

华安可转换债券债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 22 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安可转债债券	
基金主代码	040022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 22 日	
报告期末基金份额总额	2,038,298,966.53 份	
投资目标	本基金主要投资于兼具债券和股票特性的可转债(含分离交易可转债)品种，在控制风险和保持流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	1、资产配置策略 2、债券投资策略 3、股票投资策略 4、权证投资策略 5、其他衍生工具投资策略	
业绩比较基准	天相可转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×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，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
下属分级基金的交易代码	040022	040023
报告期末下属分级基金的份额总额	1,042,907,028.04 份	995,391,938.49 份

§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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）	
	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
1. 本期已实现收益	-35,572,604.66	-33,663,983.72
2. 本期利润	-30,843,275.95	-39,517,161.30
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0283	-0.0346
4. 期末基金资产净值	1,795,763,448.13	1,633,627,704.55
5. 期末基金份额净值	1.722	1.641

注：1、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、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

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

华安可转债债券 A 类

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	-1.54%	0.77%	0.52%	0.38%	-2.06%	0.39%
过去六个月	-4.23%	0.66%	-1.54%	0.35%	-2.69%	0.31%
过去一年	-5.80%	0.58%	-1.84%	0.32%	-3.96%	0.26%
过去三年	13.07%	0.58%	5.19%	0.39%	7.88%	0.19%
过去五年	40.57%	0.75%	18.69%	0.41%	21.88%	0.34%
自基金合同 生效起至今	72.20%	1.16%	48.28%	0.72%	23.92%	0.44%

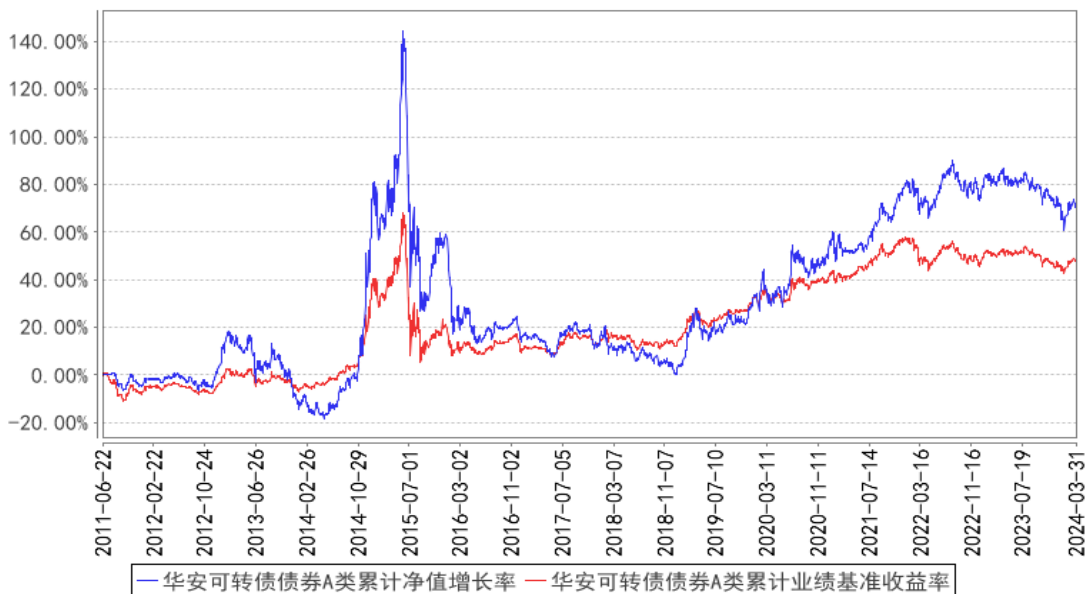
华安可转债债券 B 类

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
----	--------	---------------	----------------	-----------------------	-----	-----

