

华商可转债债券型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 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
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	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合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 中期财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.11 投资组合报告附注	47
§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	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
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	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华商可转债债券型证券投资基金	
基金简称	华商可转债债券	
基金主代码	005273	
交易代码	005273	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 22 日	
基金管理人	华商基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	342,780,540.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华商可转债 A	华商可转债 C
下属分级基金的交易代码:	005273	005284
报告期末下属分级基金的份额总额	196,910,041.85 份	145,870,498.23 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，尤其重点配置可转换债券，同时本基金将适当参与股票投资，在追求资产的长期稳定增值的同时争取超额收益。
投资策略	本基金以债券投资为主，同时充分研究国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，充分分析各类资产市场可能存在的较确定性投资机会，适当调整大类资产配置。同时在债券投资方面，本基金重点投资可转换债券（含可分离交易的可转换债券），基金管理人将充分考虑可转换债券所具有的股性与债性，认真考量可转换债券的股权价值、债权价值及其转换权益价值，根据大类资产市场特征，选择具有较高配置价值的可转换债券，以期资产长期稳定增值的基础上获得一定的超额收益。 具体投资策略详见基金合同。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×80%+中证 800 指数收益率×10%+中证全债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，但高于货币市场基金，属于较低风险收益水平的投资品种。

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		华商基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高敏	郭明
	联系电话	010-58573600	010-66105799
	电子邮箱	gaom@hsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007008880	95588
传真		010-58573520	010-66105798

注册地址	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100035	100140
法定代表人	陈牧原	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华商基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 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

基金级别	华商可转债 A	华商可转债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,530,319.00	6,773,032.13
本期利润	3,818,805.37	8,984,011.91
加权平均基金份额本期利润	0.0425	0.0720
本期加权平均净值利润率	2.89%	4.96%
本期基金份额净值增长率	8.57%	8.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	41,246,357.60	28,602,684.54
期末可供分配基金份额利润	0.2095	0.1961
期末基金资产净值	291,786,682.10	214,091,437.95
期末基金份额净值	1.4818	1.4677
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	48.18%	46.77%

注：1. 上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。

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. 对期末可供分配利润，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余额的孰低数。

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

华商可转债 A

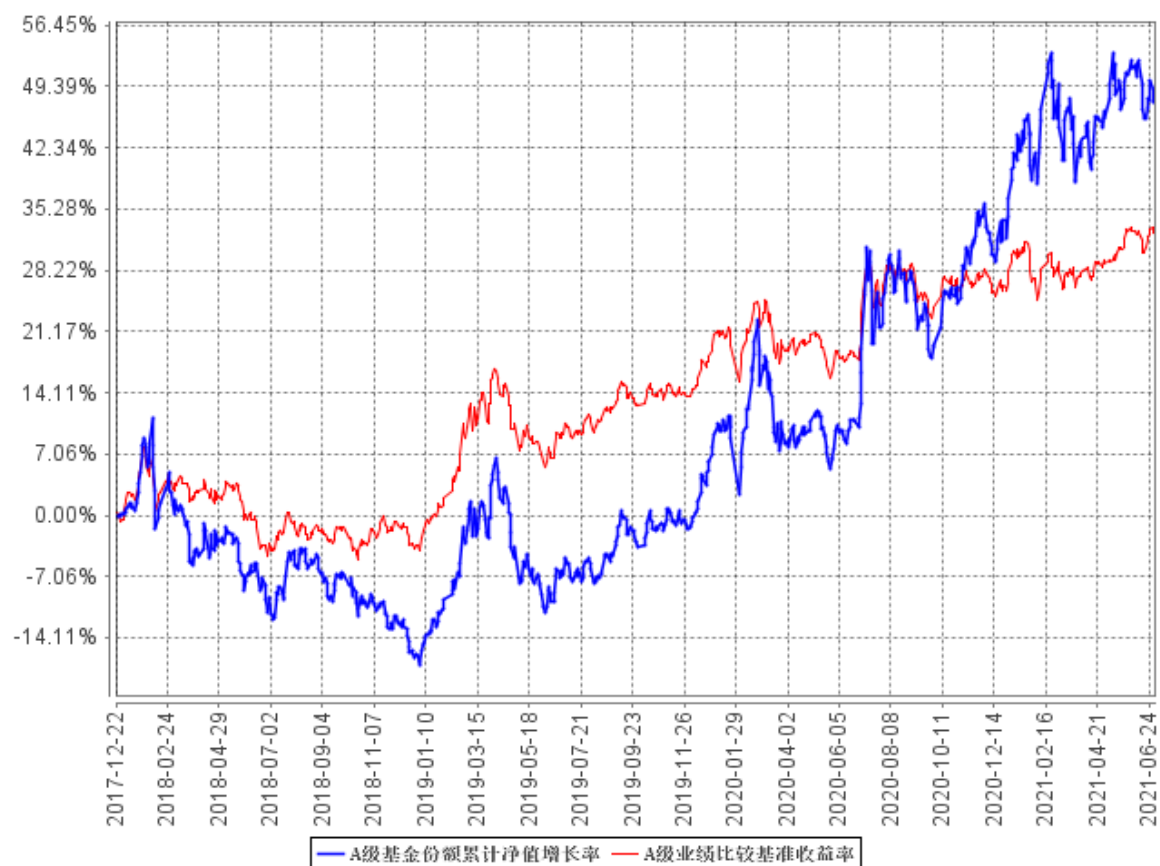
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.11%	0.85%	-0.12%	0.38%	-1.99%	0.47%
过去三个月	4.82%	0.98%	4.18%	0.34%	0.64%	0.64%
过去六个月	8.57%	1.25%	3.69%	0.51%	4.88%	0.74%
过去一年	33.15%	1.30%	11.90%	0.64%	21.25%	0.66%
过去三年	63.83%	1.13%	37.09%	0.64%	26.74%	0.49%
自基金合同生效起至今	48.18%	1.13%	32.79%	0.65%	15.39%	0.48%

