

上银可转债精选债券型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:上银基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 07 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07月18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2024年04月01日起至2024年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	上银可转债精选债券	
基金主代码	008897	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年05月08日	
报告期末基金份额总额	193,523,180.72份	
投资目标	本基金主要通过精选可转换债券进行积极投资，在控制风险的前提下，力争为投资人获取稳健回报。	
投资策略	本基金将结合国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，确定在不同时期基金在各类资产的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高投资组合的收益。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数×70%+中债综合指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券，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	上银基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	上银可转债精选债券 A	上银可转债精选债券 C
下属分级基金的交易代码	008897	015748

报告期末下属分级基金的份额总额	190,174,641.53 份	3,348,539.19 份
-----------------	------------------	----------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 04 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）	
	上银可转债精选债券 A	上银可转债精选债券 C
1. 本期已实现收益	-5,156,574.82	-115,386.39
2. 本期利润	-4,587,401.18	-180,641.17
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0358	-0.0561
4. 期末基金资产净值	135,225,535.20	2,368,826.00
5. 期末基金份额净值	0.7111	0.7074

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、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。

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

上银可转债精选债券 A 净值表现

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	-4.29%	0.92%	0.54%	0.37%	-4.83%	0.55%
过去六个月	-9.61%	1.07%	0.57%	0.40%	-10.18%	0.67%
过去一年	-10.29%	0.85%	-2.97%	0.37%	-7.32%	0.48%
过去三年	-29.80%	0.90%	-1.13%	0.45%	-28.67%	0.45%
自基金合同 生效起至今	-28.89%	0.78%	7.62%	0.48%	-36.51%	0.30%

上银可转债精选债券 C 净值表现

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	-4.38%	0.92%	0.54%	0.37%	-4.92%	0.55%
过去六个月	-9.75%	1.07%	0.57%	0.40%	-10.32%	0.67%
过去一年	-10.58%	0.85%	-2.97%	0.37%	-7.61%	0.48%
自基金合同	-20.59%	0.88%	-2.27%	0.39%	-18.32%	0.49%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为中证可转换债券指数×70%+中债综合指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×10%。

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

上银可转债精选债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年05月08日-2024年06月30日)



上银可转债精选债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年05月20日-2024年06月30日)



注：1、本基金合同生效日为 2020 年 5 月 8 日，自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时资产配置比例符合基金合同约定。

2、本基金自 2022 年 5 月 20 日起增加 C 类基金份额。

§ 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		
马小东	基金经理	2023-07-25	-	7 年	硕士研究生，历任上海博道投资管理有限公司、博道基金管理有限公司分析师；申万菱信基金管理有限公司研究员；上银基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理。2023 年 7 月担任上银可转债精选债券型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月担任上银慧鼎利债券型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月担任上银聚恒益一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2024 年 5 月担任上银慧祥利债券型证券投资基金基金经理，2024 年 5 月担任上银聚嘉益一年定期开放债券型发起式证券

					投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-----------

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的约定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》相关规定及公司内部的公平交易管理制度，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易的公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合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% 的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年二季度，社融、高频等数据较弱显示经济恢复不及预期，地产政策发布高峰结束，权益市场表现不佳，其中上证指数下跌 2.43%，沪深 300 下跌 2.1%，中证 500 下跌 6.5%，创业板下跌 7.4%，结构上大市值风格占优，稳定高股息及出海板块表现出明显的相对收益。转债二季度波动较大，整体先涨后跌，大小盘风格分化明显，尤其 6 月份在微盘股退市担忧及评级集中下调影响下，信用风险影响流动性，低价转债遭遇大跌。本基金二季度所持有转债较为分散，正股以成长弹性为主，在市场波动较大下净值也受到一定影响。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末上银可转债精选债券 A 基金份额净值为 0.7111 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.29%，同期业绩比较基准收益率为 0.54%；截至报告期末上银可转债精选债券 C 基金份额净值为 0.7074 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.38%，同期业绩比较基准收益率为 0.54%。

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,本基金未出现《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万需要在本报告中予以披露的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中: 股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	125,510,390.84	91.06
	其中: 债券	125,510,390.84	91.06
	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	8,269,522.30	6.00
8	其他资产	4,047,198.13	2.94
9	合计	137,827,111.27	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	2,031,262.14	1.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,432.66	0.01
	其中：政策性金融债	10,432.66	0.01
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）	123,467,635.63	89.73
8	同业存单	-	-
9	其他	1,060.41	0.00
10	合计	125,510,390.84	91.22

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	123217	富仕转债	15,090	1,785,222.66	1.30
2	113058	友发转债	16,170	1,778,923.72	1.29
3	123147	中辰转债	15,410	1,778,381.13	1.29
4	123076	强力转债	16,100	1,759,672.66	1.28
5	113628	晨丰转债	15,850	1,758,142.79	1.28

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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。

5.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,974.97
2	应收证券清算款	4,000,981.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	33,241.79
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,047,198.13

