

鹏华可转债债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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

报告送出日期：2023 年 4 月 21 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。

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 2023 年 04 月 20 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|-----------|
| 基金简称 | 鹏华可转债债券 | |
| 基金主代码 | 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 6,153,027,235.25 份 | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏华可转债债券 A | 鹏华可转债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000297 | 010964 |

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,969,359,526.05 份 | 3,183,667,709.20 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 风险收益特征同上 | 风险收益特征同上 |

注：无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
| | 鹏华可转债债券 A | 鹏华可转债债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | -46,551,672.44 | -47,243,957.90 |
| 2. 本期利润 | 144,627,984.45 | 179,044,825.99 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0543 | 0.0528 |
| 4. 期末基金资产净值 | 4,285,790,871.98 | 3,487,829,319.25 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.443 | 1.096 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

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。

3.2 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

鹏华可转债债券 A

| 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 | 4.95% | 0.77% | 2.79% | 0.30% | 2.16% | 0.47% |
| 过去六个月 | -3.67% | 0.94% | 1.56% | 0.38% | -5.23% | 0.56% |
| 过去一年 | -3.61% | 1.03% | 1.75% | 0.40% | -5.36% | 0.63% |
| 过去三年 | 38.97% | 1.09% | 14.14% | 0.46% | 24.83% | 0.63% |
| 过去五年 | 71.77% | 1.02% | 32.43% | 0.49% | 39.34% | 0.53% |
| 自基金合同生效起至今 | 50.65% | 0.98% | 16.76% | 0.84% | 33.89% | 0.14% |

鹏华可转债债券 C

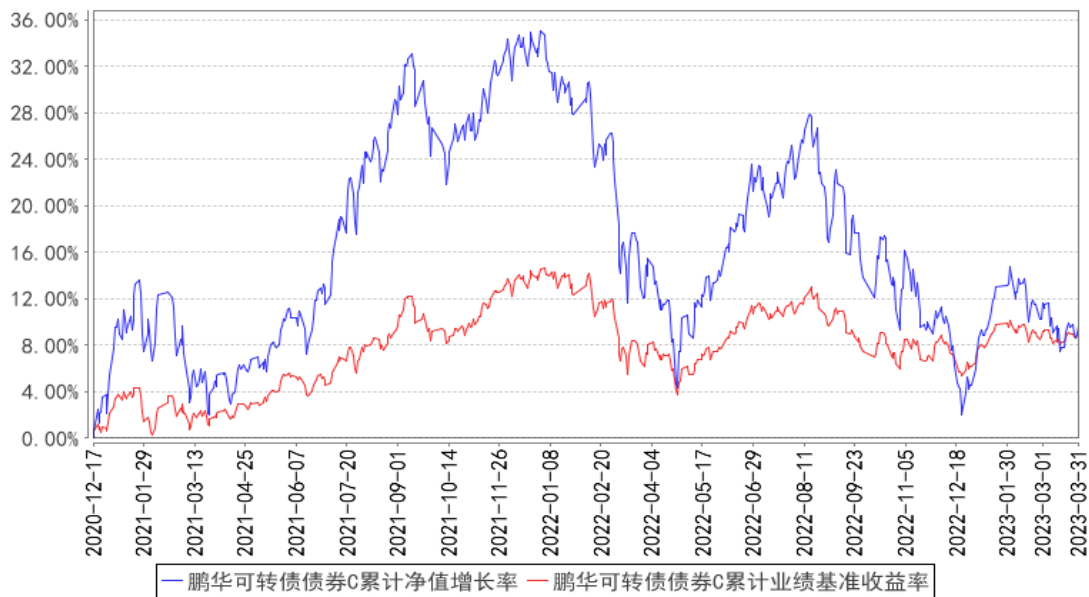
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 4.88% | 0.78% | 2.79% | 0.30% | 2.09% | 0.48% |
| 过去六个月 | -3.69% | 0.95% | 1.56% | 0.38% | -5.25% | 0.57% |
| 过去一年 | -3.78% | 1.03% | 1.75% | 0.40% | -5.53% | 0.63% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.60% | 1.07% | 9.11% | 0.44% | 0.49% | 0.63% |