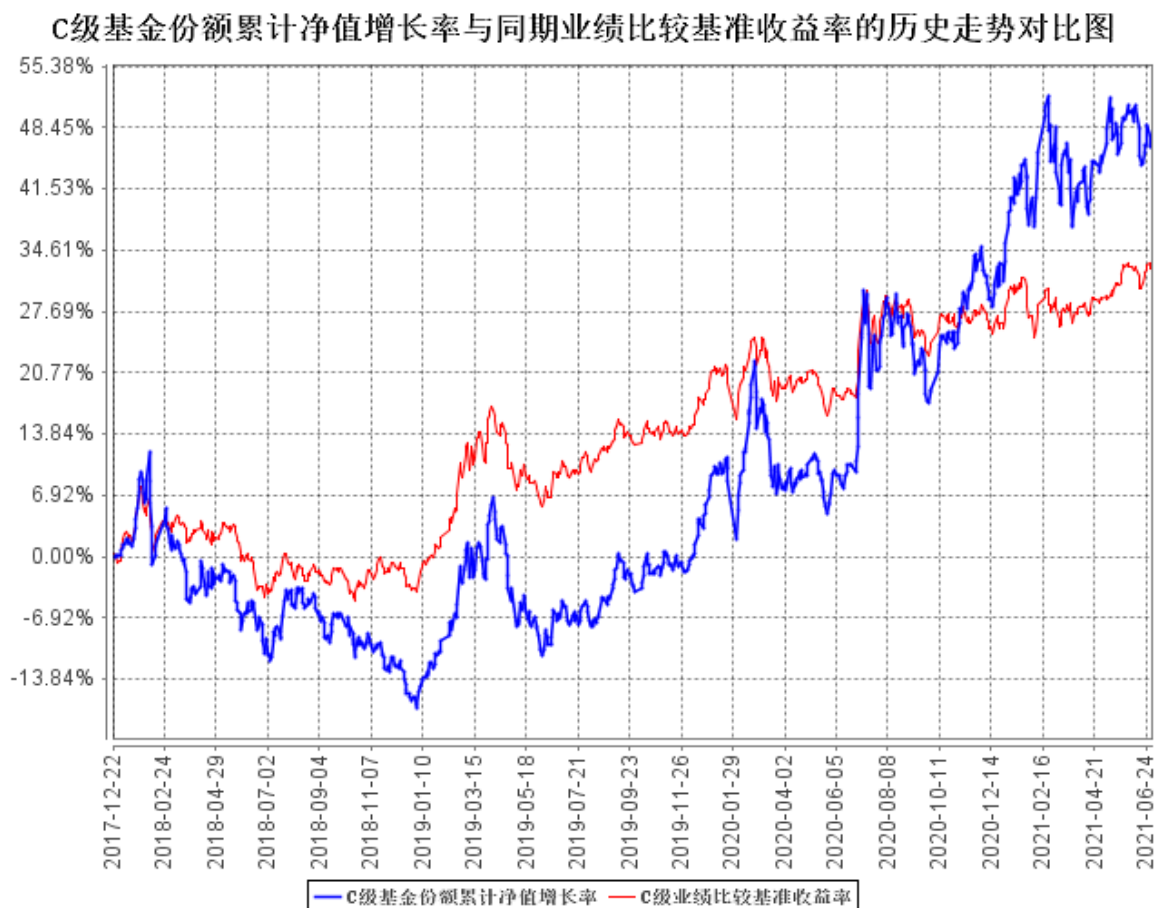
华商可转债 C

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
过去一个月	-2.13%	0.85%	-0.12%	0.38%	-2.01%	0.47%
过去三个月	4.72%	0.98%	4.18%	0.34%	0.54%	0.64%
过去六个月	8.37%	1.25%	3.69%	0.51%	4.68%	0.74%
过去一年	32.62%	1.30%	11.90%	0.64%	20.72%	0.66%
过去三年	61.71%	1.13%	37.09%	0.64%	24.62%	0.49%
自基金合同生效起至今	46.77%	1.13%	32.79%	0.65%	13.98%	0.48%

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

A级基金份额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本基金合同生效日为 2017 年 12 月 22 日。

②根据《华商可转换债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围主要为国内依法发行的金融工具，包括股票（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、国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券（含可分离交易的可转换债券）、可交换债券、中期票据、中小企业私募债、回购、同业存单和银行存款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。本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易的可转换债券）的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券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。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 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

华商基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]160 号文批准设立，于 2005 年 12 月

20 日成立，注册资本为 1 亿元人民币，注册地北京。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理六十一只基金产品，分别为华商领先企业混合型开放式证券投资基金、华商盛世成长混合型证券投资基金、华商收益增强债券型证券投资基金、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华商产业升级混合型证券投资基金、华商稳健双利债券型证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华商稳定增利债券型证券投资基金、华商价值精选混合型证券投资基金、华商主题精选混合型证券投资基金、华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华商现金增利货币市场基金、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金、华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金、华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金、华商双债丰利债券型证券投资基金、华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商新量化灵活配置混合型证券投资基金、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金、华商未来主题混合型证券投资基金、华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金、华商双翼平衡混合型证券投资基金、华商新常态灵活配置混合型证券投资基金、华商信用增强债券型证券投资基金、华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金、华商新动力混合型证券投资基金、华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金、华商乐享互联灵活配置混合型证券投资基金、华商新兴活力灵活配置混合型证券投资基金、华商万众创新灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金、华商丰利增强定期开放债券型证券投资基金、华商润丰灵活配置混合型证券投资基金、华商元亨灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞丰短债债券型证券投资基金、华商研究精选灵活配置混合型证券投资基金、华商鑫安灵活配置混合型证券投资基金、华商可转债债券型证券投资基金、华商上游产业股票型证券投资基金、华商改革创新股票型证券投资基金、华商消费行业股票型证券投资基金、华商电子行业量化股票型发起式证券投资基金、华商计算机行业量化股票型发起式证券投资基金、华商高端装备制造股票型证券投资基金、华商医药医疗行业股票型证券投资基金、华商恒益稳健混合型证券投资基金、华商科技创新混合型证券投资基金、华商龙头优势混合型证券投资基金、华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华商鸿畅 39 个月定期开放利率债债券型证券投资基金、华商转债精选债券型证券投资基金、华商量化优质精选混合型证券投资基金、华商双擎领航混合型证券投资基金、华商景气优选混合型证券投资基金、华商甄选回报混合型证券投资基金、华商鸿盈 87 个月定期开放债券型证券投资基金、华商均衡成长混合型证券投资基金、华商嘉悦平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华商远见价值混合型证券投资基金。

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		
张永志	基金经理，固定收益部副总经理，公司公募业务固收投资决策委员会委员	2017 年 12 月 22 日	-	15.4	男，中国籍，经济学硕士，具有基金从业资格。1999 年 9 月至 2003 年 7 月，就职于工商银行青岛市市北一支行，任科员、科长等职务；2006 年 1 月至 2007 年 5 月，就职于海通证券，任债券部交易员；2007 年 5 月加入华商基金管理有限公司；2007 年 5 月至 2009 年 1 月担任交易员；2009 年 1 月至 2010 年 8 月担任华商收益增强债券型证券投资基金的基金经理助理；2010 年 8 月 9 日起至今担任华商稳健双利债券型证券投资基金的基金经理；2011 年 3 月 15 日起至今担任华商稳定增利债券型证券投资基金的基金经理；2015 年 2 月 17 日至 2020 年 3 月 16 日担任华商稳固添利债券型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 24 日起至今担任华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 1 日至 2019 年 5 月 23 日担任华商瑞丰混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 22 日起至今担任华商可转债债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日起至今担任华商收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日至 2020 年 3 月 16 日担任华商双债丰利债券型证券投资基金的基

