

华安可转换债券债券型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 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

送出日期：2025 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2025 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
8.8 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贵金属投资明细	58
8.9 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	58
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.11 投资组合报告附注	58
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
§ 10 开放式基金份额变动	63
§ 11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	67
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	69
12.1 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	69
§ 13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安可转换债券债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份 额总额	4,432,638,905.73 份	
基金合同存续期	不定期	
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	2,119,027,611.73 份	2,313,611,294.00 份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	400-61-95555
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	400-61-95555
传真		021-68863414	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临	深圳市深南大道 7088 号招商银

	港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	朱学华	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类
本期已实现收益	174,466,078.56	124,210,834.38	7,759,207.74	3,165,544.02	7,589,120.32	7,551,621.71
本期利润	250,032,959.34	180,236,173.92	45,673,164.14	66,372,228.42	15,945,714.67	18,151,015.98
加权平均基金份额本期利润	0.1724	0.1391	-0.0751	-0.1029	-0.1355	-0.1454
本期加权平均净值利润率	9.77%	8.24%	-4.19%	-6.04%	-7.57%	-8.46%

本期基金份额净值增长率	8.92%	8.51%	0.06%	-0.30%	-2.73%	-3.07%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	1,601,037,181.66	1,538,569,614.52	576,918,333.40	813,173,279.89	152,682,028.78	118,548,087.18
期末可供分配基金份额利润	0.7556	0.6650	0.6743	0.5938	0.6397	0.5667
期末基金资产净值	4,037,181,255.04	4,190,572,830.83	1,496,381,980.36	2,285,265,737.14	417,258,732.66	350,194,081.44
期末基金份额净值	1.905	1.811	1.749	1.669	1.748	1.674
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	90.50%	81.10%	74.90%	66.90%	74.80%	67.40%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	4.27%	1.12%	3.97%	0.63%	0.30%	0.49%
过去六个月	8.12%	1.13%	6.40%	0.58%	1.72%	0.55%
过去一年	8.92%	0.93%	7.84%	0.48%	1.08%	0.45%

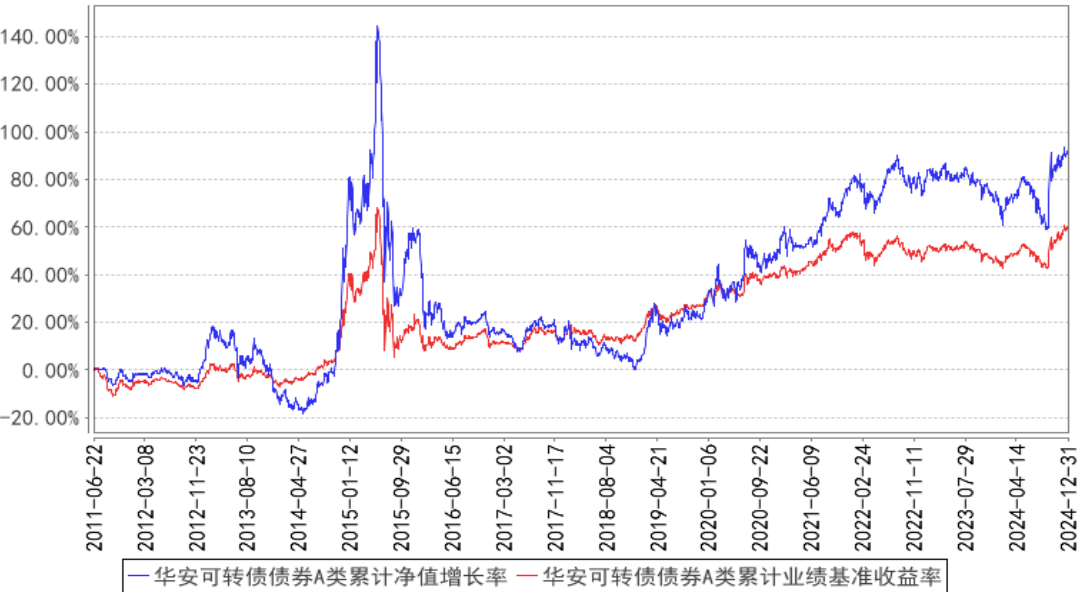
过去三年	6.01%	0.72%	0.92%	0.43%	5.09%	0.29%
过去五年	46.76%	0.78%	21.00%	0.44%	25.76%	0.34%
自基金合同生效 起至今	90.50%	1.15%	59.07%	0.71%	31.43%	0.44%

