

# 鹏华可转债债券型证券投资基金 2018 年 半年度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

## 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 2018 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 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	57,874,961.75 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	贺倩
	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	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
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

### § 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（2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	-635,972.35
本期利润	-2,337,496.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0405
本期基金份额净值增长率	-2.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018 年 06 月 30 日）
期末可供分配基金份额利润	-0.1685
期末基金资产净值	48,123,610.18
期末基金份额净值	0.832

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	-3.37	0.69	-2.33	0.58	-1.04	0.11
过去三个月	-5.13	0.69	-3.72	0.49	-1.41	0.20
过去六个月	-2.80	0.81	-1.13	0.55	-1.67	0.26
过去一年	-0.48	0.67	-1.91	0.47	1.43	0.20

过去三年	-21.21	0.88	-15.77	0.98	-5.44	-0.10
自基金成立 起至今	-16.80	0.89	-15.11	1.16	-1.69	-0.27

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



## § 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 2018 年 6 月,公司管理资产总规模达到 5,232.30 亿元,管理 152 只公募基金、10 只全国社保投资组合、3 只基本养老保险投资组合。经过近 20 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	2017-02-04	-	6	李振宇先生，国籍中国，经济学硕士，6 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 月担任鹏华丰盈债券基金基金经理，2016 年 12 月担任鹏华丰惠债券基金基金经理，2017 年 02 月担任鹏华可转债基金基金经理，2017 年 05 月担任鹏华丰康债券基金基金经理，2017 年 05 月担任鹏华金城保本混合基金基金经理，2018 年 06 月担任鹏华安益增强混合基金基金经理，2018 年 06 月担任鹏华尊享发起式定开债券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

权益市场在年初配置需求释放、资金总体宽松影响下快速上涨，后续受到美国股市调整、中美贸易争端持续发酵、信用风险频发等因素影响呈现下跌态势，上证综指在上半年下跌 13.90%。转债市场主要受到正股表现的驱动，在一月份冲高后持续下跌，中证转债指数下跌 2.17%；由于转债市场估值总体处于历史低位，且债券市场资金面偏宽松，导致转债的跌幅相对较小。

报告期内本基金在一季度总体保持中等仓位，精选优质转债和股票进行配置，并在年初增加仓位，在市场波动增加后降低仓位；二季度本基金在前期降低了转债和股票的仓位，在市场持续下跌的过程中适度增加了优质转债的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-2.80%，业绩比较基准收益率为-1.13%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，受金融监管影响，表外非标融资明显收缩，社融增速持续回落，对后续的经济可能产生一定的负面影响；净出口方面，外部需求对国内出口增速的拉动作用边际有所放缓，叠加中美贸易摩擦的升级，预计净出口对经济的贡献会显著下降；基建投资受到信用收缩、地方政府债务严格严管影响增速下行，后续财政政策可能更加积极，但基建增速短期难以大幅回升；

房地产投资增速的高增主要源于土地购置费的贡献，其对实际经济增速的拉动作用或相对有限；制造业投资和消费维持平稳。物价方面，预计 CPI 同比增速整体仍将维持低位，PPI 同比增速的趋势主要受翘尾因素的影响，后续或将进入回落区间。总体来看，未来经济仍面临一定的下行压力，通货膨胀的压力不大。

债券市场方面，由于经济基本面仍然处于下行通道，货币政策维持宽松，预计债券市场收益率易降难升。利率债方面，长端利率债较早反映了经济基本面的下行预期，今年以来出现了较大幅度的下行，后续空间有所缩窄；信用债方面，中低评级信用债受融资环境紧缩影响，市场对其信用风险担忧上升，收益率下行幅度小于高评级信用债，后续融资环境改善将有助于修复中低评级信用债的利差。

