

鹏华可转债债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	12
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	50

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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.11 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	55
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 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	4,137,616,650.41 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	鹏华可转债债券 D
下属分级基金的交 易代码	000297	010964	022156
报告期末下属分级 基金的份额总额	875,153,195.79 份	939,799,232.08 份	2,322,664,222.54 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	1、大类资产配置 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。 2、固定收益类资产投资策略 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。 （1）可转债投资策略 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，以实现对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低估的债券进行投资。 7) 中小企业私募债投资策略 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。 3、股票投资策略 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。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。 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。
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	任航
	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		4006788533	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		张纳沙	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)		
	鹏华可转债债券 A	鹏华可转债债券 C	鹏华可转债债券 D
本期已实现收益	219,055,253.10	170,283,162.05	567,224,923.99
本期利润	224,009,933.61	160,219,398.13	444,622,057.23
加权平均基	0.2131	0.1438	0.1412

金 份 额 本 期 利 润			
本 期 加 权 平 均 净 值 利 润 率	10.99%	9.83%	8.49%
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	11.25%	11.13%	11.25%
3.1.2 期 末 数 据 和 指 标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
期 末 可 供 分 配 利 润	357,985,307.33	221,980,720.79	1,020,264,644.39
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	0.4091	0.2362	0.4393
期 末 基 金 资 产 净 值	1,757,452,606.13	1,423,168,616.91	4,002,620,957.57
期 末 基 金 份 额 净 值	2.0082	1.5143	1.7233
3.1.3 累 计 期 末 指 标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率	109.65%	51.43%	72.33%

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
过去三个月	13.60%	1.30%	3.79%	0.61%	9.81%	0.69%
过去六个月	11.25%	1.36%	2.99%	0.66%	8.26%	0.70%
过去一年	35.91%	1.23%	11.25%	0.56%	24.66%	0.67%
过去三年	42.53%	1.10%	21.92%	0.47%	20.61%	0.63%
过去五年	35.14%	1.08%	26.28%	0.46%	8.86%	0.62%
过去七年	135.04%	1.07%	50.14%	0.46%	84.90%	0.61%
过去十年	149.59%	0.97%	69.40%	0.46%	80.19%	0.51%
自基金合同生效起至今	109.65%	1.01%	42.28%	0.75%	67.37%	0.26%

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
过去三个月	13.54%	1.30%	3.79%	0.61%	9.75%	0.69%
过去六个月	11.13%	1.36%	2.99%	0.66%	8.14%	0.70%
过去一年	35.63%	1.23%	11.25%	0.56%	24.38%	0.67%
过去三年	41.66%	1.10%	21.92%	0.47%	19.74%	0.63%
过去五年	33.77%	1.08%	26.28%	0.46%	7.49%	0.62%
自基金合同生效起至今	51.43%	1.07%	32.97%	0.46%	18.46%	0.61%

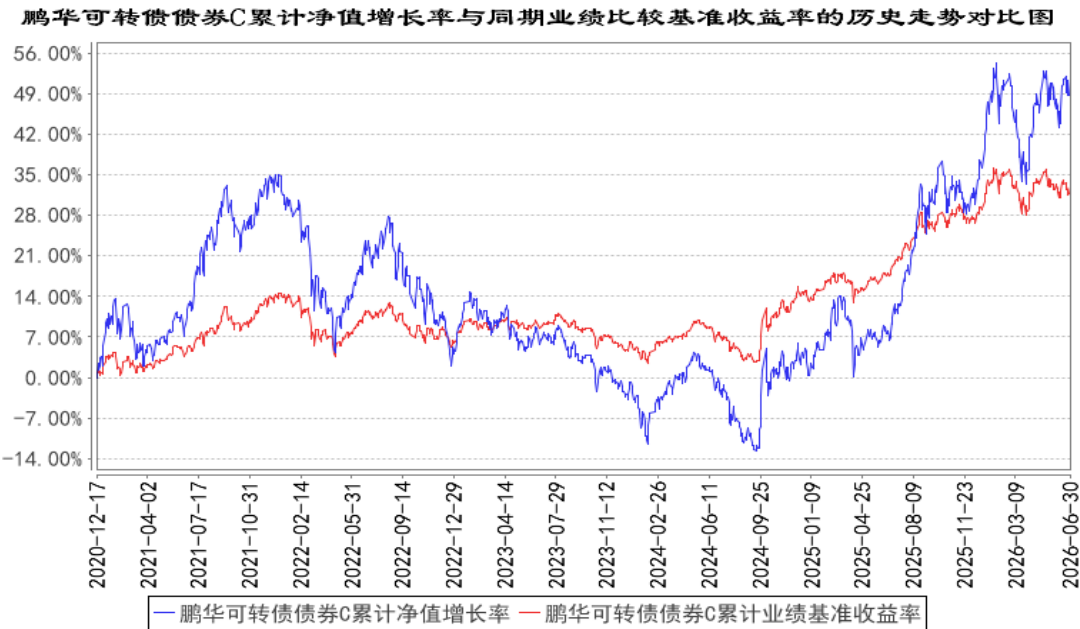
鹏华可转债债券 D

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
过去三个月	13.60%	1.30%	3.79%	0.61%	9.81%	0.69%
过去六个月	11.25%	1.36%	2.99%	0.66%	8.26%	0.70%
过去一年	35.91%	1.23%	11.25%	0.56%	24.66%	0.67%

