

# 鹏华可转债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	9
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	10
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>11</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	11
3.2 基金净值表现.....	11
3.3 其他指标.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.11 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
11.1 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.....	52

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华可转债债券型证券投资基金
基金简称	鹏华可转债
场内简称	-
基金主代码	000297
基金交易代码	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	56,535,187.01 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	<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</p>

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、债券选择策略等积极投资策略。

#### 1) 久期策略

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。

#### 2) 类属配置策略

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。

#### 3) 收益率曲线策略

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。

#### 4) 骑乘策略

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。

#### 5) 息差策略

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。

#### 6) 债券选择策略

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。

#### 7) 中小企业私募债投资策略

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  
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



	<p>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
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		何如	周慕冰

### 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	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>

网址	
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第 43 层鹏华基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

### § 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-7,745,422.64
本期利润	44,012.07
加权平均基金份额本期利润	0.0008
本期加权平均净值利润率	0.10%
本期基金份额净值增长率	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-9,262,096.48
期末可供分配基金份额利润	-0.1638
期末基金资产净值	47,273,090.53
期末基金份额净值	0.836
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-16.40%

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

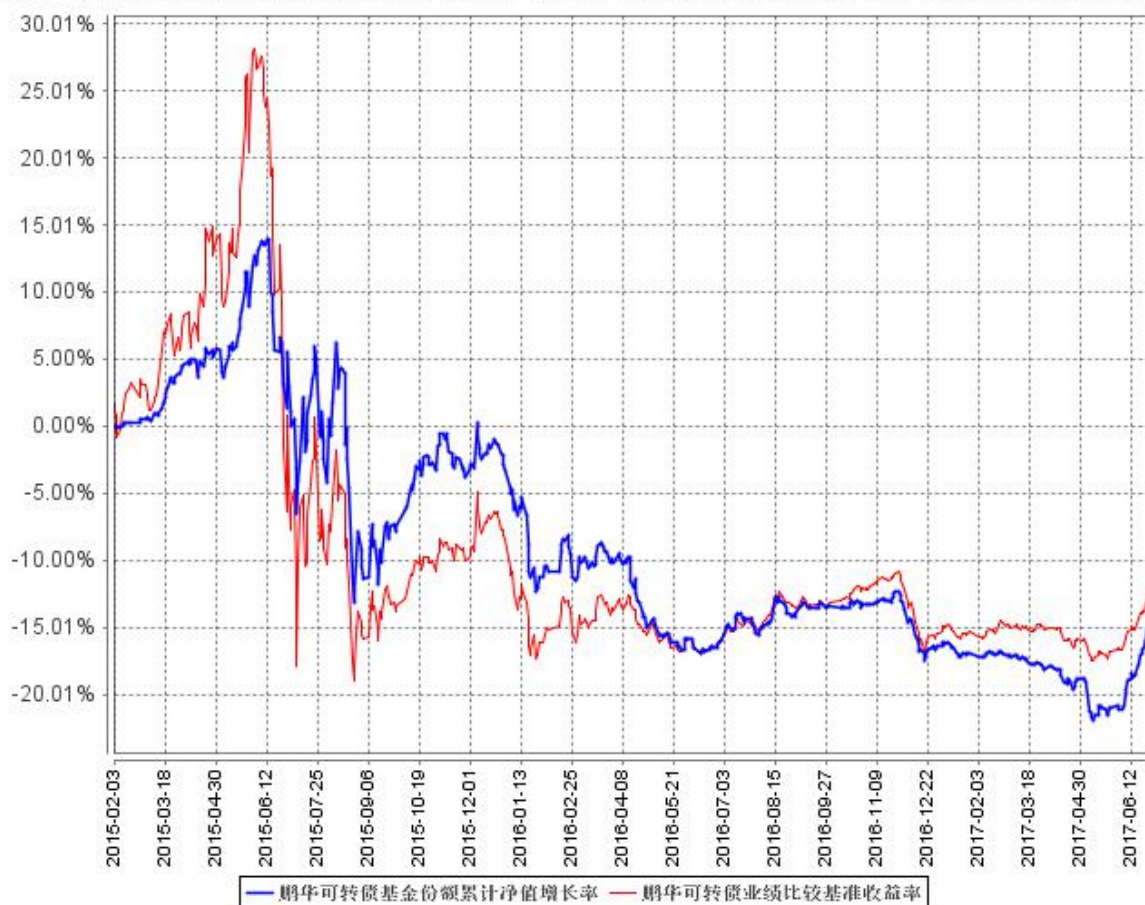
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.69%	0.57%	3.82%	0.37%	1.87%	0.20%
过去三个月	2.08%	0.57%	2.08%	0.35%	0.00%	0.22%
过去六个月	0.00%	0.42%	2.41%	0.29%	-2.41%	0.13%
过去一年	-0.48%	0.39%	3.04%	0.34%	-3.52%	0.05%
自基金合同生效起至今	-16.40%	0.96%	-13.46%	1.35%	-2.94%	-0.39%