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



鹏华可转债债券C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 02 月 03 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王石千 | 基金经理 | 2018-07-13 | - | 9 年 | 王石千先生，国籍中国，经济学硕士，9 年证券从业经验。2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，曾任固定收益部高级债券研究员，从事债券投资研究工作，现担任债券投资一部副总经理/基金经理。2018 年 03 月至今担任鹏华双债加利债券型证券投资基金基金经理，2018 年 04 月至今担任鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 04 月至 2020 年 02 月担任鹏华纯债债券型证券投资基金基金经理，2018 年 07 月至今担任鹏华可转债债券型证券投资基金基金经理，2018 年 10 月至 2019 年 11 月担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理，2018 年 11 月至今担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>年 07 月至今担任鹏华双债保利债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 09 月至 2021 年 10 月担任鹏华永泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 09 月至 2020 年 12 月担任鹏华丰饶定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2020 年 07 月至今担任鹏华安惠混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 07 月至今担任鹏华安睿两年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 02 月至今担任鹏华安悦一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 11 月至今担任鹏华安颐混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华永泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2022 年 09 月至今担任鹏华畅享债券型证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理, 王石千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。</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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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 公平交易专项说明

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、分配各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年一季度债券市场收益率表现分化，短端资金利率和利率债收益率上行，但中长端信用债收益率下行较多，背后的原因可能是 2022 年四季度信用债市场受到理财赎回基金产品的冲击导致过度调整，一季度随着理财产品负债端压力缓解，信用债收益率得到明显修复。市场整体利率水平在 3 月尤其是 3 月中旬开始有更为明显的下行，主要原因可能为央行超预期降准，改善了市场对未来资金供需的展望。债券市场在二季度可能呈现区间震荡的走势，债券市场收益率下行的制约在于经济整体处于复苏过程中，资金利率中枢难以明显下行；债券市场收益率上行的制约在于外需偏弱、国内需求恢复较为温和，货币政策暂时边际收紧的可能不大。

2023 年一季度股票市场整体上涨，行业间分化较大。由于疫情对经济的影响较为短暂，复工复产速度快于预期，股票市场在一月份明显反弹，在二、三月受海外银行危机事件扰动有所调整。行业方面，信息技术相关行业受到数据要素改革、人工智能发展等主题催化，在一季度表现亮眼，地产、新能源、部分消费板块表现落后。二季度企业盈利在低基数下同比增速会提升，欧美银行危机导致的避险情绪下降，股票市场有可能会延续上涨。

2023 年一季度转债市场上涨，中证转债指数上涨 3.53%。转债市场在一月份表现较好，二三月份呈现震荡走势，整体估值有所上升，主要是由于信用债券收益率整体下行，对转债市场估值有提振。二季度债券市场可能呈现震荡走势，转债市场估值可能相对稳定；股票市场有可能继续上涨，转债市场也会有一定的表现。

报告期内本基金精选基本面优质、估值较为合理的可转债和股票进行配置，整体仓位变化不大，对可转债个券和个股进行了一定的调整，增加了对信息技术行业股票的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华可转债债券 A 份额净值增长率为 4.95%，同期业绩比较基准增长率为 2.79%，鹏华可转债债券 C 份额净值增长率为 4.88%，同期业绩比较基准增长率为 2.79%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,426,706,656.66 | 16.18 |
| | 其中：股票 | 1,426,706,656.66 | 16.18 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 7,216,187,514.18 | 81.83 |
| | 其中：债券 | 7,216,187,514.18 | 81.83 |
| | 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 | 3,779,488.22 | 0.04 |
| | 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 | 121,726,920.77 | 1.38 |
| 8 | 其他资产 | 50,366,784.18 | 0.57 |
| 9 | 合计 | 8,818,767,364.01 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 24,856,362.00 | 0.32 |
| C | 制造业 | 470,828,833.24 | 6.06 |
| 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 | 616,219,965.98 | 7.93 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 95,126,520.96 | 1.22 |
| J | 金融业 | 190,735,097.09 | 2.45 |
| 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 | 20,882,665.92 | 0.27 |
| 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 | 8,057,211.47 | 0.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,426,706,656.66 | 18.35 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