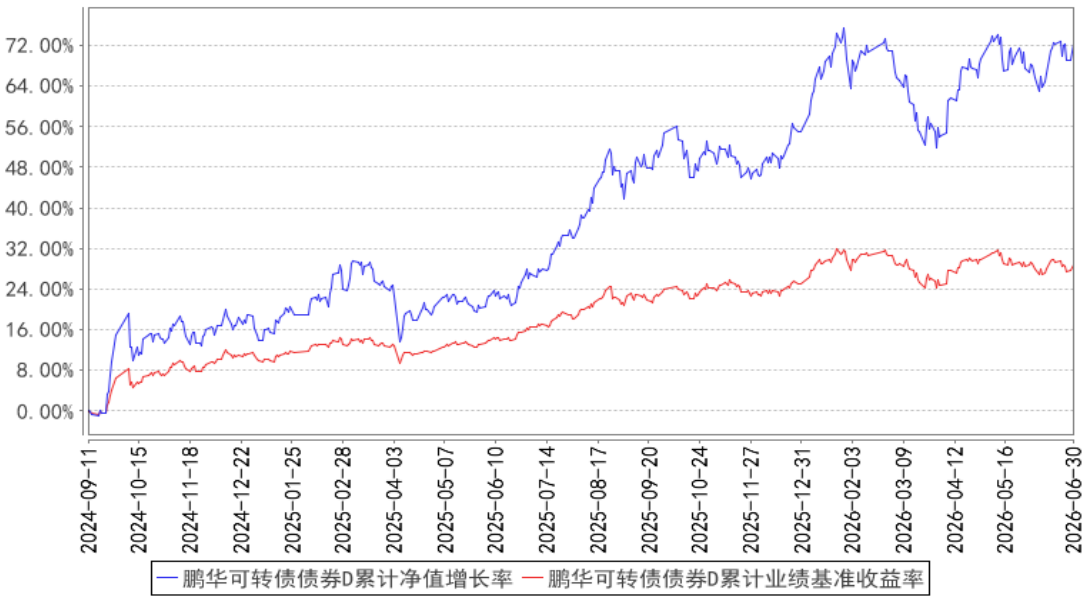
自基金合同生效 起至今	72.33%	1.26%	28.83%	0.55%	43.50%	0.71%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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



鹏华可转债债券D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。截至本报告期末，公司管理资产总规模为 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、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	本基金的基金经理	2018-07-13	-	12 年	王石千先生, 国籍中国, 经济学硕士, 12 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 2025 年 09 月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 2026 年 01 月担任鹏华畅享债券型证券投资基金基金经理，2023 年 02 月至 2025 年 06 月担任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华稳健增利债券型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月至今担任鹏华睿享 180 天持有期债券型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月至今担任鹏华睿和 90 天持有期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。
张子健	本基金的基金经理助理	2025-05-23	-	6 年	张子健先生，国籍中国，金融硕士，6 年证券从业经验。2020 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任固定收益研究部债券研究员、高级债券研究员、基金经理助

					理/资深债券研究员，现担任多元资产投资部基金经理。2026 年 01 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，2026 年 04 月至今担任鹏华添鑫 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理，张子健先生具备基金从业资格。
付锐	本基金的基金经理助理	2026-06-18	-	11 年	付锐先生，国籍中国，硕士研究生，11 年证券从业经验。曾任中国人寿资产管理有限公司助理研究员，嘉实基金管理有限公司固收交易员，招商基金管理有限公司高级债券交易员，中国国际金融股份有限公司交易主管。2026 年 06 月加盟鹏华基金管理有限公司，现从事投资研究工作。付锐先生具备基金从业资格。

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：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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

本报告期内，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%的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

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

2026 年上半年债券市场收益率整体下行，主要驱动因素来自货币环境偏宽松，银行间资金利率较低，带动债券市场收益率下行。上半年中短端债券收益率下行幅度大于长端，信用债表现好于利率债。

2026 年上半年股票市场上涨，虽然 3 月受美伊冲突影响股票市场出现回调，但上半年整体表现较好。从行业来看，行业表现较为分化，科技为代表的相关板块表现亮眼，传统内需板块较为承压。

2026 年上半年可转债市场小幅上涨，可转债整体估值水平抬升。可转债市场虽然受益于股票市场的上涨有所表现，但一方面由于转债市场估值偏高制约转债的弹性，另一方面转债市场发行人以周期行业为主，受到了正股表现的拖累。

报告期内本基金的可转债和股票仓位变化较小，对持仓的转债个券和个股进行了调整，增持了性价比更高的品种。

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 A 类份额净值增长率为 11.25%, 同期业绩比较基准增长率为 2.99%; C 类份额净值增长率为 11.13%, 同期业绩比较基准增长率为 2.99%; D 类份额净值增长率为 11.25%, 同期业绩比较基准增长率为 2.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券市场方面，宏观经济基本面较为稳定，内生融资需求偏弱，下半年物价增速可能回落，总体对债券市场较为有利；政策方面，央行维持适度宽松的货币政策，资金面相对平稳。预期债券市场后续风险不大，长端债券性价比好于中短端债券。

