华宝双债增强债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝双债增强债券
基金主代码	011280
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 4 月 23 日
报告期末基金份额总额	1,029,478,389.94 份
投资目标	在控制投资组合下行风险的基础下，通过积极主动的可转债、信用债投资管理，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×50%+中证可转换债券指数收益率×40%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型

	基金、股票型基金，高于货币市场基金。另外，由于本基金可转债（含可分离交易可转债的纯债部分）和信用债合计投资比例不低于固定收益类资产的 80%，而可转债的预期收益和风险水平通常高于普通债券，所以本基金的预期收益和风险水平高于普通债券型基金。		
基金管理人	华宝基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华宝双债增强债券 A	华宝双债增强债券 C	华宝双债增强债券 D
下属分级基金的交易代码	011280	011281	022986
报告期末下属分级基金的份额总额	770,450,788.30 份	5,448,921.14 份	253,578,680.50 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（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）		
	华宝双债增强债券 A	华宝双债增强债券 C	华宝双债增强债券 D
1.本期已实现收益	-9,954,295.98	-72,679.31	-4,829,790.75
2.本期利润	-19,470,655.36	-145,314.30	-10,123,875.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0255	-0.0278	-0.0270
4.期末基金资产净值	937,424,803.11	6,487,037.42	306,394,781.41
5.期末基金份额净值	1.2167	1.1905	1.2083

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，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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，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

华宝双债增强债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①－③	②－④

		准差②	收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	-2.07%	0.31%	-3.56%	0.36%	1.49%	-0.05%
过去六个月	-2.02%	0.40%	-0.38%	0.40%	-1.64%	0.00%
过去一年	1.36%	0.46%	0.06%	0.40%	1.30%	0.06%
过去三年	16.08%	0.55%	15.82%	0.36%	0.26%	0.19%
过去五年	19.10%	0.45%	17.16%	0.34%	1.94%	0.11%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	21.67%	0.43%	22.57%	0.33%	-0.90%	0.10%

华宝双债增强债券 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	-2.17%	0.31%	-3.56%	0.36%	1.39%	-0.05%
过去六个月	-2.22%	0.40%	-0.38%	0.40%	-1.84%	0.00%
过去一年	0.96%	0.46%	0.06%	0.40%	0.90%	0.06%
过去三年	14.69%	0.55%	15.82%	0.36%	-1.13%	0.19%
过去五年	16.74%	0.45%	17.16%	0.34%	-0.42%	0.11%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	19.05%	0.43%	22.57%	0.33%	-3.52%	0.10%

华宝双债增强债券 D

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	-2.07%	0.31%	-3.56%	0.36%	1.49%	-0.05%

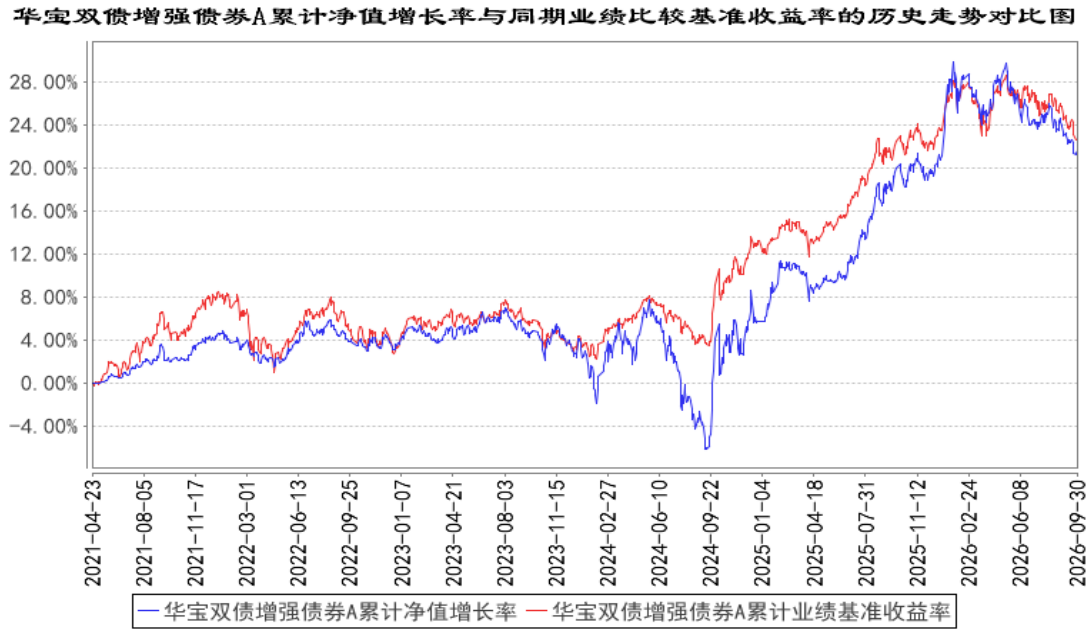
过去六个月	-2.02%	0.40%	-0.38%	0.40%	-1.64%	0.00%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至 2025-01-06	0.02%	0.00%	-0.85%	0.23%	0.87%	-0.23%
2025-05-19 至 2025-05-27	-0.16%	0.04%	-0.31%	0.15%	0.15%	-0.11%
2026-01-09 至今	-3.39%	0.48%	-2.28%	0.43%	-1.11%	0.05%

