

鹏华可转债债券型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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。本中期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 2023 年 08 月 29 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

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	45
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	45
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	45
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	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.11 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 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	
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	7,299,383,601.93 份	
基金合同存续期	不定期	
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	3,484,840,078.86 份	3,814,543,523.07 份

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。

注：无。

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	高永杰	秦一楠
	联系电话	0755-81395402	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@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 楼	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 楼	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	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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(2023年1月1日-2023年6月30日)		
	鹏华可转债债券 A	鹏华可转债债券 C	
本期已实现收益	-77,017,429.76	-73,062,624.63	
本期利润	35,613,466.25	92,236,816.95	
加权平均基金份额本期利润	0.0121	0.0267	
本期加权平均净值利润率	0.84%	2.45%	
本期基金份额净值增长率	2.47%	2.30%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)		
	期末可供分配利润	228,442,805.23	-60,544,156.22
	期末可供分配基金份额利润	0.0656	-0.0159
	期末基金资产净值	4,908,698,410.66	4,076,343,257.90
	期末基金份额净值	1.409	1.069

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	47.10%	6.90%

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) 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

鹏华可转债债券 A

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	1.51%	0.71%	0.80%	0.28%	0.71%	0.43%
过去三个月	-2.36%	0.76%	-0.04%	0.31%	-2.32%	0.45%
过去六个月	2.47%	0.77%	2.75%	0.30%	-0.28%	0.47%
过去一年	-12.54%	0.94%	-1.97%	0.35%	-10.57%	0.59%
过去三年	24.87%	1.09%	14.24%	0.46%	10.63%	0.63%
自基金合同生效起至今	47.10%	0.97%	16.71%	0.83%	30.39%	0.14%

鹏华可转债债券 C

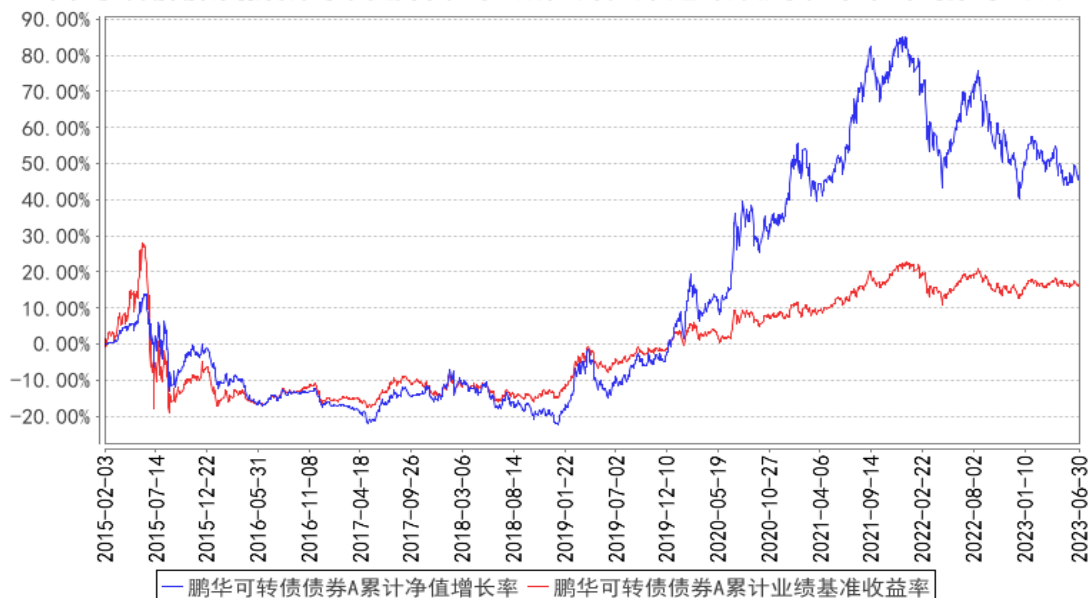
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.52%	0.69%	0.80%	0.28%	0.72%	0.41%
过去三个月	-2.46%	0.76%	-0.04%	0.31%	-2.42%	0.45%

过去六个月	2.30%	0.77%	2.75%	0.30%	-0.45%	0.47%
过去一年	-12.66%	0.94%	-1.97%	0.35%	-10.69%	0.59%
自基金合同生效起至今	6.90%	1.04%	9.06%	0.43%	-2.16%	0.61%

