

华富可转债债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 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：2024 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。

基金托管人中国建设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	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	38,464,796.67 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	$60\% \times \text{中证可转换债券指数收益率} + 30\% \times \text{上证国债指数收益率} + 10\% \times \text{沪深 300 指数收益率}$
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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	221,008.74
2. 本期利润	-618,038.17
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0156
4. 期末基金资产净值	45,752,104.33
5. 期末基金份额净值	1.1895

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

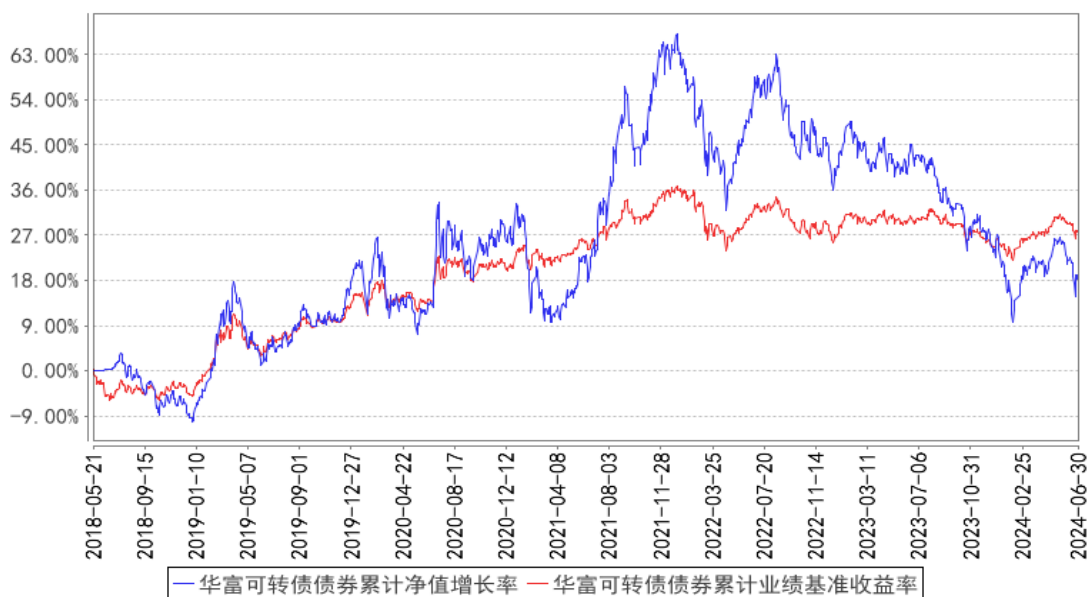
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.50%	0.80%	0.83%	0.32%	-2.33%	0.48%
过去六个月	-6.41%	0.89%	1.27%	0.35%	-7.68%	0.54%
过去一年	-16.74%	0.79%	-1.61%	0.32%	-15.13%	0.47%
过去三年	-5.73%	0.96%	1.56%	0.40%	-7.29%	0.56%
过去五年	13.56%	1.03%	20.60%	0.44%	-7.04%	0.59%
自基金合同 生效起至今	18.95%	1.00%	27.87%	0.46%	-8.92%	0.54%

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：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	本基金基金经理	2022 年 9 月 23 日	-	七年	中国社会科学院研究生院金融硕士、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 日起任华富可转债债券型证券投资基金基金经理，自 2023 年 9 月 12 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

国内方面，2024 年以来，宏观数据显示出中国经济企稳迹象明显，但市场对经济至今为止是否能算全面复苏，依然分歧很大，分歧的主要原因，一是在于国内独立于海外的低迷通胀环境，使得实际 GDP 在 2024 年一季度同比录得 5.3%、好于市场预期，但名义 GDP 增长相对不高，同比增速仅为 3.97%；二是企业效益分层显著，今年二季度以来，大型企业制造业 PMI 维持在 50 荣枯线以上，而中型企业 5、6 月的 PMI 分别为 49.4、49.8，小型企业则为 46.7、47.4，均为荣枯线下方；三是宏观经济仍处在结构转型中，主要增长引擎尚不明确，传统增长主要拉动力的房地产业及建筑业仍显疲软，尤其是房地产行业在各地政策放松的背景下尚未呈现明显的复苏，消费中的住宿与餐饮业增长也呈现增长不足态势，新的增长动力可能来源于工业和信息技术行业，但支撑起整体宏观经济的成长动能尚需一定时间。

海外方面，2024 年第二季度整体总结是“经济的微妙平衡、通胀的再度回落”。海外二季度的整体通胀没有延续一季度的反弹，在商品和住房通胀的带动下重回下降趋势。在此宏观背景下，降息预期多次起伏，10Y 美债收益率在 4.2%-4.7% 的区间内震荡，COMEX 黄金价格也在 2300-2450

