

华安可转换债券债券型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 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：二〇二三年八月三十日

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，并由董事长签发。

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 2023 年 8 月 28 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52

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的情况	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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8	其他重大事件	57
11	影响投资者决策的其他重要信息	57
12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安可转换债券债券型证券投资基金	
基金简称	华安可转债债券	
基金主代码	040022	
交易代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	1,177,531,098.01 份	
基金合同存续期	不定期	
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	715,909,170.82 份	461,621,927.19 份

2.2 基金产品说明

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	本基金主要投资于可转债品种，一方面通过利用可转债的债券特性，强调收益的安全性与稳定性，另一方面利用可转债的股票特性（内含股票期权），分享股市上涨所产生的较高收益。
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。

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		华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	0755-83077987
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555

传真	021-68863414	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 临港新片区环湖西二路888号B 楼2118室	深圳市深南大道7088号招商银行 大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 -32层	深圳市深南大道7088号招商银行 大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	朱学华	缪建民

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、 32层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、 32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（2023年1月1日至2023年6月30日）	
	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
本期已实现收益	15,332,040.89	11,160,785.81
本期利润	12,670,114.33	9,243,559.91
加权平均基金份额本期利润	0.0344	0.0307
本期加权平均净值利润率	1.89%	1.77%
本期基金份额净值增长率	3.66%	3.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
期末可供分配利润	488,223,061.87	278,816,149.64
期末可供分配基金份额利润	0.6820	0.6040
期末基金资产净值	1,297,257,317.37	799,465,504.48

期末基金份额净值	1.812	1.732
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
基金份额累计净值增长率	81.20%	73.20%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	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
过去一个月	0.89%	0.46%	0.75%	0.27%	0.14%	0.19%
过去三个月	-0.88%	0.52%	0.12%	0.30%	-1.00%	0.22%
过去六个月	3.66%	0.52%	2.99%	0.30%	0.67%	0.22%
过去一年	-1.20%	0.54%	-1.62%	0.35%	0.42%	0.19%
过去三年	30.36%	0.67%	14.53%	0.43%	15.83%	0.24%
自基金合同生效起至今	81.20%	1.19%	51.24%	0.74%	29.96%	0.45%

华安可转债债券 B 类

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
过去一个月	0.87%	0.46%	0.75%	0.27%	0.12%	0.19%
过去三个月	-0.92%	0.51%	0.12%	0.30%	-1.04%	0.21%
过去六个月	3.46%	0.51%	2.99%	0.30%	0.47%	0.21%
过去一年	-1.53%	0.54%	-1.62%	0.35%	0.09%	0.19%
过去三年	29.06%	0.67%	14.53%	0.43%	14.53%	0.24%
自基金合同生效起至今	73.20%	1.19%	51.24%	0.74%	21.96%	0.45%

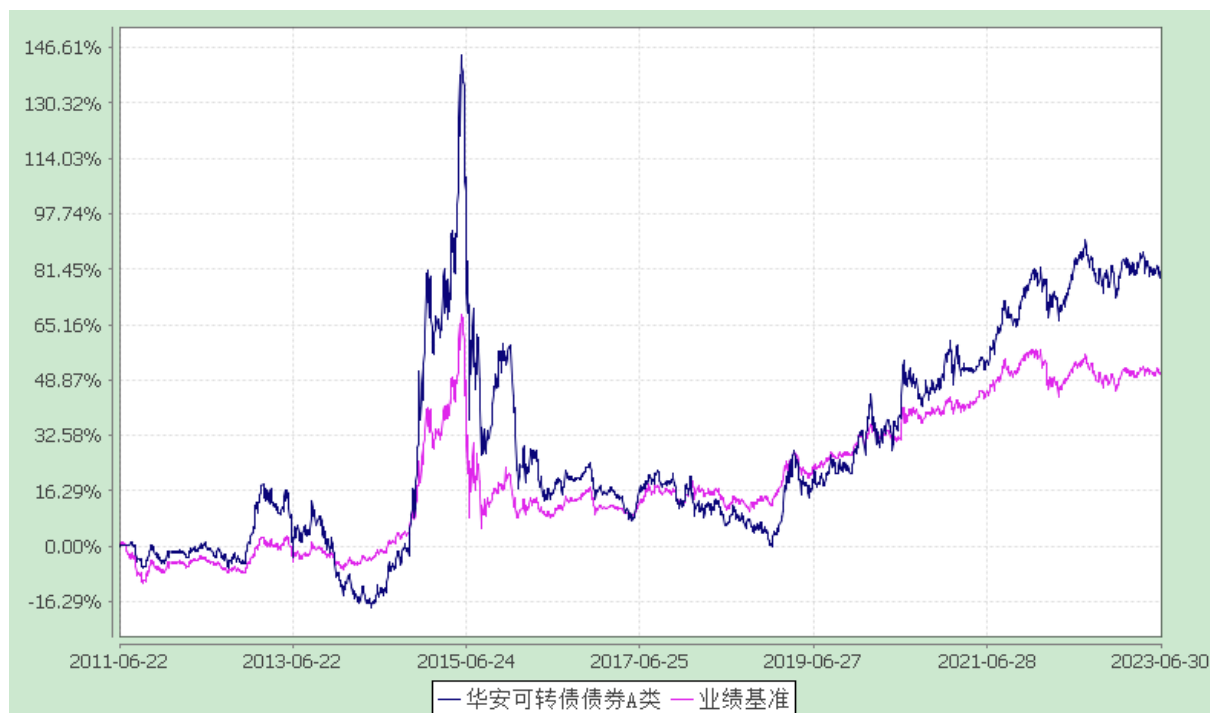
3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安可转换债券债券型证券投资基金