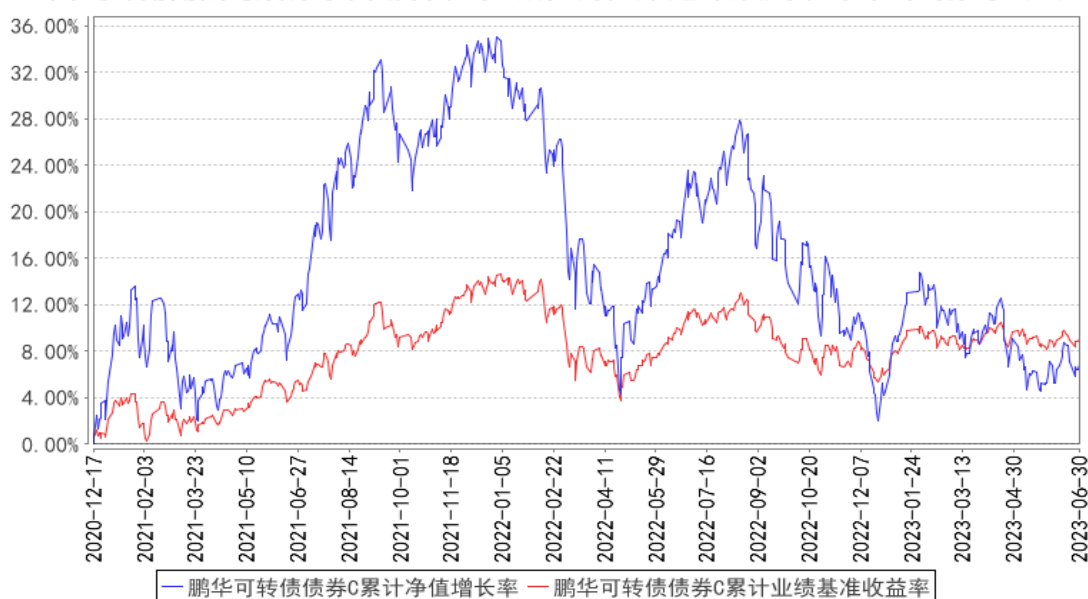
注：业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×60%+中债总指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×10%

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

鹏华可转换债券A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



鹏华可转换债券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。截至本报告期末，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，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至 6 月 30 日，公司管理资产总规模达到 11517 亿元，301 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

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		
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 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 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，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, 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。
--	--	--	--	---

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。

4.1.3 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 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 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

2023 年上半年债券市场表现较好。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，主要是由于 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。二季度债券市场收益率整体下行，短端利率下行幅度略大于中长端。一季度经济经历了疫后需求的集中释放，二季度经济修复力度有所减缓，信贷增长也有所降温，融资需求增速放缓；另一方面，货币政策整体宽松，央行在 6 月降息，商业银行调降存款利率，短端资金利率下行，导致了中长端债券收益率的下行。

2023 年股票市场小幅上涨但行业分化较大。一季度股票市场整体上涨，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。二季度股票市场整体下跌，行业表现继续分化。由于经济在二季度修复力度有所减缓，导致大部分周期、消费等行业有所调整；具备产业逻辑的行业如通信、传媒等行业表现较好，另外逆周期的公用事业股票也表现较好。

2023 年转债市场整体上涨。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。二季度转债市场基本持平，虽然股票市场有所下跌，但受益于债券市场的上涨，转债的估值水平有抬升，抵消了正股的下跌，因此转债市场表现好于股票市场。

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，对可转债个券和个股进行了一定的调整，保持了较高的信息技术行业股票的配置。

4.4.2 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 2.47%，同期业绩比较基准增长率为 2.75%，鹏华可转债债券 C 份额净值增长率为 2.30%，同期业绩比较基准增长率为 2.75%。

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，经济短期企稳的概率有所增加，整体动能仍处于恢复期。在经历了一季度需求释放、二季度回落以后，第三季度的总需求有望回归常态，在央行降息的带动下、叠加后续可能的稳增长措施的继续推出，经济有望逐步企稳。

债券市场可能在下半年维持低位震荡的格局。由于经济逐步企稳、需求回归常态，债券市场

收益率继续向下的难度较高；但货币政策依然保持宽松基调，短端资金利率可能依然维持低位，因此债券市场整体可能维持震荡格局。

股票市场下半年表现可能会好于上半年。上半年除了宏观经济的波动制约了股票市场的表现以外，美联储的持续加息也对股票市场造成了负面影响。下半年一方面宏观经济逐步企稳，另一方面美联储紧缩的货币政策也逐步进入尾声，股票市场的表现可能会好转。

转债市场下半年仍有投资机会。随着经济的企稳，股票市场的表现可能好转，带动转债的转股价值上升，驱动转债市场的上涨。虽然转债估值处于高位，会削弱转债市场的上涨弹性，但目前转债市场个券数量较多，自下而上的结构性机会也会较多。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

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，鹏华可转债债券 A 期末可供分配利润为 228,442,805.23 元，期末基金份额净值 1.409 元；鹏华可转债债券 C 期末可供分配利润为-60,544,156.22 元，期末基金份额净值 1.069 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。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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

无。

§ 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《中华人民共和国证券投资基金法》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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本中期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《公开募集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中期报告中的财务指标、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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	57,498,971.56	36,189,100.97
结算备付金		82,868,821.04	73,145,574.16
存出保证金		1,248,862.20	963,923.48
交易性金融资产	6.4.7.2	9,619,596,251.67	7,030,862,228.88
其中：股票投资		1,792,920,535.12	1,221,051,024.52

