

# 华宝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 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 04 月 01 日起至 06 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	948,440,447.33 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，主要通过对可转债的投资，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种。</p>

	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	566,146,516.63 份	382,293,930.70 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 4 月 1 日-2024 年 6 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	-34,983,450.41	-25,282,950.05
2. 本期利润	3,595,221.81	5,300,109.50
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0066	0.0129
4. 期末基金资产净值	816,767,313.65	545,432,426.98
5. 期末基金份额净值	1.4427	1.4267

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	0.66%	0.63%	0.97%	0.33%	-0.31%	0.30%
过去六个月	-3.67%	0.75%	0.76%	0.34%	-4.43%	0.41%
过去一年	-9.40%	0.67%	-1.71%	0.30%	-7.69%	0.37%
过去三年	-3.14%	0.84%	5.02%	0.37%	-8.16%	0.47%
过去五年	48.08%	0.83%	24.79%	0.40%	23.29%	0.43%
自基金合同生效起至今	44.27%	1.13%	47.30%	0.74%	-3.03%	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	0.60%	0.63%	0.97%	0.33%	-0.37%	0.30%
过去六个月	-3.80%	0.75%	0.76%	0.34%	-4.56%	0.41%
过去一年	-9.63%	0.67%	-1.71%	0.30%	-7.92%	0.37%
过去三年	-3.86%	0.84%	5.02%	0.37%	-8.88%	0.47%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	22.50%	0.86%	14.54%	0.41%	7.96%	0.45%

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、	2016-06-01	-	21 年	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

	<p>固定收益投资总监、混合资产部总经理、固定收益部总经理</p>			<p>公司从事固定收益的证券研究和投资管理的工作。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 月起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

市场需求稳中有升。从消费看，受“五一”假日、消费品以旧换新政策显效、“618”提前开卖等因素影响，5 月份社会消费品零售总额同比增长 3.7%，比上月加快 1.4 个百分点；服务消费保持较快增长，前 5 个月服务零售额同比增长 7.9%。从投资看，1-5 月份固定资产投资同比增长 4.0%，其中制造业投资、高技术产业投资保持较快增长，分别增长 9.6%和 11.5%；在大规模设备更新政策作用下，设备工器具购置投资增长加快、拉动效应大，对全部投资增长的贡献率达到 52.8%。从外贸看，进出口增速加快，5 月份货物进出口总额同比增长 8.6%，比上月加快 0.6 个百

分点。前 5 个月，进出口累计规模创历史同期新高，其中劳动密集型产品、家用电器、集成电路、船舶等产品出口额均实现较快增长。

从市场来看，2 季度以来债券收益率震荡下行，其中 4 月份中上旬和 6 月份债券收益率连续下行，4 月份下旬和 5 月份债券市场以震荡为主。股票市场先上涨后调整，可转债和股票市场走势基本一致，先上涨后下跌，期间部分行业和主题表现较好。

基金降低了转债的投资比例，调整了行业的配置比例，并对少数品种进行了交易。

#### 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 0.66%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 0.60%；同期业绩比较基准收益率为 0.97%。

#### 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	1,352,575,566.45	94.34
	其中：债券	1,352,575,566.45	94.34
	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	80,756,497.04	5.63
8	其他资产	458,730.48	0.03
9	合计	1,433,790,793.97	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	74,173,379.45	5.45
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）	1,278,402,187.00	93.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,352,575,566.45	99.29

### 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	019709	23 国债 16	600,000	60,936,904.11	4.47
2	113061	拓普转债	378,000	44,868,071.84	3.29
3	127100	神码转债	335,136	38,834,301.77	2.85
4	113044	大秦转债	300,000	36,079,528.77	2.65
5	123114	三角转债	269,072	35,270,400.07	2.59

### 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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

### 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	101,502.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	357,228.23
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	458,730.48

### 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	44,868,071.84	3.29
2	127100	神码转债	38,834,301.77	2.85
3	113044	大秦转债	36,079,528.77	2.65
4	123114	三角转债	35,270,400.07	2.59