权益市场方面，短期监管政策的微调有助于缓和市场的悲观情绪，但受制于宏观经济基本面，权益市场可能延续震荡偏弱的走势，部分板块可能会出现结构性行情。

可转债方面，虽然受权益市场影响，可转债市场可能难以出现整体大幅上涨的行情，但目前可转债市场具备一定的投资机会。一方面，当前转债市场估值处于较为合理的位置，部分转债估值便宜，性价比较高；另一方面，目前市场新发转债较多，可选择的个券大幅增加，投资机会也相应增多。

#### 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[2017]13号《中国证监会关于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. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

### 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-9,751,351.57 元，期末基金份额净值 0.832 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

本基金自 2017 年 11 月 22 日至 2018 年 1 月 24 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## § 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,373,371.39	1,675,211.09
结算备付金	854,937.37	778,286.96
存出保证金	45,066.91	52,509.49
交易性金融资产	44,767,398.48	40,778,912.51
其中：股票投资	3,213,322.91	3,879,453.74
基金投资	-	-
债券投资	41,554,075.57	36,899,458.77
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	3,958,840.30	194,569.75
应收利息	173,925.87	147,382.38
应收股利	-	-
应收申购款	4,752.87	1,009.19
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	51,178,293.19	43,627,881.37
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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	-	3,000,000.00
应付证券清算款	2,785,334.71	-
应付赎回款	487.95	-

应付管理人报酬	40,210.59	38,055.32
应付托管费	8,042.13	7,611.07
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	48,977.38	52,704.97
应交税费	548.30	-
应付利息	-	-1,397.68
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	171,081.95	305,000.00
负债合计	3,054,683.01	3,401,973.68
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	57,874,961.75	46,979,255.45
未分配利润	-9,751,351.57	-6,753,347.76
所有者权益合计	48,123,610.18	40,225,907.69
负债和所有者权益总计	51,178,293.19	43,627,881.37

注：报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.832 元，基金份额总额 57,874,961.75 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：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-1,620,087.27	605,322.17
1. 利息收入		203,914.45	189,636.93
其中：存款利息收入		18,109.67	12,935.06
债券利息收入		181,763.88	153,582.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,040.90	23,118.91
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-137,239.99	-7,392,572.41
其中：股票投资收益		-615,289.73	28,938.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益		406,579.86	-7,431,524.63
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		71,469.88	10,014.01
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-1,701,524.27	7,789,434.71
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)		14,762.54	18,822.94
减：二、费用		717,409.35	561,310.10
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	253,427.05	218,921.00
2. 托管费	6.4.8.2.2	50,685.41	43,784.17
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		142,107.57	102,035.76
5. 利息支出		87,280.31	10,384.05
其中：卖出回购金融资产支出		87,280.31	10,384.05
6. 税金及附加		302.45	-
7. 其他费用		183,606.56	186,185.12
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,337,496.62	44,012.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,337,496.62	44,012.07

### 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：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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）	46,979,255.45	-6,753,347.76	40,225,907.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,337,496.62	-2,337,496.62
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）	10,895,706.30	-660,507.19	10,235,199.11
其中：1. 基金申购款	28,731,354.55	-2,533,364.93	26,197,989.62

2. 基金赎回款	-17,835,648.25	1,872,857.74	-15,962,790.51
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）	57,874,961.75	-9,751,351.57	48,123,610.18
项目	上年度可比期间 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

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：

邓召明

苏波

郝文高

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（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》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年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 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 年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[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《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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（“鹏华基金公司”）	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

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

注：无。

###### 6.4.8.1.2 债券交易

注：无。

###### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

###### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。



## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	253,427.05	218,921.00
其中：支付销售机构的客户维护费	71,698.76	87,998.69

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 1.00%，逐日计提，按月支付。日管理费=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。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	50,685.41	43,784.17

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。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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。

## 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年
----	-------------------------------	------------------------------------

	6 月 30 日	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	6,128,409.71	-
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	6,128,409.71
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.5891%	10.8400%

注：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。

#### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		2017 年 1 月 1 日 至 2017 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	1,373,371.39	10,365.13	3,578,364.89	9,557.37