华安可转债债券 B 类

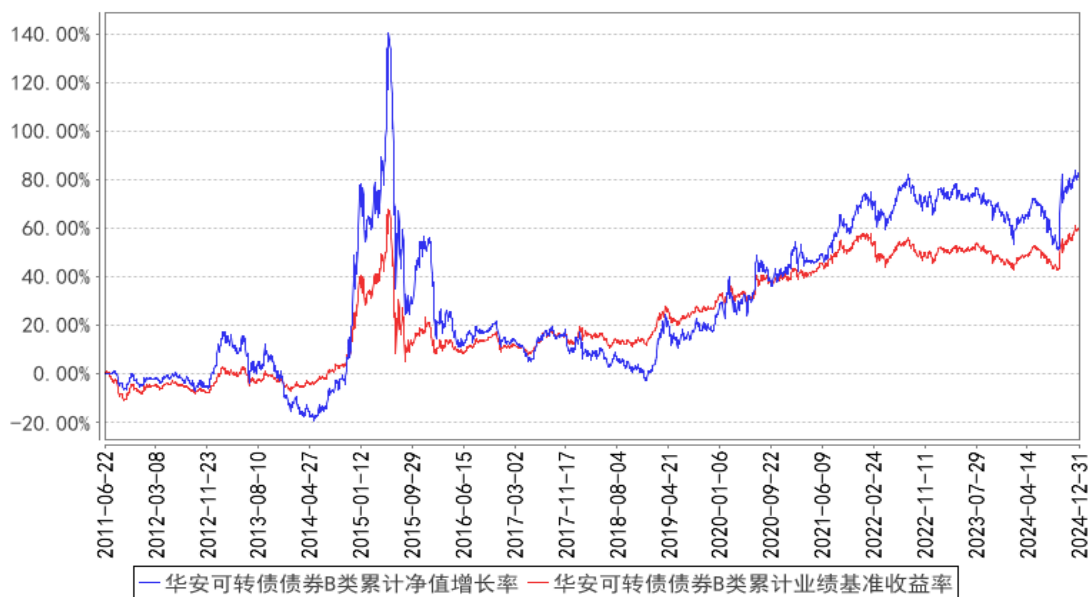
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	4.14%	1.12%	3.97%	0.63%	0.17%	0.49%
过去六个月	7.93%	1.13%	6.40%	0.58%	1.53%	0.55%
过去一年	8.51%	0.93%	7.84%	0.48%	0.67%	0.45%
过去三年	4.86%	0.72%	0.92%	0.43%	3.94%	0.29%
过去五年	44.19%	0.78%	21.00%	0.44%	23.19%	0.34%
自基金合同生效 起至今	81.10%	1.15%	59.07%	0.71%	22.03%	0.44%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

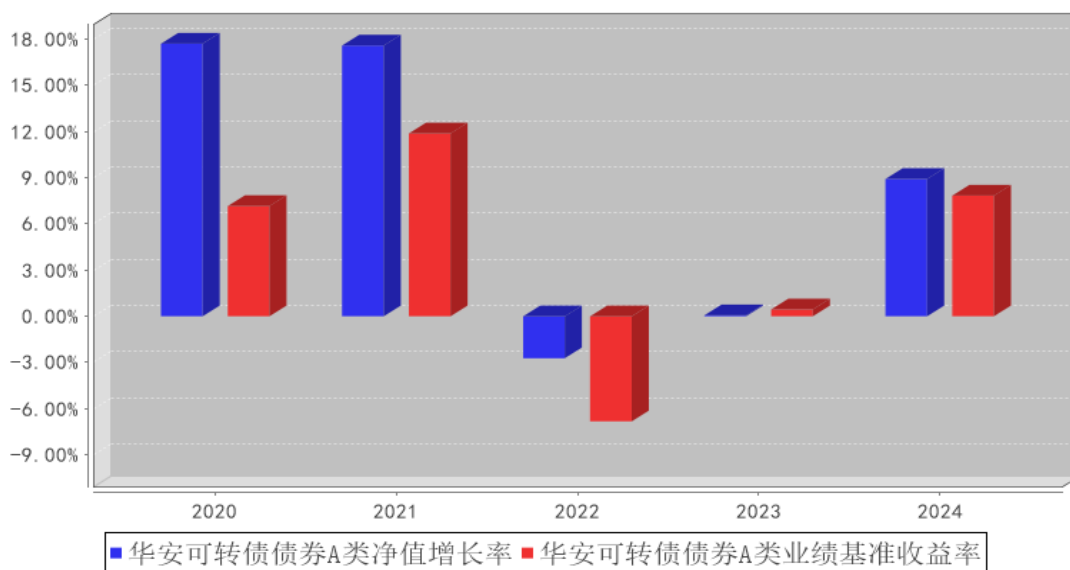


华安可转债债券B类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

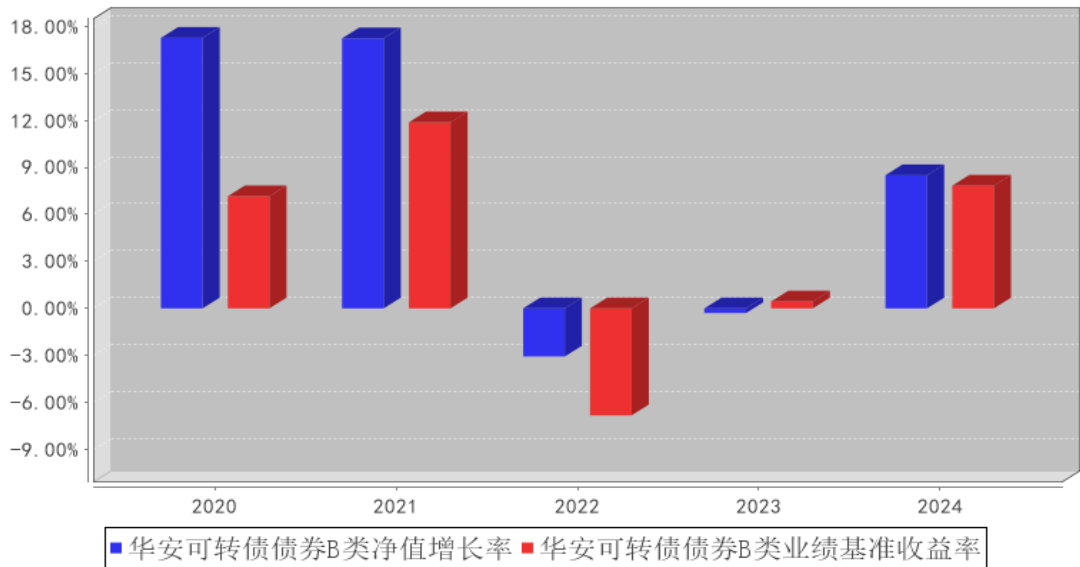


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安可转债债券A类基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华安可转债债券B类基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2024 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 275 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,931.69 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年中国宏观经济呈现 U 型走势，最终完成了 5% 的目标，尤其在四季度经济出现了明显的好转。房地产方面，无论新房还是二手房都有所回暖，部分城市的新房价格出现上升，呈现出明显的止跌企稳迹象。消费层面，下半年各地消费券和补贴力度加大，有效刺激了居民消费回升。但我们也看到，PPI 和 CPI 仍然在相对较低的水平，尚处于温和复苏阶段；海外方面，美国经济出现一些疲态，美债利率逐级下行，特朗普当选后关税政策亦有较大的不确定性。这些因素会使得当前货币和财政政策难以出现全面收紧。