					金经理；2018 年 7 月 27 日至 2021 年 4 月 26 日担任华商双翼平衡混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 7 月 27 日至 2020 年 12 月 15 日担任华商回报 1 号混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 5 月 24 日至 2019 年 8 月 23 日担任华商瑞丰短债债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 9 月 29 日起至今担任华商转债精选债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》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

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

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了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

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

今年权益市场的走势波动较大，个股和板块之间的分化也更为明显。开年以来核心资产类的股票表现优异，带动上证指数快速走高，但是春节之后，市场风格突变，核心资产分化严重，中小市值，半导体，新能源等行业轮番表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华商可转债债券型 A 类份额净值为 1.4818 元，份额累计净值为 1.4818 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.57%，同期基金业绩比较基准的收益率为 3.69%，本类基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率 4.88 个百分点。

截至本报告期末华商可转债债券型 C 类份额净值为 1.4677 元，份额累计净值为 1.4677 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.37%，同期基金业绩比较基准的收益率为 3.69%，本类基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率 4.68 个百分点。

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 2021 年下半年，随着国内各种经济维稳政策的出台，流动性有望保持平稳，宏观经济有望稳定运行，我们预计结构性机会依然存在。

2021 年上半年可转债市场同样是一波三折，但是因为可转债市场的发行主体与权益市场的上市公司数量、结构有一定的差异，所以转债指数在年初出现了一波调整，但是之后随着 A 股整体风格的切换，转债指数表现较强。

展望下半年，转债市场走势会与 A 股走势类似，结构性机会依然会反复出现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人设立的估值小组，负责组织制定、定期审核及适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值小组成员包括总经理、督察长、分管基金运营部的高管、分管投研部门的高管、固定收益部负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人、风险控制部负责人或上述部门负责人指定人员，由总经理任估值小组负责人，由基金运营部负责人任估值小组秘书。估值小组关于调整投资品种估值方法的决策，需经 1/2 以上的小组成员同意。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。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。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格，当对估值原则及技术有异议时，本基金托管人有义务要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。会计师事务所在对基金年度财务报告出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述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债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易的债券品种的估值数据，以及流通受限股票的流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《华商可转债债券型证券投资基金基金合同》约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次。本基金本报告期末进行利润分配。

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

本报告期，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华商可转债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华商可转债债券型证券投资基金的管理人——华商基金管理有限公司在华商可转债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对华商基金管理有限公司编制和披露的华商可转债债券型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华商可转债债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	48,649,746.05	1,685,370.41
结算备付金		16,624,699.61	5,472,555.90
存出保证金		141,163.74	35,035.36
交易性金融资产	6.4.7.2	634,743,186.50	239,257,805.26
其中：股票投资		186,855,857.90	51,882,223.98
基金投资		-	-
债券投资		447,887,328.60	187,375,581.28
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,060,481.61

应收利息	6.4.7.5	1,182,409.71	742,585.98
应收股利		-	-
应收申购款		1,291,572.85	103,177.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		702,632,778.46	248,357,011.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		155,000,000.00	54,000,000.00
应付证券清算款		23,772,515.18	365,641.11
应付赎回款		16,543,147.69	13,429,389.85
应付管理人报酬		292,906.43	112,653.73
应付托管费		83,687.53	32,186.76
应付销售服务费		83,521.28	40,216.49
应付交易费用	6.4.7.7	883,451.03	270,576.42
应交税费		3,130.70	1,643.55
应付利息		-	-21,079.33
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	92,298.57	188,832.07
负债合计		196,754,658.41	68,420,060.65
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	342,780,540.08	132,503,848.62
未分配利润	6.4.7.10	163,097,579.97	47,433,102.52
所有者权益合计		505,878,120.05	179,936,951.14
负债和所有者权益总计		702,632,778.46	248,357,011.79

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，华商可转债 A 基金份额净值 1.4818 元，基金份额总额 196,910,041.85 份；华商可转债 C 基金份额净值 1.4677 元，基金份额总额 145,870,498.23 份。华商可转债债券份额总额合计为 342,780,540.08 份。

6.2 利润表

会计主体：华商可转换债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
-----	-----	--	---

一、收入		18,035,057.90	1,413,640.59
1.利息收入		1,245,267.00	627,501.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	106,605.19	65,085.44
债券利息收入		1,138,661.81	562,415.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,120,070.19	7,956,440.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,707,693.54	4,358,316.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,177,021.34	3,336,059.49
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,235,355.31	262,064.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,499,466.15	-7,240,905.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	170,254.56	70,603.99
减：二、费用		5,232,240.62	2,369,858.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,070,876.33	517,492.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	305,964.66	147,854.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	354,866.11	201,615.74
4. 交易费用	6.4.7.19	2,253,542.98	872,019.17
5. 利息支出		1,152,935.89	537,331.86
其中：卖出回购金融资产支出		1,152,935.89	537,331.86
6. 税金及附加		1,195.95	773.17
7. 其他费用	6.4.7.20	92,858.70	92,771.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,802,817.28	-956,218.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,802,817.28	-956,218.12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华商可转债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	132,503,848.62	47,433,102.52	179,936,951.14
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	12,802,817.28	12,802,817.28
三、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)	210,276,691.46	102,861,660.17	313,138,351.63
其中：1.基金申购款	455,183,323.35	215,050,044.73	670,233,368.08
2.基金赎回款	-244,906,631.89	-112,188,384.56	-357,095,016.45
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	342,780,540.08	163,097,579.97	505,878,120.05
项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	102,498,958.20	7,722,184.35	110,221,142.55
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-956,218.12	-956,218.12
三、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)	6,901,909.85	5,104,148.91	12,006,058.76
其中：1.基金申购款	162,293,238.64	19,988,430.99	182,281,669.63
2.基金赎回款	-155,391,328.79	-14,884,282.08	-170,275,610.87
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	109,400,868.05	11,870,115.14	121,270,983.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.3 财务报表由下列负责人签署：

<u>王小刚</u>	<u>程蕾</u>	<u>程蕾</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华商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[2017]1272 号《关于准予华商可转债债券型证券投资基金注册的批复》注册,由华商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《华商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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 214,010,539.22 元,业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(2017)第 1121 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华商可转债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 214,057,624.97 份基金份额,其中认购资金利息折合 47,085.75 份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华商可转债债券型证券投资基金基金合同》和《华商可转债债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费,不从本类基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;不收取认购/申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。A 类、C 类基金份额分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商可转债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为国内依法发行的金融工具,包括股票(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、国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券(含可分离交易的可转换债券)、可交换债券、中期票据、中小企业私募债、回购、同业存单和银行存款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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。基金的投资组合比

