

华安可转换债券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：华安基金管理有限公司

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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安可转债债券	
基金主代码	040022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 22 日	
报告期末基金份额总额	2,934,452,580.25 份	
投资目标	本基金主要投资于兼具债券和股票特性的可转债(含分离交易可转债)品种，在控制风险和保持流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	1、资产配置策略 2、债券投资策略 3、股票投资策略 4、权证投资策略 5、其他衍生工具投资策略	
业绩比较基准	天相可转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
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	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
下属分级基金的交易代码	040022	040023
报告期末下属分级基金的份额总额	1,742,419,516.00 份	1,192,033,064.25 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）	
	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
1. 本期已实现收益	-1,971,577.61	-2,213,780.29
2. 本期利润	104,767,549.02	64,562,276.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0661	0.0588
4. 期末基金资产净值	3,183,965,159.80	2,072,508,734.18
5. 期末基金份额净值	1.827	1.739

注：1、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。

2、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。

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

华安可转债债券 A 类

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	3.69%	1.15%	2.34%	0.53%	1.35%	0.62%
过去六个月	6.10%	0.90%	3.19%	0.44%	2.91%	0.46%
过去一年	1.61%	0.79%	1.59%	0.40%	0.02%	0.39%
过去三年	8.62%	0.66%	1.27%	0.40%	7.35%	0.26%
过去五年	50.25%	0.75%	21.66%	0.42%	28.59%	0.33%
自基金合同 生效起至今	82.70%	1.15%	53.00%	0.71%	29.70%	0.44%

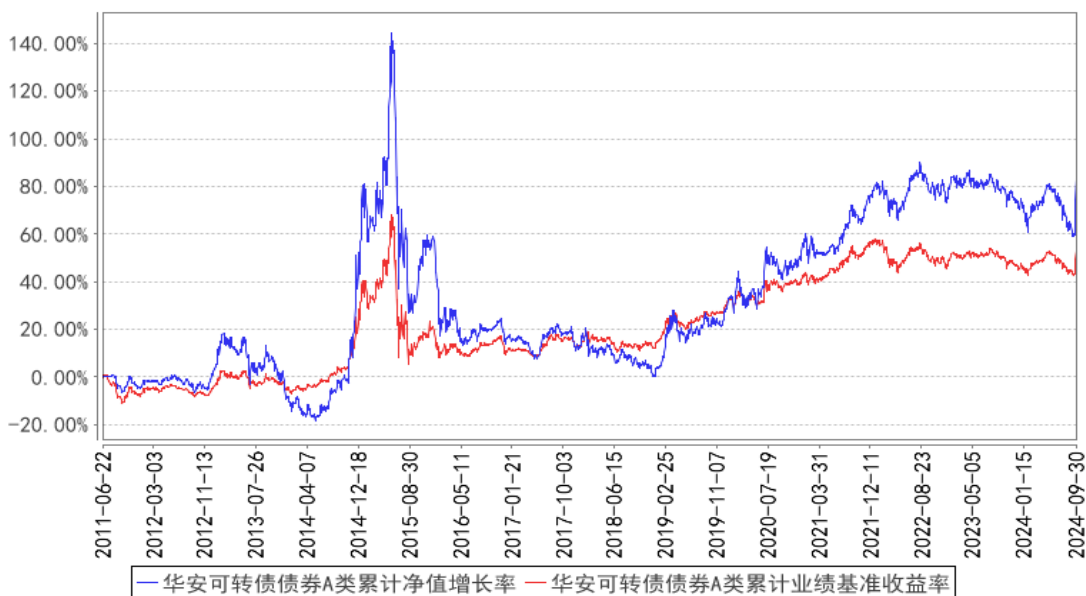
华安可转债债券 B 类

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
----	--------	---------------	----------------	-----------------------	-----	-----