美元/盎司的区间内震荡；由于欧洲方面的降息已开启，日本央行的加息一直不及预期，叠加地缘政治局势的变化，美元指数整体波动上行站稳 105，人民币汇率波动相对较大。

资产表现方面，权益方面，2024 年 4 月至 5 月中上旬市场延续了反弹行情，5 月下旬以来 A 股出现了一定的回撤，整体市场结构与宏观经济环境的分化存在一致性，大企业表现好于小企业，中证 100、沪深 300、中证 500、中证 1000、中证 2000 指数二季度分别录得-1.89%、-2.14%、-6.5%、-10.02%、-13.75%。可转债方面，二季度转债整体表现还是好于正股，一方面得益于转债的抗跌，且下修等条款对转债的平价有一定的抬升，另一方面，转债相较于股债更易受资金流动影响，5 月份资金的净流入驱动了转债行情。但转债市场表现分化显著，低价券在 6 月经历了更大的波动，核心原因是权益市场调整和转债市场的信用风险担忧和流动性问题。2024 年二季度债券市场表现较好，利率债方面，虽然 4、5 月因市场担心禁止手工补息的影响而出现震荡，但 6 月收益率趋势向下，10Y 国债从季初的 2.30% 一度降至 2.22% 的前低位置，30Y 国债收益率再度下破 2.5% 的市场心理点位，一度低至 2.41%（距离上一轮前低的 2.39% 仅一步之遥）。信用债方面，2024 年二季度整体表现强势，除 4 月末跟随利率有所调整外，收益率整体下行，且信用利差、期限利差和等级利差均继续收窄。

本基金在 2024 年一季度进行了投资策略转型，基于中长期资本市场复杂环境的预判以及过去 2 年对于组合风险管理等方面的反思和总结，本基金计划将投资重心回归可转债的“本源”，也就是进可攻、退可守的特性，坚持挖掘长期风险收益比更好的“低价格、低溢价率”或“低价格、高 YTM”的高性价比转债，而回避成长空间大但是缺乏下跌保护的高弹性资产的投资，坚持脚踏实地赚更高确定性的钱，转型回归为主投资于高性价比可转债的纯可转债基金。回顾 2024 年二季度，本基金在 4、5 月运作中保持相对稳定，虽然在 4 月出现一定波动，不过 6 月开始，随着权益市场调整和转债市场的信用风险担忧和流动性问题三大负向因素叠加影响下，低价可转债出现了较大跌幅，本基金坚持低价高 YTM、高性价比选券策略，这部分可转债则受本轮冲击影响较大，因此出现了明显回撤。本基金仍将坚持投资高性价比可转债，相信在相关影响逐渐出清后，高性价比的可转债能够回归理性估值。

展望 2024 年三季度，随着前期政策逐步落地，预计宏观数据或继续结构性修复。结构上，前期增发国债项目继续施工，三季度地方专项债加速发行进一步促开工，政府支出可能仍然是三季度宏观经济最重要的拉动因素之一。此外，地产“517”新政后，多地城市跟进，政策出台的节奏均快于市场预期。目前二手房销售已经出现企稳迹象，未来房地产市场有望按照“二手房销售→房价→新开工→新房销售→投资”的顺序逐步阶段性修复。另外，工业品价格初期回升后，有望引导部分企业利润走出阴霾。

海外宏观经济方面，预计通胀降温有一定进展，美债市场目前演绎 9 月降息预期明显升温，但叠加近期美国大选变数较多，市场对于资产定价的逻辑变化较大，“降息交易”、“美国贸易条件收紧推升通胀”、“地缘降温”、“美元长期走弱”、“中美贸易摩擦加剧”等多重逻辑交错，未来一段时间内全球风险资产预计呈现波动率放大的特征。

资产赔率角度，截至 2024 年 6 月末，A 股剔除金融、石油石化后的股权风险溢价（美债定价修正后）1.54%，处历史 93%分位，近 5 年 100%分位，近 3 年 99%分位。股债收益差（美债定价修正后）-0.36%，处历史 98%分位，近 5 年 100%分位，近 3 年 100%分位。PE25.06x，处历史 25%分位，近 5 年 2%分位，近 3 年 3%分位。PB1.91x，处历史 7%分位，近 5 年 1%分位，近 3 年 2%分位。股息率 2.08%，处历史 96%分位，近 5 年 100%分位，近 3 年 100%分位。恒生指数 PE 为 9.2 倍，处于近三年 28%分位与历史的 19%分位。可转债方面，在 6 月 24 日，转债跌破面值占比高达 19.9%，处于历史第三高点，而转债跌破债底的占比则高达 28.9%，处于历史最高的位置，显示出市场对于可转债信用风险的担忧，之后有所修复，但截止 6 月底，价格低于债底的可转债占比仍有 20%，处于历史 99%分位。信用债方面，绝对收益来看 1-5Y 各期限隐含 AAA-AA(2) 各级别的曲线收益率均在 2.55%以下，利差来看，1Y 中高等级信用利差略高，3Y 和 5Y 各期限和等级的信用利差主要在历史 5%分位以下，等级利差和期限利差也已压缩至历史低位，目前仅部分 5Y 中等偏弱信用债和 5Y 城农商永续债能带来一定骑乘收益和品种溢价。