例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易的可转换债券）的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券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中证可转换债券指数收益率 $\times$ 80%+中证 800 指数收益率 $\times$ 10%+中证全债指数收益率 $\times$ 10%。

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》、各项具体会计准则及相关规定（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》、《华商可转债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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 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

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 2018 年 1 月 1 日起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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	48,649,746.05
定期存款	—
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	—
合计：	48,649,746.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	184,413,578.39	186,855,857.90	2,442,279.51
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	444,142,401.97	447,887,328.60
	银行间市场	—	—
	合计	444,142,401.97	447,887,328.60
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	628,555,980.36	634,743,186.50	6,187,206.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,730.88
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	7,481.10
应收债券利息	1,173,134.23
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	63.50
合计	1,182,409.71

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	883,451.03
银行间市场应付交易费用	—
合计	883,451.03

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,038.42
应付证券出借违约金	—
预提费用	89,260.15
合计	92,298.57

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华商可转债 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,361,350.18	45,361,350.18
本期申购	214,975,294.96	214,975,294.96
本期赎回(以“-”号填列)	-63,426,603.29	-63,426,603.29
— 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	196,910,041.85	196,910,041.85

金额单位：人民币元

华商可转债 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,142,498.44	87,142,498.44
本期申购	240,208,028.39	240,208,028.39
本期赎回(以“-”号填列)	-181,480,028.60	-181,480,028.60
— 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	145,870,498.23	145,870,498.23

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华商可转债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,995,900.68	10,551,326.32	16,547,227.00
本期利润	4,530,319.00	-711,513.63	3,818,805.37
本期基金份额交易产生的变动数	30,720,137.92	43,790,469.96	74,510,607.88
其中：基金申购款	42,713,001.37	60,464,044.35	103,177,045.72
基金赎回款	-11,992,863.45	-16,673,574.39	-28,666,437.84

本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,246,357.60	53,630,282.65	94,876,640.25

单位：人民币元

华商可转债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,655,008.04	20,230,867.48	30,885,875.52
本期利润	6,773,032.13	2,210,979.78	8,984,011.91
本期基金份额交易产生的变动数	11,174,644.37	17,176,407.92	28,351,052.29
其中：基金申购款	44,886,514.49	66,986,484.52	111,872,999.01
基金赎回款	-33,711,870.12	-49,810,076.60	-83,521,946.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,602,684.54	39,618,255.18	68,220,939.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,478.62
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	10,698.35
结算备付金利息收入	72,716.37
其他	711.85
合计	106,605.19

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	693,857,855.31
减：卖出股票成本总额	685,150,161.77
买卖股票差价收入	8,707,693.54

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,177,021.34
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	5,177,021.34

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	339,367,709.09
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	333,243,292.01
减：应收利息总额	947,395.74
买卖债券差价收入	5,177,021.34

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未发生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未发生衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,235,355.31
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	1,235,355.31

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,499,466.15
——股票投资	-1,499,876.72
——债券投资	2,999,342.87
——资产支持证券投资	-
——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	1,499,466.15

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	170,254.56
合计	170,254.56

注：1. 基金赎回费收入含转换费收入。

2. 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。

3. 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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,253,542.98
银行间市场交易费用	-

交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,253,542.98

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,598.55
其他	-
合计	92,858.70

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
华商基金管理有限公司（“华商基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华龙证券股份有限公司（“华龙证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间内均未有应支付关联方的佣金。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,070,876.33	517,492.57
其中：支付销售机构的客户维护费	226,707.36	101,402.00

注：支付基金管理人华商基金管理有限公司的基金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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.70% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	305,964.66	147,854.96

注：支付基金托管人中国工商银行的基金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：日基金托管费 = 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华商可转债 A	华商可转债 C	合计
华商基金	-	209,568.41	209,568.41
华龙证券	-	128.63	128.63
中国工商银行	-	11,532.58	11,532.58
合计	-	221,229.62	221,229.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华商可转债 A	华商可转债 C	合计
华商基金	-	125,901.32	125,901.32
华龙证券	-	29.79	29.79
中国工商银行	-	8,576.96	8,576.96
合计	-	134,508.07	134,508.07

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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。

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

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国工商银行	48,649,746.05	22,478.62	2,571,787.64	18,400.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券的买卖。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 155,000,000.00 元,于 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为债券型证券投资基金,属于证券投资基金中风险较低、收益稳定的品种。其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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,主要投资于固定收益类资产,尤其重点配置可转换债券,同时本基金将适当参与股票投资,在追求资产的长期稳定增值的同时争取超额收益。

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次:(1)第一层次风险控制:在董事会层面设立风险控制委员会,对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查,对各种风险预测报告进行审议,提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责,按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2)第二层次风险控制:第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制,具体为在风险管理小组、投资决策委员会、监察稽核部和风险控制部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理小组对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的研究、分析、评估,全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略,对基金的总体投资情况提出指导性意见,从而达到分散投资风险,提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部和风险控制部独立于公司各业务部门和各分支机构,对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3)第三层次风险控制:第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施,相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

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人中国工商银行，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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	26,703,763.70	299,970.00
合计	26,703,763.70	299,970.00

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	220,682,540.40	94,574,135.79
AAA 以下	200,501,024.50	82,630,390.99
未评级	-	9,871,084.50
合计	421,183,564.90	187,075,611.28

注：未评级债券为国债。

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。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 155,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部金融负债的合约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(所有者权益)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 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》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上述比例限制)。

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 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%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

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。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

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 2021 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	48,649,746.05	-	-	-	48,649,746.05
结算备付金	16,624,699.61	-	-	-	16,624,699.61
存出保证金	141,163.74	-	-	-	141,163.74
交易性金融资产	410,443,050.52	37,444,278.08	-	186,855,857.90	634,743,186.50
应收利息	-	-	-	1,182,409.71	1,182,409.71
应收申购款	800.00	-	-	1,290,772.85	1,291,572.85
资产总计	475,859,459.92	37,444,278.08	-	189,329,040.46	702,632,778.46

