

# 鹏华可转债债券型证券投资基金

## 2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 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：2024 年 1 月 19 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 2024 年 01 月 18 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 10 月 01 日起至 2023 年 12 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	6,334,890,480.41 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	3,099,168,149.04 份	3,235,722,331.37 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 10 月 1 日-2023 年 12 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	-159,269,385.48	-128,378,890.78
2. 本期利润	-212,442,235.83	-170,104,831.01
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0645	-0.0495
4. 期末基金资产净值	4,053,927,280.91	3,207,711,168.20
5. 期末基金份额净值	1.308	0.991

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

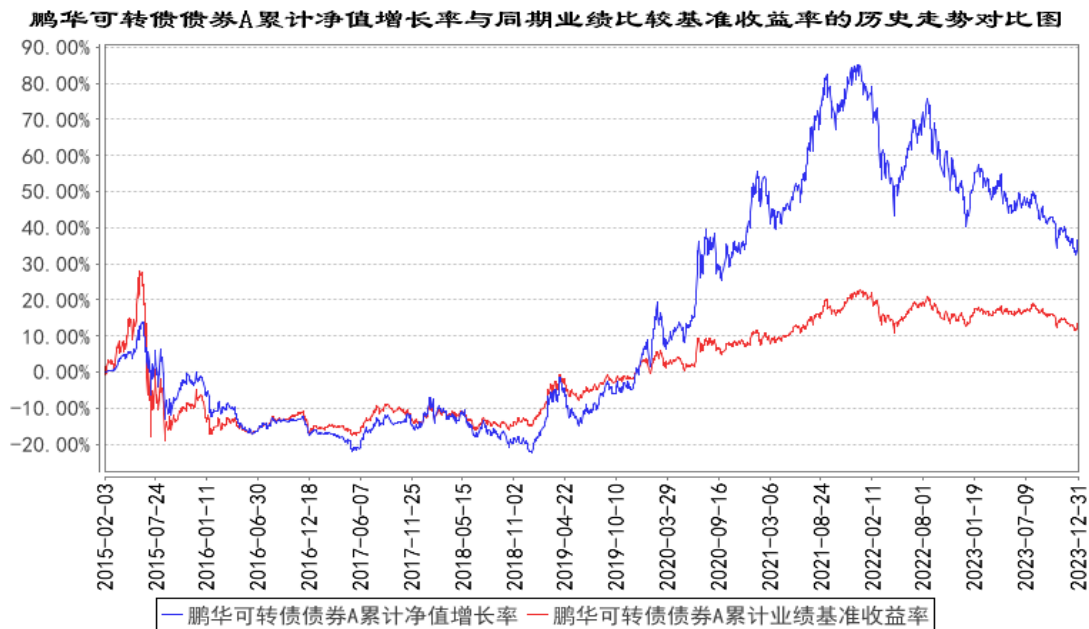
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.53%	0.66%	-2.22%	0.32%	-2.31%	0.34%
过去六个月	-7.17%	0.62%	-2.71%	0.29%	-4.46%	0.33%
过去一年	-4.87%	0.70%	-0.04%	0.30%	-4.83%	0.40%
过去三年	-5.35%	0.98%	3.96%	0.41%	-9.31%	0.57%
过去五年	74.62%	1.02%	33.08%	0.47%	41.54%	0.55%
自基金合同生效起至今	36.55%	0.96%	13.54%	0.81%	23.01%	0.15%