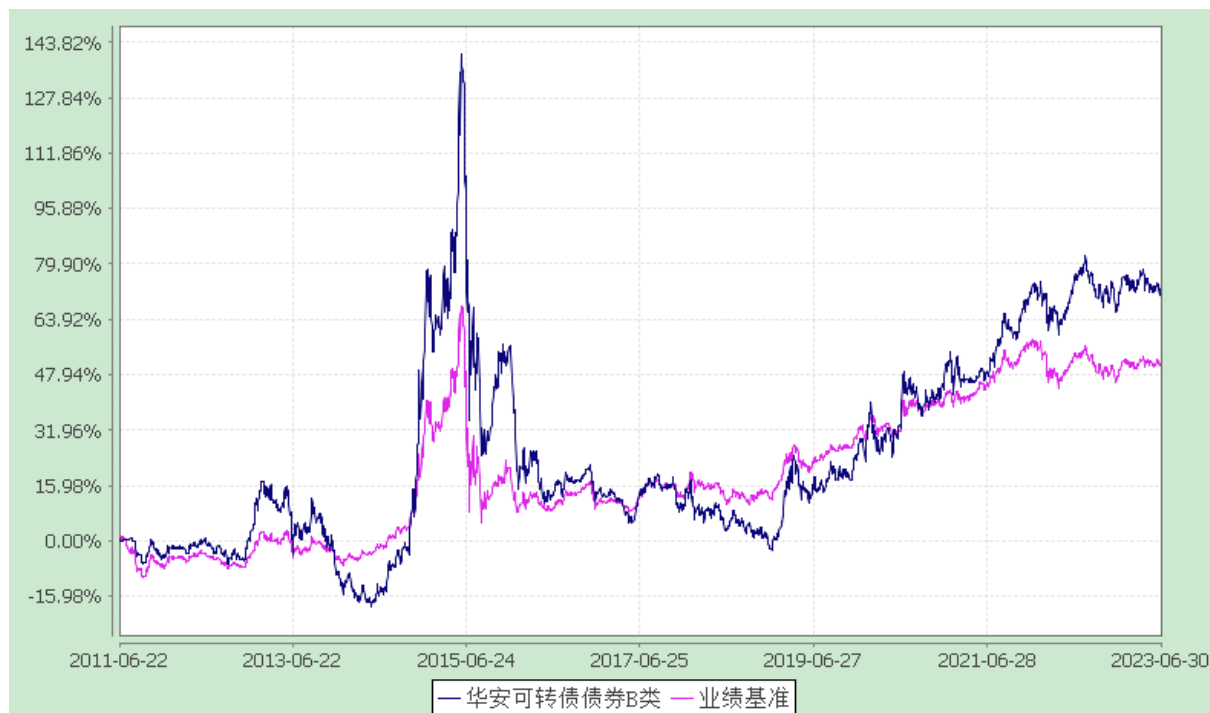
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 6 月 22 日至 2023 年 6 月 30 日)

华安可转债债券 A 类



华安可转债债券 B 类



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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2023 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 239 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,023.30 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
卢维捷	本基金的基金经理助理	2020-03-09	-	11 年	硕士研究生，11 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，历任投资研究部行业分析师，固定收益部研究员。现任固定收益部基金经理助理。
周益鸣	本基金的基金经理	2021-03-08	-	14 年	硕士，14 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、固定收益部基金经理助理。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。
--	--	--	--	--

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 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

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中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，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。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价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（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。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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 7 次，未出现异常交易。

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

上半年，中国宏观经济走出疫情的困扰，在一季度有明显的反弹，步入二季度受到去年拿地相对较少的拖累，经济略有压力，但整体看投资、消费和进出口都处于相对合理的区间内。海外宏观经济相对平稳，虽然有一些风险事件的爆发（例如 SVB 事件等），但没有出现显著的系统性问题。在美国就业市场上，由于居民资产负债状况相对较好，需求没有明显转弱，非农就业数据一直处于较强的水平，推动美债利率有所上行。美联储在上半年维持加息步伐，但由于通胀压力有所缓解，市场对于后续货币政策预期有所转松。

债券市场利率在上半年整体处于下行通道，其中 30 年国债创出近几年的新低，信用利差维持在相对中性的水平。部分地区城投平台的估值虽然有所波动，但并未产生实质性的信用风险事件。可转债受低利率环境的支撑，转股溢价率维持在相对高位，但二季度股票市场整体有所回调，制约了可转债的表现。

股票市场方面，上半年出现冲高回落，但结构性机会凸显。AI 产业链为首的数字经济板块出现大幅上涨，中特估值板块也有过阶段性行情，但消费和地产链条个股表现较差。市场走势同宏观经济和产业政策契合度高，显示市场对于中国经济转型有强烈的诉求，新老经济动能正在持续的转换。

报告期内，主要以配置中低溢价率转债为主，积极寻求结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，华安可转债债券 A 份额净值为 1.812 元，B 份额净值为 1.732 元；本报告期华安可转债债券 A 份额净值增长率为 3.66%，本报告期 B 份额净值增长率为 3.46%。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

展望下半年，宏观经济有利因素将进一步增加。6 月的 PMI 指标已经有所好转，工业企业利润降幅收窄，预示着本轮去库周期接近尾声。政策方面，国常会强调必须采取更加有力的措施，增强发展动能，优化经济结构，推动经济持续回升向好，而 6 月末央行降低 MLF 和 LPR 利率意味着政策工具箱已经被打开。下半年宏观经济本身有自然见底的迹象，同时叠加房地产、消费等刺激政策

的出台，有望迎来较为全面的复苏。

债券市场利率目前处于相对低位，虽然从货币政策层面看有利于利率下行，但如果房地产和财政方面有进一步的宽松举措，可能会不利于债券市场，因此我们倾向于认为债券利率将在下一阶段维持震荡，不易出现上半年单边下行的行情。

对于股票市场，我们认为下跌空间有限，有很强的配置价值。一方面，企业盈利增速可能在下半年有所提高；另一方面，当前市场的估值水平在历史中枢下方，且和债券收益率相比，股票的风险溢价率水平非常有吸引力。我们关注到近期政策进一步强调消费对于经济增长的重要意义，出台了新能源车购置税减免政策，同时还将出台对家居消费的刺激计划，因此下一阶段的市场风格可能会趋于平衡，成长和消费板块都有机会。

在低利率环境下，可转债的溢价率水平会在高位维持震荡，收益的来源依然来自于股票的上涨。我们会积极关注一些原本是传统制造业的公司，如果能够依靠 AI、机器人和新能源等行业性机会完成转型，或者发现新的业务增长点，那股票和转债的估值都会有提高的空间。同时，金融类转债在宏观经济上行阶段，叠加相对较低的溢价率，可能也会有不错的表现，但部分品种需要关注强赎的风险。

本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人的利益。

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，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

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 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：华安可转换债券债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	29,698,837.73	19,701,790.04