负债					
卖出回购金融资产款	155,000,000.00	-	-	-	155,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	23,772,515.18	23,772,515.18
应付赎回款	-	-	-	16,543,147.69	16,543,147.69
应付管理人报酬	-	-	-	292,906.43	292,906.43
应付托管费	-	-	-	83,687.53	83,687.53
应付销售服务费	-	-	-	83,521.28	83,521.28
应付交易费用	-	-	-	883,451.03	883,451.03
应交税费	-	-	-	3,130.70	3,130.70
其他负债	-	-	-	92,298.57	92,298.57
负债总计	155,000,000.00	-	-	41,754,658.41	196,754,658.41
利率敏感度缺口	320,859,459.92	37,444,278.08	-	147,574,382.05	505,878,120.05
上年度末 2020 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	1,685,370.41	-	-	-	1,685,370.41
结算备付金	5,472,555.90	-	-	-	5,472,555.90
存出保证金	35,035.36	-	-	-	35,035.36
交易性金融资产	10,431,318.40	127,711,098.98	49,233,163.90	51,882,223.98	239,257,805.26
应收证券清算款	-	-	-	1,060,481.61	1,060,481.61
应收利息	-	-	-	742,585.98	742,585.98
应收申购款	-	-	-	103,177.27	103,177.27
资产总计	17,624,280.07	127,711,098.98	49,233,163.90	53,788,468.84	248,357,011.79
负债					
卖出回购金融资产款	54,000,000.00	-	-	-	54,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	365,641.11	365,641.11
应付赎回款	-	-	-	13,429,389.85	13,429,389.85
应付管理人报酬	-	-	-	112,653.73	112,653.73
应付托管费	-	-	-	32,186.76	32,186.76
应付销售服务费	-	-	-	40,216.49	40,216.49
应付交易费用	-	-	-	270,576.42	270,576.42
应交税费	-	-	-	1,643.55	1,643.55
应付利息	-	-	-	-21,079.33	-21,079.33
其他负债	-	-	-	188,832.07	188,832.07
负债总计	54,000,000.00	-	-	14,420,060.65	68,420,060.65
利率敏感度缺口	-36,375,719.93	127,711,098.98	49,233,163.90	39,368,408.19	179,936,951.14

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	除市场利率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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率上升 25 个基点	-4,014,403.34	-1,748,409.71
	2. 市场利率下降 25 个基点	4,069,421.70	1,772,296.95

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。

本基金以债券资产投资为主，并重点关注宏观经济、微观市场主体及国家政策导向，动态调整债券资产在可转换债券与普通债券之间的配比，进行积极的债券配置。本基金同时适当进行股票投资，根据对市场研究结果，把握相对较确定性的投资机会，以在获得稳定回报的基础上，起到增强投资收益的目的。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易的可转换债券）的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券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。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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	186,855,857.90	36.94	51,882,223.98	28.83

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	186,855,857.90	36.94	51,882,223.98	28.83

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	16,416,085.39	7,243,739.26
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-16,416,085.39	-7,243,739.26

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具 (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 552,902,158.72 元，属于第二层次的余额为 81,841,027.78 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 218,796,505.88 元，第二层次 20,461,299.38 元，无第三层次)。

(ii) 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	186,855,857.90	26.59
	其中：股票	186,855,857.90	26.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	447,887,328.60	63.74
	其中：债券	447,887,328.60	63.74
	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	65,274,445.66	9.29
8	其他各项资产	2,615,146.30	0.37
9	合计	702,632,778.46	100.00

7.2 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	25,054,549.60	4.95
C	制造业	132,178,039.98	26.13
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	4,176,330.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	6,916,873.32	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,489,031.00	0.49
J	金融业	16,041,034.00	3.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	186,855,857.90	36.94

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000933	神火股份	1,335,400	12,619,530.00	2.49
2	000830	鲁西化工	529,776	9,922,704.48	1.96
3	601857	中国石油	1,720,700	9,102,503.00	1.80
4	002353	杰瑞股份	193,700	8,658,390.00	1.71
5	601788	光大证券	466,700	8,349,263.00	1.65
6	600782	新钢股份	1,467,700	8,189,766.00	1.62
7	601005	重庆钢铁	2,997,000	8,001,990.00	1.58
8	002539	云图控股	857,400	7,485,102.00	1.48
9	600104	上汽集团	330,800	7,267,676.00	1.44
10	300767	震安科技	86,000	7,142,300.00	1.41

11	600581	八一钢铁	1,129,800	6,982,164.00	1.38
12	000059	华锦股份	801,000	6,536,160.00	1.29
13	601899	紫金矿业	674,000	6,531,060.00	1.29
14	601872	招商轮船	1,199,886	5,543,473.32	1.10
15	000825	太钢不锈	726,300	5,439,987.00	1.08
16	600741	华域汽车	201,100	5,282,897.00	1.04
17	600346	恒力石化	200,000	5,248,000.00	1.04
18	000959	首钢股份	910,800	5,118,696.00	1.01
19	000683	远兴能源	1,085,000	5,066,950.00	1.00
20	600426	华鲁恒升	159,910	4,949,214.50	0.98
21	000001	平安银行	212,500	4,806,750.00	0.95
22	002192	融捷股份	65,460	4,494,483.60	0.89
23	002221	东华能源	381,400	4,176,330.00	0.83
24	002601	龙蟠佰利	95,300	3,295,474.00	0.65
25	300884	狄耐克	93,200	2,505,216.00	0.50
26	002624	完美世界	104,100	2,489,031.00	0.49
27	601168	西部矿业	201,400	2,402,702.00	0.47
28	300618	寒锐钴业	30,000	2,365,200.00	0.47
29	603619	中曼石油	235,200	2,297,904.00	0.45
30	603799	华友钴业	20,000	2,284,000.00	0.45
31	601601	中国太保	67,600	1,958,372.00	0.39
32	002648	卫星石化	43,400	1,700,846.00	0.34
33	002271	东方雨虹	28,000	1,548,960.00	0.31
34	603885	吉祥航空	90,000	1,373,400.00	0.27
35	600933	爱柯迪	102,800	1,340,512.00	0.26
36	600110	诺德股份	100,000	1,218,000.00	0.24
37	002110	三钢闽光	163,800	1,104,012.00	0.22
38	600036	招商银行	17,100	926,649.00	0.18
39	300258	精锻科技	66,800	893,116.00	0.18
40	002128	露天煤业	21,700	225,897.00	0.04
41	600486	扬农化工	100	11,177.00	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	000933	神火股份	20,409,396.00	11.34
2	601857	中国石油	19,433,792.00	10.80
3	002466	天齐锂业	19,030,777.00	10.58
4	601788	光大证券	18,607,334.88	10.34
5	600690	海尔智家	18,316,238.00	10.18
6	002460	赣锋锂业	16,024,773.72	8.91
7	000932	华菱钢铁	15,610,510.00	8.68
8	002532	天山铝业	15,153,704.00	8.42
9	000725	京东方 A	15,122,782.00	8.40
10	600030	中信证券	13,362,309.00	7.43
11	601628	中国人寿	12,825,373.00	7.13
12	600581	八一钢铁	12,710,168.92	7.06
13	600028	中国石化	12,274,944.00	6.82
14	002756	永兴材料	12,000,782.00	6.67
15	000683	远兴能源	11,700,874.97	6.50
16	002624	完美世界	11,473,565.12	6.38
17	600309	万华化学	11,010,529.32	6.12
18	600188	兖州煤业	10,847,369.00	6.03
19	601168	西部矿业	10,632,494.00	5.91
20	002353	杰瑞股份	10,537,413.00	5.86
21	000959	首钢股份	10,268,831.00	5.71
22	000157	中联重科	10,193,290.13	5.66
23	601005	重庆钢铁	10,152,380.00	5.64
24	603799	华友钴业	10,082,958.00	5.60
25	600031	三一重工	9,609,873.00	5.34
26	600426	华鲁恒升	9,606,779.56	5.34
27	601899	紫金矿业	9,435,678.00	5.24
28	000977	浪潮信息	9,325,748.28	5.18
29	300618	寒锐钴业	9,217,657.80	5.12
30	000830	鲁西化工	9,012,278.68	5.01
31	600760	中航沈飞	8,914,081.00	4.95
32	000603	盛达资源	8,278,469.00	4.60
33	600782	新钢股份	8,258,095.00	4.59
34	002092	中泰化学	8,230,527.00	4.57
35	600988	赤峰黄金	8,137,792.00	4.52
36	000001	平安银行	7,825,960.00	4.35