基金投资		-	-
债券投资		7,826,675,716.55	5,809,811,204.36
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	96,777,030.14	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		22,741,942.48	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,772,359.36	21,264,826.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		9,882,504,238.45	7,162,425,653.53
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
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		817,973,843.21	684,798,846.37
应付清算款		63,295,334.77	1,517,307.25
应付赎回款		1,890,634.07	19,276,733.59
应付管理人报酬		7,298,041.36	5,606,030.34
应付托管费		1,459,608.27	1,121,206.04
应付销售服务费		671,377.95	567,688.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		73,036.66	55,494.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	4,800,693.60	1,769,473.95
负债合计		897,462,569.89	714,712,781.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	7,299,383,601.93	5,451,338,195.42
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,685,658,066.63	996,374,677.00
净资产合计		8,985,041,668.56	6,447,712,872.42
负债和净资产总计		9,882,504,238.45	7,162,425,653.53

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额为 7,299,383,601.93 份，其中鹏华可转债债券 A 基金份额总额为 3,484,840,078.86 份，基金份额净值 1.409 元；鹏华可转债债券 C 基金份额总额为 3,814,543,523.07 份，基金份额净值 1.069 元。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		189,474,307.04	-1,023,048,228.32
1. 利息收入		1,385,238.36	1,397,076.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,030,997.03	941,655.26
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		354,241.33	455,421.68
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-93,009,622.94	-407,323,542.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-82,842,724.85	-238,532,472.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-26,383,185.22	-173,251,587.89
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	16,216,287.13	4,460,517.43
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	277,930,337.59	-621,404,727.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	3,168,354.03	4,282,965.32

减：二、营业总支出		61,624,023.84	59,257,609.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	39,646,543.56	38,601,285.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,929,308.72	7,720,257.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,749,184.41	3,537,743.14
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		10,118,820.31	9,214,110.68
其中：卖出回购金融资产支出		10,118,820.31	9,214,110.68
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		41,891.95	42,561.83
8. 其他费用	6.4.7.23	138,274.89	141,652.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		127,850,283.20	-1,082,305,838.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		127,850,283.20	-1,082,305,838.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		127,850,283.20	-1,082,305,838.22

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	5,451,338,195.42	-	996,374,677.00	6,447,712,872.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	5,451,338,195.42	-	996,374,677.00	6,447,712,872.42

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,848,045,406.51	-	689,283,389.63	2,537,328,796.14
(一)、综合收益总额	-	-	127,850,283.20	127,850,283.20
(二)、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)	1,848,045,406.51	-	561,433,106.43	2,409,478,512.94
其中:1.基金申购款	4,827,964,224.13	-	1,097,698,929.11	5,925,663,153.24
2.基金赎回款	-2,979,918,817.62	-	-536,265,822.68	-3,516,184,640.30
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基	7,299,383,601.93	-	1,685,658,066.63	8,985,041,668.56

金净值)				
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	6,608,737,913.90	-	3,578,154,146.59	10,186,892,060.49
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	6,608,737,913.90	-	3,578,154,146.59	10,186,892,060.49
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,566,761,243.79	-	-1,599,797,660.96	-3,166,558,904.75
(一)、综合收益总额	-	-	-1,082,305,838.22	-1,082,305,838.22
(二)、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)	-1,566,761,243.79	-	-517,491,822.74	-2,084,253,066.53
其中:1. 基金申购款	2,934,188,410.77	-	1,001,862,729.46	3,936,051,140.23
2. 基金赎回	-4,500,949,654.56	-	-1,519,354,552.20	-6,020,304,206.76

回款				
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合 收益结转 留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	5,041,976,670.11	-	1,978,356,485.63	7,020,333,155.74

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

基金管理人负责人

邢彪

主管会计工作负责人

郝文高

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。

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”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净资产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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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[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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	57,498,971.56
等于：本金	57,492,961.28
加：应计利息	6,010.28
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	57,498,971.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,849,454,626.50	-	1,792,920,535.12	-56,534,091.38	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	7,986,503,575.36	20,177,963.18	7,826,675,716.55	-180,005,821.99
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,986,503,575.36	20,177,963.18	7,826,675,716.55	-180,005,821.99
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	9,835,958,201.86	20,177,963.18	9,619,596,251.67	-236,539,913.37	

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	96,777,030.14	-
银行间市场	-	-
合计	96,777,030.14	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,035.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,691,058.53
其中：交易所市场	4,691,058.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	108,600.00
合计	4,800,693.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华可转债债券 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,276,562,170.99	2,276,562,170.99
本期申购	1,832,522,814.29	1,832,522,814.29
本期赎回（以“-”号填列）	-624,244,906.42	-624,244,906.42
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,484,840,078.86	3,484,840,078.86

鹏华可转债债券 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,174,776,024.43	3,174,776,024.43
本期申购	2,995,441,409.84	2,995,441,409.84
本期赎回（以“-”号填列）	-2,355,673,911.20	-2,355,673,911.20
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,814,543,523.07	3,814,543,523.07