股票市场方面，经历了二季度科技股的快速上行，市场出现短期休整也较为正常。展望下半年，AI 产业趋势依然如火如荼，科技硬件仍然可能是市场的主线；科技以外的板块在调整后性价比明显提升，如果内需政策加力，则可能有一定的投资机会。

转债市场方面，可转债市场的大方向将跟随股票市场上涨，但可转债市场估值仍可能维持高位，赔率有所弱化。由于科技以外的其他板块股价已经明显回落，因此关注科技以外板块的可转债的投资机会，自下而上精选个券进行投资。

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、风控管理部、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 357,985,307.33 元，期末基金份额净值 2.0082 元；鹏华可转债债券 C 期末可供分配利润为 221,980,720.79 元，期末基金份额净值 1.5143 元；鹏华可转债债券 D 期末可供分配利润为 1,020,264,644.39 元，期末基金份额净值 1.7233 元。

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

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、

法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对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、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	21,248,549.09	64,813,752.98
结算备付金		86,166,425.73	98,294,535.71
存出保证金		2,308,431.91	3,865,718.91
交易性金融资产	6.4.7.2	7,665,655,239.22	8,878,643,151.09
其中：股票投资		1,434,283,840.42	1,559,311,922.79
基金投资		-	-
债券投资		6,231,371,398.80	7,319,331,228.30
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	59,300,000.00	71,594,936.98
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		3,858,224.41	32,354,586.28
应收股利		-	-
应收申购款		3,898,035.00	37,926,844.33

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		7,842,434,905.36	9,187,493,526.28
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		640,000,000.00	713,493,714.78
应付清算款		877,643.41	50,523,731.74
应付赎回款		9,078,624.28	17,023,154.22
应付管理人报酬		5,884,684.18	6,858,326.67
应付托管费		1,176,936.87	1,371,665.35
应付销售服务费		234,167.35	254,078.16
应付投资顾问费		-	-
应交税费		102,496.66	118,634.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,838,172.00	2,054,844.10
负债合计		659,192,724.75	791,698,149.81
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	4,137,616,650.41	5,339,495,948.01
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,045,625,530.20	3,056,299,428.46
净资产合计		7,183,242,180.61	8,395,795,376.47
负债和净资产总计		7,842,434,905.36	9,187,493,526.28

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 4,137,616,650.41 份，其中鹏华可转债债券 A 基金份额总额为 875,153,195.79 份，基金份额净值 2.0082 元；鹏华可转债债券 C 基金份额总额为 939,799,232.08 份，基金份额净值 1.5143 元；鹏华可转债债券 D 基金份额总额为 2,322,664,222.54 份，基金份额净值 1.7233 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		889,604,595.22	602,139,855.54
1. 利息收入		1,050,886.69	756,789.29

其中：存款利息收入	6.4.7.13	458,880.07	452,259.68
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		592,006.62	304,529.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,015,008,921.33	148,815,388.82
其中：股票投资收益	6.4.7.14	387,715,770.40	-2,684,454.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	623,037,475.90	145,653,613.28
资产支持证券投资收益	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	4,255,675.03	5,846,230.37
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	-127,711,950.17	451,237,126.41
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	1,256,737.37	1,330,551.02
减：二、营业总支出		60,753,206.25	47,783,701.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	44,448,760.95	33,686,159.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,889,752.22	6,737,231.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,622,015.56	1,836,543.10
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,587,692.79	5,342,985.25
其中：卖出回购金融资产支出		5,587,692.79	5,342,985.25
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		79,211.99	58,208.70
8. 其他费用	6.4.7.23	125,772.74	122,572.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		828,851,388.97	554,356,154.45

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		828,851,388.97	554,356,154.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		828,851,388.97	554,356,154.45

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华可转债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	5,339,495,948.01	-	3,056,299,428.46	8,395,795,376.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,339,495,948.01	-	3,056,299,428.46	8,395,795,376.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 1,201,879,297.60	-	-10,673,898.26	- 1,212,553,195.86
(一)、综合收益总额	-	-	828,851,388.97	828,851,388.97
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	- 1,201,879,297.60	-	- 839,525,287.23	- 2,041,404,584.83
其中：1. 基金申购款	5,283,139,772.75	-	3,464,147,075.37	8,747,286,848.12
2. 基金赎回款	- 6,485,019,070.	-	- 4,303,672,362.	- 10,788,691,432.

	35		60	95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,137,616,650. 41	-	3,045,625,530. 20	7,183,242,180.6 1
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	4,973,953,216. 26	-	962,537,072.04	5,936,490,288.3 0
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,973,953,216. 26	-	962,537,072.04	5,936,490,288.3 0
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 155,250,956.71	-	569,101,911.82	413,850,955.11
(一)、综合收益总额	-	-	554,356,154.45	554,356,154.45
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	- 155,250,956.71	-	14,745,757.37	-140,505,199.34
其中：1. 基金申购款	5,687,496,969. 68	-	1,235,562,462. 30	6,923,059,431.9 8
2. 基金赎回款	- 5,842,747,926.	-	- 1,220,816,704.	- 7,063,564,631.3

	39		93	2
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,818,702,259.55	-	1,531,638,983.86	6,350,341,243.41

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

聂连杰

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《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、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《公开募集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》和《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》以及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 2026 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和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

