

银华可转债债券型证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 19 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 17 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 2023 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 银华可转债债券 |
| 基金主代码 | 005771 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 8 月 31 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,891,097,977.67 份 |
| 投资目标 | 本基金通过对可转换债券的积极投资，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 | 本基金将采用定量和定性相结合的分析方法，结合对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的定性分析，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极主动地对固定收益类资产、现金和权益类资产等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。 本基金投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易可转债）的比例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，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 |
| 业绩比较基准 | 中证可转换债券指数收益率*80%+中债综合财富（总值）指数收益率*15%+沪深 300 指数收益率*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为可转换债券主题的债券型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和普通债券型基金。 |
| 基金管理人 | 银华基金管理股份有限公司 |

基金托管人

中国工商银行股份有限公司

§ 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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -90,548,221.84 |
| 2. 本期利润 | -54,308,779.75 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0357 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,804,807,521.32 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4832 |

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

2、本报告中所列示的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：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

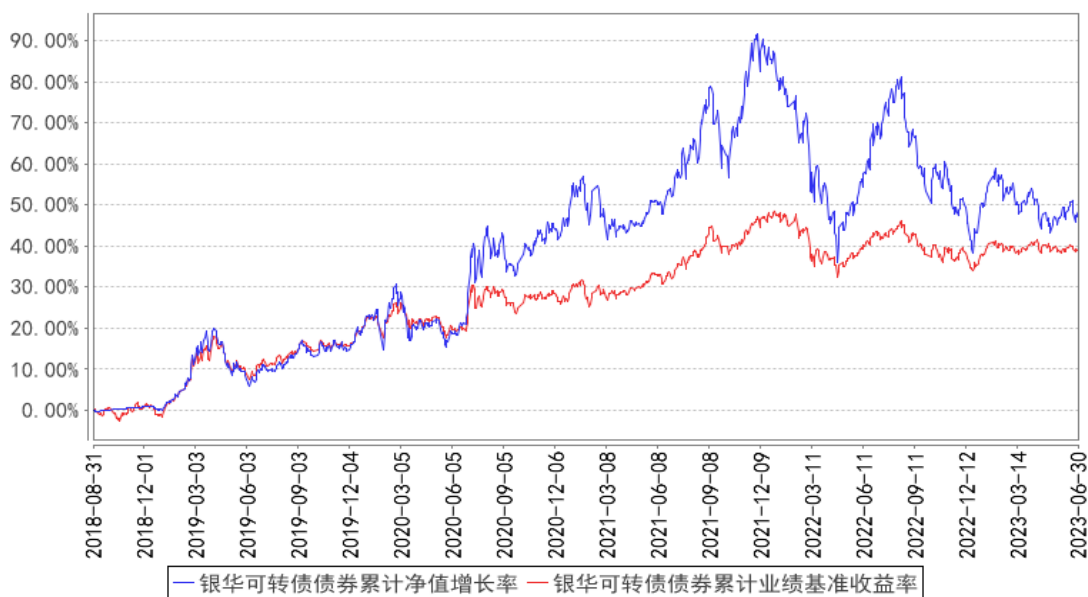
3.2 基金净值表现

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 | -2.20% | 0.81% | -0.12% | 0.35% | -2.08% | 0.46% |
| 过去六个月 | 3.65% | 0.82% | 3.08% | 0.35% | 0.57% | 0.47% |
| 过去一年 | -10.90% | 0.95% | -2.54% | 0.41% | -8.36% | 0.54% |
| 过去三年 | 20.88% | 1.16% | 16.17% | 0.53% | 4.71% | 0.63% |
| 自基金合同 生效起至今 | 48.32% | 1.03% | 39.38% | 0.55% | 8.94% | 0.48% |

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

银华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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易可转债）的比例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，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

§ 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 | | |
| 孙慧女士 | 本基金的基金经理 | 2018年8月31日 | - | 12.5年 | 硕士学位。2010年6月至2012年6月任职中邮人寿保险股份有限公司投资管理部，任投资经理助理；2012年7月至2015年2月任职于华夏人寿保险股份有限公司资产管理中心，任投资经理；2015年3月加盟银华基金管理有限公司，历任基金经理助理。自2016年2月6日至2017年8月7日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自2016年2月6日至2020年3月16日兼任银华保本增值证券投资基金基金经理，自2020年3月17日至2020年5月21日兼任银华增值证券投资基金基金经理，自2016年2月6日至2020年10月16日兼任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 2016 年 10 月 17 日至 2018 年 2 月 5 日兼任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自 2016 年 10 月 17 日至 2018 年 6 月 26 日兼任银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理,自 2016 年 12 月 22 日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理,自 2017 年 8 月 8 日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 7 月 30 日兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理,自 2018 年 8 月 31 日起兼任银华可转债债券型证券投资基金基金经理,自 2019 年 6 月 28 日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理,自 2021 年 2 月 8 日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。 |
|--|--|--|--|--|--|