结算备付金		3,801,580.67	1,701,287.16
存出保证金		129,994.41	74,366.43
交易性金融资产	6.4.7.2	2,190,330,245.77	755,206,253.05
其中：股票投资		291,611,085.47	136,014,350.00
基金投资		-	-
债券投资		1,898,719,160.30	619,191,903.05
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	-	-
应收清算款		11,871,547.88	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,637,457.89	1,430,448.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,239,469,664.35	778,114,145.44
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		116,016,101.21	-
应付清算款		22,817,759.42	8,457,520.37
应付赎回款		1,565,817.62	891,598.64
应付管理人报酬		1,035,844.78	481,778.49
应付托管费		295,955.65	137,651.02
应付销售服务费		219,385.66	121,779.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,736.96	8,001.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	782,241.20	563,001.79
负债合计		142,746,842.50	10,661,331.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,177,531,098.01	447,868,989.21
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	919,191,723.84	319,583,824.89
净资产合计		2,096,722,821.85	767,452,814.10
负债和净资产总计		2,239,469,664.35	778,114,145.44

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,177,531,098.01 份，其中 A 类基金份额净

值 1.812 元，基金份额总额 715,909,170.82 份；B 类基金份额净值 1.732 元，基金份额总额 461,621,927.19 份。

6.2 利润表

会计主体：华安可转换债券债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		29,193,441.82	7,320,478.55
1.利息收入		133,608.91	40,171.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	107,662.62	24,608.13
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		25,946.29	15,563.06
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		33,558,922.50	11,707,914.68
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,722,906.63	81,272.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	21,022,157.24	11,493,425.37
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	2,813,858.63	133,217.00
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-4,579,152.46	-4,519,335.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	80,062.87	91,728.35
减：二、营业总支出		7,279,767.58	1,420,787.51
1. 管理人报酬		4,127,914.36	827,295.76
2. 托管费		1,179,404.11	236,370.15
3. 销售服务费		900,388.04	204,631.37
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		936,594.35	36,895.44
其中：卖出回购金融资产支出		936,594.35	36,895.44
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		6,373.60	1,249.16
8. 其他费用	6.4.7.17	129,093.12	114,345.63

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,913,674.24	5,899,691.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,913,674.24	5,899,691.04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,913,674.24	5,899,691.04

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安可转换债券债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	447,868,989.21	-	319,583,824.89	767,452,814.10
二、本期期初净资产（基金净值）	447,868,989.21	-	319,583,824.89	767,452,814.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	729,662,108.80	-	599,607,898.95	1,329,270,007.75
（一）、综合收益总额	-	-	21,913,674.24	21,913,674.24
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	729,662,108.80	-	577,694,224.71	1,307,356,333.51
其中：1.基金申购款	1,088,651,710.31	-	853,842,222.69	1,942,493,933.00
2.基金赎回款	-358,989,601.51	-	-276,147,997.98	-635,137,599.49
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,177,531,098.01	-	919,191,723.84	2,096,722,821.85

产（基金净值）				85
---------	--	--	--	----

项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	111,098,180.69	-	84,348,871.13	195,447,051.82
二、本期期初净资产（基金净值）	111,098,180.69	-	84,348,871.13	195,447,051.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	38,065,182.55	-	34,248,585.94	72,313,768.49
（一）、综合收益总额	-	-	5,899,691.04	5,899,691.04
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	38,065,182.55	-	28,348,894.90	66,414,077.45
其中：1.基金申购款	155,118,293.37	-	113,394,348.97	268,512,642.34
2.基金赎回款	-117,053,110.82	-	-85,045,454.07	-202,098,564.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	149,163,363.24	-	118,597,457.07	267,760,820.31

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：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈松一

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安可转换债券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[2011]第 606 号《关于核准华安可转换债券债券型证券投资基金募集的批复》核准,由华安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《华安可转换债券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人民币 1,287,722,831.15 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 251 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,287,981,171.43 份基金份额,其中认购资金利息折合 258,340.28 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》和《华安可转换债券债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的,称为 A 类;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 B 类。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安可转换债券债券型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%,其中对可转债(含分离交易可转债)的投资比例不低于固定收益类资产的 80%;股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的 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。本基金的业绩比较基准为:天相可转债指数收益率 x60%+中证综合债券指数收益率 x30%+沪深 300 指数收益率 x10%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准

则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、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《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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 2023 年上半年度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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、

财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	29,698,837.73
等于：本金	29,691,838.20
加：应计利息	6,999.53
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	29,698,837.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	313,100,699.26	-	291,611,085.47	-21,489,613.79	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	1,907,707,337.88	5,760,477.16	1,888,613,502.77	-24,854,312.27
	银行间市 场	9,953,800.00	111,657.53	10,105,657.53	40,200.00
	合计	1,917,661,137.88	5,872,134.69	1,898,719,160.30	-24,814,112.27
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,230,761,837.14	5,872,134.69	2,190,330,245.77	-46,303,726.06	

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

无余额。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	584.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	616,445.74
其中：交易所市场	616,063.25
银行间市场	382.49
应付利息	-
预提信息披露费	129,507.37
预提审计费	35,704.06
合计	782,241.20

6.4.7.7 实收基金

华安可转债债券 A 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	238,661,008.16	238,661,008.16
本期申购	632,198,517.92	632,198,517.92
本期赎回（以“-”号填列）	-154,950,355.26	-154,950,355.26
本期末	715,909,170.82	715,909,170.82

华安可转债债券 B 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	209,207,981.05	209,207,981.05
本期申购	456,453,192.39	456,453,192.39
本期赎回（以“-”号填列）	-204,039,246.25	-204,039,246.25
本期末	461,621,927.19	461,621,927.19

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

华安可转债债券 A 类

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	152,682,028.78	25,915,695.72	178,597,724.50
本期利润	15,332,040.89	-2,661,926.56	12,670,114.33
本期基金份额交易产生的变动数	320,208,992.20	69,871,315.52	390,080,307.72
其中：基金申购款	422,242,451.27	94,452,489.33	516,694,940.60
基金赎回款	-102,033,459.07	-24,581,173.81	-126,614,632.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	488,223,061.87	93,125,084.68	581,348,146.55

华安可转债债券 B 类

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	118,548,087.18	22,438,013.21	140,986,100.39
本期利润	11,160,785.81	-1,917,225.90	9,243,559.91
本期基金份额交易产生的变动数	149,107,276.65	38,506,640.34	187,613,916.99
其中：基金申购款	268,242,227.78	68,905,054.31	337,147,282.09
基金赎回款	-119,134,951.13	-30,398,413.97	-149,533,365.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	278,816,149.64	59,027,427.65	337,843,577.29