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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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 2017 年 6 月，公司管理资产总规模达到 4509.30 亿元，管理 149 只公募基金、10 只全国社保投资组合、2 只基本养老保险投资组合。经过近 19 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		
李振宇	本基金基金经理	2017 年 2 月 4 日	-	5	李振宇先生，国籍中国，经济学硕士，5 年证券基金从业经验。曾任银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，从事债券投资研究工作；2016 年 8 月加盟鹏华基金管理有限公司，担任固定收益部投资经理，2016 年 12 月起担任鹏华丰惠债券、鹏华丰盈债券基金基金经理，2017 年 2 月起兼任鹏华可转债基金基金经理。李振宇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，增聘李振宇担任本基金基金经理，伍旋不再担任本基金基金经理。
伍旋	本基金基金经理	2015 年 2 月 3 日	2017 年 2 月 4 日	11	伍旋先生，国籍中国，工商管理硕士，11 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

					<p>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月至2017年2月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，增聘李振宇担任本基金基金经理，伍旋不再担任本基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

一季度债市先跌后小幅上涨，权益市场一季度先跌后涨，整体震荡向上。转债方面整体处于

震荡格局，由于预期未来转债供给将大幅增加，中枢略微有所下降。二季度，债市收益率总体上行，股市方面受监管影响下跌，其后于 6 月开始反弹。转债方面，四至五月转债跟随股债下跌，六月流动性驱动使得转债涨幅较大。在转债的配置上，我们一月份以防守类转债配置为主，二至三月逐步调整仓位跟随转债指数，从而使得组合净值在一季度转债市场走弱的情况下表现相对稳健。本基金在二季度初基本保持了较低仓位，其后，随着市场转暖，适度增加了股票和转债仓位，获得了一定的超额回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.836 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.00%，业绩比较基准收益率为 2.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济方面，由于前期地产销售较好，加之库存较低以及三四线城市棚改货币化等因素影响，地产投资仍然处于较好水平，同时，前期财政支出力度较大，叠加低基数影响，经济短期内预计仍然较为平稳；但是考虑到金融环境的收缩以及地产销售下行，地产投资未来仍然面临下行压力，另外，财政整肃也将影响基建投资增速。通胀方面，未来预计保持稳中有下。因此，对于货币政策而言，货币政策进一步收紧概率较低。同时，金融监管加强协调，未来造成市场大幅冲击概率较低。

因此，对于债市而言，未来存在一定的投资机会。股市方面，未来预计仍然以结构性行情为主。可转债方面，市场整体估值合理，随着一级市场新发转债不断增加，未来将出现较多的个券投资机会。