股票方面，权益市场估值大概率处于中长期的底部区域，这是基本面、资金面和情绪面多重因素交织的结果。我们应充分认识到虽然当前是中长期的底部，但对于短期的风险因素我们还是要时刻保持警惕，当前市场面临的问题仍在：①海外资金的长期持有耐心，②国内审慎的金融防风险环境，③长期经济增长的信心与经济结构、企业景气的分化。但当前资产的估值的确处在低位，市场似乎过于纠结于宏观层面的长期悲观，却忽视了部分企业的长期竞争力。另外港股估值横向与纵向均处于低洼处，纵使港股市场面临众多中长期的压力，但仅从赔率角度看仍具较好的阶段性配置价值。此前监管层暂缓 IPO 和大股东减持，严格退市制度等，都有助于股票市场长期供需格局的稳定，另外，新“国九条”站在投资者立场，重点提出“加大退市监管、强化分红、改善盈利质量”等要求，这都是中长期利好 A 股的制度建设。

可转债方面，转债的信用违约率定价处于高位区间，低价券修复策略仍有可为：截止 6 月末跌破债底的转债占比超 20%，远高于信用债市场违约率，违约定价水平已达到历史的极值水平，低价券定价水平较不合理；随着资金逐渐平稳，评级披露风险释放较为充分，市场筹码在恢复和重构中，理性定价会逐步回归，此外，条款博弈的机会也陆续出现。高盈亏比转债有极大的挖掘空间，绩优、大盘、红利风格吸引力仍较强：近 73%的转债价格落在 120 元以内，其中不乏高质

成长、行业龙头、稳健低波或小盘价值类个券。另外，6 月份的市场冲击，使得机构资金对于可转债市场进行“一刀切”的分层，这将会对可转债市场未来的投资生态重构，在传统寻找股债平衡型可转债的投资策略之外，预计或将出现可转债的“高收益债”投资策略，也就是在风险可控的前提下，寻找高赔率品种。总的来看，转债绝对价格水平处于历史较便宜位置，在高安全性资产配置压力增加的环境下仍是难得的品种，拉长时间看该点位的胜率很大，风险是机构行为出清可能需要过程，这存在一定不确定性，但对估值波动尾部风险有信心应对。

本基金将持续把握可转债的本源特征，把握好可转债兼顾债底保护和转股期权的特征，认真选出风险收益比最优的可转债组合。本基金仍将坚持在较低风险程度下，认真研究各个投资领域潜在的机会，相对积极地做好配置策略，均衡投资，降低业绩波动，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 1.1895 元，累计基金份额净值为 1.1895 元。报告期，本基金份额净值增长率为-1.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2024 年 05 月 23 日起至本报告期末（2024 年 06 月 30 日），本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形，至本报告期期末（2024 年 06 月 30 日）基金资产净值仍低于 5000 万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

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	53,408,148.81	95.77
	其中：债券	53,408,148.81	95.77
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	1,068,458.01	1.92
8	其他资产	1,291,127.76	2.32
9	合计	55,767,734.58	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

注：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	2,536,595.48	5.54
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）	50,871,553.33	111.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	53,408,148.81	116.73

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	110059	浦发转债	31,500	3,473,674.15	7.59
2	113053	隆 22 转债	28,000	2,849,009.97	6.23
3	113049	长汽转债	24,000	2,683,363.73	5.87
4	019709	23 国债 16	20,000	2,031,230.14	4.44
5	110085	通 22 转债	12,000	1,269,204.16	2.77

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

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

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，杭州银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、兴业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	5,601.46
2	应收证券清算款	1,280,665.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	4,861.27
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,291,127.76