37	601808	中海油服	7,621,263.00	4.24
38	300059	东方财富	7,616,316.97	4.23
39	600096	云天化	7,603,650.00	4.23
40	601111	中国国航	7,571,094.00	4.21
41	000975	银泰黄金	7,489,491.00	4.16
42	601233	桐昆股份	7,450,383.86	4.14
43	002539	云图控股	7,408,119.41	4.12
44	002192	融捷股份	7,392,486.40	4.11
45	600346	恒力石化	7,359,185.51	4.09
46	600104	上汽集团	7,282,233.00	4.05
47	601699	潞安环能	7,251,429.70	4.03
48	002221	东华能源	7,212,620.00	4.01
49	600176	中国巨石	7,209,592.29	4.01
50	600809	山西汾酒	6,971,865.91	3.87
51	600216	浙江医药	6,831,266.00	3.80
52	601166	兴业银行	6,730,568.00	3.74
53	300767	震安科技	6,600,207.00	3.67
54	002110	三钢闽光	6,446,545.00	3.58
55	000877	天山股份	6,441,160.92	3.58
56	000059	华锦股份	6,251,121.00	3.47
57	601898	中煤能源	5,976,206.00	3.32
58	600111	北方稀土	5,716,026.00	3.18
59	600585	海螺水泥	5,684,707.00	3.16
60	601872	招商轮船	5,664,093.25	3.15
61	600596	新安股份	5,611,934.00	3.12
62	601601	中国太保	5,422,627.00	3.01
63	600746	江苏索普	5,349,165.00	2.97
64	600519	贵州茅台	5,348,775.00	2.97
65	600409	三友化工	5,339,616.00	2.97
66	603612	索通发展	5,274,457.18	2.93
67	002025	航天电器	5,259,109.86	2.92
68	600741	华域汽车	5,157,532.50	2.87
69	000825	太钢不锈	5,075,769.00	2.82
70	002156	通富微电	5,051,744.72	2.81
71	002064	华峰化学	4,723,190.00	2.62
72	601456	国联证券	4,524,710.00	2.51

73	601939	建设银行	4,466,938.00	2.48
74	000568	泸州老窖	4,262,859.00	2.37
75	603801	志邦家居	4,069,958.20	2.26
76	000983	山西焦煤	4,047,985.80	2.25
77	600707	彩虹股份	3,980,393.00	2.21
78	601318	中国平安	3,951,603.00	2.20
79	603619	中曼石油	3,885,748.00	2.16
80	000893	亚钾国际	3,719,589.00	2.07
81	600584	长电科技	3,608,312.00	2.01
82	000858	五粮液	3,598,822.00	2.00

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。

7.4.2 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	002466	天齐锂业	20,084,701.91	11.16
2	600690	海尔智家	19,876,465.82	11.05
3	000932	华菱钢铁	16,362,742.00	9.09
4	000725	京东方 A	16,324,335.00	9.07
5	002460	赣锋锂业	16,067,996.85	8.93
6	002532	天山铝业	14,575,415.00	8.10
7	600030	中信证券	13,417,482.09	7.46
8	601628	中国人寿	12,544,787.48	6.97
9	600309	万华化学	12,026,978.10	6.68
10	600188	兖州煤业	12,000,900.00	6.67
11	600028	中国石化	11,942,888.00	6.64
12	002756	永兴材料	11,806,993.00	6.56
13	000977	浪潮信息	11,729,885.20	6.52
14	601857	中国石油	11,156,053.00	6.20
15	601788	光大证券	11,009,674.04	6.12
16	600031	三一重工	10,676,578.00	5.93
17	000157	中联重科	9,544,999.10	5.30
18	002624	完美世界	9,397,476.36	5.22
19	600096	云天化	9,208,154.00	5.12
20	600760	中航沈飞	9,080,283.00	5.05

21	601699	潞安环能	8,595,112.00	4.78
22	002092	中泰化学	8,540,749.00	4.75
23	601808	中海油服	8,516,059.68	4.73
24	603799	华友钴业	8,447,816.00	4.69
25	600988	赤峰黄金	8,240,310.74	4.58
26	000933	神火股份	8,033,042.00	4.46
27	300618	寒锐钴业	7,980,330.00	4.44
28	601898	中煤能源	7,761,744.00	4.31
29	000603	盛达资源	7,747,115.00	4.31
30	600409	三友化工	7,574,459.05	4.21
31	300059	东方财富	7,535,544.40	4.19
32	601111	中国国航	7,458,357.00	4.14
33	600176	中国巨石	7,397,141.28	4.11
34	601168	西部矿业	7,057,302.00	3.92
35	600809	山西汾酒	6,984,795.00	3.88
36	601233	桐昆股份	6,881,367.30	3.82
37	600519	贵州茅台	6,874,404.00	3.82
38	600216	浙江医药	6,656,391.00	3.70
39	000877	天山股份	6,640,079.00	3.69
40	000975	银泰黄金	6,481,037.33	3.60
41	000683	远兴能源	6,403,330.00	3.56
42	601166	兴业银行	6,161,753.00	3.42
43	600746	江苏索普	5,779,969.40	3.21
44	600596	新安股份	5,746,600.00	3.19
45	600111	北方稀土	5,702,100.00	3.17
46	600585	海螺水泥	5,600,058.20	3.11
47	600581	八一钢铁	5,485,083.00	3.05
48	603801	志邦家居	5,412,278.00	3.01
49	600426	华鲁恒升	5,382,908.00	2.99
50	000001	平安银行	5,373,643.00	2.99
51	600346	恒力石化	5,227,266.00	2.91
52	002064	华峰化学	5,212,322.00	2.90
53	000807	云铝股份	5,173,063.00	2.87
54	002025	航天电器	5,106,278.00	2.84
55	603612	索通发展	5,047,232.95	2.81
56	002110	三钢闽光	4,889,470.48	2.72
57	002156	通富微电	4,852,201.00	2.70
58	600707	彩虹股份	4,832,105.00	2.69

