

# 鹏华可转债债券型证券投资基金 2016 年 年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 30 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 2017 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华可转债
场内简称	-
基金主代码	000297
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	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	54,895,187.25份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 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	<p>1、大类资产配置</p> <p>本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>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。</p> <p>（1）可转债投资策略</p> <p>本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等，这类债券赋予债权人或债务人某种期权，比普通的债券更为灵活。本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益。</p> <p>1) 传统可转债投资策略</p> <p>传统可转债即指可转换公司债券，是指在规定的期限内持有人有权但没有义务按约定的价格转换成公司股</p>

票的一种公司债券，兼具债权和股权双重属性。债权属性是指投资者可以选择持有可转债到期，得到本金与利息收益；股权属性即股票期权属性，是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格把可转债转换成股票。因此，可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。

a. 个券选择策略。一方面，本基金将对所有可转债对应的标的股票进行深入研究，采用定性分析（行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等）与定量分析（P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV 等）相结合的方式挑选成长性好且估值合理的正股；另一方面，本基金将深入研究分析可转债自身的信用评估。综上所述，本基金将结合可转债自身的信用评估和其正股的价值分析，做为选取个券的重要依据。

b. 条款价值发现策略。可转债一般均设有一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等，这些条款在特定环境下对可转债价值有着较大的影响。修正转股价条款给予发行人向下修正转股价格的权利，有利于提升可转债的期权价值；回售条款给予投资者将可转债按照约定价格回售给发行人的权利，为可转债投资提供了一种安全边际；赎回条款给予发行人从投资者处赎回可转债的权利，若发行人放弃赎回权则会提高可转债的期权价值。本基金将通过有效分析相关信息力争把握各项条款给可转债带来的可能的投资机会。

c. 套利策略。可转债可以按照约定的价格转换为股票，因此在日常交易运作过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当处于转股期内的可转债市价低于转股价值，即可转债的转换溢价率为负时，买入可转债的同时卖出标的股票可以获得套利价差；反之，买入标的股票的同时卖出可转债也可以获取反向套利价差。在日常交易运作中，本基金将密切关注可转债与标的股票之间价格之间的对比关系，择机实施套利策略，以增强本基金的收益。

## 2) 分离交易可转债投资策略

分离交易可转债与传统可转债的不同点主要体现在分离交易可转债在上市后分离为债券部分跟权证部分分别独自进行交易。本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时，将重点分析附权部分对债券估值的影响。对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理，权证部分将在可交易之日起不超过 3 个月的时间内卖出。

### (2) 普通债券投资策略

本基金的债券投资将主要采取久期策略、类属配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选

	<p>择策略等积极投资策略。</p> <p>1) 久期策略</p> <p>本基金将通过自上而下的组合久期管理策略, 以实现 对组合利率风险的有效控制。基金管理人将根据对宏 观经济周期所处阶段及其他相关因素的研判调整组合 久期。如果预期利率下降, 本基金将增加组合的久期, 以较多地获得债券价格上升带来的收益; 反之, 如果 预期利率上升, 本基金将缩短组合的久期, 以减小债 券价格下降带来的风险。</p> <p>2) 类属配置策略</p> <p>本基金在确定久期的基础上, 通过对宏观经济、市场 利率、债券供求等的分析, 预测各类属资产预期风险 及收益情况, 并结合分析债券品种期限和不同债券市 场流动性及收益性现状, 制定普通债券品种期限配置 策略, 确定普通债券组合资产在政府债券、企业主体 债券、货币资产之间的分配比例。</p> <p>3) 收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之 一, 本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭 配。本基金将通过收益率曲线变化的预测, 适时采用 子弹式、杠铃或梯形策略构造组合, 并进行动态调 整。</p> <p>4) 骑乘策略</p> <p>本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一 策略即通过对收益率曲线的分析, 在可选的目标久期 区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。 在收益率曲线不变动的情况下, 随着其剩余期限的衰 减, 债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅的 下滑, 从而获得较高的资本收益; 即使收益率曲线升 或进一步变陡, 这一策略也能够提供更多的安全边 际。</p> <p>5) 息差策略</p> <p>本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形, 通过 正回购将所获得的资金投资于债券, 利用杠杆放大债 券投资的收益。</p> <p>6) 债券选择策略</p> <p>根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏 离程度, 结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋 特点等因素, 确定其投资价值, 选择定价合理或价值被 低估的债券进行投资。</p> <p>7) 中小企业私募债投资策略</p> <p>中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和 转让, 约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其 非公开性及条款可协商性, 普遍具有较高收益。本基 金将深入研究发行人资信及公司运营情况, 合理合规</p>
--	--

