

# 鹏华可转债债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 18 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 07 月 17 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 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 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	5,959,496,134.53 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	<p>1、大类资产配置</p> <p>本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>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。</p> <p>(1) 可转债投资策略</p> <p>本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等，这类债券赋予债权人或债务人某种期权，比普通的债券更为灵活。本基金将采用专业的分</p>

析和计算方法,综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格,力求选择被市场低估的品种,获得超额收益。

#### 1) 传统可转债投资策略

传统可转债即指可转换公司债券,是指在规定的期限内持有人有权但没有义务按约定的价格转换成公司股票的一种公司债券,兼具债权和股权双重属性。债权属性是指投资者可以选择持有可转债到期,得到本金与利息收益;股权属性即股票期权属性,是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格把可转债转换成股票。因此,可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。

a. 个券选择策略。一方面,本基金将对所有可转债对应的标的股票进行深入研究,采用定性分析(行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等)与定量分析(P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV等)相结合的方式挑选成长性好且估值合理的正股;另一方面,本基金将深入研究分析可转债自身的信用评估。综上所述,本基金将结合可转债自身的信用评估和其正股的价值分析,做为选取个券的重要依据。

b. 条款价值发现策略。可转债一般均设有一些特殊条款,包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等,这些条款在特定环境下对可转债价值有着较大的影响。修正转股价条款给予发行人向下修正转股价格的权利,有利于提升可转债的期权价值;回售条款给予投资者将可转债按照约定价格回售给发行人的权利,为可转债投资提供了一种安全边际;赎回条款给予发行人从投资者处赎回可转债的权利,若发行人放弃赎回权则会提高可转债的期权价值。本基金将通过有效分析相关信息力争把握各项条款给可转债带来的可能的投资机会。

c. 套利策略。可转债可以按照约定的价格转换为股票,因此在日常交易运作过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当处于转股期内的可转债市价低于转股价值,即可转债的转换溢价率为负时,买入可转债的同时卖出标的股票可以获得套利价差;反之,买入标的股票的同时卖出可转债也可以获取反向套利价差。在日常交易运作中,本基金将密切关注可转债与标的股票之间价格之间的对比关系,择机实施套利策略,以增强本基金的收益。

#### 2) 分离交易可转债投资策略

分离交易可转债与传统可转债的不同点主要体现在分离交易可转债在上市后分离为债券部分跟权证部分分别独自进行交易。本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时,将重点分析附权部分对债券估值的影

响。对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理，权证部分将在可交易之日起不超过 3 个月的时间内卖出。

#### (2) 普通债券投资策略

本基金的债券投资将主要采取久期策略、类属配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略。

##### 1) 久期策略

本基金将通过自上而下的组合久期管理策略，以实现组合利率风险的有效控制。基金管理人将根据对宏观经济周期所处阶段及其他相关因素的研判调整组合久期。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，以减小债券价格下降带来的风险。

##### 2) 类属配置策略

本基金在确定久期的基础上，通过对宏观经济、市场利率、债券供求等的分析，预测各类属资产预期风险及收益情况，并结合分析债券品种期限和不同债券市场流动性及收益性现状，制定普通债券品种期限配置策略，确定普通债券组合资产在政府债券、企业主体债券、货币资产之间的分配比例。

##### 3) 收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

##### 4) 骑乘策略

本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。

##### 5) 息差策略

本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

##### 6) 债券选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被

	<p>低估的债券进行投资。</p> <p>7) 中小企业私募债投资策略</p> <p>中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金股票投资以精选个股为主，发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，从定量和定性两方面考察上市公司的增值潜力。</p> <p>定量方面综合考虑盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，包括净资产与市值比率 (B/P)、每股盈利/每股市价 (E/P)、年现金流/市值 (cashflow-to-price) 以及销售收入/市值 (S/P) 等价值指标，以及净资产收益率 (ROE)、每股收益增长率以及主营业务收入增长率等成长指标。</p> <p>定性方面考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势等多种因素，精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。</p>	
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%	
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	3,091,706,383.22 份	2,867,789,751.31 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 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	-3,149,668.42	-2,715,573.31
2. 本期利润	-23,496.71	-13,716,577.75
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0000	-0.0047
4. 期末基金资产净值	4,046,700,079.72	2,841,920,785.85
5. 期末基金份额净值	1.3089	0.9910

