券从业经验。曾任职于中国建设银行，2006 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任研究部高级研究员、基金经理助理；2011 年 12 月起担任鹏华盛世创新混合（LOF）基金基金经理，2015 年 2 月起兼任鹏华可转债债券基金基金经理，2015 年 4 月起兼任鹏华改革红利股票基金基金经理，现同时担任研究部副总经理。伍旋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

2016 年上半年实体经济依然在底部徘徊，上半年 GDP 实际增速 6.7%，低于 2015 年全年增速 6.9%。二季度 GDP 在基建和房地产投资拉动下，经济有所企稳，环比增长 1.8%，较一季度高 0.6 个百分点，但是国内需求稳中偏弱表明三季度经济下行压力仍大。2016 年上半年，沪深 300 指数下跌 15.47%，中债全价指数下跌 0.44%，中证转债指数下跌-11.90%。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-13.22%，同期上证综指下跌 17.22%，深证成指下跌 17.17%，沪深 300 指数下跌 15.47%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年我们预计可转债市场供给不足的局面会有所改善，结合正股的基本面，我们关注具备成长性、有着竞争优势的企业。

## 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[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。

#### 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、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

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为-9,727,864.96元，期末基金份额净值0.840元，不符合利润分配条件，本基金本期未进行利润分配。

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

注：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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—鹏华基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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：鹏华可转债债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	3,505,195.90	6,678,192.17
结算备付金	5,067.33	-
存出保证金	12,211.35	35,072.37
交易性金融资产	47,759,094.30	56,371,464.40

其中：股票投资	3,725,723.60	2,525,870.00
基金投资	-	-
债券投资	44,033,370.70	53,845,594.40
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	-	745,117.88
应收利息	44,633.47	88,263.59
应收股利	-	-
应收申购款	-	13,990.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	51,326,202.35	63,932,100.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年6月30日</b>	<b>2015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	-	-
应付赎回款	89,057.24	626,006.56
应付管理人报酬	41,739.75	54,808.32
应付托管费	8,347.92	10,961.67
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,055.03	31,785.87
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	251,889.26	287,368.04
负债合计	394,089.20	1,010,930.46
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	60,659,978.11	64,973,137.26
未分配利润	-9,727,864.96	-2,051,967.17
所有者权益合计	50,932,113.15	62,921,170.09
负债和所有者权益总计	51,326,202.35	63,932,100.55

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.840 元，基金份额总额 60,659,978.11 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华可转债债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 3 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-7,702,166.83	26,563,916.75
1.利息收入		152,706.57	2,774,025.83
其中：存款利息收入		14,384.94	1,563,693.01
债券利息收入		138,321.63	2,252.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,208,080.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-667,472.82	16,733,561.65
其中：股票投资收益		-314,239.92	15,764,279.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-361,127.40	245,307.46
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		7,894.50	723,974.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-7,193,212.07	6,595,176.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		5,811.49	461,152.38
<b>减：二、费用</b>		532,155.11	1,890,197.67
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	277,762.00	1,193,967.93
2. 托管费	6.4.8.2.2	55,552.37	238,793.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		17,010.72	319,517.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		181,830.02	137,918.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-8,234,321.94	24,673,719.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-8,234,321.94	24,673,719.08

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华可转债债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	64,973,137.26	-2,051,967.17	62,921,170.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,234,321.94	-8,234,321.94
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)	-4,313,159.15	558,424.15	-3,754,735.00
其中：1.基金申购款	2,760,536.62	-283,670.32	2,476,866.30
2.基金赎回款	-7,073,695.77	842,094.47	-6,231,601.30
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)	60,659,978.11	-9,727,864.96	50,932,113.15
项目	上年度可比期间 2015 年 2 月 3 日(基金合同生效日)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)	430,571,056.16	-	430,571,056.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,673,719.08	24,673,719.08
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)	-333,514,423.70	-19,223,739.90	-352,738,163.60
其中：1.基金申购款	15,105,867.38	1,067,549.99	16,173,417.37
2.基金赎回款	-348,620,291.08	-20,291,289.89	-368,911,580.97
四、本期向基金份额持	-	-	-



## 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》、《鹏华可转债债券型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 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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, 对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

## 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
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内以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。

### 6.4.8.1 关联方报酬

#### 6.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的管理费	277,762.00	1,193,967.93
其中：支付销售机构的客户维护费	116,816.02	508,178.77

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 1.0%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.0%÷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。

#### 6.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	55,552.37	238,793.56

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费年费率为 0.2%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

#### 6.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

#### 6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.3.1 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。

##### 6.4.8.3.2 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。

#### 6.4.8.4 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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年2月3日(基金合同生效日)至2015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
中国农业银行	3,505,195.90	13,913.07	76,234,533.46	390,554.71

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。



**6.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期没有参与关联方承销的证券。

**6.4.9 期末（2016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：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。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：截至本报告期末，本基金没有持有暂时停牌的股票。

**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**

截至本报告期末，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。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末，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。

**§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	3,725,723.60	7.26
	其中：股票	3,725,723.60	7.26
2	固定收益投资	44,033,370.70	85.79
	其中：债券	44,033,370.70	85.79
	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	3,510,263.23	6.84
7	其他各项资产	56,844.82	0.11
8	合计	51,326,202.35	100.00