	<p>合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金股票投资以精选个股为主，发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，从定量和定性两方面考察上市公司的增值潜力。</p> <p>定量方面综合考虑盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，包括净资产与市值比率（B/P）、每股盈利/每股市价（E/P）、年现金流/市值（cashflow-to-price）以及销售收入/市值（S/P）等价值指标，以及净资产收益率（ROE）、每股收益增长率以及主营业务收入增长率等成长指标。</p> <p>定性方面考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势等多种因素，精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。</p>
业绩比较基准	中证可转换债券指数×60%+中债总指数×30%+沪深300 指数×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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2016 年	2015 年 2 月 3 日 (基金合同生效日)– 2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	-2,765,591.36	16,645,028.57	-
本期利润	-8,326,692.05	15,491,193.66	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1372	0.0929	-
本期基金份额净值增长率	-13.64%	-3.20%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1642	-0.0316	-
期末基金资产净值	45,879,999.18	62,921,170.09	-
期末基金份额净值	0.836	0.968	-

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 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4) 本基金基金合同于 2015 年 2 月 3 日生效，至 2015 年 12 月 31 日未满一年，故 2015 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

#### 3.2 基金净值表现

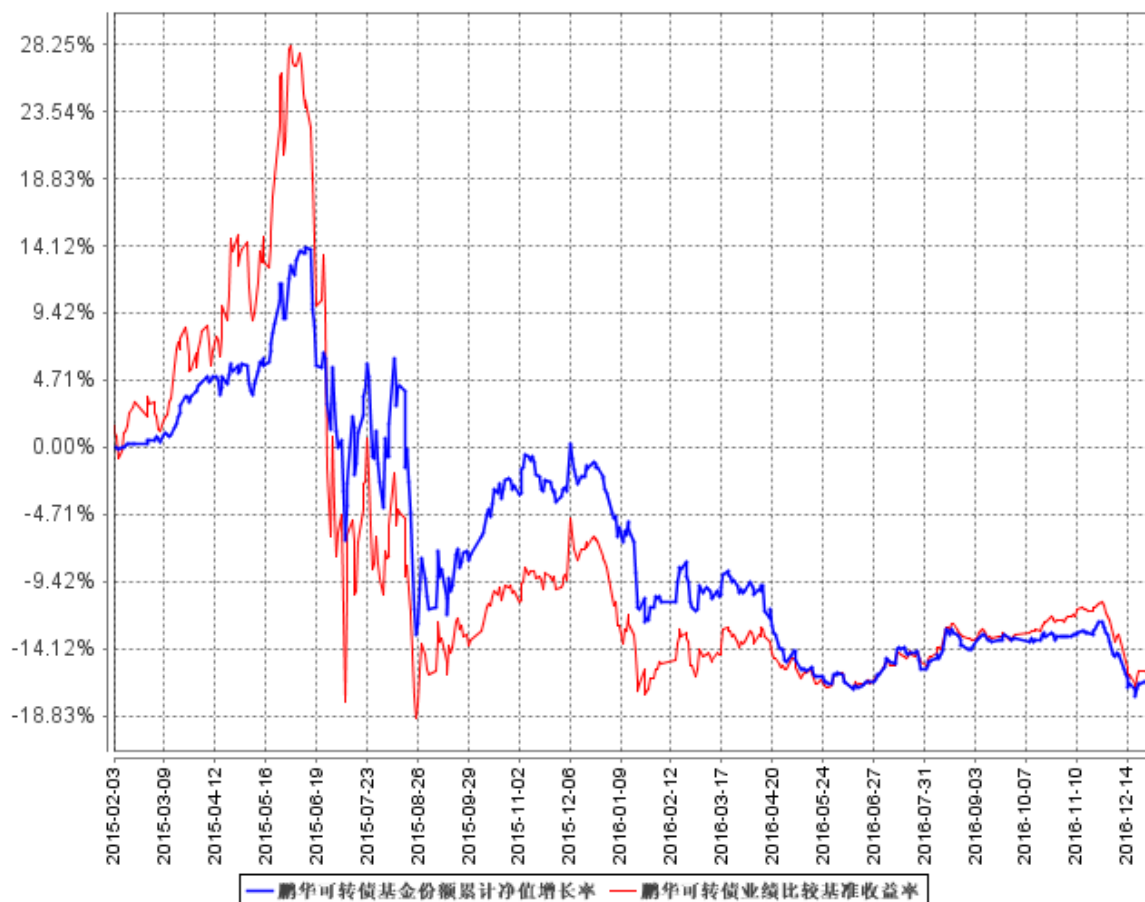
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-3.46%	0.34%	-2.66%	0.43%	-0.80%	-0.09%
过去六个月	-0.48%	0.36%	0.61%	0.38%	-1.09%	-0.02%
过去一年	-13.64%	0.53%	-7.73%	0.55%	-5.91%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	-16.40%	1.06%	-15.50%	1.51%	-0.90%	-0.45%