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	0.22%	0.71%	0.78%	0.32%	-0.56%	0.39%
过去六个月	0.07%	0.88%	1.24%	0.35%	-1.17%	0.53%
过去一年	-7.10%	0.76%	-1.50%	0.32%	-5.60%	0.44%
过去三年	-11.92%	0.96%	2.02%	0.40%	-13.94%	0.56%
过去五年	53.19%	1.00%	21.30%	0.43%	31.89%	0.57%
自基金合同 生效起至今	36.65%	0.95%	14.95%	0.79%	21.70%	0.16%

鹏华可转债债券 C

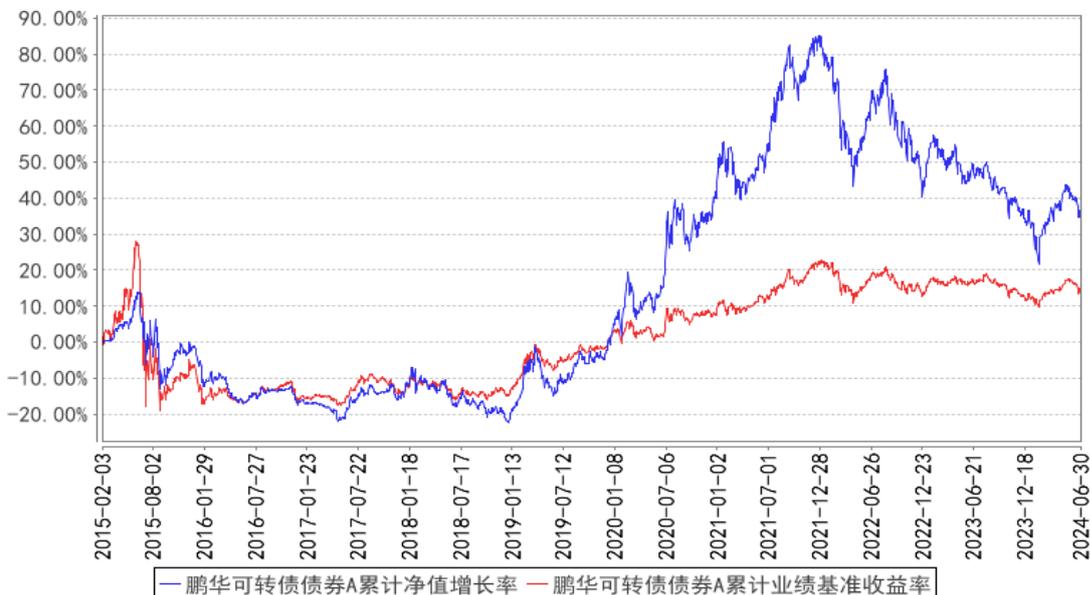
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.20%	0.71%	0.78%	0.32%	-0.58%	0.39%
过去六个月	0.00%	0.88%	1.24%	0.35%	-1.24%	0.53%

过去一年	-7.30%	0.76%	-1.50%	0.32%	-5.80%	0.44%
过去三年	-12.46%	0.96%	2.02%	0.40%	-14.48%	0.56%
自基金合同生效起至今	-0.90%	0.97%	7.43%	0.40%	-8.33%	0.57%

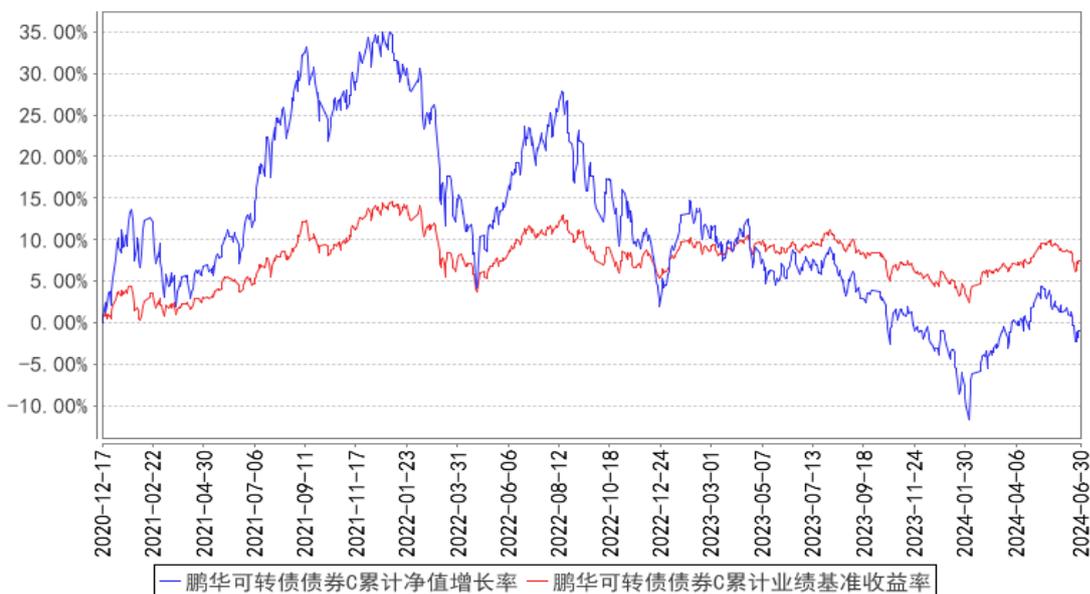
注：业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×60%+中债总指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×10%