回顾 2024 年金融市场，债券市场呈现持续下行的走势，超长久期利率债表现突出。短端利率下行幅度不及长端，收益率曲线进一步平坦化。可转债在 2024 年虽然录得正收益，但在 8 月份出现了信用风波，部分转债的退市对市场信心造成了较大的冲击，最终在股票的大幅反弹下，转债依靠转股价值的快速提高，扫除了无法还本付息的忧虑。

2024 年股票市场止跌回升，9 月后市场预期出现了非常明显的扭转，同时中央经济工作会议大力提振了市场的信心。结构方面，随着 OPENAI 的横空出世以及国内大模型的发展，AI 产业链带动了整个科技板块大幅上涨；红利指数则在利率大幅下行的背景下稳步上行。市值风格方面，由于宽基指数有大额的资金申购，尤其集中在大市值指数，导致大盘股表现强于小盘股。

本基金在报告期内，重点配置平衡型可转债，积极参与股票市场投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.905 元，B 类份额净值为 1.811 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 8.92%，同期业绩比较基准增长率为 7.84%，B 类份额净值增长率为 8.51%，同期业绩比较基准增长率为 7.84%。

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 2025 年，我们认为经济仍将处于复苏通道，尤其是人工智能和机器人等新兴行业会产生大量的投资需求，引领经济提质增效。同时，房地产也有望持续回暖，近期部分城市土地拍卖情况火热，溢价率明显走高。

我们对 2025 年的股票市场持乐观的态度。首先，经济在多个方面出现了上升势头，基本面正

在回暖。其次，人工智能和机器人产业出现历史性的机遇，国内企业展现出了强有力的国际竞争力，有望带动上下游一系列投资，进而产生结构性的行情。最后，2024 年以来央行多次降息，提供了低利率环境，居民和金融机构在资产配置上有增加股票配置的需求，在 2024 年已经衍生出了红利策略，股票市场出现了筑底回升，2025 年有望产生更多投资策略。

展望债券市场，我们认为短期或将在偏低利率环境下小幅震荡，毕竟目前经济尚处于复苏初期，需要相对较为宽松的货币市场环境。下半年如果 CPI 和 PPI 有明显回暖，债券市场利率可能会有所走高。目前，收益率曲线较为平坦，短端债券品种更具吸引力。

可转债市场自 2024 年 8 月的信用风波以来整体表现较好，无论从可转债的价格中位数还是转股溢价率都有显著的提高，背后隐含了投资者对未来股票市场的乐观预期。同时，部分发行人利用股票市场回暖的阶段下修转股价，赋予高溢价率转债新的活力，并且从 2024 年以来有不少下修后成功转股的案例，投资者收益颇丰，使得当前低价转债同样有增量配置需求。在可转债新增供给不足，且存量转债金额持续下降的背景下，可转债估值水平很难出现大幅下降，但高价转债最终收益会趋于其转股价值，过高的溢价率会削弱转债未来的收益。

本基金将继续投资平衡型转债，积极参与股票市场投资。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合法合规运作出发，持续加强合规风控与内审稽核工作。

公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。坚持全流程合规与风险管控，借助系统平台贯彻落实法律法规、基金合同和内控制度的各项要求，实现事前、事中、事后全方位监控、提示及跟踪，并进一步加强对公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等的监控。通过持续完善风险管理制度建设，提升对流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

公司定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估、内部控制评价，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平有效提升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以风险控制为核心，不断提高合规与风险管理水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金

所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、绝对收益投资部负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字（2025）第 1192 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华安可转换债券债券型证券投资基金全体份额持有人
审计意见	我们审计了华安可转换债券债券型证券投资基金(以下简称“华安可转债债券”)财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表,2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附华安可转债债券的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了华安可转债债券 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华安可转债债券,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系华安可转债债券管理人(以下简称“管理人”)根据《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供华安可转债债券份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。
其他信息	管理人对其他信息负责。其他信息包括华安可转债债券 2024 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也

	不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理人负责评估华安可转债债券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： 1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安可转债债券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然

	而，未来的事项或情况可能导致华安可转债债券不能持续经营。 5、评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与管理人就华安可转债债券的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张健	赵静文
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号 25 楼	
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安可转换债券债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	469,735,888.24	66,154,416.41
结算备付金		17,128,002.31	13,728,396.28
存出保证金		453,633.76	288,415.56
交易性金融资产	7.4.7.2	7,475,773,885.23	4,042,722,256.29
其中：股票投资		661,567,407.72	607,063,391.47
基金投资		-	-
债券投资		6,814,206,477.51	3,435,658,864.82
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	650,058,998.27	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		10,423,208.35	25,396,155.14
应收股利		-	-
应收申购款		9,401,232.81	155,738,990.17

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		8,632,974,848.97	4,304,028,629.85
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	481,014,793.58
应付清算款		329,178,005.22	6,839,932.19
应付赎回款		68,017,085.59	29,918,446.56
应付管理人报酬		4,522,434.02	2,211,254.91
应付托管费		1,292,123.99	631,787.14
应付销售服务费		1,137,768.45	660,792.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		121,390.58	41,912.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	951,955.25	1,061,993.47
负债合计		405,220,763.10	522,380,912.35
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	4,432,638,905.73	2,224,912,781.76
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	3,795,115,180.14	1,556,734,935.74
净资产合计		8,227,754,085.87	3,781,647,717.50
负债和净资产总计		8,632,974,848.97	4,304,028,629.85