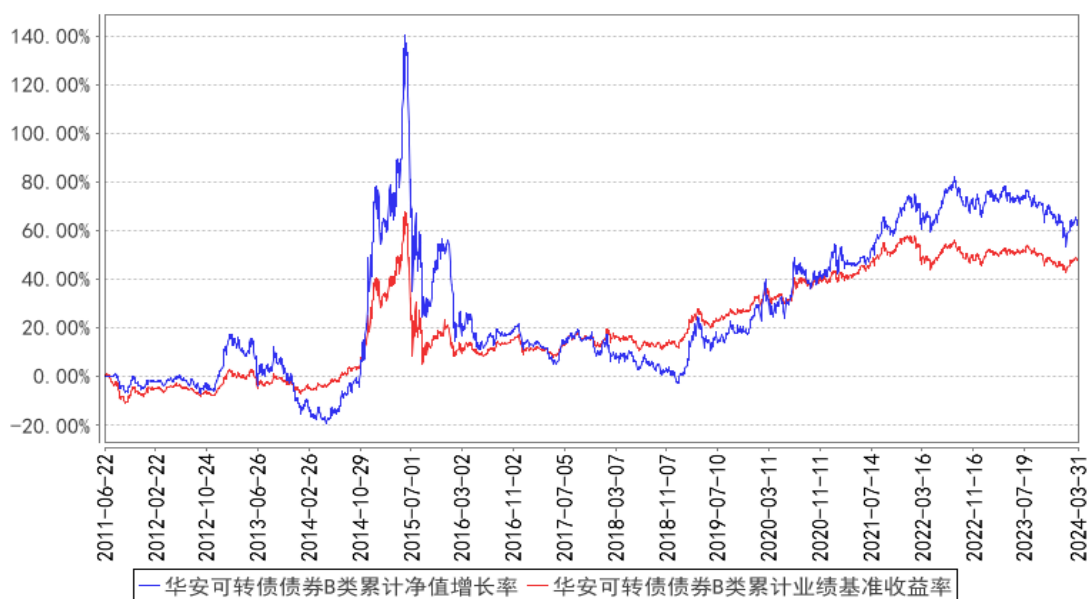
				准差④		
过去三个月	-1.68%	0.78%	0.52%	0.38%	-2.20%	0.40%
过去六个月	-4.43%	0.67%	-1.54%	0.35%	-2.89%	0.32%
过去一年	-6.12%	0.58%	-1.84%	0.32%	-4.28%	0.26%
过去三年	11.86%	0.58%	5.19%	0.39%	6.67%	0.19%
过去五年	38.02%	0.75%	18.69%	0.41%	19.33%	0.34%
自基金合同生效起至今	64.10%	1.16%	48.28%	0.72%	15.82%	0.44%

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

华安可转债债券A类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



华安可转债债券B类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



§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		
周益鸣	本基金的基金经理	2021年3月8日	-	15年	硕士，15年金融、基金行业从业经验。曾任太平资产管理有限公司交易员。2010年6月加入华安基金，历任集中交易部交易员。2018年6月至2023年5月，担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019年3月至2020年10月，同时担任华安安盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019年7月至2021年3月，同时担任华安安业债券型证券投资基金的基金经理。2019年11月至2021年3月，同时担任华安安和债券型证券投资基金的基金经理。2019年12月起，同时担任华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年4月至2021年5月，同时担任华安安敦债券型证券投资基金的基金经理。2020年6月起，同时担任华安添瑞6个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021年1月起，同时担任华安添福18个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021年2月起，同时担任华安添

					利 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月去，同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添和一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月起，同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安安心收益债券型证券投资基金、华安添禧一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
卢维捷	本基金的基金经理	2023 年 11 月 10 日	-	12 年	硕士研究生，12 年基金行业从业经验。曾任中国建设银行客户经理，2011 年 8 月加入华安基金，历任投资研究部研究员，固定收益部基金经理助理。2023 年 11 月起，担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，

公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的次数为 0 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

债券方面，今年一季度债券发行明显缩量，同时要求信贷投放不能“冲量”，所以整体社融增速有所回落。货币政策则保持相对宽松，央行降准 0.5%，同时降低了 5 年期 LPR 利率，降幅较去年明显扩大，显示了支持实体经济的决心。债券市场利率在货币宽松，信贷增速下行的背景下震荡走低，长端利率下行幅度更大，收益率曲线走平。同时，信用利差也进一步压缩。尽管个别房地产企业有信用风险事件发生，但目前房企违约市场已经有充分的认识和准备，因此对信用市场的冲击和影响较小。