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。

#### 6.4.8.6 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未参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 6.4.9 期末(2018 年 06 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：无。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

### 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

注：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

注：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	3,213,322.91	6.28
	其中：股票	3,213,322.91	6.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,554,075.57	81.19
	其中：债券	41,554,075.57	81.19
	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	2,228,308.76	4.35
8	其他各项资产	4,182,585.95	8.17
9	合计	51,178,293.19	100.00

### 7.2 报告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

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	114,838.86	0.24
B	采矿业	-	-
C	制造业	821,386.00	1.71
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	175,827.80	0.37

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	124,982.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,422,486.65	2.96
J	金融业	553,801.60	1.15
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	3,213,322.91	6.68

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600845	宝信软件	43,979	1,158,846.65	2.41
2	002262	恩华药业	20,000	400,200.00	0.83
3	601318	中国平安	5,720	335,077.60	0.70
4	300003	乐普医疗	7,700	282,436.00	0.59
5	300047	天源迪科	16,900	263,640.00	0.55
6	600030	中信证券	13,200	218,724.00	0.45
7	002419	天虹股份	12,043	175,827.80	0.37
8	000799	酒鬼酒	5,000	138,750.00	0.29
9	600258	首旅酒店	4,600	124,982.00	0.26
10	002234	民和股份	9,917	114,838.86	0.24

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com.cn> 的半年度报告正文。

## 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	601233	桐昆股份	2,064,510.00	5.13
2	600570	恒生电子	1,838,939.80	4.57
3	601688	华泰证券	1,785,664.00	4.44
4	600030	中信证券	1,784,229.00	4.44
5	000002	万 科A	1,675,104.05	4.16
6	300047	天源迪科	1,579,482.00	3.93
7	002234	民和股份	1,289,524.23	3.21
8	600845	宝信软件	1,114,462.73	2.77
9	601111	中国国航	1,039,891.00	2.59
10	002142	宁波银行	1,026,720.00	2.55
11	603757	大元泵业	1,020,659.00	2.54
12	600409	三友化工	1,015,364.00	2.52
13	600115	东方航空	1,013,415.00	2.52
14	603799	华友钴业	983,959.00	2.45
15	601318	中国平安	969,891.00	2.41
16	002563	森马服饰	930,232.00	2.31
17	300568	星源材质	920,287.00	2.29
18	600352	浙江龙盛	912,761.00	2.27
19	002419	天虹股份	878,761.00	2.18
20	601225	陕西煤业	876,298.00	2.18
21	601939	建设银行	813,469.00	2.02

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

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	601233	桐昆股份	2,142,777.99	5.33
2	000002	万 科A	1,811,767.44	4.50
3	601688	华泰证券	1,810,489.58	4.50
4	600570	恒生电子	1,774,461.41	4.41
5	300047	天源迪科	1,500,257.46	3.73
6	600030	中信证券	1,465,832.00	3.64
7	601939	建设银行	1,251,707.94	3.11
8	601111	中国国航	1,228,446.62	3.05
9	002234	民和股份	1,113,063.81	2.77
10	601318	中国平安	1,109,593.47	2.76

11	603799	华友钴业	1,104,572.00	2.75
12	600436	片仔癀	1,078,704.00	2.68
13	300568	星源材质	1,022,964.40	2.54
14	002563	森马服饰	995,718.83	2.48
15	600115	东方航空	991,977.00	2.47
16	002142	宁波银行	973,386.50	2.42
17	600409	三友化工	946,781.50	2.35
18	600352	浙江龙盛	928,979.00	2.31
19	603757	大元泵业	917,212.00	2.28
20	600176	中国巨石	883,433.00	2.20

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	46,407,137.43
卖出股票收入(成交)总额	46,230,519.69

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	3,406,340.00	7.08
	其中:政策性金融债	3,406,340.00	7.08
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)	38,147,735.57	79.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	41,554,075.57	86.35