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 4,432,638,905.73 份，其中 A 类基金份额净值 1.905 元，基金份额总额 2,119,027,611.73 份；B 类基金份额净值 1.811 元，基金份额总额 2,313,611,294.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华安可转换债券债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		486,390,740.37	-83,639,561.34
1. 利息收入		1,920,107.07	487,089.31
其中：存款利息收入	7.4.7.9	886,916.65	336,260.26
债券利息收入		-	-

资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		1,033,190.42	150,829.05
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		351,579,066.13	32,263,189.08
其中：股票投资收益	7.4.7.10	158,604,992.56	6,049,865.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	177,423,539.28	19,158,835.84
资产支持证券 投资收益		-	-
贵金属投资收 益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	15,550,534.29	7,054,487.57
以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	7.4.7.14	131,592,220.32	-116,639,056.28
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.15	1,299,346.85	249,216.55
减：二、营业总支出		56,121,607.11	28,405,831.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	32,946,488.18	15,123,982.51
其中：暂估管理人报 酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,413,282.37	4,321,137.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	7,577,296.83	3,781,353.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,871,057.96	4,887,485.39
其中：卖出回购金融 资产支出		5,871,057.96	4,887,485.39
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		63,759.46	25,495.29
8. 其他费用	7.4.7.17	249,722.31	266,376.23
三、利润总额（亏损 总额以“-”号填列）		430,269,133.26	-112,045,392.56
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		430,269,133.26	-112,045,392.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		430,269,133.26	-112,045,392.56

7.3 净资产变动表

会计主体：华安可转换债券债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,224,912,781.76	-	1,556,734,935.74	3,781,647,717.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,224,912,781.76	-	1,556,734,935.74	3,781,647,717.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,207,726,123.97	-	2,238,380,244.40	4,446,106,368.37
（一）、综合收益总额	-	-	430,269,133.26	430,269,133.26
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,207,726,123.97	-	1,808,111,111.14	4,015,837,235.11
其中：1. 基金申购款	7,383,976,406.96	-	5,541,968,076.29	12,925,944,483.25
2. 基金赎回款	-5,176,250,282.99	-	-3,733,856,965.15	-8,910,107,248.14
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,432,638,905.73	-	3,795,115,180.14	8,227,754,085.87
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	447,868,989.21	-	319,583,824.89	767,452,814.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	447,868,989.21	-	319,583,824.89	767,452,814.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,777,043,792.55	-	1,237,151,110.85	3,014,194,903.40
（一）、综合收益总额	-	-	- 112,045,392.56	-112,045,392.56
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,777,043,792.55	-	1,349,196,503.41	3,126,240,295.96
其中：1. 基金申购款	3,557,529,812.74	-	2,640,399,407.73	6,197,929,220.47
2. 基金赎回款	- 1,780,486,020.19	-	- 1,291,202,904.32	- 3,071,688,924.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2, 224, 912, 781.76	-	1, 556, 734, 935.74	3, 781, 647, 717. 50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

朱学华
基金管理人负责人

朱学华
主管会计工作负责人

陈松一
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安可转换债券债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 606 号《关于核准华安可转换债券债券型证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,287,722,831.15 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 251 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,287,981,171.43 份基金份额,其中认购资金利息折合 258,340.28 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》和《华安可转换债券债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的,称为 A 类;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 B 类。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安可转换债券债券型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市

小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%,其中对可转债(含分离交易可转债)的投资比例不低于固定收益类资产的 80%;股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:天相可转债指数收益率 $\times 60\%$ + 中证综合债券指数收益率 $\times 30\%$ + 沪深 300 指数收益率 $\times 10\%$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

①债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

1) 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资在资产负债表中以交易性金融资产列示。

②权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要

求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置

时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月，可不行收益分配；

(3) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(4) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金，如果基金份额持有人未选择收益分配方式，则默认为现金方式。基金份额持有人可对 A 类和 B 类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按分红实施日（具体以届时的基金分红公告为准）该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。
- (2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。
- (3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

- 4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。
- 5、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	469,735,888.24	66,154,416.41
等于：本金	469,709,113.10	66,149,584.67
加：应计利息	26,775.14	4,831.74
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	469,735,888.24	66,154,416.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		746,321,762.34	-	661,567,407.72	-84,754,354.62
贵金属投资- 金交所黄金合 约		-	-	-	-
债 券	交易所 市场	6,698,389,304.99	26,338,235.54	6,782,865,255.59	58,137,715.06
	银行间 市场	30,430,770.00	1,065,221.92	31,341,221.92	-154,770.00

	合计	6,728,820,074.99	27,403,457.46	6,814,206,477.51	57,982,945.06
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,475,141,837.33	27,403,457.46	7,475,773,885.23	-26,771,409.56
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		678,640,939.59	-	607,063,391.47	-71,577,548.12
贵金属投资- 金交所黄金合 约		-	-	-	-
债券	交易所 市场	3,500,871,458.26	11,458,694.88	3,425,529,471.38	-86,800,681.76
	银行间 市场	9,983,400.00	131,393.44	10,129,393.44	14,600.00
	合计	3,510,854,858.26	11,590,088.32	3,435,658,864.82	-86,786,081.76
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,189,495,797.85	11,590,088.32	4,042,722,256.29	- 158,363,629.88

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	650,058,998.27	-
银行间市场	-	-
合计	650,058,998.27	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	759.41	11,963.91
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	831,195.84	788,029.56
其中：交易所市场	830,745.84	787,854.56
银行间市场	450.00	175.00
应付利息	-	-
预提审计费	50,000.00	72,000.00
预提信息披露费	70,000.00	190,000.00
合计	951,955.25	1,061,993.47