### 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	-	10 年	王石千先生, 国籍中国, 经济学硕士, 10 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 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 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 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 2024 年 04 月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 2024 年 06 月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。

#### 4.1.1 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

2024 年二季度债券市场收益率整体下行，信用债收益率下行幅度大于利率债。二季度经济数据有所走弱，社融数据波动较大，融资需求总体有所不足，而资金供给相对平稳，从供需层面看利率趋向下行；在叫停存款“手工补息”的驱动下，资金流向非银机构，进一步增加了债券尤其是信用债的配置需求。展望 2024 年三季度，在融资需求偏弱、政策较为平稳的情况下，债券

市场收益率可能仍会维持下行趋势。

2024 年二季度股票市场整体下跌，从风格上看以沪深 300 为代表的大盘股跑赢以中证 2000 为代表的小盘股。二季度国内经济需求有所放缓，出口新订单也有走弱的担忧，美国通胀和就业表现降低了市场对美联储的降息预期，这些因素都对股票市场造成了不利的影响，市场在 5、6 月开始开始回落。展望 2024 年三季度，宏观经济整体需求偏弱的环境可能还不会有较大变化，但权益市场估值偏低、流动性较为充裕，整体可能呈现低位震荡的表现，红利、大盘风格可能延续偏强表现，科技类资产也有表现的可能。

2024 年二季度转债市场整体小幅上涨，但内部分化较大。以银行转债为代表的大盘转债表现较好，但小盘转债整体表现不佳，这与股票市场二季度整体的风格表现较为一致。转债市场的估值水平先上后下，但债性转债的估值水平的表现相对偏弱，主要是由于部分个券信用风险和退市风险较大，导致低价转债整体抛压增加。展望 2024 年三季度，在债券市场收益率下行的环境下，转债市场估值水平整体会趋于稳定，大盘转债可能会继续优于小盘转债，股性转债的性价比可能高于债性转债。

报告期内本基金以持有可转债和股票为主，转债仓位和股票仓位整体变化不大，对可转债个券进行了调整，减持了部分性价比下降的转债个券，增持了部分性价比更高的转债个券。

#### 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 类份额净值增长率为 0.22%，同期业绩比较基准增长率为 0.78%；C 类份额净值增长率为 0.20%，同期业绩比较基准增长率为 0.78%。

#### 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	1,380,959,064.50	17.91
	其中：股票	1,380,959,064.50	17.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,090,283,177.37	79.01
	其中：债券	6,090,283,177.37	79.01
	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	89,300,000.00	1.16
	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	119,777,439.32	1.55
8	其他资产	28,087,877.91	0.36
9	合计	7,708,407,559.10	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	65,825,613.00	0.96
C	制造业	1,001,539,056.58	14.54
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	258,310,246.64	3.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,576,895.22	0.08
J	金融业	9,633,988.00	0.14
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	15,974,235.90	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	6,402,438.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,696,591.16	0.26
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,380,959,064.50	20.05

### 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	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	------	-----------

				(元)	(%)
1	601872	招商轮船	10,741,904	90,769,088.80	1.32
2	002984	森麒麟	3,510,898	84,577,532.82	1.23
3	600150	中国船舶	1,983,600	80,752,356.00	1.17
4	002475	立讯精密	1,725,800	67,841,198.00	0.98
5	002371	北方华创	190,400	60,907,056.00	0.88
6	603606	东方电缆	1,148,000	56,033,880.00	0.81
7	600875	东方电气	2,991,716	55,197,160.20	0.80
8	600026	中远海能	3,451,351	53,875,589.11	0.78
9	601919	中远海控	3,463,000	53,641,870.00	0.78
10	601975	招商南油	13,179,847	47,315,650.73	0.69