根据国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、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[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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法，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，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。
- (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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	21,248,549.09
等于：本金	21,244,656.48
加：应计利息	3,892.61
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	21,248,549.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,054,871,310.06	-	1,434,283,840.42	379,412,530.36
贵金属投资- 金交所黄金合 约		-	-	-	-
债 券	交易所 市场	5,899,745,744.07	29,136,917.24	6,231,371,398.80	302,488,737.49
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	5,899,745,744.07	29,136,917.24	6,231,371,398.80	302,488,737.49
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,954,617,054.13	29,136,917.24	7,665,655,239.22	681,901,267.85

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 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	59,300,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	59,300,000.00	—

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
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,604.32
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,739,876.70
其中：交易所市场	1,739,876.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,690.98
合计	1,838,172.00

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,299,401,521.32	1,299,401,521.32
本期申购	166,517,179.73	166,517,179.73
本期赎回（以“-”号填列）	-590,765,505.26	-590,765,505.26
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	875,153,195.79	875,153,195.79

鹏华可转债债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,117,211,644.91	1,117,211,644.91
本期申购	437,756,631.80	437,756,631.80
本期赎回（以“-”号填列）	-615,169,044.63	-615,169,044.63
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	939,799,232.08	939,799,232.08

鹏华可转债债券 D

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,922,882,781.78	2,922,882,781.78
本期申购	4,678,865,961.22	4,678,865,961.22
本期赎回（以“-”号填列）	-5,279,084,520.46	-5,279,084,520.46

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	2,322,664,222.54	2,322,664,222.54

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	264,841,393.77	781,402,331.49	1,046,243,725.26
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	264,841,393.77	781,402,331.49	1,046,243,725.26
本期利润	219,055,253.10	4,954,680.51	224,009,933.61
本期基金份额交易产生的变动数	-125,911,339.54	-262,042,908.99	-387,954,248.53
其中：基金申购款	45,165,921.01	108,825,382.24	153,991,303.25
基金赎回款	-171,077,260.55	-370,868,291.23	-541,945,551.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	357,985,307.33	524,314,103.01	882,299,410.34

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	92,511,727.02	312,597,239.13	405,108,966.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	92,511,727.02	312,597,239.13	405,108,966.15
本期利润	170,283,162.05	-10,063,763.92	160,219,398.13
本期基金份额交易产生的变动数	-40,814,168.28	-41,144,811.17	-81,958,979.45
其中：基金申购款	56,427,417.69	147,865,114.86	204,292,532.55
基金赎回款	-97,241,585.97	-189,009,926.03	-286,251,512.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	221,980,720.79	261,388,664.04	483,369,384.83

鹏华可转债债券 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	769,145,408.14	835,801,328.91	1,604,946,737.05

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	769,145,408.14	835,801,328.91	1,604,946,737.05
本期利润	567,224,923.99	-122,602,866.76	444,622,057.23
本期基金份额交易产生的变动数	-316,105,687.74	-53,506,371.51	-369,612,059.25
其中：基金申购款	1,496,841,185.85	1,609,022,053.72	3,105,863,239.57
基金赎回款	-1,812,946,873.59	-1,662,528,425.23	-3,475,475,298.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,020,264,644.39	659,692,090.64	1,679,956,735.03

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	184,193.36
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	173,586.19
其他	101,100.52
合计	458,880.07

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	387,715,770.40
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	387,715,770.40

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,175,402,200.81

减：卖出股票成本总额	4,780,158,482.34
减：交易费用	7,527,948.07
买卖股票差价收入	387,715,770.40

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	36,408,279.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	586,629,195.97
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	623,037,475.90

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,563,873,961.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,956,257,002.11
减：应计利息总额	20,554,623.90
减：交易费用	433,139.38
买卖债券差价收入	586,629,195.97

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
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,255,675.03
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	4,255,675.03

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-127,711,950.17
股票投资	221,345,342.57
债券投资	-349,057,292.74
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	-127,711,950.17

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,160,727.30
基金转换费收入	96,010.07
合计	1,256,737.37

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	32,183.61
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	25,081.76
账户维护费	9,000.00
合计	125,772.74

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、关联关系

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	44,448,760.95	33,686,159.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,176,790.83	5,223,555.16
应支付基金管理人的净管理费	38,271,970.12	28,462,604.29

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,889,752.22	6,737,231.89

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	鹏华可转换债券 A	鹏华可转换债券 C	鹏华可转换债券 D	合计
国信证券	-	309.93	-	309.93
鹏华基金公司	-	1,300,184.62	-	1,300,184.62
合计	-	1,300,494.55	-	1,300,494.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	鹏华可转换债券 A	鹏华可转换债券 C	鹏华可转换债券 D	合计
国信证券	-	181.66	-	181.66
鹏华基金公司	-	1,265,997.45	-	1,265,997.45
合计	-	1,266,179.11	-	1,266,179.11

注：鹏华可转换债券 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换债券 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；鹏华可转换债券 D 基金份额不支付销售服务费。

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

份额单位：份

鹏华可转债债券 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
国信证券	103,327,133.71	2.50	103,327,133.71	1.94

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	21,248,549.09	184,193.36	37,387,897.27	246,953.60