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华安可转债债券 A 类

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	855,532,598.21	855,532,598.21
本期申购	3,432,509,415.66	3,432,509,415.66
本期赎回（以“-”号填列）	-2,169,014,402.14	-2,169,014,402.14
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,119,027,611.73	2,119,027,611.73

华安可转债债券 B 类

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,369,380,183.55	1,369,380,183.55
本期申购	3,951,466,991.30	3,951,466,991.30
本期赎回（以“-”号填列）	-3,007,235,880.85	-3,007,235,880.85
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,313,611,294.00	2,313,611,294.00

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华安可转债债券 A 类

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	576,918,333.40	63,931,048.75	640,849,382.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	576,918,333.40	63,931,048.75	640,849,382.15
本期利润	174,466,078.56	75,566,880.78	250,032,959.34
本期基金份额交易产生的变动数	849,652,769.70	177,618,532.12	1,027,271,301.82
其中：基金申购款	2,332,234,121.94	390,361,404.85	2,722,595,526.79
基金赎回款	-1,482,581,352.24	-212,742,872.73	-1,695,324,224.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,601,037,181.66	317,116,461.65	1,918,153,643.31

华安可转债债券 B 类

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	813,173,279.89	102,712,273.70	915,885,553.59
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	813,173,279.89	102,712,273.70	915,885,553.59
本期利润	124,210,834.38	56,025,339.54	180,236,173.92
本期基金份额交易产生的变动数	601,185,500.25	179,654,309.07	780,839,809.32
其中：基金申购款	2,381,414,532.19	437,958,017.31	2,819,372,549.50
基金赎回款	-1,780,229,031.94	-258,303,708.24	-2,038,532,740.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,538,569,614.52	338,391,922.31	1,876,961,536.83

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	669,373.82	222,921.33
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	207,189.50	110,433.50
其他	10,353.33	2,905.43
合计	886,916.65	336,260.26

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	158,604,992.56	6,049,865.67
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	158,604,992.56	6,049,865.67

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	1,594,262,354.99	496,860,176.78
减：卖出股票成本 总额	1,432,854,732.89	488,871,139.07
减：交易费用	2,802,629.54	1,939,172.04
买卖股票差价收入	158,604,992.56	6,049,865.67

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	34,564,545.86	13,762,601.19
债券投资收益——买	142,858,993.42	5,396,234.65

卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	177,423,539.28	19,158,835.84

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,920,488,702.72	2,081,132,881.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,754,350,019.16	2,068,108,686.68
减：应计利息总额	22,732,072.38	7,363,820.83
减：交易费用	547,617.76	264,139.02
买卖债券差价收入	142,858,993.42	5,396,234.65

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资产生的股利收益	15,550,534.29	7,054,487.57
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	15,550,534.29	7,054,487.57

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	131,592,220.32	-116,639,056.28
股票投资	-13,176,806.50	-67,213,544.26
债券投资	144,769,026.82	-49,425,512.02
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	131,592,220.32	-116,639,056.28

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,264,324.91	246,392.16
基金转换费收入	35,021.94	2,824.39
合计	1,299,346.85	249,216.55

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	72,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	42,522.31	37,176.23
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	249,722.31	266,376.23

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海上国投资资产管理有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份 有限公司	512,994,060.17	17.85	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
-------	---	----------------------------------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	2,101,496,525.75	14.68	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	1,550,000,000.00	7.09	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	252,315.76	13.85	216,352.56	26.04
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管

理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	32,946,488.18	15,123,982.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,998,028.85	3,060,315.71
应支付基金管理人的净管理费	26,948,459.33	12,063,666.80

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,413,282.37	4,321,137.91

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	174,607.25	174,607.25
华安基金管理有限公司	-	2,781,505.74	2,781,505.74
招商银行股份有限公司	-	847,307.71	847,307.71
合计	-	3,803,420.70	3,803,420.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安可转债债券 A 类	华安可转债债券 B 类	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	1,324.77	1,324.77
华安基金管理有限公司	-	952,820.43	952,820.43
招商银行股份有限公司	-	84,349.45	84,349.45
合计	-	1,038,494.65	1,038,494.65

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费按 B 类基金份额前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times B \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	469,735,888.24	669,373.82	66,154,416.41	222,921.33

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只主要投资可转债的债券型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以

上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-

A-1 以下	—	—
未评级	402,317,370.35	201,101,783.03
合计	402,317,370.35	201,101,783.03

注：未评级债券为国债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	2,538,627,939.04	1,391,261,640.09
AAA 以下	3,841,919,946.20	1,843,295,441.70
未评级	31,341,221.92	—
合计	6,411,889,107.16	3,234,557,081.79

注：未评级债券为政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具

还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	469,735,888.24	-	-	-	469,735,888.24
结算备付金	17,128,002.31	-	-	-	17,128,002.31
存出保证金	453,633.76	-	-	-	453,633.76
交易性金融资产	6,814,206,477.51	-	-	-661,567,407.72	7,475,773,885.23
买入返售金融资产	650,058,998.27	-	-	-	650,058,998.27
应收申购款	-	-	-	9,401,232.81	9,401,232.81
应收清算款	-	-	-	10,423,208.35	10,423,208.35
资产总计	7,951,583,000.09	-	-	-681,391,848.88	8,632,974,848.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	68,017,085.59	68,017,085.59
应付管理人报酬	-	-	-	4,522,434.02	4,522,434.02
应付托管费	-	-	-	1,292,123.99	1,292,123.99
应付清算款	-	-	-	-329,178,005.22	329,178,005.22
应付销售服务费	-	-	-	1,137,768.45	1,137,768.45
应交税费	-	-	-	121,390.58	121,390.58
其他负债	-	-	-	951,955.25	951,955.25
负债总计	-	-	-	-405,220,763.10	405,220,763.10
利率敏感度缺口	7,951,583,000.09	-	-	-276,171,085.78	8,227,754,085.87
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	66,154,416.41	-	-	-	66,154,416.41
结算备付金	13,728,396.28	-	-	-	13,728,396.28
存出保证金	288,415.56	-	-	-	288,415.56
交易性金融资产	3,431,086,588.66	4,572,276.16	-	-607,063,391.47	4,042,722,256.29
应收申购款	-	-	-	-155,738,990.17	155,738,990.17
应收清算款	-	-	-	-25,396,155.14	25,396,155.14
资产总计	3,511,257,816.	4,572,276.16	-	-788,198,536.78	4,304,028,629.85

