

华安可转换债券债券型证券投资基金
2022 年第 3 季度报告
2022 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：二〇二二年十月二十五日

§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 2022 年 10 月 21 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 2022 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	369,541,026.79 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	本基金主要投资于可转债品种，一方面通过利用可转债的债券特性，强调收益的安全性与稳定性，另一方面利用可转债的股票特性（内含股票期权），分享股市上涨所产生的较高收益。
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	173,722,663.52 份	195,818,363.27 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 (2022 年 7 月 1 日-2022 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	2,732,946.52	2,692,381.07
2.本期利润	-11,219,269.36	-12,823,561.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0892	-0.0909
4.期末基金资产净值	309,295,621.43	334,046,386.60
5.期末基金份额净值	1.780	1.706

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（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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 本报告期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

1、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	-2.94%	0.49%	-3.20%	0.34%	0.26%	0.15%
过去六个月	3.37%	0.57%	0.42%	0.40%	2.95%	0.17%
过去一年	5.83%	0.62%	-1.50%	0.46%	7.33%	0.16%
过去三年	46.38%	0.79%	18.34%	0.45%	28.04%	0.34%
过去五年	50.59%	0.80%	28.79%	0.44%	21.80%	0.36%
自基金合同 生效起至今	78.00%	1.22%	48.82%	0.76%	29.18%	0.46%

2、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
过去三个月	-3.01%	0.49%	-3.20%	0.34%	0.19%	0.15%
过去六个月	3.21%	0.57%	0.42%	0.40%	2.79%	0.17%
过去一年	5.50%	0.62%	-1.50%	0.46%	7.00%	0.16%
过去三年	44.82%	0.79%	18.34%	0.45%	26.48%	0.34%
过去五年	47.96%	0.80%	28.79%	0.44%	19.17%	0.36%
自基金合同 生效起至今	70.60%	1.22%	48.82%	0.76%	21.78%	0.46%

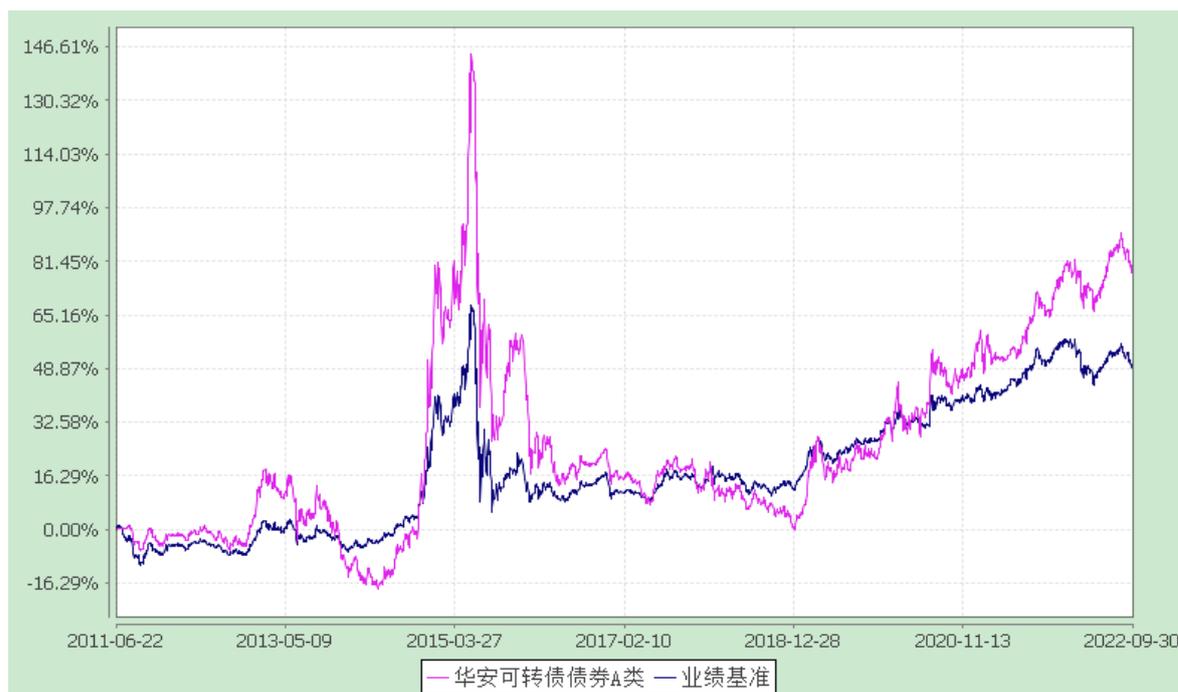
3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安可转换债券债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011 年 6 月 22 日至 2022 年 9 月 30 日)