鹏华可转债债券 C

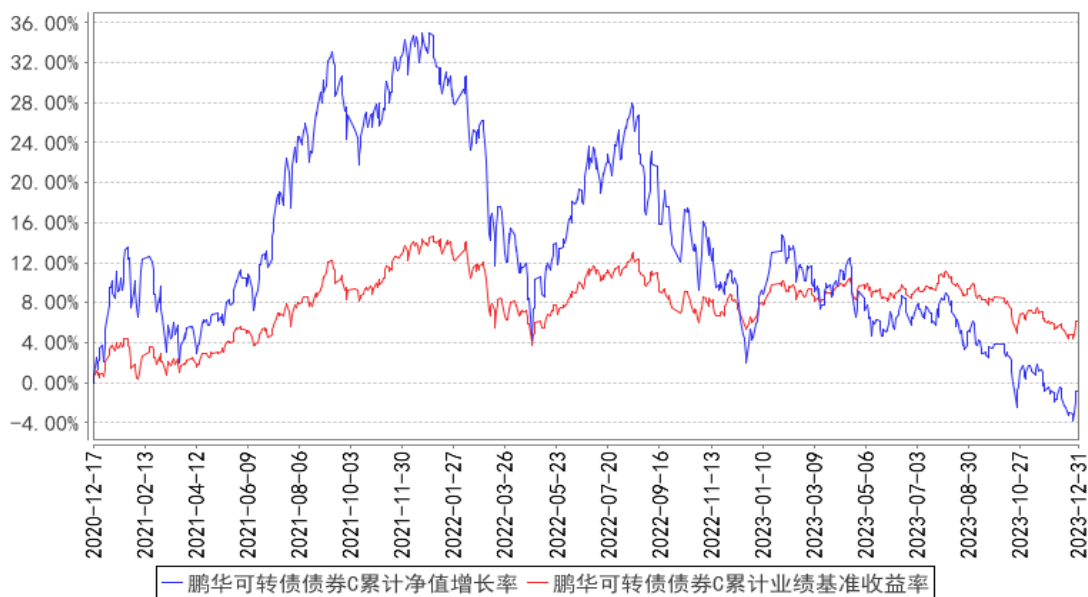
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-4.62%	0.66%	-2.22%	0.32%	-2.40%	0.34%
过去六个月	-7.30%	0.62%	-2.71%	0.29%	-4.59%	0.33%
过去一年	-5.17%	0.70%	-0.04%	0.30%	-5.13%	0.40%
过去三年	-5.98%	0.98%	3.96%	0.41%	-9.94%	0.57%
自基金合同 生效起至今	-0.90%	0.98%	6.11%	0.41%	-7.01%	0.57%

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，历任固定收益部高级债券研究员、债券投资一部基金经理、副总经理/基金经理。现担任多元资产投资部总经理/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

				<p>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。</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、分配等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 年四季度债券市场收益率整体下行，中长端利率下行幅度大于短端。随着 10 月地方政府再融资债发行，短端资金面趋紧，债券市场利率上行；10 月、11 月 PMI 回落、地产销售仍然偏弱、12 月政策基调以稳为主，债券市场长端收益率率先下行，短端收益率自 12 月中旬开始回落。展望 2024 年一季度，宏观经济可能仍然面临一定的下行压力，货币政策可能会维持宽松基调，债券市场收益率虽然整体水平较低，但可能呈现易下难上的状态。

2023 年四季度股票市场整体下跌，煤炭、电子、农业等行业上涨，地产、建材等行业跌幅靠前。股票市场下跌一方面是由于国内地产销售仍然偏弱、投资者对经济预期转为悲观，另外一方面和海外投资者持续减持中国股票有关。展望 2024 年一季度，当前股票市场估值水平已经较低，外资卖出力度可能逐步减弱，股票市场配置价值较高。后续中美货币政策都有继续宽松的可能性，股票市场可能会呈现结构性行情，与经济弱相关、受益流动性宽松的成长板块可能更为受益。

2023 年四季度可转债市场整体下跌。可转债市场一方面受到股票市场下跌的影响，另外一方面四季度债券市场短端资金面偏紧，也对转债的估值形成了压力。展望 2024 年一季度，转债市场的估值水平已经有所压缩，债券市场对估值的负面影响减弱，股票市场有望在低位企稳，因此转债市场可能会有表现，转股溢价率较低的股性转债会更加受益。

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，可转债仓位有所增加，对可转债个券和个股进行了一定的调整。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类净值增长率为-4.53%，同期业绩比较基准增长率为-2.22%；C 类净值增长率为-4.62%，同期业绩比较基准增长率为-2.22%。

### 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	1,357,792,889.34	16.34
	其中：股票	1,357,792,889.34	16.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,637,221,841.74	79.88
	其中：债券	6,637,221,841.74	79.88
	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	-9,451.78	-0.00
	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	167,299,240.30	2.01
8	其他资产	146,344,143.99	1.76
9	合计	8,308,648,663.59	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	50,532,075.00	0.70
C	制造业	773,393,420.29	10.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,870,632.00	0.33
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	362,875,076.48	5.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,213,513.67	0.33
J	金融业	40,739,139.00	0.56
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	52,519,534.00	0.72
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	29,649,498.90	0.41
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,357,792,889.34	18.70