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



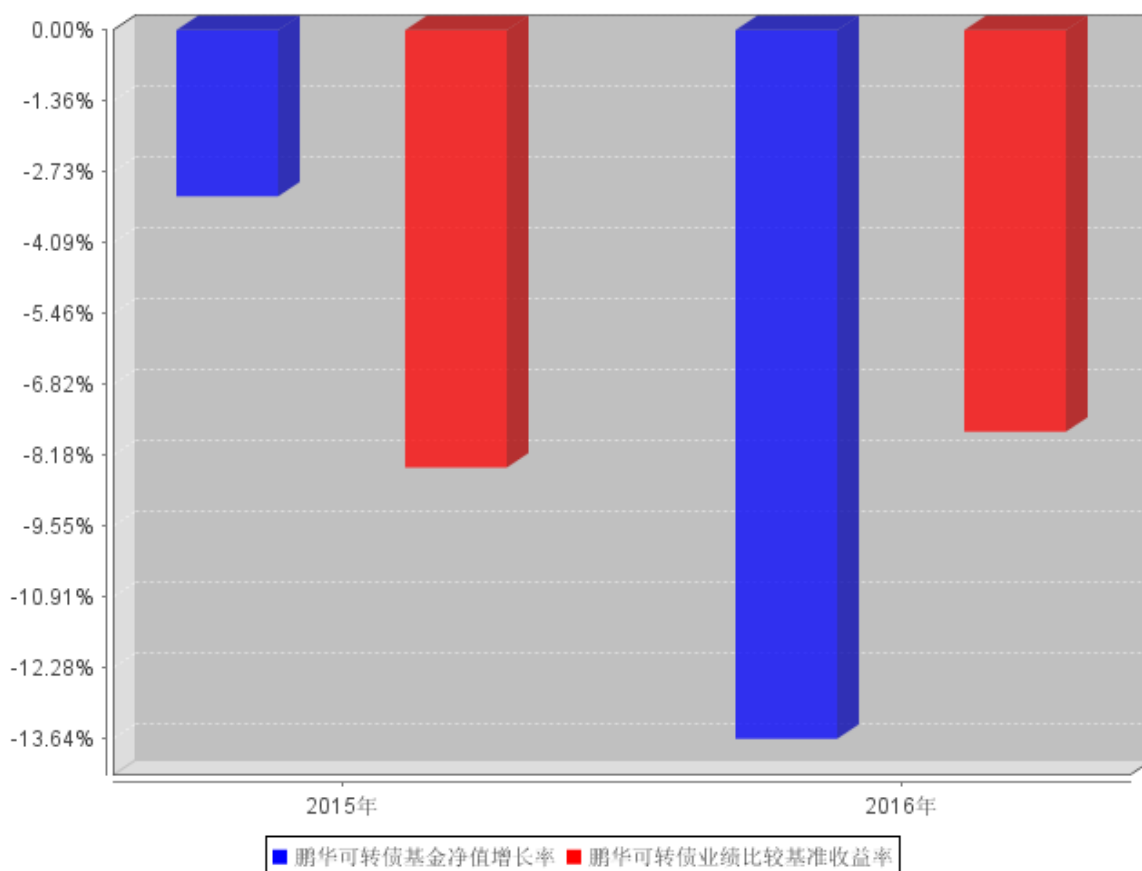
注：1、本基金基金合同于 2015 年 2 月 3 日生效。

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。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华可转债自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于 2015 年 2 月 3 日生效。截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

## §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 129 只基金和 10 只全国社保投资组合，经过 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的经验。

#### 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 3 日	2016 年 8 月 4 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）基金经理，2008 年 5 月至 2016 年 8 月兼任鹏华丰收债券基金基金经理，2013 年 9 月至 2016 年 8 月兼任鹏华双债保利债券基金基金经理，2015 年 2 月至 2016 年 8 月兼任鹏华可转债债券基金基金经理。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发生变动，阳先伟不再担任本基金基金经理，仅由伍旋担任本基金基金经理。
伍旋	本基金基金经理	2015 年 2 月 3 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，现同时担任权益投资一部副总经理。伍旋先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，阳先伟不再担任本基金基金经理，仅由伍旋担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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，本基金运作合法合规，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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资

信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

### 4.3.2 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。同时，根据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

### 4.3.3 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并对基金财产造成损失的异常交易行为。

本报告期内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% 的交易次数为 4 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

## 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 年经济运行在钢铁煤炭等行业推进供给侧改革、房地产去库存、基建投资 PPP、国企改革等方向演进。整体上，GDP 仍处在底部区域，前三季度同比增长 6.7%，但制造业生产却保持稳定，PMI 指数持续改善，工业增加值同比增速持续保持在 6% 以上的水平。金融市场上，人民币贬值、资本外流明显，叠加货币政策由稳健转为中性，导致股票、债券市场短期波动风险加大。年初股票市场遭遇熔断事件，年中英国脱欧事件、下半年美国加息以及总统大选等因素都对资本市场运行产生较大的影响，年末债市受利率突然跳升、流动性收紧的冲击，出现了较大幅度的调整。

2016 年中证全债指数上涨 2%，中证国债指数上涨 2.55%，中证转债下跌 11.76%，沪深 300 指数下跌 11.28%，创业板综指下跌 27.71%。全年来看，我们采取了较保守的投资策略，在可转债中选择较低的估值和具备一定竞争优势的上市企业。

