鹏华可转债债券型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-06-20

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

报告送出日期：2019-07-18

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本基金的财务资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人未经董事会决议，擅自公告投资管理情况以外的事项。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告书财务报告未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

项目	内容
基金简称	鹏华可转债
交易代码	167001
基金合同生效日	2010年7月6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	88,854,921.74份
投资目标	在合理的风险控制下，追求超过风险成本的收益最大化。以可转债为主要投资标的，力争取得超额基金业绩的长期稳健回报。
投资策略	1、资产配置策略；2、可转债投资策略；3、股票投资策略；4、权证投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、中小企业私募债投资策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略；9、融资融券投资策略；10、其他投资策略。
业绩比较基准	中证可转债债券指数收益率×80%＋中债总指数收益率×20%＋沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于较低预期风险/预期收益的品种，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，其债券型基金风险与股票市场关联度较高，其风险收益特征受股票市场影响较大。
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

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-04-01 至 2019-06-30）
本期已实现利润	79,759.39
本期利润	-1,921,101.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0020
期末基金资产净值	88,139,971.27
期末基金份额净值	0.992

注：1、本期已实现利润是指本期利润扣减本期公允价值变动损益后的余额。2、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）按照相关费用计提原则计入本期损益。3、上述财务指标数据均为根据本期内发生的交易或事项所做的会计核算和相关财务报表编制。4、期末可供出售金融资产期末余额为零。5、期末持有的长期股权投资为零。6、本期金额为零或为负数的，以括号内数字列示。7、上述财务指标数据均未考虑本期申购赎回的影响。

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.44 %	0.12 %	-2.04 %	0.41 %	0.62 %	-0.31 %

注：业绩比较基准=中证可转债债券指数收益率×80%＋中债总指数收益率×20%＋沪深300指数收益率×10%。

自基金合同生效以来基金净值增长率变动及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
6.30
0.25
0.20
0.15
0.10
0.05
0.00
-0.05
-0.10
-0.15
-0.20
2010-07-06
2010-12-31
2011-12-31
2012-12-31
2013-12-31
2014-12-31
2015-12-31
2016-12-31
2017-12-31
2018-12-31
2019-06-30
净值增长率
业绩比较基准
-2.04%
0.62%
6.30%
-0.31%
-0.20%
-0.10%
0.00%
0.10%
0.20%
0.30%
0.40%
0.50%
0.60%
0.70%
0.80%
0.90%
1.00%
1.10%
1.20%
1.30%
1.40%
1.50%
1.60%
1.70%
1.80%
1.90%
2.00%
2.10%
2.20%
2.30%
2.40%
2.50%
2.60%
2.70%
2.80%
2.90%
3.00%
3.10%
3.20%
3.30%
3.40%
3.50%
3.60%
3.70%
3.80%
3.90%
4.00%
4.10%
4.20%
4.30%
4.40%
4.50%
4.60%
4.70%
4.80%
4.90%
5.00%
5.10%
5.20%
5.30%
5.40%
5.50%
5.60%
5.70%
5.80%
5.90%
6.00%
6.10%
6.20