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《银华可转债债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去一个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从 T 检验(置信度为 95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 3 次，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

操作回顾：

2023 年二季度，年初预设的“剧本”走出预期差，全球经济和市场开始进行更加复杂的演绎。一季度各类资产围绕着整体偏弱的基本面（但中美来看中国可能更强）和美联储趋松的政策预期进行了充分的定价。进入二季度，中美基本面和政策面跟预期比变化较大。大类资产表现来看，美元相对坚挺，人民币大幅贬值，美股表现优异，除了日本以外其他主要经济体股票表现较差。商品总体下跌。中国国内来看，债券是最好的资产，表现好于股票和转债。

二季度，股票市场总体偏弱，重要指数普跌，港股跌幅更大。行业上，仅通信、传媒、家电、公用事业、机械设备、国防军工、汽车等上涨，其余均下跌。即便在 AI 赛道中也出现分化，计算机、电子明显偏弱。经济链条全线走弱，跌幅较大。上半年来看，稳定和成长表现优异，消费最差。可以说，相比于一季度，二季度赚钱效应是比较差的。操作上，由于股债性价比仍处于底部区间，我们维持了仓位水平，但是在结构上更加均衡，注重逆向操作，争取不犯错误的前提下获取超额。

二季度，中证转债指数下跌 0.15%，上半年上涨 3.37%。跟股票相比，转债表现是比较强的，估值也维持高位。在二季度股票普遍下跌的情况下，转债估值如此坚挺，可能原因是：一是债券收益率持续下行，固收+有一定配置需求；二是股票市场尽管下跌，但总体处于底部区域，也就是说转债对应的平价处于相对底部，加上市场经过去年两次市场探底，有一定的学习效应，情绪上很难大幅恶化；三是风格上来看，今年中小盘股票非常强势，非常符合转债主体的特点，有一定的赚钱效应。

尽管对照历史来看，我们很难想象股票市场如此低位的情况下转债估值还这么高，但是短期似乎也很难找到导致估值大幅压缩的理由。因此从操作上来看，我们至少维持了中性的仓位水平，并在股票市场下跌探底的过程中，根据市场情况适度增加仓位。假如估值再次位于极值位，我们还是做出一定的动作以规避估值压缩的风险。如果市场配合再次出现类似于去年年底那样的配置区间，我们还将大幅提高转债仓位。同时将在组合特征管理上做的更加精细，在估值水位较高的情况下，我们更加关注那些性价较好的平衡型转债。

市场展望：

展望下半年，由于当前股债性价比依旧处于极值区间，大类资产配置上我们仍看好股票。当

然这是从赔率的角度。任何资产处于赔率极值位的时候都找不到太多胜率提高的因素。但是即便不考虑重大政策刺激，企业盈利当前也处于底部。下半年基准情形下，企业盈利仍然处于修复态势，但幅度不强，假如有较大的政策出台，会在一定程度上影响复苏的斜率。假如下半年是企业盈利弱复苏的格局，其实跟上半年的主线不会偏离太大，因为本质上还是缺乏增长，那么我们结构上主要关注以下：

一是，增长稳定或者估值安全的板块。主要包括公用事业、建筑、交运、石油石化等高股息稳定类资产。

二是，有产业趋势加持的行业。以 AI 为代表，主要包括算力、大模型、游戏等。另外是国际冲突下自主可控趋势明确，以半导体设备为代表。

三是，增长趋势明确、维持较高景气度的行业。目前来看主要包括电新中的风光、汽零、家电、纺服、保险等。但是这些行业内部也需要再进行一定程度的筛选，而且需要密切跟踪季度的边际变化。