### 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-13.64%，同期上证综指下跌 12.31%，深证成指下跌 19.64%，沪深 300 指数下跌 11.28%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，货币政策保持中性、金融行业去杠杆的宏观环境下，流动性偏紧，可转债市场

大概率仍会受制于供给不足，伴随 A 股市场供给侧改革、国企改革等政策的推出，预计存在一定的个券结构性机会。

#### 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，本基金可供分配利润为-9,015,188.07元，期末基金份额净值

0.836 元，不符合利润分配条件。

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

本报告期内，本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形；截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

### §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 12 月 31 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 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

Comment [□□□]: 注意事务所名称，2016 年基金的会计师事务所所有普华永道、毕马威和瑞华三家。

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		1,865,165.57	6,678,192.17
结算备付金		-	-
存出保证金		4,406.36	35,072.37
交易性金融资产		38,980,417.45	56,371,464.40
其中：股票投资		416,415.00	2,525,870.00
基金投资		-	-
债券投资		38,564,002.45	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		9,307,826.07	745,117.88
应收利息		108,009.38	88,263.59
应收股利		-	-
应收申购款		1,984.12	13,990.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		50,267,808.95	63,932,100.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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		3,876,098.53	-
应付赎回款		31,294.36	626,006.56
应付管理人报酬		39,747.33	54,808.32
应付托管费		7,949.45	10,961.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,661.28	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		430,058.82	287,368.04
负债合计		4,387,809.77	1,010,930.46
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		54,895,187.25	64,973,137.26
未分配利润		-9,015,188.07	-2,051,967.17
所有者权益合计		45,879,999.18	62,921,170.09
负债和所有者权益总计		50,267,808.95	63,932,100.55