#### 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	380,186,010.71	5.52
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)	5,710,097,166.66	82.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,090,283,177.37	88.41

#### 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	127050	麒麟转债	1,946,776	261,488,018.82	3.80
2	127045	牧原转债	1,975,456	233,793,918.68	3.39
3	113055	成银转债	1,784,370	224,730,890.83	3.26
4	110079	杭银转债	1,657,030	200,114,927.90	2.91
5	127020	中金转债	1,569,466	189,039,599.75	2.74

#### 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

杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。  
中国南方航空股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国民用航空中南地区管理局的处罚。  
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	704,950.14
2	应收证券清算款	27,121,681.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	261,246.72
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	28,087,877.91

### 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	127050	麒麟转债	261,488,018.82	3.80
2	127045	牧原转债	233,793,918.68	3.39

3	113055	成银转债	224,730,890.83	3.26
4	110079	杭银转债	200,114,927.90	2.91
5	127020	中金转债	189,039,599.75	2.74
6	113615	金诚转债	148,901,873.35	2.16
7	123107	温氏转债	145,988,186.54	2.12
8	110075	南航转债	142,090,780.36	2.06
9	113060	浙 22 转债	140,452,415.26	2.04
10	113050	南银转债	138,737,115.92	2.01
11	113069	博 23 转债	133,159,613.14	1.93
12	123176	精测转 2	113,777,597.66	1.65
13	113666	爱玛转债	104,116,483.73	1.51
14	113648	巨星转债	103,066,429.86	1.50
15	113658	密卫转债	102,440,724.35	1.49
16	127084	柳工转 2	96,728,297.33	1.40
17	123188	水羊转债	82,113,403.12	1.19
18	123192	科思转债	81,338,178.74	1.18
19	110090	爱迪转债	71,042,317.70	1.03
20	127095	广泰转债	67,132,241.18	0.97
21	127043	川恒转债	66,325,929.19	0.96
22	113024	核建转债	65,689,626.38	0.95
23	128128	齐翔转 2	64,823,579.84	0.94
24	123219	宇瞳转债	63,362,830.62	0.92
25	127054	双箭转债	61,602,693.27	0.89
26	123194	百洋转债	61,354,510.33	0.89
27	113067	燃 23 转债	61,271,507.02	0.89
28	127086	恒邦转债	59,118,189.01	0.86
29	123191	智尚转债	59,022,679.39	0.86
30	111007	永和转债	58,315,353.08	0.85
31	113632	鹤 21 转债	56,824,292.61	0.82
32	113064	东材转债	54,424,078.80	0.79
33	110068	龙净转债	53,992,911.07	0.78
34	123119	康泰转 2	53,543,303.42	0.78
35	111011	冠盛转债	51,971,493.78	0.75
36	113619	世运转债	51,623,060.86	0.75
37	110094	众和转债	50,835,940.03	0.74
38	127032	苏行转债	50,519,664.10	0.73
39	127092	运机转债	49,656,228.97	0.72
40	128081	海亮转债	44,956,137.81	0.65
41	113664	大元转债	43,358,553.31	0.63
42	113675	新 23 转债	42,610,029.93	0.62
43	123127	耐普转债	42,409,520.74	0.62
44	118004	博瑞转债	40,945,956.65	0.59