## 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	600026	中远海能	11,743,351	143,738,616.24	1.98
2	002920	德赛西威	766,213	99,232,245.63	1.37
3	601975	招商南油	33,006,847	92,419,171.60	1.27
4	601872	招商轮船	15,507,828	91,186,028.64	1.26
5	688025	杰普特	871,446	80,652,327.30	1.11
6	002463	沪电股份	3,193,400	70,638,008.00	0.97
7	600276	恒瑞医药	968,643	43,811,722.89	0.60
8	688036	传音控股	296,310	41,009,304.00	0.56
9	300033	同花顺	259,700	40,739,139.00	0.56
10	300122	智飞生物	651,027	39,784,259.97	0.55

## 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	372,995,795.62	5.14
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）	6,264,226,046.12	86.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,637,221,841.74	91.40

## 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	132018	G 三峡 EB1	1,838,500	284,163,345.14	3.91
2	113615	金诚转债	713,140	230,023,013.93	3.17
3	113055	成银转债	1,784,370	200,325,011.27	2.76
4	019703	23 国债 10	1,967,000	199,492,601.10	2.75
5	127050	麒麟转债	1,547,987	195,792,152.45	2.70

## 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

大秦铁路股份有限公司在报告编制日前一年内受到西安铁路监督管理局的处罚。

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。

#### 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	1,056,392.29
2	应收证券清算款	89,625,164.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	55,662,587.33
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	146,344,143.99
---	----	----------------

#### 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	132018	G 三峡 EB1	284,163,345.14	3.91
2	113615	金诚转债	230,023,013.93	3.17
3	113055	成银转债	200,325,011.27	2.76
4	127050	麒麟转债	195,792,152.45	2.70
5	127045	牧原转债	192,593,458.45	2.65
6	123176	精测转 2	185,939,307.46	2.56
7	113044	大秦转债	179,993,160.95	2.48
8	110079	杭银转债	179,385,845.77	2.47
9	127063	贵轮转债	167,474,804.91	2.31
10	110077	洪城转债	160,575,087.63	2.21
11	123107	温氏转债	151,250,762.79	2.08
12	113648	巨星转债	123,240,547.07	1.70
13	127020	中金转债	118,143,947.37	1.63
14	113050	南银转债	117,281,139.56	1.62
15	110091	合力转债	115,997,714.42	1.60
16	127064	杭氧转债	109,340,738.80	1.51
17	127073	天赐转债	103,319,997.09	1.42
18	127006	敖东转债	101,500,176.47	1.40
19	110048	福能转债	101,034,839.57	1.39
20	118030	睿创转债	97,819,977.16	1.35
21	111010	立昂转债	90,356,467.30	1.24
22	110075	南航转债	89,445,843.81	1.23
23	123119	康泰转 2	83,761,859.07	1.15
24	128081	海亮转债	81,442,182.90	1.12
25	118024	冠宇转债	80,491,107.55	1.11
26	123192	科思转债	75,886,870.13	1.05
27	113060	浙 22 转债	73,940,277.66	1.02
28	127061	美锦转债	64,819,569.83	0.89
29	123194	百洋转债	64,583,236.53	0.89
30	127054	双箭转债	63,860,093.82	0.88
31	128128	齐翔转 2	62,780,313.54	0.86
32	110090	爱迪转债	59,585,588.35	0.82
33	113064	东材转债	59,549,341.83	0.82
34	113063	赛轮转债	58,146,514.86	0.80
35	123025	精测转债	50,846,865.15	0.70
36	113664	大元转债	47,438,744.87	0.65
37	127032	苏行转债	46,703,899.83	0.64
38	127030	盛虹转债	46,387,221.07	0.64