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华可转债债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	209,267,357.94	645,515,268.34	854,782,626.28
本期利润	-77,017,429.76	112,630,896.01	35,613,466.25
本期基金份额交易产生的变动数	96,192,877.05	437,269,362.22	533,462,239.27
其中：基金申购款	145,973,536.32	665,259,716.78	811,233,253.10
基金赎回款	-49,780,659.27	-227,990,354.56	-277,771,013.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	228,442,805.23	1,195,415,526.57	1,423,858,331.80

鹏华可转债债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,765,882.64	124,826,168.08	141,592,050.72
本期利润	-73,062,624.63	165,299,441.58	92,236,816.95
本期基金份额交易产生的变动数	-4,247,414.23	32,218,281.39	27,970,867.16
其中：基金申购款	-11,277,249.17	297,742,925.18	286,465,676.01
基金赎回款	7,029,834.94	-265,524,643.79	-258,494,808.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,544,156.22	322,343,891.05	261,799,734.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	281,992.94
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	740,475.60
其他	8,528.49
合计	1,030,997.03

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-82,842,724.85
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	-82,842,724.85
----	----------------

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	3,716,446,545.06
减：卖出股票成本总额	3,787,740,359.42
减：交易费用	11,548,910.49
买卖股票差价收入	-82,842,724.85

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	22,320,950.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-48,704,136.06
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	-26,383,185.22

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,589,264,067.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,626,406,692.68
减：应计利息总额	11,317,934.07
减：交易费用	243,576.39
买卖债券差价收入	-48,704,136.06

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	16,216,287.13
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,216,287.13

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	277,930,337.59
股票投资	93,292,346.53
债券投资	184,637,991.06
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	277,930,337.59

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,126,944.33
基金转换费收入	41,409.70
合计	3,168,354.03

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	49,092.63
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	20,674.89
账户维护费	9,000.00
合计	138,274.89

6.4.7.24 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（“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。

6.4.10 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年
----	--------------------------------	-----------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	39,646,543.56	38,601,285.01
其中：支付销售机构的客户维护费	4,022,958.98	4,051,266.53

注：1、支付基金管理人鹏华基金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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,929,308.72	7,720,257.02

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华可转债债券 A	鹏华可转债债券 C	合计
国信证券	-	45.77	45.77
鹏华基金公司	-	3,055,783.29	3,055,783.29
合计	-	3,055,829.06	3,055,829.06
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华可转债债券 A	鹏华可转债债券 C	合计
国信证券	-	77.82	77.82
鹏华基金公司	-	3,270,622.13	3,270,622.13
合计	-	3,270,699.95	3,270,699.95

注：鹏华可转债债券 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华可转债债券 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.2%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.2%÷当年天数。

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：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无。

6.4.10.5.2 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：本基金本报告期末及上年度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。

6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	57,498,971.56	281,992.94	50,729,919.35

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2023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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

601916	浙商 银行	2023 年 6 月 27 日	1 个月 内(含)	配股 未上 市	2.02	2.64	5,897,070	11,912,081.40	15,568,264.80	浙商银 行于 2023 年 6 月 27 日 每 10 股配 3 股
--------	----------	-----------------------	--------------	---------------	------	------	-----------	---------------	---------------	--

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金参与摇号配售或比例配售方式获配的创业板股票自发行人股票上市之日起在发行人约定的限售期内不得转让。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 817,973,843.21 元，于 2023 年 07 月 03 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持

有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

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

本基金为债券型基金。本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行交易的国债，金融债，企业债，公司债，央行票据，地方政府债，中期票据，短期融资券，可转换债券(含分离交易可转债)，资产支持证券，次级债，中小企业私募债，债券回购，银行存款等。本基金同时投资于 A 股股票(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)，权证等权益类品种以及法律，法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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及其他具有基金托管资格的银行，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。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	1,735,574,984.21	1,671,161,654.28
AAA 以下	5,621,373,063.22	3,808,786,239.87
未评级	-	-
合计	7,356,948,047.43	5,479,947,894.15

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或于约定开放日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、组合在短期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。

于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 817,973,843.21 元将在一个月内到期且计息外，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（净资产）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。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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未来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 2023 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	57,498,971.56	-	-	-	57,498,971.56