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.836 元，基金份额总额 54,895,187.25 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 3 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-7,282,659.46	18,081,017.14
1. 利息收入		293,396.67	2,912,369.06
其中：存款利息收入		27,587.28	1,607,729.02
债券利息收入		263,621.20	96,559.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,188.19	1,208,080.41
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,025,576.17	15,800,383.20
其中：股票投资收益		-299,608.13	16,308,513.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,896,681.49	-1,226,343.40
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		170,713.45	718,213.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-5,561,100.69	-1,153,834.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		10,620.73	522,099.79

<b>减：二、费用</b>		1,044,032.59	2,589,823.48
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	529,216.11	1,562,683.89
2. 托管费	7.4.8.2.2	105,843.22	312,536.72
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		36,031.26	402,587.95
5. 利息支出		2,381.95	5,753.61
其中：卖出回购金融资产支出		2,381.95	5,753.61
6. 其他费用		370,560.05	306,261.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-8,326,692.05	15,491,193.66
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-8,326,692.05	15,491,193.66

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	-8,326,692.05	-8,326,692.05
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）	-10,077,950.01	1,363,471.15	-8,714,478.86
其中：1. 基金申购款	4,770,729.45	-565,711.48	4,205,017.97
2. 基金赎回款	-14,848,679.46	1,929,182.63	-12,919,496.83
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）	54,895,187.25	-9,015,188.07	45,879,999.18



日的基金份额总额为 430,571,056.16 份基金份额，其中认购资金利息折合 200,019.04 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华可转债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等。本基金同时投资于 A 股股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种以及法律、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。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于可转换债券(含分离交易可转债)的比例合计不低于非现金基金资产的 80%，股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；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%。

#### 7.4.2 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(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策变更等说明、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

##### 7.4.4.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.4.2 会计估计变更的说明

无。

**Comment [z]:** 该内容适用于老基金。首次披露年报的新基金仍需保留 7.4.4 和 7.4.5 的全部部分，不用修改和删除，请注意。

### 7.4.5 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(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，股票的股息、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，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。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 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。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

注：无。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 7.4.8.1.4 权证交易

注：无。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 3 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的管理费	529,216.11	1,562,683.89
其中：支付销售机构的客户维护费	222,855.11	661,061.30

注：（1）支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% ÷ 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。

#### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	105,843.22	312,536.72

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% ÷ 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本年度及上年度可比报告期管理人未投资、持有本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

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。

#### 7.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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	1,865,165.57	26,984.27	6,678,192.17

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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	416,415.00	0.83
	其中：股票	416,415.00	0.83
2	固定收益投资	38,564,002.45	76.72
	其中：债券	38,564,002.45	76.72



	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	1,865,165.57	3.71
7	其他各项资产	9,422,225.93	18.74
8	合计	50,267,808.95	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	416,415.00	0.91
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	-	-
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	416,415.00	0.91
--	----	------------	------

## 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

## 8.3 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	601311	骆驼股份	25,500	416,415.00	0.91

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的全部股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600201	生物股份	1,100,839.00	1.75
2	000952	广济药业	865,953.00	1.38
3	601006	大秦铁路	763,035.00	1.21
4	000605	渤海股份	606,874.00	0.96
5	300467	迅游科技	514,246.00	0.82
6	000718	苏宁环球	513,734.00	0.82
7	600831	广电网络	505,647.00	0.80
8	601311	骆驼股份	477,053.00	0.76
9	000848	承德露露	314,076.00	0.50
10	300095	华伍股份	305,471.00	0.49
11	601098	中南传媒	304,034.00	0.48
12	000890	法尔胜	302,037.00	0.48
13	600804	鹏博士	301,415.00	0.48
14	002235	安妮股份	300,428.00	0.48
15	300012	华测检测	299,497.00	0.48
16	300357	我武生物	298,761.00	0.47
17	600395	盘江股份	290,792.00	0.46
18	000786	北新建材	289,444.00	0.46