1. 华安可转债债券 A 类：



2. 华安可转债债券 B 类:



§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	证券从业	说明
----	----	------------	------	----

		限		年限	
		任职日期	离任日期		
周益鸣	本基金的基金经理	2021-03-08	-	14 年	硕士，14 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、固定收益部基金经理助理。2018 年 6 月起，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 月起，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。

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合规守信情况的说明

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中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，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。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价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（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。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。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 0 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年三季度债券市场利率呈现 V 型走势，利率先下后上，整体中枢略有下移。相较海外市场利率的大幅上行，我国债券市场由于没有通胀压力，货币政策倾向于“以我为主”，因此走势相对较为平稳，并且在 7-8 月信贷需求不佳的情况下，甚至出现了一轮利率的下行。

股票市场在三季度出现一定程度的下跌，市场对于宏观预期转弱，欧洲不少发达国家出现股、债、汇三杀，对于我国股票市场信心也有明显的冲击。可转债市场受此影响，有明显的回调，偏股型转债的溢价率从高点有所回落。随着可转债市场监管逐步加强，高溢价率转债的炒作得到明显的遏制，市场正在朝着更为良性的方向发展。

报告期内本基金以低溢价率和低价转债为主要配置方向，并适当配置偏价值方向的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 9 月 30 日，华安可转债债券 A 份额净值为 1.780 元，B 份额净值为 1.706 元；华安可转债债券 A 份额净值增长率为-2.94%，B 份额净值增长率为-3.01%，同期业绩比较基准增长率为-3.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，影响债券利率的关键因素是国内房地产市场，目前无论是财政部、央行、还是各地方政府均出台了一系列支持居民合理住房需求的政策，房地产企业的融资环境也得到明显改善。从信贷数据上看，企业中长期贷款已经有了明显的企稳迹象，显示基建正在发力，居民中长期贷款虽然尚未企稳，但快速下降阶段已经过去，正在构筑底部区域。虽然海外市场风险正在进一步

加大,但是我国利率更多是以我为主,国内宏观若能企稳向上,债券利率很难有大幅下行的空间。

相反,随着股票市场第三季度的下跌,估值已经明显低于历史中枢水平,吸引力显著加大,而历史上信贷周期又能对股市形成较为有利的刺激,因此四季度可能会迎来配置性机会,可转债市场也或将受益。如果利率出现明显上行,可转债溢价率可能会有一定的受损,低溢价率、偏价值板块的转债或将是更优的选择。

本基金将秉承稳健、专业的投资理念,勤勉尽责地维护持有人的利益。

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	56,727,190.00	8.77
	其中:股票	56,727,190.00	8.77
2	固定收益投资	530,022,761.31	81.91
	其中:债券	530,022,761.31	81.91
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	54,716,010.42	8.46
7	其他各项资产	5,638,419.24	0.87
8	合计	647,104,380.97	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,318,900.00	4.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,324,000.00	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	612,000.00	0.10
J	金融业	9,410,200.00	1.46
K	房地产业	12,281,000.00	1.91
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,075,350.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	705,740.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	56,727,190.00	8.82

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 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	000858	五粮液	40,000	6,769,200.00	1.05
2	600383	金地集团	400,000	4,596,000.00	0.71
3	001979	招商蛇口	250,000	4,085,000.00	0.63

4	600276	恒瑞医药	110,000	3,861,000.00	0.60
5	600048	保利发展	200,000	3,600,000.00	0.56
6	600030	中信证券	200,000	3,484,000.00	0.54
7	000333	美的集团	60,000	2,958,600.00	0.46
8	300725	药石科技	40,000	2,818,000.00	0.44
9	600019	宝钢股份	500,000	2,630,000.00	0.41
10	600029	南方航空	350,000	2,324,000.00	0.36