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	76,980.09
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	29,779.97
其他	902.56
合计	107,662.62

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,722,906.63
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	9,722,906.63

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	259,426,248.49
减：卖出股票成本总额	248,775,533.24
减：交易费用	927,808.62
买卖股票差价收入	9,722,906.63

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,870,342.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,151,814.49
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	21,022,157.24
----	---------------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	601,188,992.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	582,119,186.26
减：应计利息总额	1,826,121.91
减：交易费用	91,869.64
买卖债券差价收入	17,151,814.49

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无余额。

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,813,858.63
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	2,813,858.63

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-4,579,152.46
——股票投资	-17,125,609.93
——债券投资	12,546,457.47
——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	-4,579,152.46

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	78,862.10
基金转换费收入	1,200.77
合计	80,062.87

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
银行汇划费	15,281.69
其他费用	600.00
合计	129,093.12

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

无。

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
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,127,914.36	827,295.76
其中：支付销售机构的客户维护费	1,030,746.77	332,044.26

注：支付基金管理人华安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,179,404.11	236,370.15

注：支付基金托管人招商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。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	475.99	475.99
华安基金管理有限公司	-	101,403.43	101,403.43
招商银行股份有限公司	-	26,598.85	26,598.85
合计	-	128,478.27	128,478.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	123.43	123.43
华安基金管理有限公司	-	21,716.55	21,716.55
招商银行股份有限公司	-	26,100.21	26,100.21
合计	-	47,940.19	47,940.19

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日华安可转债债券 B 基金份额的基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金，再由华安基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 B 类基金份额的基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}。$$

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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022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
招商银行	29,698,837.73	76,980.09	17,875,074.23	20,257.29

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本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 116,016,101.21 元，于 2023 年 7 月 4 日（先后）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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只主要投资可转债的债券型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

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。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，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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招商银行，因而与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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	110,344,413.14	42,579,901.92
合计	110,344,413.14	42,579,901.92

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	602,463,814.14	213,060,242.55
AAA 以下	1,185,910,933.02	363,551,758.58
未评级	-	-
合计	1,788,374,747.16	576,612,001.13

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

6.4.13.3.1 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期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发行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%。

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 6.4.12。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。

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，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,698,837.73	-	-	-	29,698,837.73
结算备付金	3,801,580.67	-	-	-	3,801,580.67
存出保证金	129,994.41	-	-	-	129,994.41
交易性金融资产	1,894,292,097.29	4,427,063.01	-	291,611,085.47	2,190,330,245.77
应收清算款	-	-	-	11,871,547.88	11,871,547.88
应收申购款	-	-	-	3,637,457.89	3,637,457.89
资产总计	1,927,922,510.10	4,427,063.01	-	307,120,091.24	2,239,469,664.35
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	116,016,101.21	-	-	-	116,016,101.21
应付清算款	-	-	-	22,817,759.42	22,817,759.42
应付赎回款	-	-	-	1,565,817.62	1,565,817.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,035,844.78	1,035,844.78
应付托管费	-	-	-	295,955.65	295,955.65
应付销售服务费	-	-	-	219,385.66	219,385.66
应交税费	-	-	-	13,736.96	13,736.96
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	782,241.20	782,241.20
负债总计	116,016,101.21	-	-	26,730,741.29	142,746,842.50
利率敏感度缺口	1,811,906,408.89	4,427,063.01	-	280,389,349.95	2,096,722,821.85
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	19,701,790.04	-	-	-	19,701,790.04
结算备付金	1,701,287.16	-	-	-	1,701,287.16
存出保证金	74,366.43	-	-	-	74,366.43
交易性金融资产	614,301,722.09	4,890,180.96	-	136,014,350.00	755,206,253.05
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,430,448.76	1,430,448.76
资产总计	635,779,165.72	4,890,180.96	-	137,444,798.76	778,114,145.44
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	8,457,520.37	8,457,520.37
应付赎回款	-	-	-	891,598.64	891,598.64
应付管理人报酬	-	-	-	481,778.49	481,778.49
应付托管费	-	-	-	137,651.02	137,651.02
应付销售服务费	-	-	-	121,779.61	121,779.61
应交税费	-	-	-	8,001.42	8,001.42
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	563,001.79	563,001.79
负债总计	-	-	-	10,661,331.34	10,661,331.34
利率敏感度缺口	635,779,165.72	4,890,180.96	-	126,783,467.42	767,452,814.10

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
		市场利率下降 25 个基点	113,326.48

	市场利率上升 25 个基点	-113,109.26	-29,300.51
--	---------------	-------------	------------

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。

6.4.13.4.3 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股票和债券，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，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。本基金投资组合中固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	291,611,085.4 7	13.91	136,014,350.0 0	17.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	1,788,374,74 7.16	85.29	576,612,001.1 3	75.13
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	2,079,985,83 2.63	99.20	712,626,351.1 3	92.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	175,220,000.00	50,900,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-175,220,000.00	-50,900,000.00

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 2023 年 6 月 30 日	上期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,063,850,217.30	712,626,351.13
第二层次	126,480,028.47	42,579,901.92

第三层次	-	-
合计	2,190,330,245.77	755,206,253.05

6.4.14.2 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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	291,611,085.47	13.02
	其中：股票	291,611,085.47	13.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,898,719,160.30	84.78
	其中：债券	1,898,719,160.30	84.78

	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	33,500,418.40	1.50
8	其他各项资产	15,639,000.18	0.70
9	合计	2,239,469,664.35	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

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	1,267,345.00	0.06
B	采矿业	1,852,230.00	0.09
C	制造业	174,634,488.16	8.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,412,000.00	0.21
E	建筑业	8,523,000.00	0.41
F	批发和零售业	8,033,100.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	20,059,284.23	0.96
H	住宿和餐饮业	2,842,500.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,180,172.00	0.29
J	金融业	39,542,580.08	1.89
K	房地产业	19,023,800.00	0.91
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,854,886.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	2,525,000.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	860,700.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	291,611,085.47	13.91