#### 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	113011	光大转债	34,970	3,548,755.60	7.37
2	018002	国开1302	33,560	3,406,340.00	7.08
3	110032	三一转债	24,750	3,037,815.00	6.31

4	128024	宁行转债	25,610	2,679,062.10	5.57
5	123006	东财转债	20,031	2,409,128.37	5.01

### 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：无。

### 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：无。

### 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 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收到公开谴责、处罚的情形

宁行转债 6月22日，银保监会网站披露宁波银监局行政处罚信息公开表发布了关于宁波银行股份有限公司及相关人员的处罚信息。

宁波银行股份有限公司以不正当手段违规吸收存款。违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第七十四条。决定处以60万元人民币罚款。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司债券的投资价值不产生重大影响。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。本基金投资的前十名的其它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 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

### 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	45,066.91
2	应收证券清算款	3,958,840.30
3	应收股利	-
4	应收利息	173,925.87
5	应收申购款	4,752.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,182,585.95

### 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	113011	光大转债	3,548,755.60	7.37
2	110032	三一转债	3,037,815.00	6.31
3	128024	宁行转债	2,679,062.10	5.57
4	123006	东财转债	2,409,128.37	5.01
5	132002	15天集EB	1,399,904.00	2.91
6	128027	崇达转债	1,293,316.73	2.69
7	128029	太阳转债	980,184.72	2.04
8	128019	久立转2	951,566.00	1.98
9	113015	隆基转债	835,897.60	1.74
10	110038	济川转债	834,967.50	1.74
11	113009	广汽转债	712,855.00	1.48
12	128032	双环转债	479,012.22	1.00
13	123003	蓝思转债	229,325.60	0.48
14	113016	小康转债	133,210.40	0.28

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 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 (%)
1,673	34,593.52	20,571,178.30	35.54	37,303,783.45	64.46

### 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	29,508.64	0.0510

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情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 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	46,979,255.45
本报告期基金总申购份额	28,731,354.55
减：本报告期基金总赎回份额	17,835,648.25
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	57,874,961.75

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

1、基金管理人的重大人事变动：基金管理人本报告期内无重大人事变动。

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。

### 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

本基金投资策略未发生改变。

### 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	
海通证券	1	21,592,705.56	23.59%	19,677.04	24.08%	-
太平洋证券	1	16,736,446.79	18.29%	13,578.49	16.61%	本报告期新增 1 个
中金公司	1	15,389,990.32	16.82%	14,025.05	17.16%	-

华泰证券	2	10,854,369.27	11.86%	9,891.36	12.10%	-
长江证券	1	10,477,975.25	11.45%	9,548.69	11.68%	-
银河证券	1	6,461,787.25	7.06%	5,888.65	7.20%	-
东兴证券	2	5,221,823.97	5.71%	4,758.48	5.82%	-
中信证券	1	4,441,941.98	4.85%	4,047.90	4.95%	-
光大证券	1	346,154.00	0.38%	315.49	0.39%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

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
海通证券	108,646,225.10	29.42%	330,100,000.00	55.14%	-	-
太平洋证券	38,862,650.90	10.52%	82,100,000.00	13.71%	-	-
中金公司	55,144,840.42	14.93%	-	-	-	-
华泰证券	72,353,791.30	19.59%	165,800,000.00	27.69%	-	-
长江证券	34,950,733.86	9.46%	-	-	-	-
银河证券	16,395,461.13	4.44%	-	-	-	-
东兴证券	34,173,613.13	9.25%	6,500,000.00	1.09%	-	-
中信证券	8,703,607.77	2.36%	2,200,000.00	0.37%	-	-
光大证券	51,076.80	0.01%	12,000,000.00	2.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20180125~20180131	-	15,259,924.53	11,841,411.73	3,418,512.80	5.91

产品特有风险

基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

鹏华基金管理有限公司

2018 年 08 月 27 日