#### 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-9,262,096.48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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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半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，未发现有关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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,578,364.89	1,865,165.57
结算备付金		305,409.13	-
存出保证金		17,771.01	4,406.36
交易性金融资产	6.4.7.2	45,056,318.92	38,980,417.45
其中：股票投资		4,172,132.15	416,415.00
基金投资		-	-
债券投资		40,884,186.77	38,564,002.45
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	800,000.00	-
应收证券清算款		2,078,769.79	9,307,826.07
应收利息	6.4.7.5	127,773.58	108,009.38
应收股利		-	-
应收申购款		99.40	1,984.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,964,506.72	50,267,808.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,227,290.90	3,876,098.53
应付赎回款		30,318.14	31,294.36
应付管理人报酬		36,296.01	39,747.33
应付托管费		7,259.21	7,949.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	36,617.15	2,661.28
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	353,634.78	430,058.82
负债合计		4,691,416.19	4,387,809.77
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	56,535,187.01	54,895,187.25
未分配利润	6.4.7.10	-9,262,096.48	-9,015,188.07
所有者权益合计		47,273,090.53	45,879,999.18
负债和所有者权益总计		51,964,506.72	50,267,808.95

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8360 元，基金份额总额 56,535,187.01 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		605,322.17	-7,702,166.83
1.利息收入		189,636.93	152,706.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,935.06	14,384.94
债券利息收入		153,582.96	138,321.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,118.91	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,392,572.41	-667,472.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	28,938.21	-314,239.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-7,431,524.63	-361,127.40
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	10,014.01	7,894.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,789,434.71	-7,193,212.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	18,822.94	5,811.49
<b>减：二、费用</b>		561,310.10	532,155.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	218,921.00	277,762.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,784.17	55,552.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	102,035.76	17,010.72

5. 利息支出		10,384.05	-
其中：卖出回购金融资产支出		10,384.05	-
6. 其他费用	6.4.7.20	186,185.12	181,830.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		44,012.07	-8,234,321.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		44,012.07	-8,234,321.94

### 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	54,895,187.25	-9,015,188.07	45,879,999.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,012.07	44,012.07
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）	1,639,999.76	-290,920.48	1,349,079.28
其中：1.基金申购款	26,581,696.86	-4,825,690.51	21,756,006.35
2.基金赎回款	-24,941,697.10	4,534,770.03	-20,406,927.07
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）	56,535,187.01	-9,262,096.48	47,273,090.53
项目	上年度可比期间 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	64,973,137.26	-2,051,967.17	62,921,170.09

金净值)			
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

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:

<u>          邓召明          </u>	<u>          高鹏          </u>	<u>          郝文高          </u>
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

鹏华可转债债券型证券投资基金(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[2013]1023号《关于核准鹏华可转债债券型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《鹏华可转债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集430,371,037.12元,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(2015)第108号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华可转债债券型证券投资基金基金合同》于2015年2月3日正式生效,基金合同生效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,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的股票、

债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：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%。本基金业绩比较基准为：中证可转换债券指数×60%+中债总指数×30%+沪深 300 指数×10%。

#### 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 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。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。

(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。

## 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	3,578,364.89
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,578,364.89

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		4,036,474.89	4,172,132.15	135,657.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	39,945,344.92	40,884,186.77	938,841.85
	银行间市场	-	-	-
	合计	39,945,344.92	40,884,186.77	938,841.85
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		43,981,819.81	45,056,318.92	1,074,499.11

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	800,000.00	-
合计	800,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	314.15
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	123.66
应收债券利息	127,328.57
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	7.20
合计	127,773.58

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	36,617.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	36,617.15

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	73.88
预提费用	353,560.90
合计	353,634.78

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,895,187.25	54,895,187.25
本期申购	26,581,696.86	26,581,696.86
本期赎回(以“-”号填列)	-24,941,697.10	-24,941,697.10
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	56,535,187.01	56,535,187.01

注：申购含红利再投、转换入份额。赎回含转换出份额。

**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	436,232.42	-9,451,420.49	-9,015,188.07
本期利润	-7,745,422.64	7,789,434.71	44,012.07
本期基金份额交易产生的变动数	-305,214.84	14,294.36	-290,920.48
其中：基金申购款	-1,656,155.48	-3,169,535.03	-4,825,690.51
基金赎回款	1,350,940.64	3,183,829.39	4,534,770.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,614,405.06	-1,647,691.42	-9,262,096.48

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	9,557.37
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	2,320.10
其他	1,057.59
合计	12,935.06

