

华宝可转债债券型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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 10 月 23 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 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝可转债债券
基金主代码	240018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 27 日
报告期末基金份额总额	939,171,826.45 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，主要通过可转债的投资，力争为基金份额持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	<p>本基金采用自上而下的宏观投资策略，通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，在固定收益类资产和权益类资产之间进行动态灵活配置。</p> <p>本基金将采用定性与定量相结合的方法来构建可转债投资组合，重点投资价值被市场低估、发债公司具有较好发展潜力、基础股票具有较高上升预期的个券品</p>

	种。 对于因可转债转股形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等资产，本基金应在其可交易（即不受锁定期等任何交易限制）之日起的三个月内卖出。该部分权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。	
业绩比较基准	标普中国可转债指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。本基金重点配置可转债（含分离交易可转债），在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
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	华宝可转债债券	华宝可转债债券 C
下属分级基金的交易代码	240018	008817
报告期末下属分级基金的份额总额	508,692,544.77 份	430,479,281.68 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	华宝可转债债券	华宝可转债债券 C
1. 本期已实现收益	-23,253,536.93	-14,654,395.25
2. 本期利润	-2,583,697.21	6,494,434.54
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0047	0.0187
4. 期末基金资产净值	736,608,446.07	616,076,286.45
5. 期末基金份额净值	1.4480	1.4311

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，本期利润等于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

华宝可转债债券

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	0.37%	0.82%	0.62%	0.47%	-0.25%	0.35%
过去六个月	1.03%	0.73%	1.60%	0.41%	-0.57%	0.32%
过去一年	-5.97%	0.74%	-0.81%	0.37%	-5.16%	0.37%
过去三年	-9.74%	0.81%	0.51%	0.37%	-10.25%	0.44%
过去五年	40.47%	0.84%	22.05%	0.41%	18.42%	0.43%
自基金合同 生效起至今	44.80%	1.13%	48.21%	0.74%	-3.41%	0.39%

华宝可转债债券 C

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	0.31%	0.82%	0.62%	0.47%	-0.31%	0.35%
过去六个月	0.91%	0.73%	1.60%	0.41%	-0.69%	0.32%
过去一年	-6.20%	0.74%	-0.81%	0.37%	-5.39%	0.37%
过去三年	-10.41%	0.81%	0.51%	0.37%	-10.92%	0.44%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	22.87%	0.85%	15.25%	0.41%	7.62%	0.44%

注：（1）基金业绩基准：标普中国可转债指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%；

（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2011 年 10 月 27 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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		

李栋梁	本基金基金经理、固定收益投资总监、混合资产部总经理、固定收益部总经理	2016-06-01	-	21 年	<p>硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的证券研究和投资管理工作。2010 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任债券分析师、基金经理助理、固定收益部副总经理、混合资产部副总经理等职务，现任固定收益投资总监、混合资产部总经理、固定收益部总经理。2011 年 6 月起任华宝宝康债券投资基金基金经理，2014 年 10 月至 2023 年 3 月任华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 10 月至 2017 年 12 月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2019 年 6 月任华宝宝鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月起任华宝可转债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月至 2017 年 12 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2021 年 3 月任华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 2 月起任华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017 年 6 月至 2019 年 3 月任华宝新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任华宝双债增强债券型证券投资基金基金经理，2022 年 5 月起任华宝安宜六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2022 年 11 月至 2024 年 9 月任华宝安悦一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2023 年 1 月起任华宝安融六个月持有期债券型证券投资基金基金经理，2023 年 8 月起任华宝安元债券型证券投资基金基金经理。</p>
-----	------------------------------------	------------	---	------	---

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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》及其各项实施细则、《华宝可转债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有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

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生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%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

我国经济的基本面及市场广阔、经济韧性强、潜力大等有利条件并未改变。同时，当前经济运行出现一些新的情况和问题。要全面客观冷静看待当前经济形势，正视困难、坚定信心，切实增强做好经济工作的责任感和紧迫感。要抓住重点、主动作为，有效落实存量政策，加力推出增量政策，进一步提高政策措施的针对性、有效性，努力完成全年经济社会发展目标任务。政