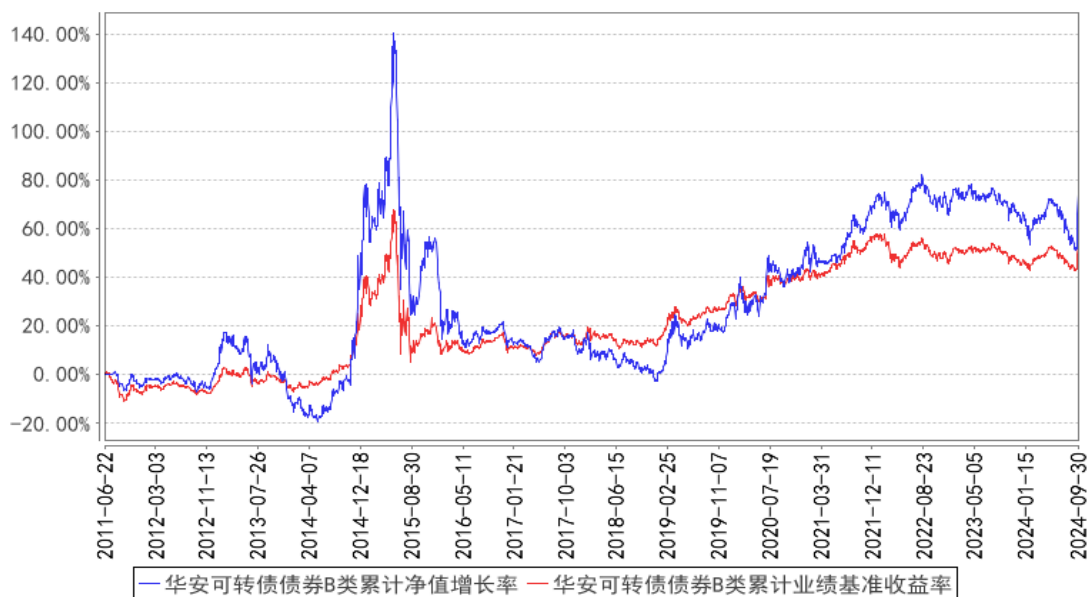
				准差④		
过去三个月	3.64%	1.16%	2.34%	0.53%	1.30%	0.63%
过去六个月	5.97%	0.91%	3.19%	0.44%	2.78%	0.47%
过去一年	1.28%	0.80%	1.59%	0.40%	-0.31%	0.40%
过去三年	7.54%	0.66%	1.27%	0.40%	6.27%	0.26%
过去五年	47.62%	0.75%	21.66%	0.42%	25.96%	0.33%
自基金合同生效起至今	73.90%	1.15%	53.00%	0.71%	20.90%	0.44%

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

华安可转债债券A类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



华安可转债债券B类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



§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		
周益鸣	本基金的基金经理	2021年3月8日	-	16年	硕士，16年金融、基金行业从业经验。曾任太平资产管理有限公司交易员。2010年6月加入华安基金，历任集中交易部交易员。2018年6月至2023年5月，担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019年3月至2020年10月，同时担任华安安盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019年7月至2021年3月，同时担任华安安业债券型证券投资基金的基金经理。2019年11月至2021年3月，同时担任华安安和债券型证券投资基金的基金经理。2019年12月起，同时担任华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年4月至2021年5月，同时担任华安安敦债券型证券投资基金的基金经理。2020年6月起，同时担任华安添瑞6个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021年1月至2024年8月，同时担任华安添福18个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021年2月起，同时

					担任华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添和一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月至 2024 年 8 月，同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安安心收益债券型证券投资基金、华安添禧一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
卢维捷	本基金的基金经理	2023 年 11 月 10 日	-	13 年	硕士研究生，13 年基金行业从业经验。曾任中国建设银行客户经理，2011 年 8 月加入华安基金，历任投资研究部研究员，固定收益部基金经理助理。2023 年 11 月起，担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，

公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。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

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》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

国内宏观经济在三季度虽然出现了短期的压力，但 9 月一系列的会议和新的举措大幅提振了市场的信心。债券市场在三季度以震荡为主，收益率先下后上，期间虽然监管对于利率的持续下行有过多风险提示，但最终直到 9 月政治局会议提出推动房地产市场止跌企稳，债券市场利率出现较为明显的上行。可转债市场在三季度先下后上，一度经历了个别转债正股退市风险而造成的恐慌，部分转债大幅跌破面值，但最终在季末股票市场大幅反弹阶段出现了明显的修复。

股票市场在三季度末出现了非常强劲的反弹，成交金额持续扩大，风险偏好快速上升，部分资金逐步从理财和债券等固定收益类资产撤离投入了权益类市场。强势板块由此前相对偏防守的红利板块切换至了券商、创业和科创板。

本基金在三季度依然采取以中低转股溢价率标的为主要的投资方向，阶段性提高了可转债的仓位，积极参与转债市场下跌带来的潜在机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 9 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.827 元，B 类份额净值为 1.739 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 3.69%，同期业绩比较基准增长率为 2.34%，B 类份额净值增长率为 3.64%，同期业绩比较基准增长率为 2.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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	946,424,950.76	15.55
	其中：股票	946,424,950.76	15.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,290,054,464.31	70.50
	其中：债券	4,290,054,464.31	70.50
	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	656,156,732.08	10.78
8	其他资产	192,659,939.51	3.17
9	合计	6,085,296,086.66	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	16,259,236.00	0.31
B	采矿业	-	-
C	制造业	677,239,215.71	12.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,530,000.00	0.09