可转债市场表现和股票类似，中小市值个股对应的转债整体表现较弱，导致整体可转债价格中位数震荡走低，但红利相关的转债标的表现突出，煤炭、电力和公路等转债都有赎回的标的出

现。

股票市场在一季度经历了较大的波动，1 月受多重不利因素影响下跌幅度较大，但 2 月开始各类指数均得到明显的纠偏和修复。站在季度维度看，中小市值个股仍然有不小的跌幅，金融、石化、电力和公路等红利板块表现突出，在偏低的利率环境下，主营业务成熟、具有较为稳定的现金流且股息率较高的公司受到市场资金的持续追捧。同时，成长板块中 AI 和低空经济概念表现活跃，但波动较大，更容易受到美股的影响，而近期美国降息有所预期转弱。整体而言，股市信心明显恢复，板块性行情在快速轮动。

本基金在报告期内以中低价可转债为主，维持相对偏高的股票仓位，积极寻求类权益资产的结构化机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 3 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.722 元，B 类份额净值为 1.641 元，本报告期 A 类份额净值增长率为-1.54%，同期业绩比较基准增长率为 0.52%，B 类份额净值增长率为-1.68%，同期业绩比较基准增长率为 0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§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	534,497,956.87	14.42
	其中：股票	534,497,956.87	14.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,020,582,693.63	81.52
	其中：债券	3,020,582,693.63	81.52
	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	50,000,000.00	1.35
	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	98,531,455.51	2.66
8	其他资产	1,919,455.96	0.05
9	合计	3,705,531,561.97	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	18,203,139.25	0.53
B	采矿业	5,887,000.00	0.17
C	制造业	285,246,695.82	8.32
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	10,706,866.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	30,015,400.00	0.88
H	住宿和餐饮业	4,278,000.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,526,788.80	0.25
J	金融业	131,140,999.00	3.82
K	房地产业	26,829,000.00	0.78
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,513,892.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	1,534,000.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,616,176.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	534,497,956.87	15.59

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600048	保利发展	1,800,000	16,434,000.00	0.48
2	600276	恒瑞医药	350,000	16,089,500.00	0.47
3	600030	中信证券	800,000	15,360,000.00	0.45
4	600690	海尔智家	600,000	14,970,000.00	0.44
5	601009	南京银行	1,592,600	14,269,696.00	0.42
6	601166	兴业银行	824,400	13,009,032.00	0.38
7	000333	美的集团	200,000	12,844,000.00	0.37

8	600989	宝丰能源	652,400	10,666,740.00	0.31
9	600660	福耀玻璃	245,200	10,607,352.00	0.31
10	300979	华利集团	173,525	10,605,848.00	0.31

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	185,520,139.73	5.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,188,606.56	0.30
	其中：政策性金融债	10,188,606.56	0.30
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）	2,824,873,947.34	82.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,020,582,693.63	88.08

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	113060	浙 22 转债	1,550,000	192,967,441.10	5.63
2	113021	中信转债	1,200,000	138,558,575.34	4.04
3	127032	苏行转债	1,112,490	136,230,953.52	3.97
4	019709	23 国债 16	1,260,000	127,411,372.61	3.72
5	113056	重银转债	1,110,000	116,150,095.89	3.39

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

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

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

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

2023 年 8 月 25 日，南京银行因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理性审查等违法违规事项，被国家外汇管理局江苏省分局（苏汇检罚〔2023〕4 号）给予警告、罚款人民币 60 万元的行政处罚。

2023 年 11 月 16 日，中信银行因违反高管准入管理相关规定等违法违规事项，被国家金融监督管理总局（金罚决字〔2023〕15 号）对总行罚款 15242.59 万元、没收违法所得 462.59 万元，对分支机构罚款 6770 万元。2023 年 12 月 29 日，中信银行因部分重要信息系统应认定未认定、相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求等违法违规事项，被国家金融监督管理总局（金罚决字〔2023〕69 号）罚款 400 万元。

2023 年 10 月 31 日，重庆银行因投资业务调查、审查、审批不尽职；资金投放不合规，被国家金融监督管理总局重庆监管局（渝金管罚决字〔2023〕24 号）罚款 150 万元。

