

华富可转债债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 华富可转债债券 |
| 基金主代码 | 005793 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 5 月 21 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 53,032,196.67 份 |
| 投资目标 | 本基金通过对可转债的积极投资，在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合流动性、估值水平、风险偏好等因素，综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略，将基金资产在股票、可转债、普通债券和现金等资产间进行配置并动态调整比例。 |
| 业绩比较基准 | 60%×中证可转换债券指数收益率+30%×上证国债指数收益率+10%×沪深 300 指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于低风险基金产品，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金及混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于可转换债券和可交换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。 |
| 基金管理人 | 华富基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -439,093.08 |
| 2. 本期利润 | -7,556,437.82 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1370 |
| 4. 期末基金资产净值 | 76,155,075.32 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4360 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

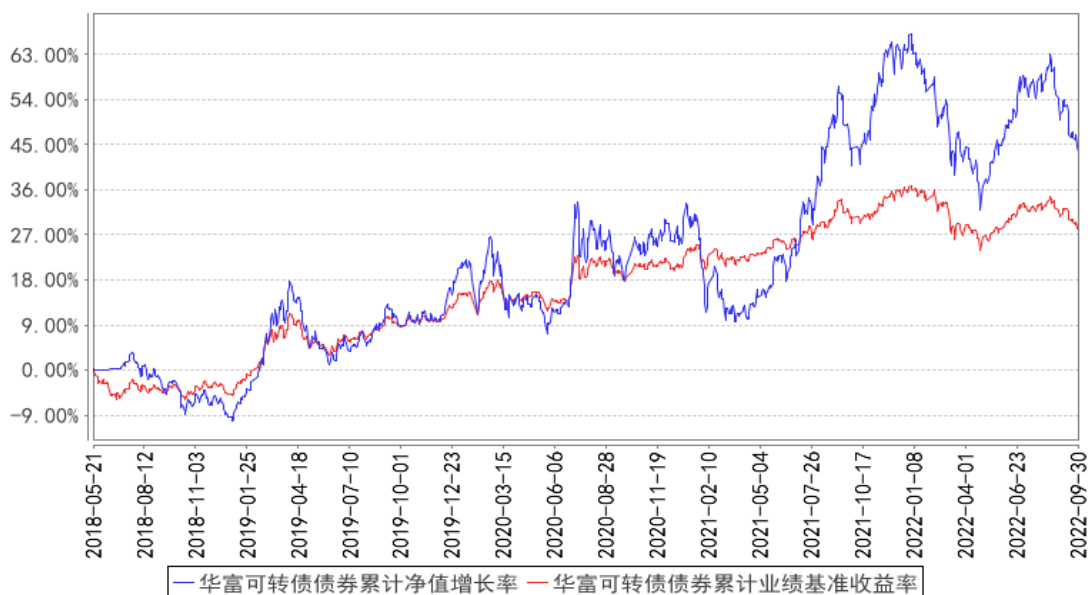
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -8.77% | 0.84% | -3.52% | 0.35% | -5.25% | 0.49% |
| 过去六个月 | 0.39% | 0.94% | 0.14% | 0.42% | 0.25% | 0.52% |
| 过去一年 | -0.42% | 1.05% | -1.72% | 0.48% | 1.30% | 0.57% |
| 过去三年 | 31.89% | 1.17% | 17.86% | 0.49% | 14.03% | 0.68% |
| 自基金合同 生效起至今 | 43.60% | 1.07% | 28.14% | 0.50% | 15.46% | 0.57% |

注：本基金业绩比较基准收益率=60%×中证可转换债券指数收益率+30%×上证国债指数收益率+10%×沪深 300 指数收益率。

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

华富可转债债券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：根据《华富可转债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易可转债）的比例合计不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2018 年 5 月 21 日到 2018 年 11 月 21 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富可转债债券型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--------------|-----------------|------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 戴弘毅 | 本基金的基金经理 | 2022 年 9 月 23 日 | - | 五年 | 中国社会科学院研究生院金融学硕士、硕士研究生学历。2017 年 7 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部行业研究员、固定收益部固收研究员、固定收益部基金经理助理。自 2022 年 9 月 23 日起任华富安鑫债券型证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 23 日任华富可转债债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。 |
| 尹培俊 | 本基金基金经理、公司总经 | 2018 年 8 月 28 日 | - | 十六年 | 兰州大学工商管理硕士，研究生学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团 |

| | | | | |
|--|---------------------------------------------------|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 理助理、 固定收益 部总监、 公司公募 投资决策 委员会委 员 | | | 部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012 年 7 月加入华富基金管理有限公司，曾任信用研究员、固定收益部总监助理、固定收益部副总监，自 2014 年 3 月 6 日起任华富强化回报债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 1 月 30 日起任华富安享债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 28 日起任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 28 日起任华富可转债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 28 日起任华富安华债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 26 日起任华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 8 日起任华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 6 日起任华富安业一年持有期债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。 |
|--|---------------------------------------------------|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《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，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全