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,434,726.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	41,160,400.00	0.78
H	住宿和餐饮业	4,440,000.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,903,747.19	1.33
J	金融业	60,727,480.30	1.16
K	房地产业	21,724,337.00	0.41
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,378,436.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	1,617,656.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,183,606.56	0.19
R	文化、体育和娱乐业	3,826,110.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	946,424,950.76	18.00

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	601998	中信银行	2,600,000	18,226,000.00	0.35
2	600989	宝丰能源	1,000,000	17,350,000.00	0.33
3	600276	恒瑞医药	300,000	15,690,000.00	0.30
4	600309	万华化学	167,700	15,314,364.00	0.29
5	601878	浙商证券	962,500	13,869,625.00	0.26
6	001979	招商蛇口	1,100,000	13,475,000.00	0.26
7	300979	华利集团	180,000	13,303,800.00	0.25
8	603195	公牛集团	145,505	12,114,746.30	0.23
9	603228	景旺电子	400,000	11,540,000.00	0.22
10	600406	国电南瑞	410,520	11,359,088.40	0.22

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	277,309,036.00	5.28
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）	4,012,745,428.31	76.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,290,054,464.31	81.61

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	113060	浙 22 转债	1,670,000	246,480,881.92	4.69
2	113062	常银转债	1,845,370	217,928,135.95	4.15
3	127032	苏行转债	1,735,400	217,385,713.04	4.14
4	110079	杭银转债	1,725,410	209,825,739.23	3.99
5	113055	成银转债	1,605,190	206,933,486.63	3.94

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投资。

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投资。

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

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，中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚；杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在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

本基金投资的前十名股票中，不存在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	244,023.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	192,415,916.21
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	192,659,939.51

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	113060	浙 22 转债	246,480,881.92	4.69
2	113062	常银转债	217,928,135.95	4.15
3	127032	苏行转债	217,385,713.04	4.14
4	110079	杭银转债	209,825,739.23	3.99
5	113055	成银转债	206,933,486.63	3.94
6	113050	南银转债	189,174,546.13	3.60
7	127027	能化转债	132,407,664.25	2.52
8	123107	温氏转债	104,626,303.72	1.99
9	110093	神马转债	92,839,606.11	1.77
10	123170	南电转债	87,282,289.52	1.66
11	113669	景 23 转债	85,481,391.78	1.63
12	127086	恒邦转债	75,547,685.87	1.44
13	123184	天阳转债	74,023,908.36	1.41

14	128133	奇正转债	64,088,252.24	1.22
15	127043	川恒转债	62,040,703.66	1.18
16	127020	中金转债	59,774,612.04	1.14
17	123035	利德转债	54,337,798.29	1.03
18	110094	众和转债	53,891,870.04	1.03
19	128141	旺能转债	49,505,667.01	0.94
20	128109	楚江转债	48,271,791.78	0.92
21	111010	立昂转债	46,856,851.94	0.89
22	127045	牧原转债	43,963,881.46	0.84
23	123228	震裕转债	43,049,354.91	0.82
24	123219	宇瞳转债	42,924,423.63	0.82
25	127054	双箭转债	42,116,030.29	0.80
26	113676	荣 23 转债	41,757,755.09	0.79
27	123204	金丹转债	39,905,631.67	0.76
28	113637	华翔转债	37,494,082.19	0.71
29	113619	世运转债	37,181,317.81	0.71
30	113067	燃 23 转债	35,245,980.27	0.67
31	113549	白电转债	34,998,922.83	0.67
32	123158	宙邦转债	34,831,809.71	0.66
33	127069	小熊转债	32,958,684.93	0.63
34	113651	松霖转债	32,752,200.00	0.62
35	123226	中富转债	32,735,724.66	0.62
36	123169	正海转债	32,167,060.28	0.61
37	123203	明电转 02	31,724,657.54	0.60
38	113631	皖天转债	28,270,006.03	0.54
39	123225	翔丰转债	26,867,298.08	0.51
40	123146	中环转 2	26,801,383.56	0.51
41	123191	智尚转债	26,129,960.55	0.50
42	127071	天箭转债	25,945,165.75	0.49
43	113056	重银转债	25,921,899.10	0.49
44	111018	华康转债	25,535,230.14	0.49
45	118028	会通转债	24,802,582.84	0.47
46	123240	楚天转债	23,817,151.78	0.45
47	123182	广联转债	22,278,301.37	0.42
48	123211	阳谷转债	21,508,442.47	0.41
49	113632	鹤 21 转债	21,281,421.03	0.40
50	123229	艾录转债	21,196,370.39	0.40
51	111016	神通转债	19,362,530.96	0.37
52	127091	科数转债	19,261,465.75	0.37
53	127105	龙星转债	18,449,294.79	0.35
54	127049	希望转 2	18,216,700.27	0.35
55	123149	通裕转债	17,796,352.17	0.34