5	113052	兴业转债	32,465,301.37	2.38
6	127086	恒邦转债	32,124,604.57	2.36
7	127027	靖远转债	29,178,761.11	2.14
8	123035	利德转债	28,317,300.00	2.08
9	123174	精锻转债	27,798,607.03	2.04
10	127020	中金转债	27,703,121.92	2.03
11	123120	隆华转债	26,434,462.79	1.94
12	113634	珀莱转债	25,620,819.46	1.88
13	113067	燃 23 转债	24,597,085.09	1.81
14	123233	凯盛转债	24,387,631.31	1.79
15	110079	杭银转债	24,204,168.81	1.78
16	113045	环旭转债	23,337,300.40	1.71
17	118025	奕瑞转债	23,233,305.27	1.71
18	123176	精测转 2	21,655,681.29	1.59
19	113662	豪能转债	20,557,584.22	1.51
20	127074	麦米转 2	19,779,698.28	1.45
21	123179	立高转债	19,751,091.47	1.45
22	128137	洁美转债	19,401,227.60	1.42
23	113064	东材转债	19,225,365.71	1.41
24	113667	春 23 转债	18,876,924.66	1.39
25	123108	乐普转 2	18,819,204.06	1.38
26	123115	捷捷转债	18,177,140.70	1.33
27	127045	牧原转债	17,752,401.37	1.30
28	123212	立中转债	17,678,429.43	1.30
29	123101	拓斯转债	17,340,606.32	1.27
30	113654	永 02 转债	17,032,731.63	1.25
31	127032	苏行转债	16,630,634.42	1.22
32	113066	平煤转债	16,354,632.58	1.20
33	123194	百洋转债	15,579,750.82	1.14
34	127072	博实转债	15,095,658.15	1.11
35	127091	科数转债	14,260,119.96	1.05
36	110059	浦发转债	13,824,120.37	1.01
37	127038	国微转债	13,605,907.16	1.00
38	113672	福蓉转债	13,480,882.19	0.99
39	123059	银信转债	13,445,965.52	0.99
40	118004	博瑞转债	13,443,127.20	0.99
41	113582	火炬转债	13,304,808.22	0.98
42	113660	寿 22 转债	13,164,233.19	0.97
43	110048	福能转债	12,940,004.06	0.95
44	113588	润达转债	12,774,111.44	0.94
45	123131	奥飞转债	12,670,232.88	0.93
46	113631	皖天转债	12,658,904.11	0.93

47	123210	信服转债	12,613,239.16	0.93
48	113638	台 21 转债	12,368,373.36	0.91
49	118024	冠宇转债	12,061,936.99	0.89
50	113051	节能转债	11,772,707.19	0.86
51	123158	宙邦转债	11,371,465.75	0.83
52	127052	西子转债	11,366,633.88	0.83
53	113652	伟 22 转债	11,311,158.90	0.83
54	123133	佩蒂转债	11,299,863.01	0.83
55	127066	科利转债	11,229,091.58	0.82
56	123071	天能转债	11,119,723.29	0.82
57	111010	立昂转债	11,067,095.89	0.81
58	123211	阳谷转债	10,976,720.33	0.81
59	123169	正海转债	10,863,258.08	0.80
60	123104	卫宁转债	10,393,490.25	0.76
61	118013	道通转债	10,337,594.80	0.76
62	118038	金宏转债	8,922,358.36	0.65
63	128121	宏川转债	8,688,459.10	0.64
64	132026	G 三峡 EB2	7,896,851.10	0.58
65	113616	韦尔转债	7,858,775.34	0.58
66	118005	天奈转债	7,140,117.62	0.52
67	128109	楚江转债	6,649,591.23	0.49
68	127085	韵达转债	6,606,060.82	0.48
69	113678	中贝转债	6,439,185.54	0.47
70	123050	聚飞转债	6,274,369.86	0.46
71	113050	南银转债	6,270,604.11	0.46
72	127101	豪鹏转债	5,928,379.55	0.44
73	128136	立讯转债	5,709,952.06	0.42
74	113639	华正转债	5,345,389.04	0.39
75	113673	岱美转债	5,326,471.27	0.39
76	123188	水羊转债	5,077,965.17	0.37
77	127051	博杰转债	5,051,839.14	0.37
78	110094	众和转债	3,697,876.44	0.27
79	111000	起帆转债	3,446,547.95	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

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	543,903,632.11	428,839,371.91
报告期期间基金总申购份额	88,820,993.48	222,051,180.73
减:报告期期间基金总赎回份额	66,578,108.96	268,596,621.94
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	566,146,516.63	382,293,930.70

## §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

无

## §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 7 月 19 日