39	127037	银轮转债	46,273,357.36	0.64
40	127022	恒逸转债	46,194,805.20	0.64
41	128095	恩捷转债	45,949,533.14	0.63
42	127043	川恒转债	45,909,618.96	0.63
43	123158	宙邦转债	44,224,411.38	0.61
44	113602	景 20 转债	42,471,304.22	0.58
45	127082	亚科转债	42,021,171.72	0.58
46	127069	小熊转债	39,875,020.94	0.55
47	111000	起帆转债	39,447,734.97	0.54
48	128106	华统转债	39,396,759.45	0.54
49	118022	锂科转债	39,102,040.73	0.54
50	123121	帝尔转债	38,746,909.87	0.53
51	113021	中信转债	38,488,923.51	0.53
52	123197	光力转债	37,550,322.61	0.52
53	123149	通裕转债	37,129,353.00	0.51
54	110062	烽火转债	37,043,462.58	0.51
55	113669	景 23 转债	36,533,659.91	0.50
56	110084	贵燃转债	35,203,872.23	0.48
57	123127	耐普转债	34,950,554.78	0.48
58	111011	冠盛转债	34,892,810.68	0.48
59	128119	龙大转债	34,183,603.87	0.47
60	118004	博瑞转债	32,861,932.28	0.45
61	113051	节能转债	31,877,953.08	0.44
62	113667	春 23 转债	31,523,661.19	0.43
63	110074	精达转债	31,354,832.09	0.43
64	127058	科伦转债	31,203,386.21	0.43
65	113631	皖天转债	28,888,803.01	0.40
66	110085	通 22 转债	27,768,126.82	0.38
67	128109	楚江转债	27,403,186.60	0.38
68	127005	长证转债	27,217,723.59	0.37
69	127086	恒邦转债	25,643,946.51	0.35
70	128141	旺能转债	24,852,375.06	0.34
71	123193	海能转债	24,154,593.39	0.33
72	118035	国力转债	24,072,063.18	0.33
73	123171	共同转债	24,003,376.90	0.33
74	123169	正海转债	20,938,028.12	0.29
75	118026	利元转债	20,809,730.64	0.29
76	113653	永 22 转债	20,298,934.25	0.28
77	118033	华特转债	19,799,670.45	0.27
78	113504	艾华转债	19,655,079.44	0.27
79	123188	水羊转债	17,587,332.82	0.24
80	110068	龙净转债	15,857,260.27	0.22

81	113534	鼎胜转债	14,569,175.91	0.20
82	123112	万讯转债	13,468,868.61	0.19
83	123170	南电转债	13,253,335.01	0.18
84	113598	法兰转债	13,123,912.09	0.18
85	118017	深科转债	12,582,204.70	0.17
86	123114	三角转债	11,341,033.64	0.16
87	113594	淳中转债	11,175,530.24	0.15
88	111007	永和转债	11,133,887.49	0.15
89	113636	甬金转债	10,705,568.40	0.15
90	127078	优彩转债	9,181,931.22	0.13
91	128144	利民转债	8,957,661.62	0.12
92	118019	金盘转债	8,454,212.10	0.12
93	128137	洁美转债	8,114,377.44	0.11
94	123143	胜蓝转债	7,823,373.36	0.11
95	123085	万顺转 2	6,920,620.60	0.10
96	113588	润达转债	6,660,944.26	0.09
97	123038	联得转债	6,635,389.71	0.09
98	113609	永安转债	5,669,253.02	0.08
99	123050	聚飞转债	5,030,961.64	0.07
100	127065	瑞鹄转债	4,901,552.95	0.07
101	118003	华兴转债	4,149,125.95	0.06
102	132020	19 蓝星 EB	3,906,476.15	0.05
103	123120	隆华转债	3,707,049.93	0.05
104	118021	新致转债	3,672,797.48	0.05
105	123144	裕兴转债	3,597,933.39	0.05
106	123150	九强转债	3,513,493.48	0.05
107	111005	富春转债	2,977,776.41	0.04
108	123090	三诺转债	2,748,058.28	0.04
109	123035	利德转债	2,470,535.33	0.03
110	118025	奕瑞转债	2,413,518.86	0.03
111	123180	浙矿转债	1,973,944.29	0.03
112	113658	密卫转债	1,959,015.08	0.03
113	118009	华锐转债	1,608,735.87	0.02
114	128123	国光转债	1,581,866.26	0.02
115	113641	华友转债	1,354,242.53	0.02
116	113033	利群转债	1,273,937.18	0.02
117	127051	博杰转债	1,120,490.54	0.02
118	123109	昌红转债	933,054.40	0.01
119	128121	宏川转债	900,938.78	0.01
120	123088	威唐转债	594,524.01	0.01
121	118018	瑞科转债	147,084.81	0.00
122	127083	山路转债	80,298.72	0.00

123	113654	永 02 转债	25,084.82	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	3,472,803,750.78	3,695,301,810.87
报告期期间基金总申购份额	90,765,755.92	607,368,936.18
减：报告期期间基金总赎回份额	464,401,357.66	1,066,948,415.68
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	3,099,168,149.04	3,235,722,331.37

### § 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 4 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

2024 年 1 月 19 日