策方面，要加大财政货币政策逆周期调节力度，保证必要的财政支出，切实做好基层“三保”工作。要发行使用好超长期特别国债和地方政府专项债，更好发挥政府投资带动作用。要降低存款准备金率，实施有力度的降息。要促进房地产市场止跌回稳，对商品房建设要严控增量、优化存量、提高质量，加大“白名单”项目贷款投放力度，支持盘活存量闲置土地。要回应群众关切，调整住房限购政策，降低存量房贷利率，抓紧完善土地、财税、金融等政策，推动构建房地产发展新模式。

三季度大部分时间基金的仓位不高且提高了纯债型转债的投资比例，三季度末期基金提高了转债的投资比例并且小幅提高了组合的弹性，由于基金规模波动加大，三季度末期基金的弹性仍显不足。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 0.37%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 0.31%；同期业绩比较基准收益率为 0.62%。

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基金份额持有人低于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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,447,285,614.36	95.70
	其中：债券	1,447,285,614.36	95.70
	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	18,535,386.58	1.23
8	其他资产	46,548,069.35	3.08
9	合计	1,512,369,070.29	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

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投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	68,632,971.13	5.07
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）	1,378,652,643.23	101.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,447,285,614.36	106.99

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	019740	24 国债 09	681,000	68,632,971.13	5.07
2	113061	拓普转债	461,410	56,307,657.37	4.16
3	127086	恒邦转债	425,920	50,832,408.43	3.76
4	113044	大秦转债	350,000	41,565,319.18	3.07
5	123176	精测转 2	325,700	41,033,881.13	3.03

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

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

华宝可转债债券截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,杭州银行股份有限公司因信贷业务违规,存款业务违规,违规授信,信息披露及资料、文件等上报违规,内部管理与控制制度不健全或执行监督不力,编制或者提供虚假资料;于 2024 年 01 月 09 日收到国家金融监督管理总局浙江监管局罚款的处罚措施。

华宝可转债债券截止 2024 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中,杭州银行股份有限公司因违规向借款人收取委托贷款手续费;投资同业理财产品风险资产权重计量不审慎且向监管部门报送错误数据;部分 EAST 数据存在质量问题;于 2024 年 08 月 12 日收到国家金融监督管理总局浙江监管局罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为,认为上述处分不会对公司的投资

价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	76,382.45
2	应收证券清算款	45,093,818.29
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,377,868.61
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	46,548,069.35

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	113061	拓普转债	56,307,657.37	4.16
2	127086	恒邦转债	50,832,408.43	3.76
3	113044	大秦转债	41,565,319.18	3.07
4	123176	精测转 2	41,033,881.13	3.03
5	127100	神码转债	40,362,256.58	2.98
6	110079	杭银转债	36,482,761.64	2.70
7	123174	精锻转债	35,918,340.67	2.66
8	127020	中金转债	35,377,100.00	2.62
9	113050	南银转债	34,869,047.76	2.58
10	127032	苏行转债	34,703,673.69	2.57
11	113067	燃 23 转债	31,366,491.69	2.32
12	123114	三角转债	30,992,234.06	2.29
13	113055	成银转债	30,023,074.96	2.22
14	127104	姚记转债	28,117,271.00	2.08
15	118025	奕瑞转债	26,512,930.04	1.96
16	113062	常银转债	26,505,140.34	1.96
17	118004	博瑞转债	24,923,795.03	1.84
18	118024	冠宇转债	24,269,254.79	1.79
19	127072	博实转债	24,179,945.21	1.79
20	123101	拓斯转债	23,907,594.08	1.77