7.2.2 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。

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	占基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	64,000	13,412,480.00	0.64
2	600690	海尔智家	482,700	11,333,796.00	0.54
3	001979	招商蛇口	860,000	11,205,800.00	0.53
4	000333	美的集团	173,000	10,193,160.00	0.49
5	600276	恒瑞医药	200,000	9,580,000.00	0.46
6	600048	保利发展	600,000	7,818,000.00	0.37
7	601006	大秦铁路	1,047,761	7,784,864.23	0.37
8	002436	兴森科技	500,000	7,750,000.00	0.37
9	601881	中国银河	604,228	7,015,087.08	0.33
10	600519	贵州茅台	4,000	6,764,000.00	0.32
11	601398	工商银行	1,291,500	6,225,030.00	0.30
12	603638	艾迪精密	250,000	5,130,000.00	0.24
13	600030	中信证券	250,000	4,945,000.00	0.24
14	601111	中国国航	600,000	4,944,000.00	0.24
15	600900	长江电力	200,000	4,412,000.00	0.21
16	601668	中国建筑	700,000	4,018,000.00	0.19
17	603901	永创智能	266,322	3,877,648.32	0.18
18	601066	中信建投	150,000	3,630,000.00	0.17
19	002594	比亚迪	14,000	3,615,780.00	0.17
20	601117	中国化学	400,000	3,312,000.00	0.16
21	603916	苏博特	250,000	3,310,000.00	0.16
22	603650	彤程新材	100,000	3,280,000.00	0.16
23	601689	拓普集团	40,000	3,228,000.00	0.15
24	603368	柳药集团	130,000	3,212,300.00	0.15
25	603486	科沃斯	40,000	3,110,800.00	0.15
26	300607	拓斯达	200,000	3,006,000.00	0.14
27	601878	浙商证券	300,000	2,964,000.00	0.14
28	600058	五矿发展	300,000	2,949,000.00	0.14
29	601336	新华保险	80,000	2,941,600.00	0.14
30	603501	韦尔股份	30,000	2,941,200.00	0.14

31	000651	格力电器	80,000	2,920,800.00	0.14
32	600258	首旅酒店	150,000	2,842,500.00	0.14
33	600019	宝钢股份	500,000	2,810,000.00	0.13
34	600941	中国移动	30,000	2,799,000.00	0.13
35	002332	仙琚制药	200,000	2,650,000.00	0.13
36	603516	淳中科技	120,000	2,646,000.00	0.13
37	001872	招商港口	150,000	2,590,500.00	0.12
38	000967	盈峰环境	500,000	2,525,000.00	0.12
39	600309	万华化学	27,400	2,406,816.00	0.11
40	600111	北方稀土	100,000	2,398,000.00	0.11
41	000301	东方盛虹	200,000	2,364,000.00	0.11
42	300630	普利制药	120,000	2,346,000.00	0.11
43	300613	富瀚微	40,000	2,269,600.00	0.11
44	300986	志特新材	80,000	2,240,000.00	0.11
45	002541	鸿路钢构	77,232	2,225,053.92	0.11
46	002859	洁美科技	80,000	2,216,000.00	0.11
47	000060	中金岭南	450,000	2,137,500.00	0.10
48	601288	农业银行	600,000	2,118,000.00	0.10
49	600893	航发动力	50,000	2,113,000.00	0.10
50	002572	索菲亚	120,000	2,090,400.00	0.10
51	002475	立讯精密	64,200	2,083,290.00	0.10
52	601601	中国太保	80,000	2,078,400.00	0.10
53	688050	爱博医疗	10,000	2,053,300.00	0.10
54	002508	老板电器	80,000	2,023,200.00	0.10
55	600377	宁沪高速	200,000	1,966,000.00	0.09
56	600745	闻泰科技	40,000	1,956,000.00	0.09
57	600350	山东高速	300,000	1,911,000.00	0.09
58	002984	森麒麟	60,000	1,887,600.00	0.09
59	601238	广汽集团	180,000	1,875,600.00	0.09
60	600827	百联股份	140,000	1,871,800.00	0.09
61	002271	东方雨虹	60,000	1,635,600.00	0.08
62	300633	开立医疗	30,000	1,635,000.00	0.08
63	688268	华特气体	20,000	1,614,600.00	0.08
64	002049	紫光国微	15,000	1,398,750.00	0.07
65	000672	上峰水泥	149,920	1,368,769.60	0.07
66	000703	恒逸石化	200,000	1,356,000.00	0.06
67	001215	千味央厨	20,000	1,329,800.00	0.06
68	000538	云南白药	25,000	1,312,000.00	0.06
69	600801	华新水泥	100,000	1,235,000.00	0.06
70	688179	阿拉丁	40,000	1,194,400.00	0.06
71	002051	中工国际	100,000	1,193,000.00	0.06
72	603345	安井食品	8,000	1,174,400.00	0.06
73	600919	江苏银行	156,100	1,147,335.00	0.05
74	600089	特变电工	49,900	1,112,271.00	0.05

75	600406	国电南瑞	48,120	1,111,572.00	0.05
76	600926	杭州银行	93,800	1,102,150.00	0.05
77	300314	戴维医疗	50,000	1,057,000.00	0.05
78	600660	福耀玻璃	29,200	1,046,820.00	0.05
79	601229	上海银行	181,900	1,045,925.00	0.05
80	300979	华利集团	21,100	1,028,414.00	0.05
81	688981	中芯国际	20,000	1,010,400.00	0.05
82	601100	恒立液压	15,500	997,115.00	0.05
83	601838	成都银行	81,000	989,010.00	0.05
84	600887	伊利股份	34,900	988,368.00	0.05
85	300450	先导智能	27,200	983,824.00	0.05
86	000895	双汇发展	39,100	957,559.00	0.05
87	601009	南京银行	119,600	956,800.00	0.05
88	600028	中国石化	150,000	954,000.00	0.05
89	000001	平安银行	83,600	938,828.00	0.04
90	002129	TCL 中环	28,125	933,750.00	0.04
91	600438	通威股份	26,900	922,939.00	0.04
92	300498	温氏股份	50,000	917,500.00	0.04
93	603195	公牛集团	9,472	909,880.32	0.04
94	002705	新宝股份	50,000	901,500.00	0.04
95	601899	紫金矿业	79,000	898,230.00	0.04
96	600989	宝丰能源	69,500	876,395.00	0.04
97	002841	视源股份	13,000	868,920.00	0.04
98	601919	中远海控	91,800	862,920.00	0.04
99	002001	新 和 成	55,900	860,860.00	0.04
100	603882	金域医学	11,400	860,700.00	0.04
101	000877	天山股份	100,000	814,000.00	0.04
102	605089	味知香	20,700	813,510.00	0.04
103	601615	明阳智能	48,100	811,928.00	0.04
104	002821	凯莱英	6,800	801,448.00	0.04
105	002304	洋河股份	6,100	801,235.00	0.04
106	300894	火星人	31,100	794,294.00	0.04
107	002938	鹏鼎控股	32,400	786,996.00	0.04
108	300037	新宙邦	15,000	778,350.00	0.04
109	000661	长春高新	5,700	776,910.00	0.04
110	603833	欧派家居	7,900	756,820.00	0.04
111	601166	兴业银行	46,700	730,855.00	0.03
112	601318	中国平安	15,400	714,560.00	0.03
113	603259	药明康德	10,600	660,486.00	0.03
114	603899	晨光股份	14,200	633,888.00	0.03
115	603986	兆易创新	5,400	573,750.00	0.03
116	002714	牧原股份	8,300	349,845.00	0.02