59	000066	中国长城	4,815,458.00	2.68
60	000983	山西焦煤	4,692,169.00	2.61
61	000959	首钢股份	4,651,196.00	2.58
62	601939	建设银行	4,456,353.00	2.48
63	000568	泸州老窖	4,283,744.00	2.38
64	601456	国联证券	4,125,909.00	2.29
65	002493	荣盛石化	4,054,172.00	2.25
66	600966	博汇纸业	3,992,068.68	2.22
67	601318	中国平安	3,988,215.00	2.22
68	601899	紫金矿业	3,868,606.00	2.15
69	600392	盛和资源	3,671,033.40	2.04
70	002353	杰瑞股份	3,650,851.00	2.03
71	000893	亚钾国际	3,619,688.00	2.01
72	600584	长电科技	3,610,355.00	2.01

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。

7.4.3 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	821,623,672.41
卖出股票收入（成交）总额	693,857,855.31

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	26,703,763.70	5.28
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）	421,183,564.90	83.26
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	447,887,328.60	88.54

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	110053	苏银转债	371,840	45,126,502.40	8.92
2	110079	杭银转债	285,670	32,529,242.90	6.43
3	120003	19 华菱 EB	170,322	23,962,602.18	4.74
4	113009	广汽转债	202,260	22,202,080.20	4.39
5	113011	光大转债	179,970	20,800,932.60	4.11

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投资贵金属投资。

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。

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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

光大转债

2020 年 8 月 25 日，光大银行因为涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局罚款、警告、没收违法所得；2020 年 10 月 20 日，光大银行因涉嫌违反法律法规等原因被国家外汇管理局罚款；2020 年 11 月 6 日，银行间交易商协会针对“永煤债违约事件”开展自律调查，作为债务融资工具主承销商，在相关债务融资工具的簿记建档过程中未妥善保存工作底稿，未就簿记建档工作建立有效的内部监督制度，违反了银行间市场相关自律管理规则，被交易商协会谈话并责令整改；2020 年 11 月 19 日，作为永煤债券的承销商，光大银行存在涉嫌违法银行间债券市场自律管理规则的行

为，被交易商协会启动自律调查；2021 年 1 月 15 日，银行间交易商协会公布自律处分信息，一是光大银行未对永煤控股独立性开展进一步核查并在尽职调查报告中体现，未能充分保证尽职调查质量；二是永煤控股 DFI 项目尽职调查工作开展不规范。交易商协会对其予以诫勉谈话，并责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改；2021 年 2 月 3 号，光大银行因为违规经营，被银保监会责令改正。

苏银转债

2020 年 9 月和 12 月因个人贷款资金用途管控不严；以贷转存、虚增存贷款规模；发放贷款偿还银行承兑汇票垫款，企图掩盖不良资产等违法违规事实；理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理；个人理财资金对接项目资本金；理财业务未与自营业务相分离；理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求。江苏银行收到罚单，累计被罚金额 1323 万元。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	141,163.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,182,409.71
5	应收申购款	1,291,572.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,615,146.30

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	110053	苏银转债	45,126,502.40	8.92

2	113009	广汽转债	22,202,080.20	4.39
3	113011	光大转债	20,800,932.60	4.11
4	132017	19 新钢 EB	17,692,986.00	3.50
5	110043	无锡转债	14,300,218.80	2.83
6	127011	中鼎转 2	12,425,215.00	2.46
7	128048	张行转债	10,501,762.40	2.08
8	110067	华安转债	10,335,952.40	2.04
9	113508	新风转债	9,917,484.00	1.96
10	127005	长证转债	8,987,097.94	1.78
11	113025	明泰转债	7,322,890.10	1.45
12	110075	南航转债	6,586,904.00	1.30
13	128129	青农转债	6,267,125.28	1.24
14	113013	国君转债	6,266,595.50	1.24
15	113548	石英转债	5,009,400.00	0.99
16	110073	国投转债	4,743,548.40	0.94
17	127022	恒逸转债	4,552,196.00	0.90
18	110066	盛屯转债	4,523,334.00	0.89
19	113509	新泉转债	4,341,213.10	0.86
20	110072	广汇转债	3,943,472.70	0.78
21	128029	太阳转债	3,620,118.90	0.72
22	127018	本钢转债	3,502,800.00	0.69
23	113615	金诚转债	3,404,467.20	0.67
24	110045	海澜转债	3,270,759.00	0.65
25	113516	苏农转债	3,028,051.00	0.60
26	132014	18 中化 EB	3,007,623.30	0.59
27	128130	景兴转债	2,910,936.60	0.58
28	113040	星宇转债	2,623,728.40	0.52
29	113542	好客转债	2,589,156.00	0.51
30	132020	19 蓝星 EB	2,557,684.80	0.51
31	113044	大秦转债	2,465,723.60	0.49
32	128075	远东转债	2,395,237.36	0.47
33	127027	靖远转债	2,247,898.80	0.44
34	128081	海亮转债	2,223,030.50	0.44
35	113537	文灿转债	1,999,941.40	0.40
36	128116	瑞达转债	1,979,402.00	0.39
37	110047	山鹰转债	1,871,386.80	0.37
38	128109	楚江转债	1,707,230.00	0.34
39	123085	万顺转 2	1,681,538.90	0.33
40	110061	川投转债	1,638,684.90	0.32
41	128134	鸿路转债	1,582,551.60	0.31
42	123060	苏试转债	1,456,356.00	0.29