注：其他为申购款利息收入与结算保证金利息收入。

**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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	33,193,582.21
减：卖出股票成本总额	33,164,644.00
买卖股票差价收入	28,938.21

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,431,524.63
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-7,431,524.63

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	86,894,303.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	93,936,288.87
减：应收利息总额	389,539.46
买卖债券差价收入	-7,431,524.63

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,014.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,014.01

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	7,789,434.71
——股票投资	196,295.26
——债券投资	7,593,139.45
——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	7,789,434.71

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日

基金赎回费收入	18,494.30
转换费收入	328.64
合计	18,822.94

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	102,035.76
银行间市场交易费用	-
合计	102,035.76

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
账户维护费	9,050.00
银行汇划费用	3,574.22
合计	186,185.12

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 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。

## 6.4.10 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

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

### 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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	218,921.00	277,762.00

其中：支付销售机构的客户维护费	87,998.69	116,816.02
-----------------	-----------	------------

注：（1）支付基金管理人鹏华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%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%÷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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	43,784.17	55,552.37

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 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：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

#### 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
基金合同生效日（2015年2月3日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	6,128,409.71	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,128,409.71	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.84%	-

注：（1）本基金管理人于 2017 年 4 月 17 日申购本基金 2,447,213.60 份，4 月 19 日申购本基金 3,681,196.11 份。

（2）本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

#### 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

注：本基金本报告期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。

#### 6.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	3,578,364.89	9,557.37	3,505,195.90	13,913.07

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期没有参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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（2017 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：无。

##### 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
002499	科林环保	2017 年 4 月	重大	28.92	2017 年 7 月	26.03	7,502	209,621.08	216,957.84	-



		月 20 日	事 项		月 11 日				
--	--	-----------	--------	--	-----------	--	--	--	--

### 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，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，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

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资债券等固定收益类金融工具。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。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约责任，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会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

中国农业银行股份有限公司，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。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	2,613,766.40	1,498,050.00
合计	2,613,766.40	1,498,050.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	19,287,154.10	18,709,587.10
AAA 以下	18,983,266.27	18,356,365.35
未评级	0.00	0.00
合计	38,270,420.37	37,065,952.45

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

#### 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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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同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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 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。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	3,578,364.89	-	-	-	3,578,364.89
结算备付金	305,409.13	-	-	-	305,409.13
存出保证金	17,771.01	-	-	-	17,771.01
交易性金融资产	5,167,946.90	32,595,660.87	3,120,579.00	4,172,132.15	45,056,318.92
买入返售金融资产	800,000.00	-	-	-	800,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-2,078,769.79	2,078,769.79
应收利息	-	-	-	127,773.58	127,773.58
应收申购款	-	-	-	99.40	99.40
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,869,491.93	32,595,660.87	3,120,579.00	6,378,774.92	51,964,506.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-4,227,290.90	4,227,290.90
应付赎回款	-	-	-	30,318.14	30,318.14
应付管理人报酬	-	-	-	36,296.01	36,296.01
应付托管费	-	-	-	7,259.21	7,259.21
应付交易费用	-	-	-	36,617.15	36,617.15
其他负债	-	-	-	353,634.78	353,634.78
负债总计	-	-	-	-4,691,416.19	4,691,416.19
利率敏感度缺口	9,869,491.93	32,595,660.87	3,120,579.00	1,687,358.73	47,273,090.53
上年度末 2016 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	1,865,165.57	-	-	-	1,865,165.57
存出保证金	4,406.36	-	-	-	4,406.36
交易性金融资产	1,498,050.00	33,323,290.70	3,742,661.75	416,415.00	38,980,417.45
应收证券清算款	-	-	-	-9,307,826.07	9,307,826.07
应收利息	-	-	-	108,009.38	108,009.38
应收申购款	-	-	-	1,984.12	1,984.12
资产总计	3,367,621.93	33,323,290.70	3,742,661.75	9,834,234.57	50,267,808.95
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-3,876,098.53	3,876,098.53
应付赎回款	-	-	-	31,294.36	31,294.36
应付管理人报酬	-	-	-	39,747.33	39,747.33
应付托管费	-	-	-	7,949.45	7,949.45
应付交易费用	-	-	-	2,661.28	2,661.28
其他负债	-	-	-	430,058.82	430,058.82
负债总计	-	-	-	-4,387,809.77	4,387,809.77
利率敏感度缺口	3,367,621.93	33,323,290.70	3,742,661.75	5,446,424.80	45,879,999.18