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（2026 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：债券										
证券 代码	证 券	成功 认购	受限 期	流 通	认购 价格	期末 估值	数量 （单	期末 成本总额	期末估值总额	备 注

	名称	日期		受限类型		单价	单位：张)			
118072	鼎通转债	2026年6月25日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	10,030	1,003,000.00	1,003,030.78	-

注：1、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中需要限售的部分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。

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、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026年6月29日	重大事项	879.53	2026年7月13日	890.99	1,266	426,771.30	1,113,484.98	-

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 2026 年 6 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 640,000,000.00 元，于 2026 年 07 月 01 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同责任，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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	2,202,077,932.91	1,534,280,777.17
AAA 以下	3,600,110,181.80	5,326,984,542.07
未评级	—	—
合计	5,802,188,114.71	6,861,265,319.24

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、组合在短时间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 2026 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 640,000,000.00 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时间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公司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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,248,549.09	-	-	-	21,248,549.09
结算备付金	86,166,425.73	-	-	-	86,166,425.73
存出保证金	2,308,431.91	-	-	-	2,308,431.91
交易性金融资产	1,731,839,333.23	4,353,589,895.98	145,942,169.59	1,434,283,840.42	7,665,655,239.22

买入返售金融资产	59,300,000.00	-	-	-	59,300,000.00
应收申购款	-	-	-	3,898,035.00	3,898,035.00
应收清算款	-	-	-	3,858,224.41	3,858,224.41
资产总计	1,900,862,739.96	4,353,589,895.98	145,942,169.59	1,442,040,099.83	7,842,434,905.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,078,624.28	9,078,624.28
应付管理人报酬	-	-	-	5,884,684.18	5,884,684.18
应付托管费	-	-	-	1,176,936.87	1,176,936.87
应付清算款	-	-	-	877,643.41	877,643.41
卖出回购金融资产款	640,000,000.00	-	-	-	640,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	234,167.35	234,167.35
应交税费	-	-	-	102,496.66	102,496.66
其他负债	-	-	-	1,838,172.00	1,838,172.00
负债总计	640,000,000.00	-	-	19,192,724.75	659,192,724.75
利率敏感度缺口	1,260,862,739.96	4,353,589,895.98	145,942,169.59	1,422,847,375.08	7,183,242,180.61
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	64,813,752.98	-	-	-	64,813,752.98
结算备付金	98,294,535.71	-	-	-	98,294,535.71
存出保证金	3,865,718.91	-	-	-	3,865,718.91
交易性金融资产	901,943,319.48	5,982,387,261.20	435,000,647.62	1,559,311,922.79	8,878,643,151.09
买入返售金融资产	71,594,936.98	-	-	-	71,594,936.98
应收申购款	-	-	-	37,926,844.33	37,926,844.33
应收清算款	-	-	-	32,354,586.28	32,354,586.28
资产总计	1,140,512,264.06	5,982,387,261.20	435,000,647.62	1,629,593,353.40	9,187,493,526.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,023,154.22	17,023,154.22
应付管理人报酬	-	-	-	6,858,326.67	6,858,326.67
应付托管费	-	-	-	1,371,665.35	1,371,665.35
应付清算款	-	-	-	50,523,731.74	50,523,731.74
卖出回购金融资产款	713,493,714.78	-	-	-	713,493,714.78
应付销售服务费	-	-	-	254,078.16	254,078.16
应交税费	-	-	-	118,634.79	118,634.79
其他负债	-	-	-	2,054,844.10	2,054,844.10
负债总计	713,493,714.78	-	-	78,204,435.03	791,698,149.81
利率敏感度缺口	427,018,549.28	5,982,387,261.20	435,000,647.62	1,551,388,918.37	8,395,795,376.47

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。		
分析	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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	404,735.52	276,701.38
	市场利率上升 25 个基点	-403,898.58	-276,315.71

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	1,434,283,840.42	19.97	1,559,311,922.79	18.57
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	5,802,188,114.71	80.77	6,861,265,319.24	81.72
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	7,236,471,955.13	100.74	8,420,577,242.03	100.30

注：债券投资为可转债、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。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	337,899,712.18	404,047,652.49
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-337,899,712.18	-404,047,652.49

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	7,180,937,913.26
第二层次	484,717,325.96
第三层次	-
合计	7,665,655,239.22

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	1,434,283,840.42	18.29
	其中：股票	1,434,283,840.42	18.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,231,371,398.80	79.46
	其中：债券	6,231,371,398.80	79.46
	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	59,300,000.00	0.76
	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	107,414,974.82	1.37
8	其他各项资产	10,064,691.32	0.13
9	合计	7,842,434,905.36	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	196,224.00	0.00
C	制造业	1,079,586,763.29	15.03
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	90,443,228.25	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	163,547,349.68	2.28
J	金融业	43,113,166.20	0.60
K	房地产业	35,495,800.00	0.49
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	21,901,309.00	0.30
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,434,283,840.42	19.97