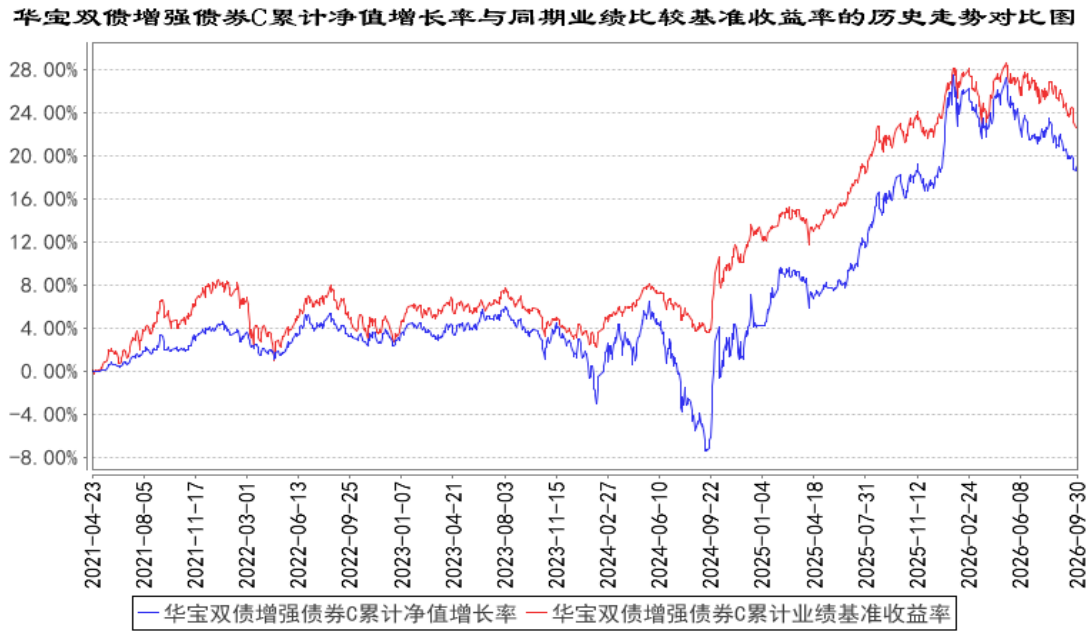
注：（1）基金业绩基准：中证综合债指数收益率×50%+中证可转换债券指数收益率×40%+沪深 300 指数收益率×10%；

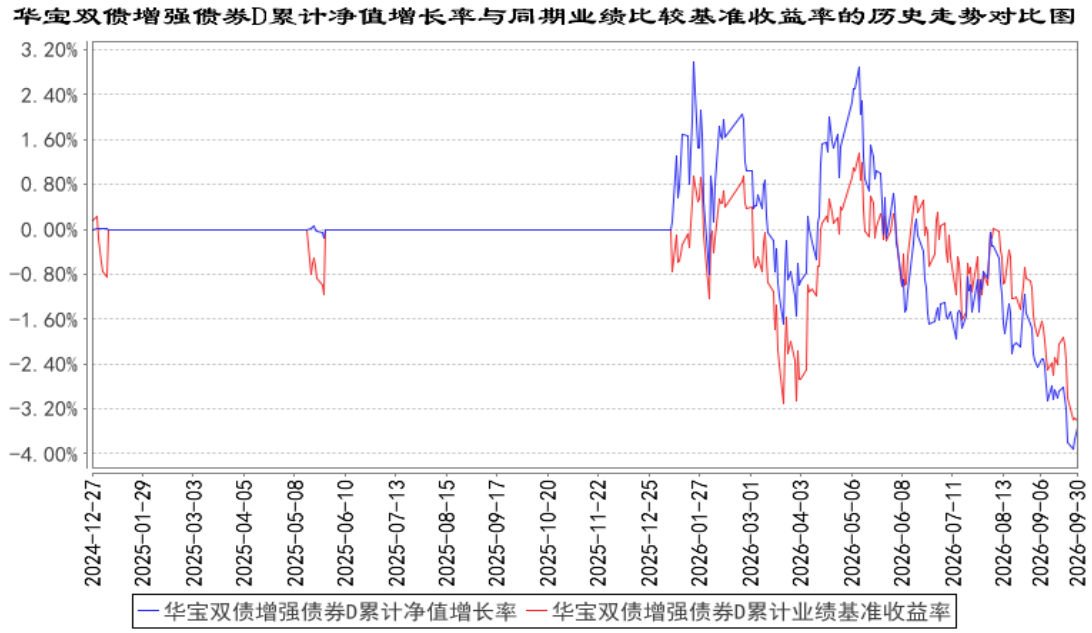
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）；