四是，半导体周期。尽管时间上有所延后，目前也没有看到太多新的需求拉动点，但周期底部明确值得关注。

假如出台经济刺激政策，扭转了海内外对于中国经济增长的预期，那么顺周期经济链条行业，可能表现会相对较好，但是我们更想等待更明确的时点再加大配置。总体上，我们当前配置继续维持均衡，结合市场情况适度操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4832 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.20%，业绩比较基准收益率为-0.12%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人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 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 | 559,304,238.07 | 17.31 |
| | 其中：股票 | 559,304,238.07 | 17.31 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,583,004,610.76 | 79.95 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：债券 | 2,583,004,610.76 | 79.95 |
| | 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 | 30,350,582.74 | 0.94 |
| | 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 | 57,810,608.79 | 1.79 |
| 8 | 其他资产 | 332,913.32 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 3,230,802,953.68 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 33,234,236.28 | 1.18 |
| C | 制造业 | 338,057,308.26 | 12.05 |
| 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 | 18,788,987.85 | 0.67 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 89,651,396.00 | 3.20 |
| J | 金融业 | 48,782,121.68 | 1.74 |
| 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 | 19,156,500.00 | 0.68 |
| 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 | 11,633,688.00 | 0.41 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 559,304,238.07 | 19.94 |

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 | 600938 | 中国海油 | 1,834,119 | 33,234,236.28 | 1.18 |
| 2 | 000860 | 顺鑫农业 | 839,200 | 28,272,648.00 | 1.01 |
| 3 | 002371 | 北方华创 | 75,200 | 23,887,280.00 | 0.85 |
| 4 | 603019 | 中科曙光 | 460,699 | 23,449,579.10 | 0.84 |
| 5 | 600872 | 中炬高新 | 617,317 | 22,711,092.43 | 0.81 |
| 6 | 688111 | 金山办公 | 46,819 | 22,108,868.18 | 0.79 |
| 7 | 601628 | 中国人寿 | 617,608 | 21,591,575.68 | 0.77 |
| 8 | 600487 | 亨通光电 | 1,470,199 | 21,553,117.34 | 0.77 |
| 9 | 002531 | 天顺风能 | 1,370,700 | 20,875,761.00 | 0.74 |
| 10 | 002555 | 三七互娱 | 597,200 | 20,830,336.00 | 0.74 |

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 | 151,458,771.23 | 5.40 |
| 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） | 2,431,545,839.53 | 86.69 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,583,004,610.76 | 92.09 |

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 | 110062 | 烽火转债 | 871,890 | 108,780,221.20 | 3.88 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 529,100 | 66,516,422.57 | 2.37 |
| 3 | 019688 | 22 国债 23 | 634,000 | 64,109,611.01 | 2.29 |
| 4 | 019679 | 22 国债 14 | 626,000 | 63,725,479.40 | 2.27 |
| 5 | 118023 | 广大转债 | 504,760 | 63,105,911.11 | 2.25 |

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：本基金本报告期末未持有国债期货。

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本期不存在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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 326,694.38 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 6,218.94 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 332,913.32 |

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 | 110062 | 烽火转债 | 108,780,221.20 | 3.88 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 66,516,422.57 | 2.37 |
| 3 | 118023 | 广大转债 | 63,105,911.11 | 2.25 |
| 4 | 127012 | 招路转债 | 62,756,027.40 | 2.24 |
| 5 | 127074 | 麦米转 2 | 58,623,371.14 | 2.09 |
| 6 | 113563 | 柳药转债 | 55,728,062.46 | 1.99 |
| 7 | 111000 | 起帆转债 | 54,838,298.17 | 1.96 |
| 8 | 123158 | 宙邦转债 | 54,550,320.46 | 1.94 |
| 9 | 128140 | 润建转债 | 53,029,357.43 | 1.89 |
| 10 | 113024 | 核建转债 | 46,663,204.90 | 1.66 |
| 11 | 118027 | 宏图转债 | 44,869,341.88 | 1.60 |