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	300308	中际旭创	107,500	136,525,000.00	1.90
2	688256	寒武纪	69,357	110,662,561.35	1.54
3	601872	招商轮船	5,093,721	89,496,677.97	1.25
4	000811	冰轮环境	891,100	50,097,642.00	0.70
5	688808	联讯仪器	20,467	47,531,128.11	0.66
6	688347	华虹宏力	132,839	44,673,755.70	0.62
7	688627	精智达	61,672	44,095,480.00	0.61
8	000776	广发证券	1,842,443	43,113,166.20	0.60
9	603067	振华股份	852,935	39,482,361.15	0.55
10	688629	华丰科技	206,883	38,792,631.33	0.54
11	688012	中微公司	77,656	36,381,836.00	0.51
12	600246	万通发展	1,868,200	35,495,800.00	0.49
13	688025	杰普特	75,171	35,330,370.00	0.49
14	688981	中芯国际	189,939	30,166,111.98	0.42

15	300666	江丰电子	80,100	29,524,860.00	0.41
16	300408	三环集团	174,430	29,112,367.00	0.41
17	688362	甬矽电子	297,210	28,651,044.00	0.40
18	688668	鼎通科技	75,740	28,273,742.00	0.39
19	603618	杭电股份	538,691	26,869,907.08	0.37
20	002384	东山精密	102,300	26,838,405.00	0.37
21	002821	凯莱英	155,820	25,242,840.00	0.35
22	002916	深南电路	53,600	24,543,440.00	0.34
23	603268	松发股份	170,700	23,775,096.00	0.33
24	603876	鼎胜新材	905,200	23,544,252.00	0.33
25	300661	圣邦股份	158,420	22,730,101.60	0.32
26	603259	药明康德	175,900	21,901,309.00	0.30
27	688052	纳芯微	75,220	21,686,678.20	0.30
28	301013	利和兴	276,100	19,948,225.00	0.28
29	600487	亨通光电	181,600	19,856,144.00	0.28
30	300432	富临精工	886,640	17,812,597.60	0.25
31	600549	厦门钨业	207,000	17,636,400.00	0.25
32	000657	中钨高新	167,339	16,017,689.08	0.22
33	688702	盛科通信-U	40,623	15,842,563.77	0.22
34	688521	芯原股份	41,374	15,355,546.36	0.21
35	002475	立讯精密	214,000	15,065,600.00	0.21
36	300395	菲利华	111,900	14,964,387.00	0.21
37	301486	致尚科技	67,500	14,061,600.00	0.20
38	688603	天承科技	66,362	13,799,977.90	0.19
39	300857	协创数据	40,210	13,667,379.00	0.19
40	603083	剑桥科技	51,400	13,100,318.00	0.18
41	301392	汇成真空	39,200	11,314,688.00	0.16
42	300037	新宙邦	118,535	11,005,974.75	0.15
43	300373	扬杰科技	64,400	10,125,612.00	0.14
44	300751	迈为股份	33,900	9,575,394.00	0.13
45	688513	苑东生物	207,462	9,120,029.52	0.13
46	688068	热景生物	94,485	8,182,401.00	0.11
47	603678	火炬电子	96,500	8,009,500.00	0.11
48	002865	钧达股份	112,400	6,708,032.00	0.09
49	002025	航天电器	80,750	6,154,765.00	0.09
50	605589	圣泉集团	95,600	6,077,292.00	0.08
51	688008	澜起科技	15,358	4,759,444.20	0.07
52	688028	沃尔德	21,788	3,396,095.56	0.05
53	688617	惠泰医疗	18,114	3,288,777.84	0.05
54	603986	兆易创新	3,700	3,015,500.00	0.04
55	688553	汇宇制药-W	267,873	2,847,489.99	0.04
56	688525	佰维存储	4,604	2,277,736.92	0.03
57	002222	福晶科技	21,300	1,965,564.00	0.03

58	688072	拓荆科技	1,266	1,113,484.98	0.02
59	300476	胜宏科技	3,200	1,108,576.00	0.02
60	002938	鹏鼎控股	9,400	990,572.00	0.01
61	603162	海通发展	105,524	946,550.28	0.01
62	000962	东方钨业	4,825	437,145.00	0.01
63	600301	华锡有色	3,200	196,224.00	0.00

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(%)
1	300308	中际旭创	196,516,668.50	2.34
2	601318	中国平安	128,185,504.96	1.53
3	300502	新易盛	118,292,204.45	1.41
4	688627	精智达	103,642,491.77	1.23
5	601872	招商轮船	95,876,876.44	1.14
6	600547	山东黄金	94,404,437.60	1.12
7	300408	三环集团	94,181,486.40	1.12
8	300432	富临精工	90,915,723.38	1.08
9	601336	新华保险	81,166,289.00	0.97
10	300394	天孚通信	81,093,907.00	0.97
11	601600	中国铝业	78,807,257.00	0.94
12	688012	中微公司	78,657,167.00	0.94
13	000338	潍柴动力	75,065,506.00	0.89
14	300751	迈为股份	74,382,476.98	0.89
15	300750	宁德时代	73,264,673.00	0.87
16	002384	东山精密	67,806,719.00	0.81
17	688629	华丰科技	65,695,583.16	0.78
18	600519	贵州茅台	65,545,522.85	0.78
19	688256	寒武纪	60,989,285.47	0.73
20	688808	联讯仪器	58,855,922.97	0.70

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	300308	中际旭创	249,437,686.58	2.97
2	688627	精智达	148,765,048.51	1.77
3	300502	新易盛	124,102,871.24	1.48
4	601899	紫金矿业	121,311,576.74	1.44
5	688668	鼎通科技	109,128,924.59	1.30
6	601318	中国平安	108,402,495.38	1.29
7	000338	潍柴动力	99,392,067.00	1.18
8	300750	宁德时代	96,367,830.20	1.15