	91				
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,918,446.56	29,918,446.56
应付管理人报酬	-	-	-	2,211,254.91	2,211,254.91
应付托管费	-	-	-	631,787.14	631,787.14
应付清算款	-	-	-	6,839,932.19	6,839,932.19
卖出回购金融资产款	481,014,793.58	-	-	-	481,014,793.58
应付销售服务费	-	-	-	660,792.30	660,792.30
应交税费	-	-	-	41,912.20	41,912.20
其他负债	-	-	-	1,061,993.47	1,061,993.47
负债总计	481,014,793.58	-	-	41,366,118.77	522,380,912.35
利率敏感度缺口	3,030,243,023.33	4,572,276.16	-	-746,832,418.01	3,781,647,717.50

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	328,740.95	155,028.91
	市场利率上升 25 个基点	-328,165.20	-154,754.11

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组

合风险管理全过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	661,567,407.72	8.04	607,063,391.47	16.05
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	6,380,547,885.24	77.55	3,234,557,081.79	85.53
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	7,042,115,292.96	85.59	3,841,620,473.26	101.59

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准上升 5%	775,456,768.23	312,260,108.43
	业绩比较基准下降 5%	-775,456,768.23	-312,260,108.43

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	7,042,115,292.96	3,841,620,473.26
第二层次	433,658,592.27	201,101,783.03
第三层次	-	-
合计	7,475,773,885.23	4,042,722,256.29

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。
--

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	661,567,407.72	7.66
	其中：股票	661,567,407.72	7.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,814,206,477.51	78.93
	其中：债券	6,814,206,477.51	78.93
	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	650,058,998.27	7.53
	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	486,863,890.55	5.64
8	其他各项资产	20,278,074.92	0.23
9	合计	8,632,974,848.97	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	5,123,909.23	0.06
B	采矿业	20,871,256.00	0.25
C	制造业	442,880,250.49	5.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,011,000.00	0.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,454,865.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	48,562,950.00	0.59
H	住宿和餐饮业	7,335,000.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,976,837.00	0.10
J	金融业	37,453,765.00	0.46
K	房地产业	30,590,700.00	0.37
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	19,020,672.00	0.23
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	5,227,947.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	4,058,256.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	661,567,407.72	8.04

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	002815	崇达技术	2,000,000	20,400,000.00	0.25
2	600029	南方航空	2,500,000	16,225,000.00	0.20
3	600745	闻泰科技	400,000	15,512,000.00	0.19
4	600900	长江电力	500,000	14,775,000.00	0.18
5	603986	兆易创新	134,440	14,358,192.00	0.17
6	601111	中国国航	1,600,000	12,656,000.00	0.15
7	600438	通威股份	541,200	11,965,932.00	0.15

8	601088	中国神华	250,000	10,870,000.00	0.13
9	600989	宝丰能源	630,500	10,617,620.00	0.13
10	600089	特变电工	811,600	10,339,784.00	0.13
11	603259	药明康德	186,800	10,281,472.00	0.12
12	603195	公牛集团	143,705	10,093,839.20	0.12
13	601615	明阳智能	782,500	9,867,325.00	0.12
14	601100	恒立液压	181,700	9,588,309.00	0.12
15	300850	新强联	500,000	9,555,000.00	0.12
16	688266	泽璟制药	150,000	9,346,500.00	0.11
17	600276	恒瑞医药	200,000	9,180,000.00	0.11
18	603899	晨光股份	295,800	8,947,950.00	0.11
19	600048	保利发展	1,000,000	8,860,000.00	0.11
20	603833	欧派家居	127,600	8,796,744.00	0.11
21	603799	华友钴业	300,000	8,778,000.00	0.11
22	600887	伊利股份	290,600	8,770,308.00	0.11
23	300347	泰格医药	160,000	8,739,200.00	0.11
24	002841	视源股份	231,500	8,544,665.00	0.10
25	601229	上海银行	913,200	8,355,780.00	0.10
26	001979	招商蛇口	800,000	8,192,000.00	0.10
27	601666	平煤股份	800,000	8,016,000.00	0.10
28	601166	兴业银行	412,700	7,907,332.00	0.10
29	601012	隆基绿能	500,000	7,855,000.00	0.10
30	300408	三环集团	202,300	7,790,573.00	0.09
31	600383	金地集团	1,765,000	7,730,700.00	0.09
32	600258	首旅酒店	500,000	7,335,000.00	0.09
33	000538	云南白药	120,000	7,194,000.00	0.09
34	000895	双汇发展	273,600	7,102,656.00	0.09
35	000661	长春高新	69,200	6,881,248.00	0.08
36	601006	大秦铁路	1,000,000	6,780,000.00	0.08
36	603081	大丰实业	600,000	6,780,000.00	0.08
37	603043	广州酒家	400,000	6,652,000.00	0.08
38	300001	特锐德	293,300	6,437,935.00	0.08
39	002984	森麒麟	250,000	6,165,000.00	0.07
40	603713	密尔克卫	120,000	6,144,000.00	0.07
41	002129	TCL 中环	658,725	5,842,890.75	0.07
42	002557	洽洽食品	200,000	5,810,000.00	0.07
43	000002	万 科 A	800,000	5,808,000.00	0.07
44	600176	中国巨石	500,000	5,695,000.00	0.07
45	601665	齐鲁银行	1,000,000	5,590,000.00	0.07
46	300475	香农芯创	188,500	5,370,365.00	0.07
47	601009	南京银行	498,000	5,303,700.00	0.06
48	603882	金域医学	189,900	5,227,947.00	0.06
49	000100	TCL 科技	1,000,000	5,030,000.00	0.06