5.11.4 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	123217	富仕转债	1,785,222.66	1.30
2	113058	友发转债	1,778,923.72	1.29
3	123147	中辰转债	1,778,381.13	1.29
4	123076	强力转债	1,759,672.66	1.28
5	113628	晨丰转债	1,758,142.79	1.28
6	123202	祥源转债	1,754,126.20	1.27
7	127055	精装转债	1,750,670.30	1.27
8	123191	智尚转债	1,750,471.06	1.27
9	128081	海亮转债	1,749,114.07	1.27
10	123089	九洲转 2	1,747,931.96	1.27
11	111000	起帆转债	1,745,102.11	1.27
12	123208	孩王转债	1,743,708.52	1.27
13	113609	永安转债	1,743,609.00	1.27
14	128125	华阳转债	1,742,282.77	1.27
15	123225	翔丰转债	1,740,789.37	1.27
16	123183	海顺转债	1,740,403.24	1.26
17	111010	立昂转债	1,739,747.47	1.26
18	123100	朗科转债	1,738,753.77	1.26

19	110052	贵广转债	1,737,934.57	1.26
20	123121	帝尔转债	1,736,600.30	1.26
21	128063	未来转债	1,735,663.30	1.26
22	123067	斯莱转债	1,732,814.88	1.26
23	111015	东亚转债	1,732,338.62	1.26
24	123143	胜蓝转债	1,730,721.07	1.26
25	128066	亚泰转债	1,729,821.91	1.26
26	118042	奥维转债	1,729,292.34	1.26
27	111016	神通转债	1,728,563.02	1.26
28	123130	设研转债	1,727,431.38	1.26
29	123231	信测转债	1,723,267.76	1.25
30	123159	崧盛转债	1,721,951.52	1.25
31	128130	景兴转债	1,721,117.65	1.25
32	113565	宏辉转债	1,720,483.02	1.25
33	123235	亿田转债	1,720,024.85	1.25
34	127059	永东转 2	1,719,652.01	1.25
35	118024	冠宇转债	1,719,374.29	1.25
36	113679	芯能转债	1,718,689.25	1.25
37	113068	金铜转债	1,716,773.43	1.25
38	113639	华正转债	1,715,869.88	1.25
39	123154	火星转债	1,715,105.62	1.25
40	128134	鸿路转债	1,714,959.00	1.25
41	123063	大禹转债	1,713,246.77	1.25
42	123113	仙乐转债	1,712,700.00	1.24
43	123059	银信转债	1,711,906.16	1.24
44	113593	沪工转债	1,710,312.34	1.24
45	123165	回天转债	1,709,409.36	1.24
46	123168	惠云转债	1,708,892.15	1.24
47	113653	永 22 转债	1,708,477.70	1.24
48	123233	凯盛转债	1,708,286.42	1.24
49	127042	嘉美转债	1,707,786.80	1.24
50	123126	瑞丰转债	1,706,996.30	1.24
51	123218	宏昌转债	1,706,900.99	1.24
52	113662	豪能转债	1,704,775.28	1.24
53	127053	豪美转债	1,702,535.16	1.24
54	118043	福立转债	1,701,988.51	1.24
55	123203	明电转 02	1,700,389.81	1.24
56	118030	睿创转债	1,699,406.91	1.24
57	113627	太平转债	1,698,986.53	1.23
58	118025	奕瑞转债	1,698,546.37	1.23
59	111004	明新转债	1,698,096.09	1.23
60	113606	荣泰转债	1,692,503.09	1.23
61	113661	福 22 转债	1,692,113.06	1.23

62	118013	道通转债	1,691,336.49	1.23
63	123087	明电转债	1,691,180.56	1.23
64	113670	金 23 转债	1,691,019.39	1.23
65	113030	东风转债	1,688,824.34	1.23
66	113673	岱美转债	1,687,251.93	1.23
67	123204	金丹转债	1,686,988.63	1.23
68	123078	飞凯转债	1,680,738.23	1.22
69	123120	隆华转债	1,673,236.37	1.22
70	127075	百川转 2	1,258,673.24	0.91

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	上银可转债精选债券 A	上银可转债精选债券 C
报告期期初基金份额总额	122,506,183.31	2,474,026.40
报告期期间基金总申购份额	123,236,709.87	5,437,721.95
减：报告期期间基金总赎回份 额	55,568,251.65	4,563,209.16
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	190,174,641.53	3,348,539.19

注：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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	上银可转债精选债券 A	上银可转债精选债券 C
报告期期初管理人持有的本基 金份额	7,429,936.31	-
报告期期间买入/申购总份 额	-	-

报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	7,429,936.31	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	3.84	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内本基金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、中国证监会批准设立上银可转债精选债券型证券投资基金的文件
- 2、《上银可转债精选债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《上银可转债精选债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《上银可转债精选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、报告期内在中国证监会规定报刊上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人，客服电话：021-60231999，公司网址：
www.boscam.com.cn。

上银基金管理有限公司

二〇二四年七月十九日