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

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	3,934.39	1,255.65
	市场利率上升 25 个基点	-3,922.59	-1,251.54

#### 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。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；投资与可转换债券（含分离交易可转债）的比例合计不低于非现金资产的 80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%。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 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	4,172,132.15	8.83	416,415.00	0.91
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,172,132.15	8.83	416,415.00	0.91

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 8.83%（2016 年 12 月 31 日：0.91%）因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

**6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

无。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂

适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	4,172,132.15	8.03
	其中：股票	4,172,132.15	8.03
2	固定收益投资	40,884,186.77	78.68
	其中：债券	40,884,186.77	78.68
	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	800,000.00	1.54
	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	3,883,774.02	7.47
7	其他各项资产	2,224,413.78	4.28
8	合计	51,964,506.72	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,545,715.91	7.50
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	174,498.24	0.37
K	房地产业	451,918.00	0.96
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	4,172,132.15	8.83

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

## 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

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	002241	歌尔股份	114,644	2,210,336.32	4.68
2	600383	金地集团	39,400	451,918.00	0.96
3	000651	格力电器	9,973	410,588.41	0.87
4	600887	伊利股份	11,626	251,005.34	0.53
5	600741	华域汽车	9,500	230,280.00	0.49
6	600660	福耀玻璃	8,700	226,548.00	0.48
7	002499	科林环保	7,502	216,957.84	0.46
8	601601	中国太保	5,152	174,498.24	0.37

## 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	002241	歌尔股份	2,959,353.80	6.45
2	601336	新华保险	2,933,282.49	6.39
3	600030	中信证券	2,629,677.99	5.73
4	601601	中国太保	1,738,505.14	3.79
5	601688	华泰证券	1,582,263.00	3.45
6	000651	格力电器	1,397,926.00	3.05
7	601555	东吴证券	1,299,400.00	2.83
8	601211	国泰君安	1,084,447.00	2.36

9	600887	伊利股份	1,081,817.00	2.36
10	600383	金地集团	913,087.00	1.99
11	600004	白云机场	851,627.74	1.86
12	601318	中国平安	850,694.00	1.85
13	600729	重庆百货	844,600.00	1.84
14	600031	三一重工	835,078.35	1.82
15	600570	恒生电子	651,017.00	1.42
16	000858	五粮液	645,686.94	1.41
17	601939	建设银行	637,361.00	1.39
18	000063	中兴通讯	635,162.00	1.38
19	002419	天虹商场	547,437.15	1.19
20	600660	福耀玻璃	447,414.00	0.98

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	601336	新华保险	2,897,483.82	6.32
2	600030	中信证券	2,628,606.43	5.73
3	601688	华泰证券	1,603,353.00	3.49
4	601601	中国太保	1,589,513.20	3.46
5	601555	东吴证券	1,290,000.00	2.81
6	000651	格力电器	1,180,430.06	2.57
7	601211	国泰君安	1,115,817.00	2.43
8	600004	白云机场	928,419.22	2.02
9	601318	中国平安	924,766.00	2.02
10	600887	伊利股份	898,383.27	1.96
11	600031	三一重工	823,014.78	1.79
12	600729	重庆百货	791,020.18	1.72
13	002241	歌尔股份	783,103.81	1.71
14	000063	中兴通讯	705,096.76	1.54
15	000858	五粮液	668,506.72	1.46
16	600570	恒生电子	652,296.86	1.42
17	601939	建设银行	643,043.40	1.40
18	002419	天虹股份	530,692.00	1.16
19	000069	华侨城 A	455,304.00	0.99