（3）本基金于 2024 年 12 月 18 日增设 D 类基金份额，D 类基金份额从 2024 年 12 月 27 日开始存续。2025 年 1 月 7 日，D 类基金份额全部赎回，份额为 0。2025 年 5 月 19 日，D 类基金新增基金份额。2025 年 5 月 28 日，D 类基金份额全部赎回，份额为 0。2026 年 1 月 9 日，D 类基金新增基金份额，相关数据按实际存续期计算。

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


华宝双债增强债券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
28.00%
24.00%
20.00%
16.00%
12.00%
8.00%
4.00%
0.00%
-4.00%
2021-04-23
2021-08-05
2021-11-17
2022-03-01
2022-06-13
2022-09-25
2023-01-07
2023-04-21
2023-08-03
2023-11-15
2024-02-27
2024-06-10
2024-09-22
2025-01-04
2025-04-18
2025-07-31
2025-11-12
2026-02-24
2026-06-08
2026-09-30
华宝双债增强债券A累计净值增长率
华宝双债增强债券A累计业绩基准收益率


华宝双债增强债券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
28.00%
24.00%
20.00%
16.00%
12.00%
8.00%
4.00%
0.00%
-4.00%
-8.00%
2021-04-23
2021-08-05
2021-11-17
2022-03-01
2022-06-13
2022-09-25
2023-01-07
2023-04-21
2023-08-03
2023-11-15
2024-02-27
2024-06-10
2024-09-22
2025-01-04
2025-04-18
2025-07-31
2025-11-12
2026-02-24
2026-06-08
2026-09-30
华宝双债增强债券C累计净值增长率
华宝双债增强债券C累计业绩基准收益率



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2021 年 10 月 23 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。本基金于 2024 年 12 月 18 日增设 D 类基金份额，D 类基金份额从 2024 年 12 月 27 日开始存续。2025 年 1 月 7 日，D 类基金份额全部赎回，份额为 0。2025 年 5 月 19 日，D 类基金新增基金份额。2025 年 5 月 28 日，D 类基金份额全部赎回，份额为 0。2026 年 1 月 9 日，D 类基金新增基金份额，相关数据按实际存续期计算。

§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		
李栋梁	本基金基金经理、固定收益投资总监、混合资产部总经理	2021-04-23	-	23 年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的证券研究和投资管理工作。2010 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任债券分析师、基金经理助理、固定收益部副总经理、混合资产部副总经理、固定收益部总经理等职务，现任固定收益投资总监、混合资产部总经理。2011 年 6 月起任华宝宝康债券投资基金基金经理，2014 年 10 月至 2023 年 3 月任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月至 2017 年 12 月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资

					基金(LOF)、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2019 年 6 月任华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月起任华宝可转债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月至 2017 年 12 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2021 年 3 月任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 2 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月至 2019 年 3 月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任华宝双债增强债券型证券投资基金基金经理，2022 年 5 月起任华宝安宜六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月至 2024 年 9 月任华宝安悦一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2023 年 1 月起任华宝安融六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2023 年 8 月起任华宝安元债券型证券投资基金基金经理。
李巍	本基金基金经理	2023-10-26	-	12 年	硕士。曾在海富通基金管理有限公司任债券交易员，富国基金管理有限公司任高级债券交易员，安信基金管理有限责任公司任投研助理、基金经理、投资经理等，2023 年 3 月加入华宝基金管理有限公司。2023 年 10 月起任华宝双债增强债券型证券投资基金、华宝安融六个月持有期债券型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 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

本报告期内，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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝双债增强债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有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

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人未发生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%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