56	123201	纽泰转债	17,098,714.37	0.33
57	127070	大中转债	16,454,712.93	0.31
58	123202	祥源转债	16,322,039.05	0.31
59	123208	孩王转债	16,152,168.55	0.31
60	110067	华安转债	16,138,618.33	0.31
61	127101	豪鹏转债	15,791,979.18	0.30
62	127073	天赐转债	15,612,604.11	0.30
63	111015	东亚转债	15,384,177.80	0.29
64	123087	明电转债	15,276,410.96	0.29
65	113644	艾迪转债	15,222,171.35	0.29
66	111000	起帆转债	15,078,361.64	0.29
67	118011	银微转债	13,844,191.73	0.26
68	113051	节能转债	13,764,592.36	0.26
69	127078	优彩转债	12,546,076.47	0.24
70	127095	广泰转债	11,923,429.32	0.23
71	123076	强力转债	11,637,890.41	0.22
72	110084	贵燃转债	11,555,931.51	0.22
73	113563	柳药转债	11,396,786.30	0.22
74	113655	欧 22 转债	11,342,772.95	0.22
75	118041	星球转债	11,285,745.05	0.21
76	127088	赫达转债	11,074,623.85	0.21
77	123234	中能转债	10,464,198.90	0.20
78	118031	天 23 转债	10,424,123.79	0.20
79	123233	凯盛转债	10,126,978.54	0.19
80	128121	宏川转债	9,453,326.41	0.18
81	127030	盛虹转债	9,230,806.85	0.18
82	123150	九强转债	8,927,283.33	0.17
83	123212	立中转债	8,821,567.16	0.17
84	123178	花园转债	8,591,732.88	0.16
85	113664	大元转债	8,456,316.44	0.16
86	123236	家联转债	7,847,283.84	0.15
87	113663	新化转债	7,654,586.30	0.15
88	118037	上声转债	7,282,520.55	0.14
89	128134	鸿路转债	7,086,395.80	0.13
90	123064	万孚转债	6,928,093.50	0.13
91	123120	隆华转债	6,869,328.32	0.13
92	123121	帝尔转债	6,749,843.84	0.13
93	118008	海优转债	6,463,627.40	0.12
94	113643	风语转债	6,309,386.30	0.12
95	127039	北港转债	6,050,108.09	0.12
96	111002	特纸转债	5,961,047.95	0.11
97	111007	永和转债	5,903,452.06	0.11

98	113658	密卫转债	5,836,770.48	0.11
99	123224	宇邦转债	5,790,230.58	0.11
100	123131	奥飞转债	5,566,293.93	0.11
101	113623	凤 21 转债	5,555,322.21	0.11
102	127050	麒麟转债	5,514,805.48	0.10
103	123168	惠云转债	5,349,908.07	0.10
104	123119	康泰转 2	5,051,306.50	0.10
105	113069	博 23 转债	4,944,243.29	0.09
106	118042	奥维转债	4,865,690.48	0.09
107	128081	海亮转债	4,475,951.78	0.09
108	127074	麦米转 2	3,894,693.24	0.07
109	118004	博瑞转债	3,661,853.42	0.07
110	123221	力诺转债	3,637,760.93	0.07
111	128118	瀛通转债	2,696,967.12	0.05
112	127052	西子转债	2,659,054.49	0.05
113	118025	奕瑞转债	2,254,596.71	0.04
114	111011	冠盛转债	2,163,855.27	0.04
115	110074	精达转债	1,554,396.44	0.03

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
报告期期初 基金 份额总额	1,566,880,235.50	1,293,499,564.34
报告期期间基金总申购份额	659,863,094.58	513,418,346.79
减：报告期期间基金总赎回份额	484,323,814.08	614,884,846.88
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	1,742,419,516.00	1,192,033,064.25

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安可转换债券债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安可转换债券债券型证券投资基金托管协议》

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站

<http://www.huaan.com.cn>。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2024 年 10 月 25 日