部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

经济基本面方面，三季度国内疫情形势趋于严峻，叠加烂尾楼盘断贷风波，经济景气度整体处于偏低迷的状态。分结构来看，消费增速、地产投资增速分别受疫情管控、地产信用风险影响较大，二者的环比增速均低于历史同期水平。出口方面，三季度海外 PMI 加速下滑，受此影响，国内出口增速明显回落，对经济形成边际拖累。基建方面，受益于政策性金融工具投放及信贷政策宽松，基建资金较为充裕，基建投资增速持续位于双位数以上，是目前经济中最重要的拉动因素。

国内通胀方面，三季度通胀数据存在较大程度的分化。受猪肉价格回升影响，CPI 同比增速逐步攀升，表观通胀较强。但如剔除猪肉等因素，核心 CPI 同比增速并未超过 1.0%，反映经济偏弱背景下内需承压。PPI 方面，受全球衰退预期强化、国内景气度低迷影响，商品价格整体承压，对应 PPI 同比增速呈现明显的回落。

海外方面，一方面，俄乌局势仍旧严峻，全球能源紧张格局持续，欧美央行持续加息，美联储 9 月 FOMC 会议加息 75BP，美元与美债收益率持续上升，且由于美国就业市场好于预期、核心 CPI 由于薪资与收入粘性高居不下，年内持续加息预期持续升温；另一方面，能源紧张与各国央行流动性收缩已经导致欧美经济持续走弱，欧洲制造业 PMI 三季度下滑至荣枯线下方，美国 9 月 PMI 下滑至接近荣枯线，总体而言，海外滞胀环境较为严峻。

从国内资本市场的表现来看，三季度利率债市场小幅走强，而信用债在流动性宽裕、短端资金成本低的支撑下，整体表现更强。国内 A 股市场三季度各大指数持续向下调整，上证指数、沪深 300、创业板指分别下跌 11.01%、15.16%、18.56%。行业表现方面，能源主线表现相对较好，成长主线、消费主线有所回调。可转债方面，跟随权益市场调整，中证转债、可转债等权指数三季度分别下跌 3.82% 和 4.97%，其中 8 月中之后分别下跌 6.3% 和 10.4%，由于多数可转债对应正股为中小盘成长股，因此三季度先是延续上涨后快速补跌。

本基金三季度整体超配股票和转债资产，受到股票市场大跌的冲击，组合净值波动较大，整

体净值表现不及预期。

展望四季度基本面，经济或在偏弱的增速下企稳，上有消费、地产、出口制约，下有基建支撑。具体来说，消费端仍然受到消费场景缺失的约束，地产端也仍然受到地产信用风险的抑制，目前经济主要的堵点还需政策进一步的疏解。出口端，海外政策收紧的影响正逐步显现，预计四季度出口端可能对国内经济形成进一步的拖累。基建端，国常会新增 3000 亿政策性金融工具额度，要求依法用好 5000 多亿元专项债地方结存限额，预计四季度基建投资增速仍然可以维持在较高的水平。海外方面，地缘政治格局依然复杂，大国博弈持续存在，主要经济体仍处在货币收紧阶段，全球经济滞胀风险仍高。

在资产配置上，债券面临的问题是赔率仍偏低，和胜率受到基本面边际持续改善的挑战，信用债票息杠杆策略依然是流动性宽松背景下确定性更高的选择方向，长端利率债的机会可能来自于“跌出来的机会”。权益市场整体赔率较高，股票的性价比优于债券。外部看，四季度之前是流动性收紧斜率最高、滞胀预期强烈的阶段，地缘冲突近期再升级+中美脱钩预期悲观，内部看，盈利底基本出现，像是 4 月的多重利空共振的组合，但考虑到国内预期的明朗和美国中期选举后市场转向衰退交易的概率在提升，内部盈利底基本已经探明，因此 A 股向下空间有限，当前阶段更建议根据三季报“布局明年”。结构上仍考虑围绕能源安全、发展安全和疫后复苏等方向。转债方面整体估值仍偏贵，但相比于纯债而言替代价值仍在，下半年将在控制整体组合溢价率的情况下把握结构性机会，考虑围绕选股思路的正股替代与中低价位的纯债替代两个维度展开。