43	113591	胜达转债	1,438,109.20	0.28
44	128127	文科转债	1,437,260.30	0.28
45	128046	利尔转债	1,393,400.00	0.28
46	123078	飞凯转债	1,192,159.93	0.24
47	113550	常汽转债	1,192,006.80	0.24
48	113024	核建转债	1,190,701.40	0.24
49	110057	现代转债	1,182,949.80	0.23
50	113012	骆驼转债	1,166,406.00	0.23
51	113034	滨化转债	1,149,253.00	0.23
52	132021	19 中电 EB	1,098,127.80	0.22
53	113594	淳中转债	1,095,653.40	0.22
54	123046	天铁转债	1,095,442.08	0.22
55	113043	财通转债	1,066,900.00	0.21
56	127026	超声转债	1,051,309.90	0.21
57	123091	长海转债	962,485.60	0.19
58	127019	国城转债	890,242.40	0.18
59	128125	华阳转债	688,168.00	0.14
60	113600	新星转债	669,485.30	0.13
61	110034	九州转债	640,780.80	0.13
62	110041	蒙电转债	566,836.80	0.11
63	128064	司尔转债	532,397.40	0.11
64	110060	天路转债	529,978.20	0.10
65	110033	国贸转债	514,951.60	0.10
66	113572	三祥转债	509,007.00	0.10
67	128107	交科转债	500,461.60	0.10
68	123070	鹏辉转债	493,793.90	0.10
69	123033	金力转债	490,436.73	0.10
70	113598	法兰转债	482,268.30	0.10
71	113525	台华转债	467,587.20	0.09
72	128082	华锋转债	453,760.00	0.09
73	113596	城地转债	446,065.80	0.09
74	128050	钧达转债	404,589.00	0.08
75	128056	今飞转债	400,217.40	0.08
76	128063	未来转债	397,892.44	0.08
77	123028	清水转债	392,732.52	0.08
78	113570	百达转债	382,527.60	0.08
79	128123	国光转债	368,183.90	0.07
80	110070	凌钢转债	367,830.60	0.07
81	128018	时达转债	361,792.10	0.07
82	123089	九洲转 2	342,896.05	0.07
83	113528	长城转债	330,787.60	0.07

84	123053	宝通转债	311,224.50	0.06
85	128118	瀛通转债	298,625.60	0.06
86	113036	宁建转债	296,984.80	0.06
87	127024	盈峰转债	291,526.50	0.06
88	127013	创维转债	272,387.00	0.05
89	123076	强力转债	264,279.40	0.05
90	123049	维尔转债	256,059.64	0.05
91	113519	长久转债	253,076.20	0.05
92	110064	建工转债	231,992.00	0.05
93	127014	北方转债	229,536.72	0.05
94	123063	大禹转债	214,326.00	0.04
95	128057	博彦转债	209,372.00	0.04
96	113604	多伦转债	207,342.50	0.04
97	113567	君禾转债	204,896.00	0.04
98	110062	烽火转债	204,326.40	0.04
99	123075	贝斯转债	204,286.67	0.04
100	113599	嘉友转债	202,929.30	0.04
101	113536	三星转债	202,859.70	0.04
102	123088	威唐转债	202,334.23	0.04
103	128023	亚太转债	201,229.00	0.04
104	128021	兄弟转债	199,804.00	0.04
105	110058	永鼎转债	197,780.50	0.04
106	113569	科达转债	190,120.00	0.04
107	123007	道氏转债	187,340.79	0.04
108	128066	亚泰转债	182,014.60	0.04
109	113026	核能转债	179,741.00	0.04
110	113549	白电转债	176,971.20	0.03
111	128083	新北转债	158,807.04	0.03
112	128093	百川转债	154,629.00	0.03
113	113561	正裕转债	136,861.20	0.03
114	128101	联创转债	128,743.76	0.03
115	113033	利群转债	126,252.00	0.02
116	123023	迪森转债	125,666.50	0.02
117	113546	迪贝转债	115,478.00	0.02
118	113532	海环转债	106,212.00	0.02
119	128071	合兴转债	102,327.28	0.02
120	128040	华通转债	96,641.40	0.02
121	110038	济川转债	89,224.50	0.02
122	113524	奇精转债	76,000.30	0.02
123	113568	新春转债	71,744.40	0.01
124	123077	汉得转债	68,621.40	0.01

125	128049	华源转债	67,524.60	0.01
126	128051	光华转债	64,625.68	0.01
127	113505	杭电转债	43,789.20	0.01
128	123010	博世转债	25,283.23	0.00

7.11.5 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的情况。

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，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
华商可转债 A	10,330	19,061.96	113,941,156.61	57.86%	82,968,885.24	42.14%
华商可转债 C	6,801	21,448.39	75,742,635.17	51.92%	70,127,863.06	48.08%
合计	17,131	20,009.37	189,683,791.78	55.34%	153,096,748.30	44.66%

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	华商可转债 A	265.76	0.0001%
	华商可转债 C	124.67	0.0001%
	合计	390.43	0.0001%

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	华商可转债 A	0
	华商可转债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华商可转债 A	0
	华商可转债 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华商可转债 A	华商可转债 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 22 日）基金份额总额	116,361,616.66	97,696,008.31
本报告期期初基金份额总额	45,361,350.18	87,142,498.44
本报告期基金总申购份额	214,975,294.96	240,208,028.39
减：本报告期基金总赎回份额	63,426,603.29	181,480,028.60
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	196,910,041.85	145,870,498.23

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自 2017 年 12 月 22 日（基金合同生效日）起至今为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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	
东吴证券	2	1,228,103,330.82	81.04%	1,143,732.92	81.04%	-
海通证券	2	287,378,196.90	18.96%	267,635.17	18.96%	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

- ① 证券经营机构财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进。
- ② 证券经营机构具有较强的研究能力：有较强的研究分析能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务。
- ③ 证券经营机构能提供最优惠合理的佣金率：与其他证券经营机构相比，该证券经营机构能够提供最优惠、最合理的佣金率。

(2) 选择程序

- ① 基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券交易单元的证券经营机构；
- ② 基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券交易单元租用协议。

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		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
东吴证券	718,117,975.68	77.18%	8,531,790,000.00	81.55%	-	-
海通证券	212,287,328.37	22.82%	1,930,800,000.00	18.45%	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

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	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东莞农村商业银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证	2021 年 1 月 4 日

		券报、证券日报	
2	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 1 月 7 日
3	华商可转债债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 22 日
4	华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年第四季度报告提示性公告	证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 1 月 22 日
5	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 2 月 2 日
6	华商基金管理有限公司关于开展网上直销系统定投费率优惠的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 2 月 3 日
7	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 9 日
8	华商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	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 13 日
9	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 15 日
10	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 25 日
11	华商可转债债券型证券投资基金（华商可转债 A 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 25 日
12	华商可转债债券型证券投资基金（华商可转债 C 份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 25 日
13	华商可转债债券型证券投资基金招募说明书(更新)	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 25 日
14	华商可转债债券型证券投资基金基金合同	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 25 日
15	华商可转债债券型证券投资基金托管协议	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 25 日
16	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金	公司网站、中国证监会基	2021 年 3 月 30 日

	参加北京度小满基金销售有限公司费率优惠活动的公告	金电子披露网站	
17	华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 31 日
18	华商可转债债券型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 31 日
19	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加天风证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 4 月 16 日
20	华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第一季度报告提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 4 月 22 日
21	华商可转债债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 22 日
22	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加南京证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 4 月 28 日
23	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 6 月 24 日
24	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 6 月 30 日

§ 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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

1. 中国证监会批准华商可转债债券型证券投资基金设立的文件；
2. 《华商可转债债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《华商可转债债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《华商可转债债券型证券投资基金招募说明书》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 报告期内华商可转债债券型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010—58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

华商基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日