50	300274	阳光电源	63,080	4,657,196.40	0.06
51	300832	新产业	64,300	4,555,655.00	0.06
52	002120	韵达股份	600,000	4,512,000.00	0.05
53	603368	柳药集团	250,000	4,465,000.00	0.05
54	002508	老板电器	200,000	4,286,000.00	0.05
55	601139	深圳燃气	600,000	4,236,000.00	0.05
56	000060	中金岭南	901,200	4,226,628.00	0.05
57	603638	艾迪精密	250,000	4,222,500.00	0.05
58	300498	温氏股份	254,473	4,201,349.23	0.05
59	300251	光线传媒	429,900	4,058,256.00	0.05
60	603290	斯达半导	45,000	4,041,900.00	0.05
61	002600	领益智造	500,000	4,000,000.00	0.05
62	002332	仙琚制药	400,000	3,976,000.00	0.05
63	300002	神州泰岳	339,700	3,937,123.00	0.05
64	300049	福瑞股份	122,116	3,851,538.64	0.05
65	603939	益丰药房	150,000	3,619,500.00	0.04
66	600298	安琪酵母	100,000	3,605,000.00	0.04
67	300705	九典制药	193,821	3,479,086.95	0.04
68	000708	中信特钢	300,000	3,423,000.00	0.04
69	300573	兴齐眼药	48,620	3,392,703.60	0.04
70	000333	美的集团	44,800	3,369,856.00	0.04
71	002436	兴森科技	300,000	3,333,000.00	0.04
72	601231	环旭电子	200,000	3,300,000.00	0.04
73	000301	东方盛虹	400,000	3,284,000.00	0.04
74	600690	海尔智家	107,700	3,066,219.00	0.04
75	301308	江波龙	35,500	3,053,000.00	0.04
76	601636	旗滨集团	539,700	3,027,717.00	0.04
77	300601	康泰生物	175,100	3,002,965.00	0.04
78	300285	国瓷材料	171,700	2,925,768.00	0.04
79	300628	亿联网络	75,200	2,902,720.00	0.04
80	002335	科华数据	100,000	2,892,000.00	0.04
81	301030	仕净科技	115,720	2,793,480.80	0.03
82	603992	松霖科技	150,000	2,770,500.00	0.03
83	300765	新诺威	104,100	2,768,019.00	0.03
84	002916	深南电路	20,900	2,612,500.00	0.03
85	603966	法兰泰克	329,869	2,546,588.68	0.03
86	000651	格力电器	55,700	2,531,565.00	0.03
87	000568	泸州老窖	20,000	2,504,000.00	0.03
88	600810	神马股份	300,000	2,427,000.00	0.03
89	002859	洁美科技	110,000	2,282,500.00	0.03
90	300014	亿纬锂能	48,700	2,276,238.00	0.03
91	300207	欣旺达	101,500	2,264,465.00	0.03
92	300373	扬杰科技	51,700	2,249,984.00	0.03

93	601919	中远海控	144,900	2,245,950.00	0.03
94	600660	福耀玻璃	35,900	2,240,160.00	0.03
95	300604	长川科技	50,300	2,219,739.00	0.03
96	600919	江苏银行	225,800	2,217,356.00	0.03
97	300661	圣邦股份	27,100	2,216,238.00	0.03
98	300088	长信科技	337,500	2,207,250.00	0.03
99	300760	迈瑞医疗	8,500	2,167,500.00	0.03
100	600926	杭州银行	146,700	2,143,287.00	0.03
101	600406	国电南瑞	84,400	2,128,568.00	0.03
102	300979	华利集团	27,000	2,123,550.00	0.03
103	600111	北方稀土	100,000	2,122,000.00	0.03
104	002001	新 和 成	96,400	2,117,908.00	0.03
105	002938	鹏鼎控股	57,800	2,108,544.00	0.03
106	688036	传音控股	22,173	2,106,435.00	0.03
107	603650	彤程新材	60,000	2,098,200.00	0.03
108	300763	锦浪科技	34,200	2,088,594.00	0.03
109	000001	平安银行	178,500	2,088,450.00	0.03
110	300677	英科医疗	82,500	2,085,600.00	0.03
111	601138	工业富联	95,300	2,048,950.00	0.02
112	002304	洋河股份	24,100	2,013,073.00	0.02
113	601899	紫金矿业	131,300	1,985,256.00	0.02
114	603901	永创智能	266,322	1,962,793.14	0.02
115	600309	万华化学	27,500	1,962,125.00	0.02
116	600498	烽火通信	100,000	1,946,000.00	0.02
117	300339	润和软件	38,200	1,911,146.00	0.02
118	300394	天孚通信	20,900	1,909,424.00	0.02
119	002821	凯莱英	24,900	1,894,641.00	0.02
120	300450	先导智能	94,400	1,889,888.00	0.02
121	601238	广汽集团	200,000	1,868,000.00	0.02
122	002572	索菲亚	107,600	1,848,568.00	0.02
123	601601	中国太保	50,000	1,704,000.00	0.02
124	300181	佐力药业	107,000	1,643,520.00	0.02
125	603345	安井食品	20,000	1,629,600.00	0.02
126	300633	开立医疗	50,000	1,469,500.00	0.02
127	601288	农业银行	224,000	1,196,160.00	0.01
128	002475	立讯精密	23,900	974,164.00	0.01
129	601318	中国平安	18,000	947,700.00	0.01
130	002714	牧原股份	24,000	922,560.00	0.01
131	688187	时代电气	13,059	625,787.28	0.01
132	688122	西部超导	14,445	618,534.90	0.01
133	688180	君实生物	21,881	598,007.73	0.01
134	688169	石头科技	2,680	587,697.20	0.01
135	688819	天能股份	21,151	575,730.22	0.01