| 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 | 601872 | 招商轮船 | 36,985,550 | 259,268,705.50 | 3.34 |
| 2 | 600026 | 中远海能 | 18,267,262 | 247,338,727.48 | 3.18 |
| 3 | 300033 | 同花顺 | 482,200 | 98,513,460.00 | 1.27 |
| 4 | 601916 | 浙商银行 | 24,946,400 | 71,346,704.00 | 0.92 |
| 5 | 601111 | 中国国航 | 5,055,670 | 54,095,669.00 | 0.70 |
| 6 | 603885 | 吉祥航空 | 2,664,700 | 47,911,306.00 | 0.62 |
| 7 | 601728 | 中国电信 | 7,273,700 | 46,042,521.00 | 0.59 |
| 8 | 688025 | 杰普特 | 806,549 | 42,351,887.99 | 0.54 |
| 9 | 301191 | 菲菱科思 | 374,125 | 40,817,037.50 | 0.53 |
| 10 | 002078 | 太阳纸业 | 3,268,281 | 39,840,345.39 | 0.51 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 439,465,243.48 | 5.65 |
| 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） | 6,776,722,270.70 | 87.18 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 7,216,187,514.18 | 92.83 |

5.5 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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 113055 | 成银转债 | 2,191,990 | 259,017,429.20 | 3.33 |
| 2 | 113057 | 中银转债 | 2,059,330 | 249,008,033.82 | 3.20 |
| 3 | 110068 | 龙净转债 | 1,286,750 | 231,764,650.79 | 2.98 |
| 4 | 019688 | 22 国债 23 | 2,240,000 | 225,059,305.21 | 2.90 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-----------|----------------|------|
| 5 | 110079 | 杭银转债 | 1,933,780 | 220,364,403.20 | 2.83 |
|---|--------|------|-----------|----------------|------|

5.6 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资产支持证券投资 明细

注：无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本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内受到公开谴责、处罚的情形

中远海运能源运输股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国曹妃甸海事局、中华人民共和国南疆海事局、中华人民共和国浦东海事局的处罚。

杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行杭州中心支行的处罚。

成都银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行成都分行、中国银行保险监督管理委员会四川监管局的处罚。