2024 年 1 月 9 日，杭州银行因债券承销业务与债券交易/投资业务间“防火墙”建设不到位等违法违规事项，被国家金融监督管理总局浙江监管局（浙金罚决字〔2024〕1 号）给予罚款 210 万元的行政处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	218,381.89
2	应收证券清算款	1,506,344.23

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	189,929.84
6	其他应收款	-
7	其他	4,800.00
8	合计	1,919,455.96

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	113060	浙 22 转债	192,967,441.10	5.63
2	113021	中信转债	138,558,575.34	4.04
3	127032	苏行转债	136,230,953.52	3.97
4	113056	重银转债	116,150,095.89	3.39
5	113050	南银转债	108,374,951.62	3.16
6	113055	成银转债	82,254,174.21	2.40
7	110079	杭银转债	79,277,102.19	2.31
8	123107	温氏转债	75,850,216.59	2.21
9	113602	景 20 转债	73,922,104.11	2.16
10	110094	众和转债	60,961,275.61	1.78
11	127086	恒邦转债	48,741,667.84	1.42
12	123184	天阳转债	44,863,125.51	1.31
13	113065	齐鲁转债	43,315,612.60	1.26
14	110093	神马转债	42,547,127.63	1.24
15	113052	兴业转债	41,671,287.67	1.22
16	113067	燃 23 转债	40,938,704.33	1.19
17	128133	奇正转债	40,188,494.88	1.17
18	127027	能化转债	39,307,428.80	1.15
19	127084	柳工转 2	36,106,271.23	1.05
20	123158	宙邦转债	34,501,479.45	1.01
21	127054	双箭转债	33,482,588.08	0.98
22	113619	世运转债	31,986,920.40	0.93
23	113637	华翔转债	31,879,063.87	0.93
24	113651	松霖转债	31,669,863.01	0.92
25	127091	科数转债	31,669,500.48	0.92
26	118028	会通转债	30,628,023.29	0.89
27	123169	正海转债	30,576,866.85	0.89
28	110073	国投转债	29,065,529.59	0.85
29	118025	奕瑞转债	28,762,973.61	0.84
30	113631	皖天转债	28,688,960.58	0.84
31	123035	利德转债	27,890,598.38	0.81
32	127071	天箭转债	26,214,473.70	0.76
33	127073	天赐转债	25,920,590.41	0.76

34	127050	麒麟转债	25,301,808.22	0.74
35	113549	白电转债	22,926,266.04	0.67
36	127049	希望转 2	20,882,923.80	0.61
37	123219	宇瞳转债	20,060,544.93	0.58
38	118011	银微转债	20,047,198.15	0.58
39	128109	楚江转债	18,707,134.25	0.55
40	113062	常银转债	18,384,574.25	0.54
41	127020	中金转债	18,346,335.62	0.53
42	127078	优彩转债	17,175,304.11	0.50
43	111017	蓝天转债	16,826,726.88	0.49
44	113669	景 23 转债	16,759,204.11	0.49
45	110067	华安转债	15,455,405.48	0.45
46	113676	荣 23 转债	15,417,878.90	0.45
47	123204	金丹转债	15,382,851.89	0.45
48	123163	金沃转债	14,704,103.84	0.43
49	123076	强力转债	14,433,543.84	0.42
50	128141	旺能转债	14,273,219.69	0.42
51	128121	宏川转债	13,203,492.02	0.39
52	113061	拓普转债	13,117,370.41	0.38
53	127045	牧原转债	13,009,781.39	0.38
54	123211	阳谷转债	12,910,595.64	0.38
55	118030	睿创转债	12,601,082.19	0.37
56	123172	漱玉转债	12,262,730.45	0.36
57	113644	艾迪转债	11,751,055.34	0.34
58	110084	贵燃转债	11,431,821.92	0.33
59	123146	中环转 2	11,247,936.99	0.33
60	113655	欧 22 转债	11,177,299.34	0.33
61	127088	赫达转债	10,959,923.29	0.32
62	127030	盛虹转债	10,697,632.77	0.31
63	123182	广联转债	10,620,086.30	0.31
64	118024	冠宇转债	10,554,424.66	0.31
65	123170	南电转债	10,246,699.73	0.30
66	123121	帝尔转债	9,660,986.79	0.28
67	123157	科蓝转债	9,273,297.40	0.27
68	123190	道氏转 02	9,201,380.54	0.27
69	113051	节能转债	9,077,878.36	0.26
70	127070	大中转债	8,911,901.37	0.26
71	123179	立高转债	8,866,021.41	0.26
72	123212	立中转债	8,790,508.70	0.26
73	113643	风语转债	8,635,842.19	0.25
74	113628	晨丰转债	8,499,006.85	0.25
75	113667	春 23 转债	8,386,450.69	0.24

