

重要提示

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。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes details like 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30). Includes 本期已实现收益, 本期利润, etc.

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可能会低于所列数字。

基金业绩表现

Table with 6 columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), 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.

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

自基金合同生效以来基金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



注：1、本基金合同于2015年02月03日生效。2、截至建仓期末，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。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-04-01至2019-06-30). Includes 基金份额持有人数量, etc.

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks).

注：1、任职日期和离任日期均指公司作出决定并正式对外公告之日；担任新设立基金基金经理的，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业务的相关规定。

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，本着诚实守信、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。

公平交易专项说明

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、分配等环节得到公平对待。

异常交易行为的专项说明
报告期内，本基金未发生法律法规规定的异常交易行为。报告期内未发生基金管理人管理的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超过该证券当日成交量5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年上半年债券市场收益率有所上行，受一季度社融和经济数据超预期影响，二、三月份债券市场收益率普遍上行，自五月份开始受中美贸易摩擦加剧、经济数据回落后，债券收益率下行，从品种看，信用债收益率下行幅度大于利率债，预期三季度宏观经济稳中趋弱，在通胀继续以大幅上升，债券收益率上行风险不大，但下行的空间亦相对有限。

2019年上半年可转债市场表现较好，但波动亦较大，上证综指累计上涨19.43%，权益市场在一季度受经济金融数据向好、贸易摩擦缓和等因素影响持续上行，在4月下旬开始连续受贸易战、中美贸易谈判进展等因素影响出现回调，在并未受中美贸易谈判出现转机影响，结构上看，以大蓝筹等为代表的主动策略好于指数表现，市场风格更偏向于优质蓝筹股。预期期内本基金整体策略的思路是：在保持流动性较为充裕、权益市场更多以结构性机会为主。
2019年上半年可转债市场表现良好，中证转债指数上涨13.3%，最高溢价率维持在基本一致。转债市场整体估值目前仍处于低位，转债跟踪正债的能力较好。从结构上来看，受益于转债市场的大幅扩募，目前出现了较多高市值、同时转股性价比较高的转债，具备较好的投资价值。
报告期内本基金基金经理根据市场环境，及时调整可转债仓位以应对市场波动为主，重点关注具有成长性、流动性较好的转债品种。
报告期内本基金基金经理根据市场环境，及时调整可转债仓位以应对市场波动为主，重点关注具有成长性、流动性较好的转债品种。

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-4.60%，业绩比较基准收益率为-2.08%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets).

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告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

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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债券投资明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousand), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metal Code), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量 (份) (Quantity in Units), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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权证投资明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓数量 (元/卖) (Quantity in Yuan/Buy/Sell), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description).

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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股指期货投资明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓数量 (元/卖) (Quantity in Yuan/Buy/Sell), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description).

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

投资组合报告附注

受处罚及处罚情况
本基金投资的前十名证券中本期没有发生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。

申明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。

其他资产构成
Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 名称 (Name).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

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。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数量 (Quantity).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (元) (Amount in Yuan).

注：本基金管理人投资本基金的比例与本报告披露的投资者适用的费率标准一致。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Mode), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额 (份) (Transaction Amount in Units), 交易金额 (元) (Transaction Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 6 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额总数 (Total Shares Issued), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Issued), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period for Issued Shares).

报告期内前十名基金持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 6 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval for Holding 20% or More of Shares), 期初份额 (Start Period Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Period Shares), 份额占比 (Percentage of Shares).

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转入份额、场内买入份额、指数分级基金申购和红利再投资。
2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转出份额、场内卖出份额和指数分级基金赎回份额。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- (一)《鹏华可转债债券型证券投资基金合同》；
(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2019年第2季度报告》（原文）。

存放地点

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。

查阅方式

投资者可在本基金管理人营业时间免费查阅，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.cn）查阅。
投资者对本报告如有任何疑问，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：4006788899。