| | | | | |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 12 | 123164 | 法本转债 | 43,224,869.70 | 1.54 |
| 13 | 113021 | 中信转债 | 43,110,428.99 | 1.54 |
| 14 | 113594 | 淳中转债 | 43,099,913.12 | 1.54 |
| 15 | 113639 | 华正转债 | 42,209,567.88 | 1.50 |
| 16 | 123071 | 天能转债 | 41,746,603.51 | 1.49 |
| 17 | 111010 | 立昂转债 | 41,437,151.10 | 1.48 |
| 18 | 127029 | 中钢转债 | 41,395,582.65 | 1.48 |
| 19 | 113061 | 拓普转债 | 41,318,786.46 | 1.47 |
| 20 | 113637 | 华翔转债 | 40,701,302.41 | 1.45 |
| 21 | 123131 | 奥飞转债 | 40,001,086.68 | 1.43 |
| 22 | 127038 | 国微转债 | 38,952,045.71 | 1.39 |
| 23 | 127058 | 科伦转债 | 38,624,376.22 | 1.38 |
| 24 | 127063 | 贵轮转债 | 37,654,002.59 | 1.34 |
| 25 | 113654 | 永 02 转债 | 37,533,044.10 | 1.34 |
| 26 | 113045 | 环旭转债 | 35,366,869.91 | 1.26 |
| 27 | 113602 | 景 20 转债 | 35,339,961.75 | 1.26 |
| 28 | 118012 | 微芯转债 | 34,402,459.16 | 1.23 |
| 29 | 128083 | 新北转债 | 32,900,860.56 | 1.17 |
| 30 | 118013 | 道通转债 | 32,246,806.94 | 1.15 |
| 31 | 123025 | 精测转债 | 31,995,144.80 | 1.14 |
| 32 | 110073 | 国投转债 | 31,765,902.79 | 1.13 |
| 33 | 128122 | 兴森转债 | 31,305,127.36 | 1.12 |
| 34 | 113615 | 金诚转债 | 31,134,315.90 | 1.11 |
| 35 | 113039 | 嘉泽转债 | 30,442,412.92 | 1.09 |
| 36 | 123142 | 申昊转债 | 29,889,552.49 | 1.07 |
| 37 | 113597 | 佳力转债 | 29,770,629.07 | 1.06 |
| 38 | 113527 | 维格转债 | 29,679,532.18 | 1.06 |
| 39 | 113017 | 吉视转债 | 29,622,365.44 | 1.06 |
| 40 | 128023 | 亚太转债 | 29,607,229.14 | 1.06 |
| 41 | 113582 | 火炬转债 | 28,453,797.20 | 1.01 |
| 42 | 110061 | 川投转债 | 28,358,730.22 | 1.01 |
| 43 | 118017 | 深科转债 | 28,136,527.88 | 1.00 |
| 44 | 128044 | 岭南转债 | 27,428,969.00 | 0.98 |
| 45 | 113643 | 风语转债 | 27,344,161.54 | 0.97 |
| 46 | 127032 | 苏行转债 | 27,166,636.69 | 0.97 |
| 47 | 111004 | 明新转债 | 27,165,792.26 | 0.97 |
| 48 | 113619 | 世运转债 | 27,149,454.91 | 0.97 |
| 49 | 123138 | 丝路转债 | 26,792,040.54 | 0.96 |
| 50 | 123048 | 应急转债 | 26,759,618.63 | 0.95 |
| 51 | 127066 | 科利转债 | 26,521,050.50 | 0.95 |
| 52 | 118003 | 华兴转债 | 26,160,368.71 | 0.93 |
| 53 | 123170 | 南电转债 | 25,939,620.14 | 0.92 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 54 | 128074 | 游族转债 | 25,749,461.56 | 0.92 |
| 55 | 113025 | 明泰转债 | 24,481,284.23 | 0.87 |
| 56 | 127007 | 湖广转债 | 22,105,235.29 | 0.79 |
| 57 | 123038 | 联得转债 | 22,035,912.59 | 0.79 |
| 58 | 128142 | 新乳转债 | 21,845,055.39 | 0.78 |
| 59 | 123050 | 聚飞转债 | 19,749,979.13 | 0.70 |
| 60 | 113648 | 巨星转债 | 19,273,506.34 | 0.69 |
| 61 | 123054 | 思特转债 | 17,798,695.22 | 0.63 |
| 62 | 127071 | 天箭转债 | 14,525,501.12 | 0.52 |
| 63 | 127072 | 博实转债 | 12,919,072.93 | 0.46 |
| 64 | 113662 | 豪能转债 | 9,898,655.05 | 0.35 |
| 65 | 110060 | 天路转债 | 7,039,836.58 | 0.25 |
| 66 | 123122 | 富瀚转债 | 4,560,197.81 | 0.16 |

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

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,561,105,773.79 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,007,900,414.34 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 677,908,210.46 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,891,097,977.67 |

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人于本报告期末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

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

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

- 9.1.1 银华可转债债券型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 9.1.2 《银华可转债债券型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《银华可转债债券型证券投资基金招募说明书》
- 9.1.4 《银华可转债债券型证券投资基金托管协议》
- 9.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2023 年 7 月 19 日