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	000568	泸州老窖	17,013,299.00	2.22
2	600690	海尔智家	11,503,220.00	1.50
3	000333	美的集团	10,841,769.00	1.41
4	002436	兴森科技	9,659,953.00	1.26
5	601881	中国银河	9,396,520.28	1.22
6	001979	招商蛇口	8,973,285.00	1.17
7	000858	五粮液	8,341,759.00	1.09
8	601111	中国国航	8,203,577.00	1.07
9	601186	中国铁建	8,156,000.00	1.06
10	601006	大秦铁路	8,111,070.27	1.06
11	600048	保利发展	7,637,922.85	1.00
12	300613	富瀚微	7,165,512.36	0.93
13	601939	建设银行	7,147,277.00	0.93
14	300274	阳光电源	6,885,000.00	0.90
15	002541	鸿路钢构	6,764,368.56	0.88
16	603650	彤程新材	6,263,884.00	0.82
17	601398	工商银行	6,259,470.00	0.82
18	600030	中信证券	6,172,898.40	0.80
19	601336	新华保险	5,937,829.00	0.77
20	000651	格力电器	5,827,409.00	0.76

注：本项“买入金额”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。

7.4.2 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	000858	五粮液	11,347,067.00	1.48
2	601186	中国铁建	8,937,069.00	1.16
3	600030	中信证券	7,530,458.00	0.98
4	601939	建设银行	7,367,719.00	0.96
5	600019	宝钢股份	7,020,537.00	0.91
6	300613	富瀚微	6,993,955.12	0.91
7	300274	阳光电源	6,708,216.00	0.87

8	601881	中国银河	6,280,072.00	0.82
9	601668	中国建筑	6,152,000.00	0.80
10	002541	鸿路钢构	6,151,656.40	0.80
11	000651	格力电器	6,136,134.00	0.80
12	000333	美的集团	4,984,293.00	0.65
13	601998	中信银行	4,633,550.00	0.60
14	001979	招商蛇口	4,407,269.08	0.57
15	601398	工商银行	4,339,620.00	0.57
16	000002	万科A	4,327,000.00	0.56
17	002271	东方雨虹	4,273,375.00	0.56
18	300308	中际旭创	4,258,570.28	0.55
19	600420	国药现代	3,897,334.95	0.51
20	601878	浙商证券	3,774,998.00	0.49

注：本项“卖出金额”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。

7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	421,497,878.64
卖出股票的收入（成交）总额	259,426,248.49

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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	100,238,755.61	4.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,105,657.53	0.48
	其中：政策性金融债	10,105,657.53	0.48
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）	1,788,374,747.16	85.29

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,898,719,160.30	90.56

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	113021	中信转债	720,000	82,882,533.70	3.95
2	110053	苏银转债	633,950	79,697,762.41	3.80
3	113056	重银转债	784,230	79,346,565.11	3.78
4	019694	23 国债 01	620,000	62,687,979.18	2.99
5	113602	景 20 转债	409,880	52,063,631.38	2.48

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚

的投资决策说明

2023 年 2 月 6 日，江苏银行因违反账户管理规定、违反流通人民币管理规定等违法违规事项，被中国人民银行（银罚决字（2023）1 号）给予警告，没收违法所得 42 元，罚款 773.6 万元的行政处罚。

2022 年 9 月 9 日，兴业银行因债券承销业务严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2022）41 号）给予罚款 150 万元的行政处罚。2022 年 9 月 28 日，兴业银行因理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹、未按规定开展理财业务内部审计等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2022）50 号）给予罚款 450 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。

7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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。

7.12.3 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	129,994.41
2	应收清算款	11,871,547.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,637,457.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,639,000.18

7.12.4 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	113021	中信转债	82,882,533.70	3.95

2	110053	苏银转债	79,697,762.41	3.80
3	113056	重银转债	79,346,565.11	3.78
4	113602	景 20 转债	52,063,631.38	2.48
5	113044	大秦转债	43,896,142.46	2.09
6	111010	立昂转债	39,694,385.57	1.89
7	113052	兴业转债	31,531,051.23	1.50
8	113061	拓普转债	31,325,637.92	1.49
9	113060	浙 22 转债	31,026,142.45	1.48
10	113057	中银转债	29,626,552.80	1.41
11	127012	招路转债	25,102,410.96	1.20
12	127071	天箭转债	22,456,243.33	1.07
13	127054	双箭转债	20,645,347.95	0.98
14	127063	贵轮转债	18,556,539.73	0.89
15	127032	苏行转债	18,444,278.08	0.88
16	110062	烽火转债	18,368,959.35	0.88
17	123167	商络转债	18,333,529.86	0.87
18	123146	中环转 2	16,982,528.14	0.81
19	123170	南电转债	16,135,615.33	0.77
20	123131	奥飞转债	15,900,263.01	0.76
21	123162	东杰转债	15,584,991.78	0.74
22	113045	环旭转债	15,209,544.11	0.73
23	123107	温氏转债	15,071,523.29	0.72
24	118023	广大转债	15,002,593.97	0.72
25	113065	齐鲁转债	14,225,486.07	0.68
26	113619	世运转债	14,192,757.53	0.68
27	113628	晨丰转债	13,457,830.09	0.64
28	123172	漱玉转债	13,342,370.14	0.64
29	118019	金盘转债	12,772,936.99	0.61
30	110079	杭银转债	12,651,630.41	0.60
31	110080	东湖转债	12,588,932.71	0.60
32	110061	川投转债	12,472,314.37	0.59
33	113655	欧 22 转债	12,276,042.74	0.59
34	127053	豪美转债	12,221,880.02	0.58
35	123035	利德转债	12,145,498.03	0.58
36	118011	银微转债	12,002,619.42	0.57
37	123157	科蓝转债	11,994,263.01	0.57
38	127049	希望转 2	11,689,172.80	0.56
39	113644	艾迪转债	11,616,219.62	0.55
40	118028	会通转债	11,484,475.92	0.55
41	113050	南银转债	11,258,454.80	0.54
42	127020	中金转债	10,418,063.38	0.50
43	128142	新乳转债	10,182,778.77	0.49
44	113631	皖天转债	10,177,282.19	0.49
45	113643	风语转债	9,839,804.79	0.47