19	002185	华天科技	287,633.00	0.46
20	002594	比亚迪	284,447.00	0.45

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。

#### 8.4.2 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	601398	工商银行	2,443,145.00	3.88
2	600201	生物股份	1,150,981.00	1.83
3	601006	大秦铁路	751,205.00	1.19
4	000952	广济药业	724,421.00	1.15
5	300467	迅游科技	543,668.00	0.86
6	000605	渤海股份	543,356.00	0.86
7	600831	广电网络	507,390.00	0.81
8	000718	苏宁环球	501,870.00	0.80
9	300095	华伍股份	348,126.00	0.55
10	600804	鹏博士	337,736.00	0.54
11	300012	华测检测	319,200.00	0.51
12	002185	华天科技	316,738.66	0.50
13	000848	承德露露	305,942.00	0.49
14	002594	比亚迪	303,800.00	0.48
15	300357	我武生物	303,133.08	0.48
16	002094	青岛金王	299,728.00	0.48
17	002217	合力泰	288,189.93	0.46
18	002051	中工国际	272,679.20	0.43
19	000786	北新建材	271,158.00	0.43
20	002235	安妮股份	269,149.00	0.43

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。

#### 8.4.3 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	10,724,567.00
卖出股票收入（成交）总额	12,528,925.87

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。

## 8.5 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	1,498,050.00	3.27
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）	37,065,952.45	80.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,564,002.45	84.05

## 8.6 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	110031	航信转债	86,410	9,382,397.80	20.45
2	113008	电气转债	81,510	9,327,189.30	20.33
3	110030	格力转债	60,310	6,864,484.20	14.96
4	132002	15天集EB	52,540	5,575,019.40	12.15
5	123001	蓝标转债	20,000	2,174,200.00	4.74

## 8.7 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：无。

## 8.8 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：无。

## 8.9 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：无。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 8.10.3 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。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 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	4,406.36
2	应收证券清算款	9,307,826.07
3	应收股利	-
4	应收利息	108,009.38
5	应收申购款	1,984.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,422,225.93

### 8.11.4 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	110031	航信转债	9,382,397.80	20.45
2	113008	电气转债	9,327,189.30	20.33
3	110030	格力转债	6,864,484.20	14.96
4	132002	15天集EB	5,575,019.40	12.15
5	123001	蓝标转债	2,174,200.00	4.74
6	128010	顺昌转债	1,801,537.47	3.93
7	128012	辉丰转债	1,616,737.28	3.52

8	110034	九州转债	324,387.00	0.71
---	--------	------	------------	------

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 8.11.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
2,151	25,520.78	0.0	0.00%	54,895,187.25	100.00%

### 9.2 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	5,982.9	0.0109%

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。

### 9.3 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。

## §10 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	4,770,729.45
减:本报告期基金总赎回份额	14,848,679.46
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	54,895,187.25

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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

1、报告期内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。

经公司董事会审议通过,公司同意聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动:

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。

### 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为两年。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	12,865,142.87	55.33%	11,724.02	55.33%	-
国金证券	1	9,622,952.00	41.38%	8,769.19	41.38%	-
银河证券	1	398,836.00	1.72%	363.46	1.72%	-
中信建投	1	214,720.00	0.92%	195.67	0.92%	报告期新增
东兴证券	2	151,842.00	0.65%	138.40	0.65%	报告期新增一个
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	报告期新增
东方证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	报告期新增一个
光大证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	报告期新增
海通证券	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。

### 11.7.2 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	5,785,803.53	25.49%	-	-	-	-
国金证券	16,902,498.59	74.46%	10,000,000.00	100.00%	-	-
银河证券	10,968.20	0.05%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

---

海通证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

鹏华基金管理有限公司  
2017年3月30日