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	20,185,019.18	3.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,234,917.26	2.21
	其中：政策性金融债	14,234,917.26	2.21
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）	495,602,824.87	77.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	530,022,761.31	82.39

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	110053	苏银转债	230,000	29,081,949.86	4.52
2	113044	大秦转债	232,220	25,762,232.31	4.00
3	110059	浦发转债	230,000	24,736,783.56	3.85
4	110079	杭银转债	180,150	22,173,414.79	3.45
5	019674	22 国债 09	200,000	20,185,019.18	3.14

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2021 年 11 月 15 日，浦发银行因银行卡境外交易信息报送错误，被国家外汇管理局上海市分局（上海汇管罚字〔2021〕3121210802 号）责令改正，给予警告、处 6 万元人民币罚款的行政处罚。2022 年 3 月 21 日，浦发银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 EAST 数据等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕25 号）给予罚款 420 万元的行政处罚。2022 年 9 月 2 日，浦发银行因违规办理远期结汇业务等违法违规事项，被国家外汇管理局上海市分局（上海汇管罚字〔2022〕3111220601 号）责令改正，给予警告，并处罚款 933 万元人民币，没收违法所得 334.69 万元人民币的行政处罚。

2022 年 5 月 23 日，杭州银行因未按规定履行客户身份识别义务等违法违规事项，被中国人民银行杭州中心支行（杭银处罚字〔2022〕30 号）给予罚款 580 万元的行政处罚。

2022 年 3 月 21 日，国家开发银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 EAST 数据等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2022）8 号）给予罚款 440 万元的行政处罚。

2021 年 12 月 24 日，江阴农商行因个人经营性贷款变相流入房市、不正当吸收存款，被中国银行保险监督管理委员会无锡监管分局（锡银保监罚决字（2021）39 号）罚款人民币 80 万元。

本基金投资上述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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	47,775.97
2	应收证券清算款	612,780.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,977,862.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,638,419.24

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	110053	苏银转债	29,081,949.86	4.52
2	113044	大秦转债	25,762,232.31	4.00
3	110059	浦发转债	24,736,783.56	3.85
4	110079	杭银转债	22,173,414.79	3.45
5	127049	希望转 2	15,216,549.51	2.37
6	113057	中银转债	14,015,008.61	2.18
7	123107	温氏转债	12,464,364.38	1.94

8	128034	江银转债	10,978,491.69	1.71
9	113640	苏利转债	9,506,897.48	1.48
10	127020	中金转债	9,231,680.00	1.43
11	113052	兴业转债	9,060,308.36	1.41
12	110084	贵燃转债	7,900,931.64	1.23
13	128083	新北转债	7,030,637.29	1.09
14	110043	无锡转债	6,688,287.81	1.04
15	127045	牧原转债	6,494,016.44	1.01
16	123132	回盛转债	6,208,640.21	0.97
17	113055	成银转债	5,681,831.92	0.88
18	113636	甬金转债	5,575,590.00	0.87
19	123125	元力转债	5,435,400.19	0.84
20	128119	龙大转债	5,384,040.41	0.84
21	113591	胜达转债	4,896,697.40	0.76
22	128042	凯中转债	4,871,941.92	0.76
23	113045	环旭转债	4,650,499.73	0.72
24	128141	旺能转债	4,606,196.58	0.72
25	127027	靖远转债	4,577,928.08	0.71
26	113043	财通转债	4,239,945.21	0.66
27	128130	景兴转债	4,089,908.41	0.64
28	113602	景 20 转债	4,087,065.07	0.64
29	127039	北港转债	4,042,605.48	0.63
30	110075	南航转债	4,026,697.12	0.63
31	113516	苏农转债	3,989,921.51	0.62
32	123105	拓尔转债	3,959,932.60	0.62
33	128121	宏川转债	3,949,697.26	0.61
34	110064	建工转债	3,943,963.01	0.61
35	128144	利民转债	3,894,261.70	0.61
36	128081	海亮转债	3,738,246.58	0.58
37	113632	鹤 21 转债	3,602,372.88	0.56
38	113048	晶科转债	3,513,793.15	0.55
39	127053	豪美转债	3,473,852.43	0.54
40	128037	岩土转债	3,466,471.23	0.54
41	127050	麒麟转债	3,155,076.03	0.49
42	127028	英特转债	3,035,869.86	0.47
43	128048	张行转债	3,010,047.95	0.47
44	123035	利德转债	3,007,089.04	0.47
45	127040	国泰转债	2,975,884.93	0.46
46	118000	嘉元转债	2,912,482.88	0.45
47	123114	三角转债	2,881,392.88	0.45
48	132018	G 三峡 EB1	2,856,835.62	0.44
49	113024	核建转债	2,856,215.75	0.44
50	123100	朗科转债	2,824,943.15	0.44