以上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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,026,211.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | 46,307,879.56 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,032,693.56 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 50,366,784.18 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|----------------|--------------|
| 1 | 113055 | 成银转债 | 259,017,429.20 | 3.33 |
| 2 | 113057 | 中银转债 | 249,008,033.82 | 3.20 |
| 3 | 110068 | 龙净转债 | 231,764,650.79 | 2.98 |
| 4 | 110079 | 杭银转债 | 220,364,403.20 | 2.83 |
| 5 | 132018 | G 三峡 EB1 | 209,493,442.68 | 2.69 |
| 6 | 127030 | 盛虹转债 | 200,174,083.12 | 2.58 |
| 7 | 113615 | 金诚转债 | 199,794,806.79 | 2.57 |
| 8 | 128140 | 润建转债 | 190,968,371.63 | 2.46 |
| 9 | 110053 | 苏银转债 | 170,210,331.28 | 2.19 |
| 10 | 127006 | 敖东转债 | 168,370,024.96 | 2.17 |
| 11 | 113050 | 南银转债 | 161,012,660.98 | 2.07 |
| 12 | 123119 | 康泰转 2 | 130,666,735.48 | 1.68 |
| 13 | 127043 | 川恒转债 | 113,109,270.10 | 1.46 |
| 14 | 110075 | 南航转债 | 111,864,360.09 | 1.44 |
| 15 | 113626 | 伯特转债 | 110,088,716.67 | 1.42 |
| 16 | 110048 | 福能转债 | 109,199,148.46 | 1.40 |
| 17 | 118013 | 道通转债 | 107,927,977.96 | 1.39 |
| 18 | 127061 | 美锦转债 | 98,527,954.62 | 1.27 |
| 19 | 127073 | 天赐转债 | 95,349,676.51 | 1.23 |
| 20 | 128048 | 张行转债 | 90,436,395.11 | 1.16 |
| 21 | 123158 | 宙邦转债 | 87,992,453.32 | 1.13 |
| 22 | 127022 | 恒逸转债 | 87,280,969.18 | 1.12 |
| 23 | 127005 | 长证转债 | 83,442,606.94 | 1.07 |
| 24 | 127036 | 三花转债 | 82,373,098.57 | 1.06 |
| 25 | 128095 | 恩捷转债 | 77,695,995.80 | 1.00 |
| 26 | 127020 | 中金转债 | 77,073,427.24 | 0.99 |
| 27 | 128128 | 齐翔转 2 | 71,968,491.83 | 0.93 |
| 28 | 128081 | 海亮转债 | 67,313,411.60 | 0.87 |
| 29 | 128017 | 金禾转债 | 67,295,037.32 | 0.87 |
| 30 | 127037 | 银轮转债 | 67,178,494.27 | 0.86 |