21	123194	百洋转债	23,652,486.52	1.75
22	113634	珀莱转债	22,837,963.01	1.69
23	123233	凯盛转债	21,085,787.02	1.56
24	127027	靖远转债	20,240,176.71	1.50
25	123179	立高转债	19,712,567.34	1.46
26	123108	乐普转 2	18,651,368.27	1.38
27	113667	春 23 转债	18,566,547.95	1.37
28	127091	科数转债	18,348,245.67	1.36
29	127064	杭氧转债	17,999,630.14	1.33
30	127085	韵达转债	17,115,386.07	1.27
31	123212	立中转债	16,484,275.91	1.22
32	123115	捷捷转债	16,307,260.04	1.21
33	113064	东材转债	16,274,938.36	1.20
34	111010	立昂转债	15,646,767.12	1.16
35	113638	台 21 转债	15,379,651.25	1.14
36	128137	洁美转债	14,964,068.49	1.11
37	113060	浙 22 转债	14,759,334.25	1.09
38	127038	国微转债	14,032,863.81	1.04
39	123169	正海转债	13,991,598.98	1.03
40	123210	信服转债	13,789,617.21	1.02
41	113660	寿 22 转债	12,753,435.29	0.94
42	113654	永 02 转债	12,490,454.79	0.92
43	123120	隆华转债	12,197,547.60	0.90
44	127052	西子转债	11,854,597.66	0.88
45	123104	卫宁转债	11,779,828.23	0.87
46	123076	强力转债	11,483,106.47	0.85
47	113051	节能转债	11,415,104.86	0.84
48	127066	科利转债	11,373,605.29	0.84
49	110076	华海转债	11,240,726.38	0.83
50	123211	阳谷转债	11,219,482.80	0.83
51	110077	洪城转债	11,151,739.73	0.82
52	123071	天能转债	10,990,986.30	0.81
53	113652	伟 22 转债	10,938,449.32	0.81
54	113588	润达转债	10,806,827.96	0.80
55	123188	水羊转债	9,832,003.36	0.73
56	127045	牧原转债	9,303,417.43	0.69
57	118038	金宏转债	9,223,463.01	0.68
58	132026	G 三峡 EB2	9,043,071.78	0.67
59	118022	锂科转债	9,001,713.70	0.67
60	113066	平煤转债	8,444,067.95	0.62
61	128121	宏川转债	8,405,854.86	0.62
62	113641	华友转债	8,330,240.00	0.62

63	123145	药石转债	8,032,513.32	0.59
64	123223	九典转 02	8,008,876.71	0.59
65	110081	闻泰转债	7,292,954.79	0.54
66	128109	楚江转债	7,240,768.77	0.54
67	123170	南电转债	7,165,980.03	0.53
68	113621	彤程转债	6,595,267.12	0.49
69	118005	天奈转债	6,349,127.11	0.47
70	113662	豪能转债	6,186,089.04	0.46
71	123035	利德转债	5,780,885.98	0.43
72	113682	益丰转债	5,526,936.99	0.41
73	110085	通 22 转债	5,411,493.90	0.40
74	113639	华正转债	5,263,547.01	0.39
75	123158	宙邦转债	4,676,038.36	0.35
76	128122	兴森转债	4,573,407.12	0.34
77	127101	豪鹏转债	4,261,778.45	0.32
78	113672	福蓉转债	4,219,189.62	0.31
79	127050	麒麟转债	3,625,984.60	0.27
80	118034	晶能转债	3,455,058.23	0.26
81	123186	志特转债	1,679,933.98	0.12
82	118000	嘉元转债	1,371,346.03	0.10
83	111009	盛泰转债	1,011,820.25	0.07
84	113056	重银转债	967,957.40	0.07
85	123161	强联转债	959,990.41	0.07
86	110082	宏发转债	379,315.01	0.03
87	127089	晶澳转债	267,287.26	0.02
88	113653	永 22 转债	166,035.84	0.01
89	123192	科思转债	25,224.73	0.00

5.10.5 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投资。

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，合计数可能不等于分项之和。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝可转债债券	华宝可转债债券 C
报告期期初基金份额总额	566,146,516.63	382,293,930.70
报告期期间基金总申购份额	11,454,559.27	147,863,451.20
减：报告期期间基金总赎回份额	68,908,531.13	99,678,100.22

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	508,692,544.77	430,479,281.68

§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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝可转债债券型证券投资基金基金合同；
 华宝可转债债券型证券投资基金招募说明书；
 华宝可转债债券型证券投资基金托管协议；
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2024 年 10 月 25 日