本基金股票投资会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念，分享优秀企业的成长和价值增长，转债投资将坚持在较低风险程度下，综合基本面驱动、策略轮动、行业主题挖掘、条款博弈等各方面机会，稳健地做好配置策略，均衡投资，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 1.4360 元，累计份额净值为 1.4360 元。报告期，本基金份额净值增长率为-8.77%，同期业绩比较基准收益率为-3.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 14,893,677.50 | 15.32 |
| | 其中：股票 | 14,893,677.50 | 15.32 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 78,731,209.65 | 81.00 |
| | 其中：债券 | 78,731,209.65 | 81.00 |
| | 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 | 2,755,280.85 | 2.83 |
| 8 | 其他资产 | 824,327.54 | 0.85 |
| 9 | 合计 | 97,204,495.54 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 817,800.00 | 1.07 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 11,654,989.50 | 15.30 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 835,088.00 | 1.10 |
| J | 金融业 | 1,585,800.00 | 2.08 |
| 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 | 14,893,677.50 | 19.56 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 300059 | 东方财富 | 90,000 | 1,585,800.00 | 2.08 |
| 2 | 300693 | 盛弘股份 | 38,000 | 1,438,680.00 | 1.89 |
| 3 | 601012 | 隆基绿能 | 28,200 | 1,351,062.00 | 1.77 |
| 4 | 300274 | 阳光电源 | 12,000 | 1,327,440.00 | 1.74 |
| 5 | 002126 | 银轮股份 | 100,000 | 1,233,000.00 | 1.62 |
| 6 | 300775 | 三角防务 | 31,000 | 1,113,830.00 | 1.46 |
| 7 | 600885 | 宏发股份 | 30,000 | 1,044,900.00 | 1.37 |
| 8 | 002475 | 立讯精密 | 33,000 | 970,200.00 | 1.27 |
| 9 | 002833 | 弘亚数控 | 70,000 | 900,200.00 | 1.18 |
| 10 | 300613 | 富瀚微 | 15,200 | 835,088.00 | 1.10 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 4,380,865.84 | 5.75 |
| 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） | 74,350,343.81 | 97.63 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 78,731,209.65 | 103.38 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 110053 | 苏银转债 | 43,500 | 5,500,281.82 | 7.22 |
| 2 | 110073 | 国投转债 | 45,000 | 4,693,533.29 | 6.16 |
| 3 | 123125 | 元力转债 | 33,000 | 4,068,782.47 | 5.34 |
| 4 | 113044 | 大秦转债 | 30,000 | 3,328,167.12 | 4.37 |
| 5 | 123107 | 温氏转债 | 25,000 | 3,280,095.89 | 4.31 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 6,490.27 |
| 2 | 应收证券清算款 | 483,972.99 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 333,864.28 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 824,327.54 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 110053 | 苏银转债 | 5,500,281.82 | 7.22 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 2 | 110073 | 国投转债 | 4,693,533.29 | 6.16 |
| 3 | 123125 | 元力转债 | 4,068,782.47 | 5.34 |
| 4 | 113044 | 大秦转债 | 3,328,167.12 | 4.37 |
| 5 | 123107 | 温氏转债 | 3,280,095.89 | 4.31 |
| 6 | 113588 | 润达转债 | 3,016,829.36 | 3.96 |
| 7 | 127020 | 中金转债 | 3,000,296.00 | 3.94 |
| 8 | 113043 | 财通转债 | 2,967,961.64 | 3.90 |
| 9 | 127043 | 川恒转债 | 2,958,906.58 | 3.89 |
| 10 | 113640 | 苏利转债 | 2,911,225.34 | 3.82 |
| 11 | 113045 | 环旭转债 | 2,906,562.33 | 3.82 |
| 12 | 113053 | 隆 22 转债 | 2,838,612.11 | 3.73 |
| 13 | 113057 | 中银转债 | 2,793,689.42 | 3.67 |
| 14 | 127035 | 濮耐转债 | 2,408,688.77 | 3.16 |
| 15 | 127031 | 洋丰转债 | 2,355,564.38 | 3.09 |
| 16 | 113052 | 兴业转债 | 2,269,340.76 | 2.98 |
| 17 | 111000 | 起帆转债 | 1,942,214.38 | 2.55 |
| 18 | 110081 | 闻泰转债 | 1,861,644.38 | 2.44 |
| 19 | 110079 | 杭银转债 | 1,846,246.03 | 2.42 |
| 20 | 127040 | 国泰转债 | 1,785,530.96 | 2.34 |
| 21 | 123109 | 昌红转债 | 1,762,120.36 | 2.31 |
| 22 | 128131 | 崇达转 2 | 1,761,321.64 | 2.31 |
| 23 | 123126 | 瑞丰转债 | 1,390,876.38 | 1.83 |
| 24 | 110082 | 宏发转债 | 1,377,746.96 | 1.81 |
| 25 | 123099 | 普利转债 | 1,332,452.71 | 1.75 |
| 26 | 128137 | 洁美转债 | 1,219,852.88 | 1.60 |
| 27 | 132018 | G 三峡 EB1 | 1,142,734.25 | 1.50 |
| 28 | 128142 | 新乳转债 | 1,102,045.21 | 1.45 |
| 29 | 110075 | 南航转债 | 1,079,181.81 | 1.42 |
| 30 | 123075 | 贝斯转债 | 911,983.34 | 1.20 |
| 31 | 123076 | 强力转债 | 739,868.93 | 0.97 |
| 32 | 123090 | 三诺转债 | 717,727.40 | 0.94 |
| 33 | 128135 | 洽洽转债 | 602,975.07 | 0.79 |
| 34 | 123063 | 大禹转债 | 475,283.84 | 0.62 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 52,996,616.18 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 22,522,587.88 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 22,487,007.39 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 53,032,196.67 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 4,794,820.85 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 4,794,820.85 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 9.04 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|------|------|------|------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | - | - | - | - | - | - | - |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

无

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、华富可转债债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富可转债债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富可转债债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富可转债债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2022 年 10 月 26 日