结算备付金	82,868,821.04	-	-	-	82,868,821.04
存出保证金	1,248,862.20	-	-	-	1,248,862.20
交易性金融资产	1,302,611,309.66	4,901,451,134.55	1,622,613,272.34	1,792,920,535.12	9,619,596,251.67
买入返售金融资产	96,777,030.14	-	-	-	96,777,030.14
应收申购款	-	-	-	1,772,359.36	1,772,359.36
应收清算款	-	-	-	22,741,942.48	22,741,942.48
资产总计	1,541,004,994.60	4,901,451,134.55	1,622,613,272.34	1,817,434,836.96	9,882,504,238.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,890,634.07	1,890,634.07
应付管理人报酬	-	-	-	7,298,041.36	7,298,041.36
应付托管费	-	-	-	1,459,608.27	1,459,608.27
应付清算款	-	-	-	63,295,334.77	63,295,334.77
卖出回购金融资产款	817,973,843.21	-	-	-	817,973,843.21
应付销售服务费	-	-	-	671,377.95	671,377.95
应交税费	-	-	-	73,036.66	73,036.66
其他负债	-	-	-	4,800,693.60	4,800,693.60
负债总计	817,973,843.21	-	-	79,488,726.68	897,462,569.89
利率敏感度缺口	723,031,151.39	4,901,451,134.55	1,622,613,272.34	1,737,946,110.28	8,985,041,668.56
上年度末 2022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	36,189,100.97	-	-	-	36,189,100.97
结算备付金	73,145,574.16	-	-	-	73,145,574.16
存出保证金	963,923.48	-	-	-	963,923.48
交易性金融资产	435,839,243.03	3,955,765,560.09	1,418,206,401.24	1,221,051,024.52	7,030,862,228.88
应收申购款	-	-	-	21,264,826.04	21,264,826.04
资产总计	546,137,841.64	3,955,765,560.09	1,418,206,401.24	1,242,315,850.56	7,162,425,653.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,276,733.59	19,276,733.59
应付管理人报酬	-	-	-	5,606,030.34	5,606,030.34
应付托管费	-	-	-	1,121,206.04	1,121,206.04
应付清算款	-	-	-	1,517,307.25	1,517,307.25
卖出回购金融资产款	684,798,846.37	-	-	-	684,798,846.37
应付销售服务	-	-	-	567,688.67	567,688.67

费					
应交税费	-	-	-	55,494.90	55,494.90
其他负债	-	-	-	1,769,473.95	1,769,473.95
负债总计	684,798,846.37	-	-	29,913,934.74	714,712,781.11
利率敏感度缺口	-138,661,004.73	3,955,765,560.09	1,418,206,401.24	1,212,401,915.82	6,447,712,872.42

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。		
	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	457,705.03	127,983.34
	市场利率上升 25 个基点	-456,407.66	-127,776.31

注：无。

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

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

交易的证券投资品种，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。

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%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	1,792,920,535.12	19.95	1,221,051,024.52	18.94
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,356,948,047.43	81.88	5,479,947,894.15	84.99
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	9,149,868,582.55	101.83	6,700,998,918.67	103.93

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	300,684,419.44	231,666,323.51
	业绩比较基准下降 5%	-300,684,419.44	-231,666,323.51

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	8,748,641,623.70
第二层次	870,954,627.97
第三层次	-
合计	9,619,596,251.67

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	1,792,920,535.12	18.14
	其中：股票	1,792,920,535.12	18.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,826,675,716.55	79.20
	其中：债券	7,826,675,716.55	79.20
	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	96,777,030.14	0.98
	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	140,367,792.60	1.42
8	其他各项资产	25,763,164.04	0.26
9	合计	9,882,504,238.45	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

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	60,870,558.00	0.68
C	制造业	869,253,654.58	9.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,305,610.00	0.21
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	557,864,572.36	6.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	145,540,871.38	1.62
J	金融业	90,272,704.72	1.00
K	房地产业	8,965,824.08	0.10
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	40,846,740.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	1,792,920,535.12	19.95

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600026	中远海能	18,998,251	240,137,892.64	2.67
2	601872	招商轮船	34,167,628	197,830,566.12	2.20
3	600150	中国船舶	2,470,300	81,297,573.00	0.90
4	000063	中兴通讯	1,670,500	76,074,570.00	0.85
5	002463	沪电股份	3,614,300	75,683,442.00	0.84
6	688025	杰普特	755,371	65,981,656.85	0.73
7	601916	浙商银行	20,317,873	53,639,184.72	0.60
8	601728	中国电信	9,340,300	52,585,889.00	0.59