51	113033	利群转债	2,713,777.40	0.42
52	110070	凌钢转债	2,627,302.77	0.41
53	113053	隆 22 转债	2,468,358.36	0.38
54	118003	华兴转债	2,461,224.11	0.38
55	128135	洽洽转债	2,411,900.27	0.37
56	127035	濮耐转债	2,408,688.77	0.37
57	123044	红相转债	2,399,058.08	0.37
58	128136	立讯转债	2,294,869.43	0.36
59	118005	天奈转债	2,276,857.71	0.35
60	113505	杭电转债	2,266,290.96	0.35
61	128049	华源转债	2,244,252.05	0.35
62	110080	东湖转债	2,236,969.86	0.35
63	128132	交建转债	2,229,901.37	0.35
64	110067	华安转债	2,180,539.18	0.34
65	113042	上银转债	2,132,932.05	0.33
66	113039	嘉泽转债	2,071,892.60	0.32
67	110057	现代转债	2,068,949.59	0.32
68	128133	奇正转债	1,729,045.89	0.27
69	123127	耐普转债	1,708,581.78	0.27
70	110077	洪城转债	1,678,770.14	0.26
71	128014	永东转债	1,667,730.82	0.26
72	123082	北陆转债	1,614,965.28	0.25
73	127034	绿茵转债	1,569,337.81	0.24
74	113519	长久转债	1,518,118.63	0.24
75	113600	新星转债	1,337,901.37	0.21
76	113588	润达转债	1,320,285.29	0.21
77	123089	九洲转 2	1,279,534.79	0.20
78	110085	通 22 转债	1,278,960.00	0.20
79	123119	康泰转 2	1,222,554.79	0.19
80	127052	西子转债	1,214,751.29	0.19
81	127029	中钢转债	1,178,018.36	0.18
82	113049	长汽转债	1,171,490.68	0.18
83	127012	招路转债	1,145,384.11	0.18
84	113638	台 21 转债	1,139,814.79	0.18
85	128142	新乳转债	1,102,045.21	0.17
86	113606	荣泰转债	1,101,755.07	0.17
87	127042	嘉美转债	1,093,180.82	0.17
88	127036	三花转债	1,087,975.67	0.17
89	128125	华阳转债	1,083,680.82	0.17
90	128022	众信转债	1,052,315.62	0.16
91	113037	紫银转债	1,040,841.10	0.16
92	113565	宏辉转债	994,634.48	0.15
93	113563	柳药转债	773,888.36	0.12

94	127058	科伦转债	713,231.78	0.11
95	127016	鲁泰转债	693,594.71	0.11
96	110056	亨通转债	686,321.92	0.11
97	128109	楚江转债	650,004.11	0.10
98	113641	华友转债	594,980.00	0.09
99	127017	万青转债	592,853.40	0.09
100	111001	山玻转债	569,175.07	0.09
101	113610	灵康转债	554,032.05	0.09
102	113623	凤 21 转债	549,014.38	0.09
103	123129	锦鸡转债	548,900.96	0.09
104	128044	岭南转债	542,496.85	0.08
105	123113	仙乐转债	538,984.93	0.08
106	127047	帝欧转债	499,271.10	0.08
107	123091	长海转债	448,522.63	0.07
108	113549	白电转债	422,999.16	0.07
109	123122	富瀚转债	229,402.74	0.04

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
本报告期期初基金份额总额	71,716,827.60	77,446,535.64
报告期期间基金总申购份额	132,527,461.78	192,687,194.82
减：报告期期间基金总赎回份额	30,521,625.86	74,315,367.19
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	173,722,663.52	195,818,363.27

§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办公场所，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办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇二二年十月二十五日