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	110059	浦发转债	3,473,674.15	7.59
2	113053	隆 22 转债	2,849,009.97	6.23
3	113049	长汽转债	2,683,363.73	5.87
4	110085	通 22 转债	1,269,204.16	2.77
5	118027	宏图转债	1,157,291.10	2.53
6	110079	杭银转债	1,147,288.71	2.51
7	113052	兴业转债	1,082,176.71	2.37
8	113048	晶科转债	850,561.64	1.86
9	113641	华友转债	811,736.11	1.77
10	118039	煜邦转债	767,602.30	1.68
11	111009	盛泰转债	763,669.04	1.67
12	113050	南银转债	752,472.49	1.64
13	118031	天 23 转债	742,809.86	1.62
14	110047	山鹰转债	710,847.95	1.55
15	123182	广联转债	698,344.11	1.53
16	123228	震裕转债	668,092.38	1.46
17	123200	海泰转债	655,056.82	1.43
18	118008	海优转债	652,912.22	1.43
19	128119	龙大转债	649,883.84	1.42
20	123202	祥源转债	645,294.74	1.41
21	113516	苏农转债	637,882.41	1.39
22	123168	惠云转债	635,275.89	1.39
23	123107	温氏转债	630,995.21	1.38
24	123120	隆华转债	611,738.78	1.34
25	123163	金沃转债	608,073.97	1.33
26	110093	神马转债	607,770.95	1.33
27	113647	禾丰转债	604,611.86	1.32
28	118023	广大转债	602,701.23	1.32
29	113044	大秦转债	601,325.48	1.31
30	113679	芯能转债	594,849.18	1.30
31	127086	恒邦转债	571,258.62	1.25
32	113640	苏利转债	545,076.75	1.19
33	111015	东亚转债	540,980.14	1.18
34	127050	麒麟转债	537,273.97	1.17
35	123219	宇瞳转债	504,892.16	1.10

36	113033	利群转债	498,129.17	1.09
37	123010	博世转债	485,336.10	1.06
38	123063	大禹转债	470,918.61	1.03
39	123076	强力转债	469,974.68	1.03
40	123078	飞凯转债	464,981.56	1.02
41	128130	景兴转债	463,709.64	1.01
42	127077	华宏转债	463,456.16	1.01
43	113609	永安转债	462,440.00	1.01
44	128105	长集转债	462,183.53	1.01
45	113629	泉峰转债	455,456.40	1.00
46	123144	裕兴转债	443,556.16	0.97
47	113649	丰山转债	441,714.45	0.97
48	128083	新北转债	415,854.05	0.91
49	128138	侨银转债	411,158.47	0.90
50	127075	百川转 2	407,997.81	0.89
51	123218	宏昌转债	404,752.95	0.88
52	127099	盛航转债	398,907.38	0.87
53	123205	大叶转债	386,708.96	0.85
54	113674	华设转债	385,730.55	0.84
55	118000	嘉元转债	372,683.29	0.81
56	127020	中金转债	361,345.07	0.79
57	123169	正海转债	356,739.49	0.78
58	118026	利元转债	356,145.89	0.78
59	113675	新 23 转债	347,799.12	0.76
60	123152	润禾转债	346,661.10	0.76
61	118028	会通转债	345,830.55	0.76
62	123160	泰福转债	324,010.36	0.71
63	123217	富仕转债	307,593.04	0.67
64	123191	智尚转债	303,479.73	0.66
65	123121	帝尔转债	283,758.22	0.62
66	123234	中能转债	281,056.22	0.61
67	123132	回盛转债	278,766.85	0.61
68	128049	华源转债	278,675.68	0.61
69	113606	荣泰转债	278,555.48	0.61
70	123115	捷捷转债	276,839.04	0.61
71	123126	瑞丰转债	275,499.73	0.60
72	118043	福立转债	275,402.67	0.60
73	123159	崧盛转债	271,258.90	0.59
74	123166	蒙泰转债	268,317.72	0.59
75	113639	华正转债	267,269.45	0.58
76	123193	海能转债	263,666.44	0.58
77	113648	巨星转债	260,393.70	0.57

78	123171	共同转债	245,756.85	0.54
79	110063	鹰 19 转债	243,380.14	0.53
80	128066	亚泰转债	240,708.93	0.53
81	123189	晓鸣转债	222,585.62	0.49
82	123100	朗科转债	218,573.70	0.48
83	127066	科利转债	218,184.66	0.48
84	123214	东宝转债	210,200.55	0.46
85	113627	太平转债	205,217.70	0.45
86	127068	顺博转债	204,368.49	0.45
87	123220	易瑞转债	199,251.71	0.44
88	123196	正元转 02	188,649.75	0.41
89	127074	麦米转 2	179,859.04	0.39
90	123225	翔丰转债	172,355.38	0.38
91	127040	国泰转债	170,253.16	0.37
92	123216	科顺转债	143,051.47	0.31
93	123204	金丹转债	116,504.74	0.25
94	123147	中辰转债	115,404.36	0.25

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	41,837,247.46
报告期期间基金总申购份额	670,749.28
减：报告期期间基金总赎回份额	4,043,200.07
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	38,464,796.67

§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	5,864,582.76
报告期期间买入/申购总份	0.00

额	
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	5,864,582.76
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	15.25

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

2024 年 7 月 19 日