45	113021	中信转债	40,511,217.74	0.59
46	127069	小熊转债	38,593,105.65	0.56
47	118025	奕瑞转债	36,432,450.83	0.53
48	123145	药石转债	36,080,669.39	0.52
49	127074	麦米转 2	36,030,562.17	0.52
50	118037	上声转债	35,985,853.27	0.52
51	127035	濮耐转债	35,706,352.27	0.52
52	127016	鲁泰转债	35,389,556.04	0.51
53	123223	九典转 02	35,270,346.28	0.51
54	113602	景 20 转债	35,213,154.27	0.51
55	127064	杭氧转债	35,106,164.50	0.51
56	127037	银轮转债	35,033,684.88	0.51
57	127088	赫达转债	35,021,413.19	0.51
58	128106	华统转债	34,868,152.19	0.51
59	113669	景 23 转债	34,730,397.01	0.50
60	111000	起帆转债	34,378,166.91	0.50
61	113033	利群转债	34,371,929.12	0.50
62	123212	立中转债	34,243,871.34	0.50
63	123035	利德转债	33,535,006.62	0.49
64	110084	贵燃转债	33,025,425.86	0.48
65	118042	奥维转债	32,984,454.44	0.48
66	110062	烽火转债	31,279,149.09	0.45
67	110074	精达转债	31,199,724.66	0.45
68	127078	优彩转债	31,061,535.73	0.45
69	113667	春 23 转债	29,911,116.35	0.43
70	127099	盛航转债	29,247,583.38	0.42
71	113631	皖天转债	29,223,080.14	0.42
72	123172	漱玉转债	29,077,800.19	0.42
73	123025	精测转债	27,320,987.93	0.40
74	127082	亚科转债	25,219,617.07	0.37
75	127101	豪鹏转债	24,545,757.66	0.36
76	123205	大叶转债	23,665,299.25	0.34
77	128141	旺能转债	23,181,453.10	0.34
78	127073	天赐转债	21,562,236.83	0.31
79	110085	通 22 转债	20,924,945.99	0.30
80	123169	正海转债	19,419,816.98	0.28
81	123221	力诺转债	18,481,260.36	0.27
82	127089	晶澳转债	18,296,187.30	0.27
83	113623	凤 21 转债	18,170,709.24	0.26
84	127085	韵达转债	17,795,626.84	0.26
85	123236	家联转债	17,543,714.17	0.25
86	113673	岱美转债	17,129,812.86	0.25

87	118030	睿创转债	16,512,478.23	0.24
88	123224	宇邦转债	15,284,334.43	0.22
89	118003	华兴转债	15,143,609.51	0.22
90	127022	恒逸转债	13,885,239.38	0.20
91	123197	光力转债	13,078,674.76	0.19
92	118024	冠宇转债	12,457,787.83	0.18
93	113653	永 22 转债	12,350,912.95	0.18
94	113534	鼎胜转债	11,826,348.32	0.17
95	123158	宙邦转债	10,709,077.87	0.16
96	123121	帝尔转债	9,951,968.26	0.14
97	113598	法兰转债	8,629,847.64	0.13
98	111010	立昂转债	8,593,599.96	0.12
99	113652	伟 22 转债	7,974,367.03	0.12
100	127100	神码转债	7,321,061.26	0.11
101	118022	锂科转债	7,018,981.51	0.10
102	123087	明电转债	5,096,976.04	0.07
103	113636	甬金转债	4,044,613.32	0.06
104	132020	19 蓝星 EB	3,973,565.79	0.06
105	123203	明电转 02	3,356,415.97	0.05
106	123150	九强转债	3,210,680.98	0.05
107	123090	三诺转债	2,620,533.90	0.04
108	111005	富春转债	2,122,786.43	0.03
109	128144	利民转债	1,923,477.26	0.03
110	123180	浙矿转债	1,902,612.90	0.03
111	118035	国力转债	1,730,333.94	0.03
112	127030	盛虹转债	1,679,277.16	0.02
113	128123	国光转债	1,604,740.62	0.02
114	118043	福立转债	1,440,906.78	0.02
115	118009	华锐转债	1,405,260.07	0.02
116	113663	新化转债	1,391,437.83	0.02
117	113641	华友转债	1,322,115.19	0.02
118	118040	宏微转债	1,316,974.14	0.02
119	127051	博杰转债	1,098,824.16	0.02
120	128137	洁美转债	1,064,500.64	0.02
121	123109	昌红转债	904,014.83	0.01
122	128121	宏川转债	784,948.41	0.01
123	123088	威唐转债	522,531.67	0.01
124	113530	大丰转债	423,825.53	0.01
125	113651	松霖转债	261,638.36	0.00
126	118018	瑞科转债	114,794.41	0.00
127	127083	山路转债	82,233.53	0.00
128	113654	永 02 转债	21,415.84	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	2,963,602,088.28	2,550,740,839.94
报告期期间基金总申购份额	338,069,608.99	1,247,688,869.06
减：报告期期间基金总赎回份额	209,965,314.05	930,639,957.69
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	3,091,706,383.22	2,867,789,751.31

## § 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 2024 年第 2 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 7 月 18 日