9	000960	锡业股份	2,959,800	46,024,890.00	0.51
10	002371	北方华创	141,688	45,007,193.20	0.50
11	688120	华海清科	177,518	44,743,411.90	0.50
12	600760	中航沈飞	992,460	44,660,700.00	0.50
13	601989	中国重工	9,241,400	44,543,548.00	0.50
14	000651	格力电器	1,213,978	44,322,336.78	0.49
15	002230	科大讯飞	643,100	43,705,076.00	0.49
16	301155	海力风电	540,200	41,638,616.00	0.46
17	300274	阳光电源	351,597	41,006,758.11	0.46
18	300413	芒果超媒	1,194,000	40,846,740.00	0.45
19	600482	中国动力	1,622,400	38,029,056.00	0.42
20	300033	同花顺	209,000	36,633,520.00	0.41
21	601021	春秋航空	628,200	36,102,654.00	0.40
22	300750	宁德时代	157,200	35,965,788.00	0.40
23	601333	广深铁路	7,738,900	30,646,044.00	0.34
24	000021	深科技	1,369,400	27,374,306.00	0.30
25	603885	吉祥航空	1,734,800	26,767,964.00	0.30
26	002409	雅克科技	362,400	26,411,712.00	0.29
27	600845	宝信软件	513,306	26,081,077.86	0.29
28	600547	山东黄金	1,001,800	23,522,264.00	0.26
29	600489	中金黄金	2,231,600	23,052,428.00	0.26
30	688036	传音控股	136,447	20,057,709.00	0.22
31	688006	杭可科技	538,307	16,402,214.29	0.18
32	600988	赤峰黄金	1,062,100	14,295,866.00	0.16
33	002430	杭氧股份	395,506	13,589,586.16	0.15
34	601890	亚星锚链	1,163,843	13,477,301.94	0.15
35	600004	白云机场	928,590	13,315,980.60	0.15
36	601000	唐山港	3,700,700	13,063,471.00	0.15
37	000032	深桑达 A	326,100	10,728,690.00	0.12
38	300320	海达股份	1,155,737	9,049,420.71	0.10
39	600266	城建发展	1,764,926	8,965,824.08	0.10
40	000928	中钢国际	888,800	8,576,920.00	0.10
41	688579	山大地纬	493,624	8,134,923.52	0.09
42	002777	久远银海	221,700	7,863,699.00	0.09
43	301191	菲菱科思	75,512	7,809,451.04	0.09
44	603444	吉比特	14,600	7,170,206.00	0.08
45	603496	恒为科技	277,020	5,202,435.60	0.06
46	300548	博创科技	122,400	4,216,680.00	0.05
47	688008	澜起科技	11,900	683,298.00	0.01

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 (%)
----	------	------	----------	-----------------

	码			
1	300033	同花顺	222,232,205.83	3.45
2	600150	中国船舶	188,454,424.05	2.92
3	600026	中远海能	167,651,169.67	2.60
4	300059	东方财富	136,409,076.95	2.12
5	002463	沪电股份	116,951,359.08	1.81
6	601872	招商轮船	112,237,417.45	1.74
7	000063	中兴通讯	110,576,334.22	1.71
8	688025	杰普特	91,482,095.30	1.42
9	000960	锡业股份	90,732,502.50	1.41
10	300251	光线传媒	85,840,116.27	1.33
11	603885	吉祥航空	81,262,104.82	1.26
12	601728	中国电信	81,019,007.00	1.26
13	300750	宁德时代	80,801,962.46	1.25
14	601989	中国重工	80,411,270.92	1.25
15	002230	科大讯飞	75,827,048.62	1.18
16	300274	阳光电源	75,044,845.68	1.16
17	600988	赤峰黄金	70,323,312.88	1.09
18	002371	北方华创	66,825,914.39	1.04
19	300308	中际旭创	64,548,455.39	1.00
20	300394	天孚通信	61,141,529.92	0.95

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	300033	同花顺	290,910,876.27	4.51
2	601975	招商南油	155,526,375.62	2.41
3	300059	东方财富	126,916,820.21	1.97
4	600150	中国船舶	110,486,156.05	1.71
5	600958	东方证券	110,373,256.15	1.71
6	300308	中际旭创	79,602,572.59	1.23
7	300251	光线传媒	79,409,073.96	1.23
8	601111	中国国航	76,844,576.22	1.19
9	300394	天孚通信	64,232,872.24	1.00
10	601138	工业富联	59,821,402.15	0.93
11	601117	中国化学	58,053,534.06	0.90
12	601318	中国平安	55,663,035.08	0.86
13	688063	派能科技	55,601,652.44	0.86
14	300320	海达股份	55,480,217.02	0.86
15	600522	中天科技	55,036,227.36	0.85
16	002078	太阳纸业	54,866,024.57	0.85
17	601601	中国太保	53,664,866.33	0.83

18	002415	海康威视	52,743,811.00	0.82
19	300274	阳光电源	51,783,510.77	0.80
20	603885	吉祥航空	50,736,174.48	0.79

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	4,266,317,523.49
卖出股票收入（成交）总额	3,716,446,545.06

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	469,727,669.12	5.23
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）	7,356,948,047.43	81.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,826,675,716.55	87.11

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	132018	G 三峡 EB1	2,670,120	378,785,783.58	4.22
2	113055	成银转债	2,191,990	255,882,403.06	2.85
3	113057	中银转债	1,880,460	245,036,714.82	2.73
4	019688	22 国债 23	2,240,000	226,507,143.00	2.52
5	110079	杭银转债	1,933,780	222,413,362.33	2.48

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：无。

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

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 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。

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内受到公开谴责、处罚的情形

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。

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宁波海事局、中华人民共和国浦东海事局的处罚。

金诚信矿业管理股份有限公司在报告编制日前一年内受到烟台市应急管理局的处罚。

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。

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	1,248,862.20
2	应收清算款	22,741,942.48
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,772,359.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,763,164.04

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	132018	G 三峡 EB1	378,785,783.58	4.22
2	113055	成银转债	255,882,403.06	2.85