| | | | | |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 31 | 113534 | 鼎胜转债 | 66,870,064.69 | 0.86 |
| 32 | 111000 | 起帆转债 | 65,626,984.70 | 0.84 |
| 33 | 113048 | 晶科转债 | 64,877,165.67 | 0.83 |
| 34 | 110063 | 鹰 19 转债 | 63,772,687.73 | 0.82 |
| 35 | 123108 | 乐普转 2 | 60,232,170.28 | 0.77 |
| 36 | 113582 | 火炬转债 | 56,671,035.45 | 0.73 |
| 37 | 132014 | 18 中化 EB | 56,311,208.14 | 0.72 |
| 38 | 113648 | 巨星转债 | 52,168,381.97 | 0.67 |
| 39 | 127038 | 国微转债 | 50,957,535.22 | 0.66 |
| 40 | 113516 | 苏农转债 | 49,667,092.65 | 0.64 |
| 41 | 127032 | 苏行转债 | 47,074,338.75 | 0.61 |
| 42 | 123098 | 一品转债 | 44,041,907.78 | 0.57 |
| 43 | 113636 | 甬金转债 | 43,972,403.26 | 0.57 |
| 44 | 123149 | 通裕转债 | 41,486,304.41 | 0.53 |
| 45 | 110074 | 精达转债 | 40,553,851.40 | 0.52 |
| 46 | 127067 | 恒逸转 2 | 40,097,931.66 | 0.52 |
| 47 | 110043 | 无锡转债 | 39,771,167.14 | 0.51 |
| 48 | 128134 | 鸿路转债 | 39,047,107.68 | 0.50 |
| 49 | 127063 | 贵轮转债 | 37,060,742.02 | 0.48 |
| 50 | 127058 | 科伦转债 | 37,055,618.24 | 0.48 |
| 51 | 113051 | 节能转债 | 36,019,060.95 | 0.46 |
| 52 | 128119 | 龙大转债 | 35,503,254.81 | 0.46 |
| 53 | 110047 | 山鹰转债 | 35,153,165.91 | 0.45 |
| 54 | 127051 | 博杰转债 | 33,719,144.17 | 0.43 |
| 55 | 123103 | 震安转债 | 31,988,923.92 | 0.41 |
| 56 | 113049 | 长汽转债 | 30,534,876.84 | 0.39 |
| 57 | 123114 | 三角转债 | 28,847,639.96 | 0.37 |
| 58 | 128109 | 楚江转债 | 28,012,237.02 | 0.36 |
| 59 | 128141 | 旺能转债 | 25,846,399.08 | 0.33 |
| 60 | 123083 | 朗新转债 | 25,222,354.83 | 0.32 |
| 61 | 128034 | 江银转债 | 25,043,411.12 | 0.32 |
| 62 | 128137 | 洁美转债 | 24,316,989.57 | 0.31 |
| 63 | 113653 | 永 22 转债 | 24,150,794.22 | 0.31 |
| 64 | 113025 | 明泰转债 | 21,726,076.60 | 0.28 |
| 65 | 113658 | 密卫转债 | 19,080,265.73 | 0.25 |
| 66 | 110085 | 通 22 转债 | 17,811,965.44 | 0.23 |
| 67 | 113598 | 法兰转债 | 17,750,110.94 | 0.23 |
| 68 | 118009 | 华锐转债 | 16,396,321.60 | 0.21 |
| 69 | 118014 | 高测转债 | 15,531,475.48 | 0.20 |
| 70 | 127014 | 北方转债 | 14,658,222.26 | 0.19 |
| 71 | 113033 | 利群转债 | 10,760,428.80 | 0.14 |
| 72 | 128144 | 利民转债 | 9,863,158.57 | 0.13 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 73 | 123085 | 万顺转 2 | 8,270,297.07 | 0.11 |
| 74 | 123035 | 利德转债 | 7,350,133.46 | 0.09 |
| 75 | 123090 | 三诺转债 | 6,802,099.31 | 0.09 |
| 76 | 127016 | 鲁泰转债 | 6,624,546.90 | 0.09 |
| 77 | 132020 | 19 蓝星 EB | 6,519,690.82 | 0.08 |
| 78 | 113061 | 拓普转债 | 6,223,346.16 | 0.08 |
| 79 | 123133 | 佩蒂转债 | 5,651,625.12 | 0.07 |
| 80 | 113504 | 艾华转债 | 5,542,855.51 | 0.07 |
| 81 | 113632 | 鹤 21 转债 | 5,010,676.87 | 0.06 |
| 82 | 118003 | 华兴转债 | 4,387,789.38 | 0.06 |
| 83 | 123120 | 隆华转债 | 4,037,766.59 | 0.05 |
| 84 | 123144 | 裕兴转债 | 3,957,395.22 | 0.05 |
| 85 | 128023 | 亚太转债 | 2,293,572.67 | 0.03 |
| 86 | 128123 | 国光转债 | 1,493,703.29 | 0.02 |
| 87 | 113641 | 华友转债 | 1,492,215.95 | 0.02 |
| 88 | 123088 | 威唐转债 | 1,225,221.73 | 0.02 |
| 89 | 123109 | 昌红转债 | 947,093.20 | 0.01 |
| 90 | 128121 | 宏川转债 | 935,464.17 | 0.01 |
| 91 | 127064 | 杭氧转债 | 790,475.45 | 0.01 |
| 92 | 113633 | 科沃转债 | 478,284.05 | 0.01 |
| 93 | 123092 | 天壕转债 | 352,295.88 | 0.00 |
| 94 | 118018 | 瑞科转债 | 153,521.70 | 0.00 |
| 95 | 113654 | 永 02 转债 | 27,673.34 | 0.00 |
| 96 | 110083 | 苏租转债 | 12,603.36 | 0.00 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 鹏华可转债债券 A | 鹏华可转债债券 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,276,562,170.99 | 3,174,776,024.43 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,010,604,863.75 | 1,713,142,947.01 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 317,807,508.69 | 1,704,251,262.24 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 2,969,359,526.05 | 3,183,667,709.20 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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 2023 年第 1 季度报告》（原文）。

9.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

9.3 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.cn>）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

2023 年 4 月 21 日