中共中央政治局 7 月 30 日召开会议，会议认为，今年以来我国经济呈现动能向新、结构向优的发展态势。同时，要高度重视经济运行中的困难挑战，坚定信心，迎难而上，用好各种机遇和优势，推动高质量发展行稳致远。会议强调，做好下半年经济工作，要坚持稳中求进工作总基调，坚持深化改革开放，加快推动新旧动能转换，实施好更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，充分发挥各项存量政策效能，及时谋划出台务实管用的增量政策，加大逆周期调节力度，加力扩大内需、优化供给，切实保障和改善民生，增强发展动力、激发社会活力，推动经济持续向新向优向好发展，努力实现“十五五”良好开局。会议指出，宏观政策要发力提效，加快财政支出和债券资金使用进度，有力推进“两重”建设和“两新”工作。兜牢基层“三保”底线。综合运用并适时调整货币政策工具，优化实施财政金融协同促内需政策。会议强调，要有效扩大国内需求，适应不同群体消费需求扩大优质供给，挖掘服务消费潜力。扎实推进“六张网”规划建设。加快

现代化产业体系建设，加强对基础研究的长期稳定支持，深入实施“人工智能+”行动，发展智能经济新形态，完善人工智能治理体系。积极推动前沿技术突破和未来产业发展，着力打造新兴支柱产业，持续推动传统产业改造升级。

3 季度债券市场总体较好，其中长久期利率债表现较好，期限利差压缩。股票市场震荡调整，期间贵金属、医药出现阶段性机会，红利类资产表现较好，可转债市场同样呈现震荡调整走势。整体来说权益类资产投资难度加大。

基金 3 季度降低了转债整体的投资比例，期间对部分弹性品种进行了交易。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期华宝双债增强债券 A 净值增长率为-2.07%，本报告期华宝双债增强债券 C 净值增长率为-2.17%，本报告期华宝双债增强债券 D 净值增长率为-2.07%;同期业绩比较基准收益率为-3.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,305,763,955.86	99.19
	其中：债券	1,305,763,955.86	99.19
	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	-	-
	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	10,447,961.04	0.79
8	其他资产	273,181.22	0.02
9	合计	1,316,485,098.12	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利

息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

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

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

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投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	70,545,529.81	5.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	611,592,689.32	48.92
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	6,762,218.41	0.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,282,399.45	2.42
7	可转债（可交换债）	586,581,118.87	46.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,305,763,955.86	104.44

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	232480011	24 农行二级资本债 02A	1,000,000	102,888,504.11	8.23
2	2128033	21 建设银行二级 03	700,000	72,409,591.78	5.79
3	232480014	24 交行二级资本债 01A	700,000	72,276,630.14	5.78
4	2228017	22 邮储银行二级 01	700,000	72,027,265.21	5.76
5	232480001	24 中行二级资本债 01A	600,000	62,798,725.48	5.02

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。

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。

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

本基金未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

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

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国光大银行股份有限公司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审查；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；于 2025 年 10 月 29 日收到国家外汇管理局北京市分局罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司因相关产品销售、服务收费不合规，信贷资金流向管理不审慎等；于 2025 年 10 月 31 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国银行股份有限公司因相关公司治理、贷款、同业、票据、资产质量、不良资产处置等业务管理不审慎；于 2025 年 10 月 31 日收到金融监管总局警告,罚款的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,兴业银行股份有限公司因外包机构管理不到位、企业划型不准确等；于 2025 年 12 月 05 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国邮政储蓄银行股份有限公司因在债务融资工具承销发行过程中涉嫌违规，违反公平、公正、勤勉尽责的原则；

于 2025 年 12 月 15 日收到中国银行间市场交易商协会立案调查的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,交通银行股份有限公司因：1.违反账户管理规定；2.违反清算管理规定；3.违反特约商户实名制管理规定；4.违反反假货币业务管理规定；5.占压财政存款或者资金；6.违反国库科目设置和使用规定；7.违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；8.未按规定履行客户身份识别义务；9.未按规定保存客户身份资料和交易记录；10.未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；11.与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户;于 2025 年 12 月 19 日收到中国人民银行警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司因:1.违反账户管理规定；2.违反特约商户管理规定；3.违反人民币流通管理规定；4.违反反假货币业务管理规定；5.占压财政存款或资金；6.违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；7.未按规定履行客户身份识别义务；8.未按规定保存客户身份资料和交易记录；9.未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；10.与身份不明的客户进行交易；于 2026 年 02 月 14 日收到中国人民银行警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,交通银行股份有限公司因灾备恢复能力建设不足、重要信息系统应急管理不足等；于 2026 年 06 月 05 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司因重要信息系统投产变更风险管控不到位、重要信息系统应急管理不足等；于 2026 年 06 月 05 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司因未经批准擅自经营结汇、售汇业务；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审查；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；未按照规定进行国际收支统计申报；未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料；违反外汇账户管理规定；违反外汇登记管理规定；于 2026 年 09 月 23 日收到国家外汇管理局北京市分局警告,罚款,没收违法所得的处罚措施。