3	113057	中银转债	245,036,714.82	2.73
4	110079	杭银转债	222,413,362.33	2.48
5	113615	金诚转债	205,141,689.78	2.28
6	128140	润建转债	198,204,036.39	2.21
7	110048	福能转债	173,567,623.96	1.93
8	127006	敖东转债	171,850,069.20	1.91
9	113050	南银转债	158,937,858.03	1.77
10	113626	伯特转债	151,780,404.35	1.69
11	110053	苏银转债	151,632,551.67	1.69
12	127064	杭氧转债	147,023,796.52	1.64
13	111010	立昂转债	145,940,708.07	1.62
14	110068	龙净转债	145,443,610.39	1.62
15	110077	洪城转债	139,011,760.20	1.55
16	127030	盛虹转债	123,085,162.51	1.37
17	123119	康泰转 2	122,361,239.81	1.36
18	118022	锂科转债	103,552,908.39	1.15
19	128048	张行转债	90,073,439.39	1.00
20	127061	美锦转债	85,590,061.97	0.95
21	127005	长证转债	83,877,414.22	0.93
22	127022	恒逸转债	81,296,689.48	0.90
23	127020	中金转债	78,089,981.04	0.87
24	127037	银轮转债	77,152,049.75	0.86
25	127029	中钢转债	76,924,029.07	0.86
26	127073	天赐转债	72,131,070.57	0.80
27	128081	海亮转债	67,711,120.28	0.75
28	128095	恩捷转债	67,566,273.35	0.75
29	128128	齐翔转 2	67,187,518.14	0.75
30	127036	三花转债	66,918,679.14	0.74
31	127054	双箭转债	66,076,597.40	0.74
32	123025	精测转债	64,992,883.75	0.72
33	113048	晶科转债	64,296,931.50	0.72
34	113582	火炬转债	62,467,783.86	0.70
35	113064	东材转债	62,339,007.73	0.69
36	123108	乐普转 2	61,653,890.68	0.69
37	110063	鹰 19 转债	60,420,801.50	0.67
38	113534	鼎胜转债	59,649,095.38	0.66
39	118013	道通转债	59,065,635.49	0.66
40	113648	巨星转债	56,537,839.67	0.63
41	128017	金禾转债	55,521,748.51	0.62
42	127043	川恒转债	54,504,318.14	0.61
43	110091	合力转债	50,039,460.55	0.56
44	113516	苏农转债	49,773,023.52	0.55
45	127069	小熊转债	49,084,716.89	0.55

46	127032	苏行转债	47,823,871.15	0.53
47	123158	宙邦转债	47,412,926.49	0.53
48	118021	新致转债	46,153,303.38	0.51
49	113044	大秦转债	45,586,143.95	0.51
50	113602	景 20 转债	44,613,811.97	0.50
51	110074	精达转债	42,260,924.31	0.47
52	113636	甬金转债	41,919,734.84	0.47
53	111000	起帆转债	41,199,125.64	0.46
54	127058	科伦转债	40,266,732.35	0.45
55	123149	通裕转债	40,036,331.19	0.45
56	113021	中信转债	39,469,353.24	0.44
57	110043	无锡转债	38,989,313.68	0.43
58	127063	贵轮转债	38,586,336.16	0.43
59	127067	恒逸转 2	37,500,059.29	0.42
60	110084	贵燃转债	36,155,753.93	0.40
61	113051	节能转债	35,325,554.64	0.39
62	127051	博杰转债	34,515,579.58	0.38
63	128119	龙大转债	34,357,864.67	0.38
64	110047	山鹰转债	33,277,642.70	0.37
65	110073	国投转债	33,249,047.21	0.37
66	128134	鸿路转债	31,326,833.37	0.35
67	113063	赛轮转债	30,787,462.14	0.34
68	127038	国微转债	30,578,591.03	0.34
69	113049	长汽转债	29,613,717.54	0.33
70	113631	皖天转债	29,367,819.93	0.33
71	123114	三角转债	28,917,170.76	0.32
72	123165	回天转债	28,482,663.56	0.32
73	113664	大元转债	28,381,432.82	0.32
74	128109	楚江转债	27,427,648.12	0.31
75	123103	震安转债	25,137,180.58	0.28
76	128141	旺能转债	25,058,893.82	0.28
77	128034	江银转债	24,299,635.19	0.27
78	128137	洁美转债	24,237,638.07	0.27
79	123122	富瀚转债	21,892,835.65	0.24
80	110085	通 22 转债	21,520,379.45	0.24
81	123075	贝斯转债	21,428,344.45	0.24
82	113065	齐鲁转债	20,949,632.88	0.23
83	113653	永 22 转债	20,302,639.90	0.23
84	118026	利元转债	19,771,378.14	0.22
85	113025	明泰转债	19,393,312.97	0.22
86	113598	法兰转债	15,992,626.93	0.18
87	123170	南电转债	15,932,162.06	0.18
88	110075	南航转债	15,795,235.98	0.18