20	600383	金地集团	453,100.00	0.99
----	--------	------	------------	------

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	36,724,065.89
卖出股票收入（成交）总额	33,193,582.21

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

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	2,613,766.40	5.53
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）	38,270,420.37	80.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,884,186.77	86.49

### 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	132007	16 凤凰 EB	67,880	6,337,955.60	13.41
2	110032	三一转债	47,530	5,646,564.00	11.94
3	132008	17 山高 EB	45,440	4,371,328.00	9.25
4	110034	九州转债	34,180	4,325,479.00	9.15
5	110033	国贸转债	36,360	4,305,751.20	9.11

### 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股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.11.2 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	17,771.01
2	应收证券清算款	2,078,769.79
3	应收股利	-
4	应收利息	127,773.58
5	应收申购款	99.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,224,413.78

**7.11.3 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	110032	三一转债	5,646,564.00	11.94
2	110034	九州转债	4,325,479.00	9.15
3	110033	国贸转债	4,305,751.20	9.11
4	132002	15 天集 EB	2,669,273.00	5.65
5	132001	14 宝钢 EB	2,554,180.50	5.40
6	132004	15 国盛 EB	1,881,762.00	3.98
7	132006	16 皖新 EB	1,411,120.80	2.99
8	113009	广汽转债	1,021,349.00	2.16
9	128010	顺昌转债	624,175.20	1.32
10	128011	汽模转债	903.07	0.00

#### 7.11.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002499	科林环保	216,957.84	0.46	重大事项

#### 7.11.5 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
1,975	28,625.41	6,128,409.71	10.84%	50,406,777.30	89.16%

### 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	0.00%

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

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	54,895,187.25
本报告期基金总申购份额	26,581,696.86
减：本报告期基金总赎回份额	24,941,697.10
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	56,535,187.01

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

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，公司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。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	



			例			
东兴证券	2	36,187,498.68	53.50%	32,977.67	53.50%	-
海通证券	1	7,612,179.77	11.25%	6,937.02	11.25%	-
申万宏源	2	4,905,438.39	7.25%	4,470.34	7.25%	-
国金证券	1	4,612,995.99	6.82%	4,203.82	6.82%	-
长江证券	1	4,425,623.90	6.54%	4,033.04	6.54%	-
中金公司	1	3,420,080.51	5.06%	3,116.75	5.06%	-
华泰证券	2	3,338,524.37	4.94%	3,042.42	4.94%	-
中信证券	1	3,134,736.20	4.63%	2,856.66	4.63%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	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
东兴证券	126,380,519.48	73.88%	200,000,000.00	84.46%	-	-
海通证券	20,717,024.79	12.11%	20,200,000.00	8.53%	-	-
申万宏源	3,669,731.69	2.15%	-	-	-	-
国金证券	3,320,143.84	1.94%	16,600,000.00	7.01%	-	-
长江证券	6,218,755.34	3.64%	-	-	-	-
中金公司	7,592,296.55	4.44%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	3,167,485.60	1.85%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

## 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	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与张家港农村商业银行柜面和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》	2017年1月3日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京肯特瑞财富投资管理有限公司认\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》	2017年1月10日
3	鹏华基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月10日
4	2016年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月19日
5	鹏华可转债债券型证券投资基金	《中国证券报》、《上	2017年2月4日

	基金经理变更公告	海证券报》、《证券时报》	
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道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》	2017 年 2 月 23 日
7	鹏华基金管理有限公司关于增加民生证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 1 日
8	鹏华可转债债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 11 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认\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》	2017 年 3 月 20 日
10	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》	2017 年 3 月 23 日
11	鹏华基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 30 日
12	2016 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 30 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与张家港农村商业银行柜面和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》	2017 年 3 月 31 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道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》	2017 年 4 月 22 日
15	2017 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 24 日
16	鹏华基金管理有限公司关于网上直销交易系统升级切换及启用新版网上直销交易系统的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 27 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华可转债债券型证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华可转债债券型证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华可转债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告》(原文)。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 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

### 12.3 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

2017 年 8 月 28 日