## 7.2 期末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	661,338.00	1.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	269,085.60	0.53
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	2,448,660.00	4.81
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	346,640.00	0.68
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	3,725,723.60	7.32

## 7.3 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

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	601398	工商银行	551,500	2,448,660.00	4.81
2	300012	华测检测	28,000	346,640.00	0.68
3	002185	华天科技	26,000	330,980.00	0.65
4	002051	中工国际	13,680	269,085.60	0.53
5	300439	美康生物	6,100	219,478.00	0.43

6	600332	白云山	4,500	110,880.00	0.22
---	--------	-----	-------	------------	------

## 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	000952	广济药业	865,953.00	1.38
2	000605	渤海股份	606,874.00	0.96
3	600201	生物股份	586,850.00	0.93
4	300095	华伍股份	305,471.00	0.49
5	601098	中南传媒	304,034.00	0.48
6	000890	法尔胜	302,037.00	0.48
7	600804	鹏博士	301,415.00	0.48
8	002235	安妮股份	300,428.00	0.48
9	300012	华测检测	299,497.00	0.48
10	300357	我武生物	298,761.00	0.47
11	600395	盘江股份	290,792.00	0.46
12	000786	北新建材	289,444.00	0.46
13	002185	华天科技	287,633.00	0.46
14	002594	比亚迪	284,447.00	0.45
15	002094	青岛金王	284,369.00	0.45
16	002051	中工国际	253,134.00	0.40
17	300439	美康生物	175,206.00	0.28
18	300061	康耐特	141,645.00	0.23
19	002042	华孚色纺	113,315.00	0.18
20	600332	白云山	103,730.00	0.16

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	000952	广济药业	724,421.00	1.15
2	600201	生物股份	630,354.00	1.00

3	000605	渤海股份	543,356.00	0.86
4	300095	华伍股份	348,126.00	0.55
5	600804	鹏博士	337,736.00	0.54
6	002594	比亚迪	303,800.00	0.48
7	300357	我武生物	303,133.08	0.48
8	002094	青岛金王	299,728.00	0.48
9	000786	北新建材	271,158.00	0.43
10	002235	安妮股份	269,149.00	0.43
11	601098	中南传媒	262,702.00	0.42
12	600395	盘江股份	260,973.00	0.41
13	000890	法尔胜	196,106.00	0.31
14	300061	康耐特	110,878.00	0.18
15	002042	华孚色纺	109,752.00	0.17
16	300202	聚龙股份	60,172.00	0.10
17	002518	科士达	55,638.00	0.09
18	002010	传化股份	53,792.00	0.09
19	600050	中国联通	48,112.00	0.08

注：(1) 买出金额按买出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

(2) 以上为本报告期内买出的全部股票明细。

### 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	6,622,526.00
卖出股票收入（成交）总额	5,189,086.08

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	44,033,370.70	86.46

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,033,370.70	86.46

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132002	15 天集 EB	137,540	14,632,880.60	28.73
2	110031	航信转债	119,300	13,157,597.00	25.83
3	113008	电气转债	81,510	8,812,046.10	17.30
4	110030	格力转债	64,420	7,430,847.00	14.59

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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国债期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

### 7.10.3 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。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

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。

### 7.11.2

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。

### 7.11.3 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	12,211.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	44,633.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,844.82

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132002	15 天集 EB	14,632,880.60	28.73
2	110031	航信转债	13,157,597.00	25.83
3	113008	电气转债	8,812,046.10	17.30
4	110030	格力转债	7,430,847.00	14.59

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.11.6 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。

## §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

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
2,371	25,584.13	0.0	0.00%	60,659,978.11	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	994.79	0.0016%

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。

### 8.3 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、基金投资和研发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

基金合同生效日（2015年2月3日）基金份额总额	430,571,056.16
本报告期期初基金份额总额	64,973,137.26
本报告期基金总申购份额	2,760,536.62
减：本报告期基金总赎回份额	7,073,695.77
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	60,659,978.11

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。

## §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

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动:

报告期内, 因股东方更换董事代表, 原董事 Alessandro Varaldo 先生不再担任公司董事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐, 并经本公司股东会审议通过, 同意由 Andrea Vismara 先生担任本公司董事, Alessandro Varaldo 先生不再担任本公司董事职务。Andrea Vismara 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

报告期内, 原监事 Andrea Vismara 先生辞去公司监事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐, 并经本公司股东会审议通过, 同意由 Sandro Vesprini 先生担任本公司监事, Andrea Vismara 先生不再担任本公司监事职务。Sandro Vesprini 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

#### 10.2.2 基金托管人的重大人事变动:

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 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

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	
中信证券	1	8,230,278.08	69.68%	7,500.29	69.68%	-
国金证券	1	3,030,656.00	25.66%	2,761.43	25.66%	-
银河证券	1	398,836.00	3.38%	363.46	3.38%	-
东兴证券	2	151,842.00	1.29%	138.40	1.29%	本报告期新增
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	本报告期新增
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	188,864.00	8.63%	-	-	-	-
国金证券	1,989,513.50	90.87%	-	-	-	-
银河证券	10,968.20	0.50%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

鹏华基金管理有限公司  
2016年8月29日