9	688256	寒武纪	93,525,720.70	1.11
10	000657	中钨高新	89,605,939.72	1.07
11	300408	三环集团	85,767,783.00	1.02
12	300432	富临精工	85,542,194.80	1.02
13	300394	天孚通信	81,063,609.16	0.97
14	601872	招商轮船	80,943,111.60	0.96
15	300274	阳光电源	77,835,783.73	0.93
16	600547	山东黄金	70,693,941.56	0.84
17	002384	东山精密	67,040,672.00	0.80
18	601336	新华保险	66,930,966.00	0.80
19	600519	贵州茅台	65,615,016.00	0.78
20	601600	中国铝业	64,082,276.89	0.76

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	4,433,785,057.40
卖出股票收入（成交）总额	5,175,402,200.81

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	429,183,284.09	5.97
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）	5,802,188,114.71	80.77
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,231,371,398.80	86.75

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	113052	兴业转债	5,874,540	676,086,967.24	9.41
2	118030	睿创转债	684,700	348,869,469.54	4.86
3	019792	25 国债 19	2,809,000	283,847,295.16	3.95

4	113056	重银转债	2,240,000	279,032,197.27	3.88
5	113042	上银转债	2,312,050	267,102,901.81	3.72

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

上海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上海监管局、中国人民银行的处罚。

兴业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的处罚。

重庆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重庆监管局、国家外汇管理局重庆市分局的处罚。

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约定的备选股票库

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	2,308,431.91
2	应收清算款	3,858,224.41
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	3,898,035.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	-
9	合计	10,064,691.32

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	113052	兴业转债	676,086,967.24	9.41
2	118030	睿创转债	348,869,469.54	4.86
3	113056	重银转债	279,032,197.27	3.88
4	113042	上银转债	267,102,901.81	3.72
5	123107	温氏转债	263,982,690.78	3.67
6	113053	隆 22 转债	189,756,759.21	2.64
7	123176	精测转 2	185,622,498.13	2.58
8	127045	牧原转债	183,064,420.07	2.55
9	123158	宙邦转债	181,748,013.86	2.53
10	118056	路维转债	168,689,337.52	2.35
11	113615	金诚转债	165,901,476.74	2.31
12	127037	银轮转债	163,627,207.94	2.28
13	113661	福 22 转债	162,816,782.77	2.27
14	113677	华懋转债	125,750,702.22	1.75
15	127092	运机转债	119,867,008.28	1.67
16	118024	冠宇转债	110,694,047.81	1.54
17	113697	应流转债	107,639,588.74	1.50
18	113046	金田转债	92,610,303.85	1.29
19	123255	鼎龙转债	89,216,973.49	1.24
20	127070	大中转债	86,800,648.01	1.21
21	111018	华康转债	80,418,170.39	1.12
22	118034	晶能转债	77,777,380.88	1.08
23	113043	财通转债	74,338,015.20	1.03
24	123216	科顺转债	73,509,578.93	1.02
25	127050	麒麟转债	71,625,084.72	1.00
26	110093	神马转债	62,789,236.30	0.87
27	127054	双箭转债	62,260,973.16	0.87
28	127089	晶澳转债	60,552,475.93	0.84
29	110085	通 22 转债	59,658,709.80	0.83
30	113691	和邦转债	55,430,563.91	0.77
31	132026	G 三峡 EB2	53,417,526.11	0.74
32	113058	友发转债	51,738,773.63	0.72
33	127056	中特转债	48,576,176.05	0.68
34	113655	欧 22 转债	47,692,595.69	0.66
35	127067	恒逸转 2	45,799,121.94	0.64
36	118013	道通转债	44,991,395.96	0.63
37	127104	姚记转债	43,999,486.37	0.61
38	111020	合顺转债	42,132,253.57	0.59

39	127082	亚科转债	39,270,637.78	0.55
40	123259	锦浪转 02	37,299,550.07	0.52
41	110090	爱迪转债	36,654,539.86	0.51
42	127069	小熊转债	33,651,508.90	0.47
43	127099	盛航转债	33,586,229.06	0.47
44	118037	上声转债	32,280,602.17	0.45
45	123178	花园转债	32,217,446.53	0.45
46	113632	鹤 21 转债	31,437,315.39	0.44
47	123237	佳禾转债	31,013,425.03	0.43
48	127095	广泰转债	30,910,703.80	0.43
49	127061	美锦转债	28,842,184.17	0.40
50	118031	天 23 转债	28,628,686.19	0.40
51	118012	微芯转债	28,239,396.67	0.39
52	111003	聚合转债	27,473,092.29	0.38
53	127027	能化转债	26,056,981.44	0.36
54	123251	华医转债	22,534,468.76	0.31
55	110097	天润转债	22,514,412.77	0.31
56	123220	易瑞转债	21,793,090.59	0.30
57	127030	盛虹转债	20,569,785.60	0.29
58	118042	奥维转债	19,187,615.12	0.27
59	113636	甬金转债	18,790,876.68	0.26
60	113051	节能转债	18,215,351.63	0.25
61	113658	密卫转债	18,018,538.82	0.25
62	127103	东南转债	16,895,629.92	0.24
63	123247	万凯转债	15,622,734.71	0.22
64	113667	春 23 转债	15,239,540.71	0.21
65	123119	康泰转 2	14,893,246.57	0.21
66	113673	岱美转债	12,843,357.33	0.18
67	123114	三角转债	9,820,270.02	0.14
68	113039	嘉泽转债	9,606,311.92	0.13
69	127078	优彩转债	9,213,790.65	0.13
70	123211	阳谷转债	8,996,864.45	0.13
71	123222	博俊转债	8,902,903.78	0.12
72	111022	锡振转债	4,688,221.50	0.07
73	113681	镇洋转债	3,593,002.70	0.05
74	123241	欧通转债	2,516,514.71	0.04
75	128128	齐翔转 2	2,030,402.04	0.03
76	113640	苏利转债	1,548,339.78	0.02