46	111005	富春转债	9,607,407.53	0.46
47	123142	申昊转债	9,398,554.79	0.45
48	113055	成银转债	9,342,318.49	0.45
49	128121	宏川转债	9,212,345.21	0.44
50	123163	金沃转债	8,947,421.64	0.43
51	113640	苏利转债	8,879,802.74	0.42
52	128133	奇正转债	8,856,265.75	0.42
53	113563	柳药转债	8,747,222.51	0.42
54	128134	鸿路转债	8,707,357.53	0.42
55	123119	康泰转 2	8,095,826.03	0.39
56	128137	洁美转债	8,073,830.14	0.39
57	113064	东材转债	8,029,755.62	0.38
58	128136	立讯转债	7,876,246.58	0.38
59	113654	永 02 转债	7,837,113.70	0.37
60	127060	湘佳转债	7,824,535.85	0.37
61	127050	麒麟转债	7,746,587.46	0.37
62	110084	贵燃转债	7,641,230.14	0.36
63	123158	宙邦转债	7,635,803.70	0.36
64	113639	华正转债	7,590,511.23	0.36
65	113549	白电转债	7,480,175.34	0.36
66	113048	晶科转债	7,278,073.97	0.35
67	123120	隆华转债	7,220,702.88	0.34
68	113647	禾丰转债	7,058,802.74	0.34
69	110088	淮 22 转债	6,959,827.40	0.33
70	113063	赛轮转债	6,858,423.29	0.33
71	123147	中辰转债	6,812,839.91	0.32
72	118027	宏图转债	6,705,924.66	0.32
73	118006	阿拉转债	6,655,863.42	0.32
74	127056	中特转债	6,612,027.95	0.32
75	113058	友发转债	6,583,055.48	0.31
76	123082	北陆转债	6,501,179.85	0.31
77	110083	苏租转债	6,461,280.01	0.31
78	127030	盛虹转债	6,330,141.10	0.30
79	123161	强联转债	6,304,646.58	0.30
80	128132	交建转债	6,243,171.23	0.30
81	132018	G 三峡 EB1	6,100,021.23	0.29
82	128049	华源转债	6,076,517.49	0.29
83	128119	龙大转债	5,700,184.93	0.27
84	128141	旺能转债	5,688,591.12	0.27
85	123132	回盛转债	5,683,493.43	0.27
86	123101	拓斯转债	5,523,482.18	0.26
87	127052	西子转债	5,521,820.55	0.26
88	113530	大丰转债	5,498,641.10	0.26
89	118017	深科转债	5,447,800.55	0.26

90	113651	松霖转债	5,401,237.81	0.26
91	123145	药石转债	5,396,438.80	0.26
92	113632	鹤 21 转债	5,329,695.21	0.25
93	127045	牧原转债	5,314,485.21	0.25
94	118015	芯海转债	5,244,102.44	0.25
95	110047	山鹰转债	5,086,941.78	0.24
96	128042	凯中转债	5,071,823.56	0.24
97	113051	节能转债	5,044,526.03	0.24
98	118013	道通转债	5,016,615.89	0.24
99	113505	杭电转债	4,893,315.07	0.23
100	113024	核建转债	4,840,455.89	0.23
101	128071	合兴转债	4,599,150.68	0.22
102	113062	常银转债	4,572,995.13	0.22
103	111004	明新转债	4,572,082.85	0.22
104	113623	凤 21 转债	4,526,164.38	0.22
105	118007	山石转债	4,450,073.56	0.21
106	113604	多伦转债	4,443,331.46	0.21
107	113662	豪能转债	4,436,016.99	0.21
108	132026	G 三峡 EB2	4,427,063.01	0.21
109	127039	北港转债	4,369,553.42	0.21
110	110048	福能转债	4,365,124.26	0.21
111	110089	兴发转债	4,355,344.66	0.21
112	128034	江银转债	4,353,018.08	0.21
113	110059	浦发转债	4,323,690.96	0.21
114	113594	淳中转债	4,316,321.92	0.21
115	123150	九强转债	4,267,532.88	0.20
116	123149	通裕转债	4,223,784.91	0.20
117	127027	能化转债	4,221,522.60	0.20
118	110090	爱迪转债	4,184,243.01	0.20
119	128130	景兴转债	4,130,785.69	0.20
120	123154	火星转债	4,074,117.53	0.19
121	118018	瑞科转债	4,068,713.56	0.19
122	128075	远东转债	3,912,115.07	0.19
123	128144	利民转债	3,828,149.18	0.18
124	128081	海亮转债	3,826,495.89	0.18
125	123160	泰福转债	3,759,683.93	0.18
126	127037	银轮转债	3,711,957.20	0.18
127	128048	张行转债	3,681,435.20	0.18
128	127006	敖东转债	3,672,365.75	0.18
129	127029	中钢转债	3,649,758.02	0.17
130	128140	润建转债	3,639,325.88	0.17
131	127077	华宏转债	3,611,962.19	0.17
132	127058	科伦转债	3,607,476.53	0.17
133	118016	京源转债	3,564,649.32	0.17