华宝双债增强债券截至 2026 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,中国邮政储蓄银行股份有限公司因：违反金融统计管理规定；2.违反账户管理规定；3.违反银行卡收单业务管理规定；4.违反数据安全管理规定；5.违反反假货币业务管理规定；6.占压财政存款或者资金；7.违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；8.未按规定履行客户身份识别义务；9.未按规定

报送大额交易报告或者可疑交易报告；10.与身份不明的客户进行交易；于 2026 年 09 月 08 日收到中国人民银行警告,通报批评,罚款,没收违法所得的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本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约定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	175,182.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	97,999.07
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	273,181.22

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	113659	莱克转债	33,246,235.50	2.66
2	113699	金 25 转债	28,813,868.45	2.30
3	110095	双良转债	28,421,902.97	2.27
4	127110	广核转债	26,656,828.62	2.13
5	118024	冠宇转债	24,153,916.68	1.93
6	113052	兴业转债	23,032,419.92	1.84
7	113070	渝水转债	20,818,910.04	1.67
8	118022	锂科转债	19,377,275.92	1.55
9	113648	巨星转债	19,276,424.09	1.54
10	127085	韵达转债	19,154,098.89	1.53
11	113652	伟 22 转债	16,774,398.27	1.34
12	113691	和邦转债	16,057,837.96	1.28
13	127089	晶澳转债	15,061,386.32	1.20
14	111004	明新转债	15,019,015.96	1.20
15	113692	保隆转债	14,863,848.31	1.19
16	110090	爱迪转债	14,152,115.67	1.13

17	111014	李子转债	13,610,384.16	1.09
18	127111	金威转债	12,582,463.04	1.01
19	127068	顺博转债	12,239,068.46	0.98
20	110098	南药转债	12,038,230.53	0.96
21	123119	康泰转 2	11,401,713.62	0.91
22	127049	希望转 2	10,832,778.08	0.87
23	110099	福能转债	10,183,807.52	0.81
24	113643	风语转债	9,614,822.15	0.77
25	110087	天业转债	9,600,361.64	0.77
26	127082	亚科转债	9,043,808.22	0.72
27	113638	台 21 转债	8,860,247.78	0.71
28	127056	中特转债	7,146,525.37	0.57
29	123179	立高转债	6,695,302.49	0.54
30	111021	奥锐转债	6,619,098.28	0.53
31	113649	丰山转债	6,384,541.10	0.51
32	123178	花园转债	6,287,048.40	0.50
33	113647	禾丰转债	5,795,956.16	0.46
34	113066	平煤转债	5,500,135.89	0.44
35	113056	重银转债	4,874,163.61	0.39
36	113666	爱玛转债	4,862,347.55	0.39
37	113067	燃 23 转债	4,335,710.33	0.35
38	113633	科沃转债	4,020,606.12	0.32
39	127072	博实转债	3,442,097.33	0.28
40	127103	东南转债	2,972,558.66	0.24
41	113062	常银转债	2,918,834.46	0.23
42	127040	国泰转债	2,892,924.66	0.23
43	127050	麒麟转债	2,377,164.93	0.19
44	118036	力合转债	2,012,043.30	0.16
45	127064	杭氧转债	982,891.00	0.08

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

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，合计数可能不等于分项之和。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝双债增强债券 A	华宝双债增强债券 C	华宝双债增强债券 D

报告期期初基金份额总额	766,574,747.03	4,857,562.73	414,125,908.50
报告期期间基金总申购份额	9,769,825.62	972,138.25	-
减:报告期期间基金总赎回份额	5,893,784.35	380,779.84	160,547,228.00
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	770,450,788.30	5,448,921.14	253,578,680.50

§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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260701~20260930	743,545,535.80	0.00	0.00	743,545,535.80	72.23
	2	20260701~20260930	237,622,970.29	0.00	0.00	237,622,970.29	23.08
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。 在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

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

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝双债增强债券型证券投资基金基金合同；

华宝双债增强债券型证券投资基金招募说明书；

华宝双债增强债券型证券投资基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日