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

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	31,361	27,905.78	603,362,460.94	68.94	271,790,734.85	31.06
鹏华可转 债债券 C	3,746	250,880.73	911,601,341.87	97.00	28,197,890.21	3.00
鹏华可转 债债券 D	930	2,497,488.41	2,316,884,416.20	99.75	5,779,806.34	0.25
合计	36,037	114,815.79	3,831,848,219.01	92.61	305,768,431.40	7.39

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	647,637.88	0.0740
	鹏华可转债债券 C	72,600.18	0.0077
	鹏华可转债债券 D	3,010.50	0.0001
	合计	723,248.56	0.0175

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：截至本报告期末，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	鹏华可转债债券 D
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	1,299,401,521.32	1,117,211,644.91	2,922,882,781.78
本报告期基金总申购份额	166,517,179.73	437,756,631.80	4,678,865,961.22
减：本报告期基金总赎回份额	590,765,505.26	615,169,044.63	5,279,084,520.46
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	875,153,195.79	939,799,232.08	2,322,664,222.54

§ 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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理李伟先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第三百三十八次会议审议通过，自 2026 年 4 月 3 日起，李伟先生不再担任公司副总经理。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

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

无。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
东方证券	1	2,794,590,246.29	29.13	1,260,087.23	29.13	-
中信建投证券	1	2,045,747,176.37	21.33	922,428.65	21.33	-
浙商证券	1	1,181,255,673.51	12.31	532,629.63	12.31	-
中金公司	1	908,365,532.23	9.47	409,581.64	9.47	-
广发证券	1	837,478,081.26	8.73	377,622.02	8.73	-
申万宏源证券	3	577,015,491.18	6.02	260,177.67	6.02	-
华泰证券	1	492,969,017.61	5.14	222,278.96	5.14	-
长江证券	1	225,816,050.91	2.35	101,821.88	2.35	-
汇丰前海证券	1	219,854,062.44	2.29	99,131.32	2.29	-
国泰海通证券	1	196,697,683.53	2.05	88,693.81	2.05	-
国金证券	1	107,730,880.20	1.12	48,574.82	1.12	-
中信证券	1	5,023,276.0	0.05	2,265.09	0.05	-

		0				
东吴证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- （1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- （2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- （3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
东方证券	4,944,949,834.89	42.92	43,603,319,000.00	44.39	-	-
中信建投证券	2,261,164,873.01	19.62	4,519,290,000.00	4.60	-	-

浙商证 券	1,160,047, 127.25	10.07	19,738,909,0 00.00	20.10	-	-
中金公 司	894,413,28 6.43	7.76	2,779,300,00 0.00	2.83	-	-
广发证 券	286,000,62 3.35	2.48	1,520,550,00 0.00	1.55	-	-
申万宏 源证券	284,285,79 3.60	2.47	3,118,808,00 0.00	3.18	-	-
华泰证 券	513,574,00 9.85	4.46	11,618,420,0 00.00	11.83	-	-
长江证 券	276,883,62 2.27	2.40	769,900,000. 00	0.78	-	-
汇丰前 海证券	17,829,655 .41	0.15	2,068,033,00 0.00	2.11	-	-
国泰海 通证券	652,342,12 9.43	5.66	5,749,131,00 0.00	5.85	-	-
国金证 券	230,839,08 7.74	2.00	2,703,291,00 0.00	2.75	-	-
中信证 券	-	-	31,400,000.0 0	0.03	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 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	鹏华可转债债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《上海证券报》、基金 管理人网站及/或中国 证监会基金电子披露网 站	2026 年 01 月 21 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部 分基金参与东方证券股份有限公司	《上海证券报》、基金 管理人网站及/或中国	2026 年 02 月 04 日

	申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	证监会基金电子披露网站	
3	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/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 05 日
4	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/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 05 日
5	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/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 05 日
6	鹏华可转债债券型证券投资基金（D 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/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 05 日
7	鹏华可转债债券型证券投资基金 2025 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 30 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与海南有知有行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/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 31 日
9	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 04 日
10	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日
11	鹏华可转债债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 21 日
12	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 30 日
13	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国	2026 年 06 月 24 日

	下基金销售业务的公告	证监会基金电子披露网站	
14	鹏华可转债债券型证券投资基金基金合同	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 26 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 26 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 2026 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：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司
2026 年 8 月 28 日