134	123152	润禾转债	3,537,309.04	0.17
135	128135	洽洽转债	3,533,901.37	0.17
136	127040	国泰转债	3,493,342.19	0.17
137	113519	长久转债	3,487,149.92	0.17
138	113615	金诚转债	3,419,408.73	0.16
139	110064	建工转债	3,387,180.82	0.16
140	128037	岩土转债	3,361,602.74	0.16
141	123099	普利转债	3,271,802.29	0.16
142	113043	财通转债	3,205,108.77	0.15
143	123141	宏丰转债	3,073,025.77	0.15
144	113591	胜达转债	3,063,000.00	0.15
145	123122	富瀚转债	3,033,102.03	0.14
146	113661	福 22 转债	3,026,171.92	0.14
147	123050	聚飞转债	2,960,128.77	0.14
148	123100	朗科转债	2,901,530.82	0.14
149	123151	康医转债	2,887,000.00	0.14
150	123153	英力转债	2,858,064.68	0.14
151	113663	新化转债	2,817,400.60	0.13
152	127074	麦米转 2	2,763,832.33	0.13
153	123059	银信转债	2,634,603.58	0.13
154	118025	奕瑞转债	2,546,712.49	0.12
155	123127	耐普转债	2,533,643.84	0.12
156	113545	金能转债	2,465,488.39	0.12
157	123171	共同转债	2,405,852.22	0.11
158	113565	宏辉转债	2,396,419.18	0.11
159	127035	濮耐转债	2,330,967.12	0.11
160	127075	百川转 2	2,293,135.83	0.11
161	113605	大参转债	2,262,046.58	0.11
162	127042	嘉美转债	2,246,345.21	0.11
163	110067	华安转债	2,196,292.60	0.10
164	127066	科利转债	2,067,121.75	0.10
165	127024	盈峰转债	2,059,626.97	0.10
166	118005	天奈转债	1,949,434.93	0.09
167	127019	国城转债	1,942,530.83	0.09
168	113600	新星转债	1,933,212.05	0.09
169	123133	佩蒂转债	1,769,717.67	0.08
170	128109	楚江转债	1,767,131.51	0.08
171	110070	凌钢转债	1,765,455.62	0.08
172	127076	中宠转 2	1,729,688.11	0.08
173	113542	好客转债	1,706,971.23	0.08
174	123169	正海转债	1,641,815.66	0.08
175	113653	永 22 转债	1,632,394.93	0.08
176	118000	嘉元转债	1,610,708.22	0.08
177	113633	科沃转债	1,609,301.33	0.08

178	113033	利群转债	1,568,237.67	0.07
179	110091	合力转债	1,560,076.71	0.07
180	128083	新北转债	1,315,508.22	0.06
181	123089	九洲转 2	1,300,008.22	0.06
182	127043	川恒转债	1,272,647.67	0.06
183	127078	优彩转债	1,247,245.27	0.06
184	113059	福莱转债	1,199,160.27	0.06
185	113659	莱克转债	1,178,809.59	0.06
186	128097	奥佳转债	1,160,042.47	0.06
187	127016	鲁泰转债	1,140,728.77	0.05
188	113516	苏农转债	1,123,037.53	0.05
189	113606	荣泰转债	1,116,047.95	0.05
190	127067	恒逸转 2	1,109,842.38	0.05
191	127072	博实转债	1,106,203.40	0.05
192	123144	裕兴转债	1,060,371.01	0.05
193	123091	长海转债	1,059,106.25	0.05
194	127033	中装转 2	954,965.75	0.05
195	127070	大中转债	930,059.15	0.04
196	113027	华钰转债	753,235.34	0.04
197	123140	天地转债	732,486.16	0.03
198	118012	微芯转债	628,332.47	0.03
199	127026	超声转债	597,996.44	0.03
200	123129	锦鸡转债	570,121.51	0.03
201	110086	精工转债	569,733.56	0.03
202	123113	仙乐转债	534,750.00	0.03
203	128125	华阳转债	506,280.56	0.02
204	113524	奇精转债	441,780.09	0.02

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
华安可转债债券 A 类	39,267	18,231.83	586,227,246.4 3	81.89%	129,681,924.3 9	18.11%
华安可转债债券 B 类	98,983	4,663.65	345,313,523.6 1	74.80%	116,308,403.58	25.20%
合计	138,250	8,517.40	931,540,770.0 4	79.11%	245,990,327.9 7	20.89%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	华安可转债债券 A 类	54,801.62	0.01%
	华安可转债债券 B 类	0.00	0.00%
	合计	54,801.62	0.00%

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安可转债债券 A 类	-
	华安可转债债券 B 类	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	华安可转债债券 A 类	0~10
	华安可转债债券 B 类	-
	合计	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

9 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
基金合同生效日（2011 年 6 月 22 日）基金份额总额	706,745,673.56	581,235,497.87
本报告期期初基金份额总额	238,661,008.16	209,207,981.05
本报告期基金总申购份额	632,198,517.92	456,453,192.39

减：本报告期基金总赎回份额	154,950,355.26	204,039,246.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	715,909,170.82	461,621,927.19

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	

广发证券	1	268,171,725.98	40.35%	249,747.76	40.54%	-
浙商证券	1	137,615,284.42	20.70%	126,784.21	20.58%	-
中信证券	3	89,775,891.00	13.51%	83,609.62	13.57%	-
民生证券	1	67,208,662.82	10.11%	61,919.52	10.05%	-
方正证券	2	48,732,318.88	7.33%	44,896.52	7.29%	-
信达证券	1	41,898,562.80	6.30%	38,600.97	6.27%	-
首创证券	1	11,279,708.00	1.70%	10,504.65	1.71%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
野村东方证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2023 年 1 月完成租用托管在招商银行的国泰君安深交所 016401 交易单元

2023 年 1 月完成租用托管在招商银行的国泰君安深交所 016402 交易单元

2023 年 1 月完成租用托管在招商银行的野村东方上交所 56969 交易单元

2023 年 1 月完成租用托管在招商银行的华创证券上交所 47797 交易单元

2023 年 3 月完成退租托管在招商银行的国泰君安深交所 016402 交易单元

10.7.2 基金租用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		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
广发证券	1,062,860,253.27	44.49%	2,646,000,000.00	76.12%	-	-
浙商证券	462,956,210.13	19.38%	-	-	-	-
中信证券	328,615,902.90	13.75%	786,000,000.00	22.61%	-	-
民生证券	278,572,111.71	11.66%	-	-	-	-
方正证券	125,398,787.68	5.25%	-	-	-	-
信达证券	101,725,299.62	4.26%	-	-	-	-
首创证券	28,937,121.16	1.21%	44,000,000.00	1.27%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
野村东方证券	-	-	-	-	-	-

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	华安可转换债券债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-01-20
2	华安可转换债券债券型证券投资基金更新的招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-03
3	华安可转换债券债券型证券投资基金(华安可转债债券 A 类) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-03
4	华安可转换债券债券型证券投资基金(华安可转债债券 B 类) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-03
5	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-25
6	华安可转换债券债券型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-30
7	华安可转换债券债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-04-21

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

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

无。

12 备查文件目录

12.1 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》
- 4、中国证监会批准华安可转换债券债券型证券投资基金设立的文件；

- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

12.3 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办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日