89	123169	正海转债	14,162,016.71	0.16
90	123112	万讯转债	13,674,623.85	0.15
91	113033	利群转债	10,521,829.28	0.12
92	113658	密卫转债	10,405,666.66	0.12
93	128144	利民转债	9,365,776.83	0.10
94	127068	顺博转债	8,951,712.83	0.10
95	123085	万顺转 2	8,264,361.73	0.09
96	123035	利德转债	7,505,191.47	0.08
97	123157	科蓝转债	6,598,773.79	0.07
98	132020	19 蓝星 EB	6,509,013.21	0.07
99	127016	鲁泰转债	6,425,725.15	0.07
100	123133	佩蒂转债	5,294,405.37	0.06
101	113504	艾华转债	5,144,270.01	0.06
102	113632	鹤 21 转债	4,768,300.64	0.05
103	118003	华兴转债	4,324,625.32	0.05
104	123120	隆华转债	4,105,297.80	0.05
105	123144	裕兴转债	3,793,924.84	0.04
106	123090	三诺转债	3,144,598.73	0.03
107	128023	亚太转债	2,284,335.58	0.03
108	118009	华锐转债	1,657,875.23	0.02
109	128123	国光转债	1,575,621.10	0.02
110	113641	华友转债	1,421,199.59	0.02
111	123088	威唐转债	1,231,351.72	0.01
112	128121	宏川转债	957,952.30	0.01
113	123109	昌红转债	936,179.42	0.01
114	113633	科沃转债	481,017.06	0.01
115	123092	天壕转债	336,458.90	0.00
116	118018	瑞科转债	149,961.16	0.00
117	113654	永 02 转债	28,099.61	0.00
118	110083	苏租转债	12,881.34	0.00

7.11.5 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	601916	浙商银行	15,568,264.80	0.17	配股未上市

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

份额级别	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 (%)
鹏华可转 债债券 A	56,649	61,516.36	2,731,830,306.85	78.39	753,009,772.01	21.61
鹏华可转 债债券 C	3,052	1,249,850.43	3,786,007,257.74	99.25	28,536,265.33	0.75
合计	59,701	122,265.68	6,517,837,564.59	89.29	781,546,037.34	10.71

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	鹏华可转债债券 A	501,268.17	0.0144
	鹏华可转债债券 C	8,271.70	0.0002
	合计	509,539.87	0.0070

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

项目	鹏华可转债债券 A	鹏华可转债债券 C
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	2,276,562,170.99	3,174,776,024.43
本报告期基金总申购 份额	1,832,522,814.29	2,995,441,409.84

减：本报告期基金总赎回份额	624,244,906.42	2,355,673,911.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,484,840,078.86	3,814,543,523.07

§ 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

无。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
光大证券	1	3,071,463,134.65	38.95	2,829,728.58	39.24	-

长江证券	1	1,911,601,006.99	24.24	1,761,159.21	24.42	-
信达证券	1	538,169,127.19	6.82	441,998.09	6.13	-
中信证券	1	507,444,739.29	6.43	467,507.78	6.48	-
海通证券	1	375,778,609.77	4.77	346,199.73	4.80	-
国金证券	1	334,628,520.30	4.24	308,288.86	4.27	-
广发证券	1	323,361,148.46	4.10	297,913.02	4.13	-
银河证券	1	270,715,007.52	3.43	249,409.98	3.46	-
东方证券	1	221,565,992.49	2.81	204,127.28	2.83	-
中信建投证券	1	211,048,762.03	2.68	194,440.40	2.70	-
华泰证券	1	82,893,702.65	1.05	76,371.15	1.06	-
中金公司	1	37,534,697.60	0.48	34,580.78	0.48	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	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(%)
光大证券	2,591,179,949.70	39.05	60,857,410,000.00	60.58	-	-
长江证券	708,361,836.76	10.67	2,021,500,000.00	2.01	-	-
信达证券	1,043,698,433.34	15.73	964,700,000.00	0.96	-	-
中信证券	296,080,069.46	4.46	260,200,000.00	0.26	-	-
海通证券	582,628,781.74	8.78	12,736,989,000.00	12.68	-	-
国金证券	414,469,872.83	6.25	11,126,514,000.00	11.08	-	-
广发证券	208,323,816.57	3.14	481,100,000.00	0.48	-	-
银河证券	50,195,232.21	0.76	114,000,000.00	0.11	-	-
东方证券	339,546,855.00	5.12	9,429,046,000.00	9.39	-	-
中信建投证券	139,563,198.14	2.10	297,400,000.00	0.30	-	-
华泰证券	242,576,185.30	3.66	2,150,136,000.00	2.14	-	-
中金公司	19,479,463.33	0.29	15,800,000.00	0.02	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证	-	-	-	-	-	-

券						
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

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澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 04 日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 05 日
3	鹏华可转债债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
4	鹏华可转债债券型证券投资基金更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 08 日
5	鹏华可转债债券型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 08 日
6	鹏华可转债债券型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 08 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 14 日
8	鹏华可转债债券型证券投资基金 2022 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
9	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
10	鹏华可转债债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
11	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海证券股份有限公司申购	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2023 年 06 月 05 日

	(含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	基金电子披露网站	
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购(含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 20 日

注：无。

§ 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 2023 年中期报告》(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第 43 层鹏华基金管理有限公司。

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.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 8 月 30 日