76	113064	东材转债	8,003,770.95	0.23
77	123202	祥源转债	7,848,346.30	0.23
78	118038	金宏转债	7,674,791.72	0.22
79	113045	环旭转债	7,618,784.66	0.22
80	113656	嘉诚转债	7,508,610.41	0.22
81	128134	鸿路转债	7,177,149.74	0.21
82	113563	柳药转债	7,155,953.42	0.21
83	113654	永 02 转债	6,999,192.76	0.20
84	118019	金盘转债	6,774,504.87	0.20
85	123215	铭利转债	6,507,475.64	0.19
86	123120	隆华转债	6,449,082.69	0.19
87	118013	道通转债	6,386,556.16	0.19
88	127056	中特转债	6,338,942.47	0.18
89	123201	纽泰转债	6,318,232.88	0.18
90	123150	九强转债	6,305,068.49	0.18
91	113647	禾丰转债	6,158,460.34	0.18
92	123119	康泰转 2	5,807,493.15	0.17
93	113663	新化转债	5,760,294.52	0.17
94	123174	精锻转债	5,688,965.75	0.17
95	127039	北港转债	5,626,562.34	0.16
96	123171	共同转债	5,587,068.77	0.16
97	113632	鹤 21 转债	5,022,583.69	0.15
98	128137	洁美转债	4,722,999.94	0.14
99	128081	海亮转债	4,548,272.88	0.13
100	113623	凤 21 转债	4,523,875.85	0.13
101	118036	力合转债	4,476,085.48	0.13
102	123168	惠云转债	4,392,455.91	0.13
103	113600	新星转债	4,391,978.08	0.13
104	123214	东宝转债	4,200,417.53	0.12
105	128071	合兴转债	4,180,205.96	0.12
106	113640	苏利转债	4,126,257.53	0.12
107	123153	英力转债	4,105,233.08	0.12
108	123149	通裕转债	3,777,163.46	0.11
109	118042	奥维转债	3,711,258.70	0.11
110	118004	博瑞转债	3,680,720.55	0.11
111	127060	湘佳转债	3,578,747.25	0.10
112	111015	东亚转债	3,518,037.53	0.10
113	123161	强联转债	3,507,216.88	0.10
114	123160	泰福转债	3,413,543.77	0.10
115	123203	明电转 02	3,411,265.48	0.10
116	113639	华正转债	3,314,043.29	0.10
117	128130	景兴转债	3,265,297.79	0.10

118	123191	智尚转债	3,173,881.64	0.09
119	127092	运机转债	2,814,830.15	0.08
120	123221	力诺转债	2,514,706.30	0.07
121	123187	超达转债	2,492,147.40	0.07
122	123224	宇邦转债	2,350,900.82	0.07
123	113675	新 23 转债	2,316,064.11	0.07
124	123078	飞凯转债	2,259,619.18	0.07
125	111005	富春转债	2,209,980.82	0.06
126	113024	核建转债	2,139,247.67	0.06
127	127043	川恒转债	1,763,377.40	0.05
128	113662	豪能转债	1,447,001.13	0.04
129	111004	明新转债	1,080,843.84	0.03
130	123144	裕兴转债	1,015,590.41	0.03

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
报告期期初基金份额总额	855,532,598.21	1,369,380,183.55
报告期期间基金总申购份额	515,409,369.28	593,222,450.25
减：报告期期间基金总赎回份额	328,034,939.45	967,210,695.31
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	1,042,907,028.04	995,391,938.49

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安可转换债券债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安可转换债券债券型证券投资基金托管协议》

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站

<http://www.huaan.com.cn>。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2024 年 4 月 22 日