136	688065	凯赛生物	14,803	574,356.40	0.01
137	688390	固德威	13,164	538,407.60	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601838	成都银行	117,148,057.96	3.10
2	601878	浙商证券	93,165,764.43	2.46
3	603228	景旺电子	27,756,852.18	0.73
4	600048	保利发展	23,557,337.46	0.62
5	601088	中国神华	22,716,902.00	0.60
6	601998	中信银行	22,395,557.10	0.59
7	300850	新强联	22,319,125.00	0.59
8	600029	南方航空	21,986,587.00	0.58
9	002815	崇达技术	21,415,557.00	0.57
10	601166	兴业银行	20,642,310.00	0.55
11	601006	大秦铁路	18,904,200.00	0.50
12	603992	松霖科技	16,221,755.22	0.43
13	002335	科华数据	15,626,626.00	0.41
14	600900	长江电力	14,653,065.00	0.39
15	601009	南京银行	14,445,590.00	0.38
16	600745	闻泰科技	13,704,808.00	0.36
17	002966	苏州银行	12,560,949.00	0.33
18	600989	宝丰能源	12,452,758.00	0.33
19	001979	招商蛇口	11,072,617.00	0.29
20	300498	温氏股份	10,698,021.34	0.28

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601838	成都银行	130,845,035.44	3.46
2	601878	浙商证券	106,575,826.51	2.82
3	603228	景旺电子	35,115,002.30	0.93
4	601998	中信银行	27,813,098.44	0.74
5	600690	海尔智家	27,049,334.63	0.72
6	601166	兴业银行	25,659,118.01	0.68
7	601006	大秦铁路	24,457,957.75	0.65
8	601398	工商银行	23,224,780.00	0.61

9	601009	南京银行	21,027,590.00	0.56
10	601288	农业银行	20,554,633.00	0.54
11	600048	保利发展	19,356,688.00	0.51
12	000333	美的集团	19,091,103.00	0.50
13	300979	华利集团	17,169,415.25	0.45
14	002938	鹏鼎控股	15,918,329.95	0.42
15	600309	万华化学	15,794,419.00	0.42
16	300498	温氏股份	15,791,425.41	0.42
17	601088	中国神华	15,237,878.00	0.40
18	601601	中国太保	15,001,898.00	0.40
19	002335	科华数据	14,877,482.00	0.39
20	600030	中信证券	14,144,747.56	0.37

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,500,535,555.64
卖出股票收入（成交）总额	1,594,262,354.99

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	402,317,370.35	4.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,341,221.92	0.38
	其中：政策性金融债	31,341,221.92	0.38
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）	6,380,547,885.24	77.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,814,206,477.51	82.82

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110079	杭银转债	2,530,000	326,600,680.54	3.97

2	113062	常银转债	2,490,000	312,907,589.59	3.80
3	110059	浦发转债	2,700,000	294,299,630.13	3.58
4	127032	苏行转债	2,130,000	278,684,823.30	3.39
5	113042	上银转债	1,958,000	235,063,210.74	2.86

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

无。

8.10.2 本期国债期货投资评价

无。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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、国家外汇管理局浙江省分局的处罚；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；上海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上海监管局的处罚。

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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	453,633.76
2	应收清算款	10,423,208.35
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	9,401,232.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,278,074.92

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110079	杭银转债	326,600,680.54	3.97
2	113062	常银转债	312,907,589.59	3.80
3	110059	浦发转债	294,299,630.13	3.58
4	127032	苏行转债	278,684,823.30	3.39
5	113042	上银转债	235,063,210.74	2.86
6	113050	南银转债	211,779,424.66	2.57
7	110081	闻泰转债	204,905,095.88	2.49
8	113065	齐鲁转债	195,932,061.03	2.38
9	113641	华友转债	171,601,228.49	2.09
10	110085	通 22 转债	148,175,841.64	1.80
11	123107	温氏转债	138,854,094.43	1.69
12	127027	能化转债	129,972,473.97	1.58
13	127091	科数转债	115,739,276.71	1.41
14	123161	强联转债	113,547,040.47	1.38
15	127086	恒邦转债	99,194,689.24	1.21
16	123169	正海转债	97,920,441.37	1.19
17	113053	隆 22 转债	97,033,303.03	1.18
18	113685	升 24 转债	93,782,487.67	1.14
19	110093	神马转债	88,533,842.47	1.08
20	113069	博 23 转债	86,810,213.70	1.06
21	127052	西子转债	85,615,953.51	1.04
22	127020	中金转债	85,349,968.45	1.04
23	123158	宙邦转债	81,206,653.33	0.99
24	111019	宏柏转债	71,146,895.82	0.86
25	123145	药石转债	70,283,104.89	0.85
26	123120	隆华转债	69,933,939.91	0.85
27	111010	立昂转债	69,827,627.40	0.85
28	128133	奇正转债	67,098,193.36	0.82
29	113669	景 23 转债	62,869,479.45	0.76
30	113637	华翔转债	58,093,352.05	0.71
31	128141	旺能转债	57,489,473.44	0.70
32	127043	川恒转债	55,883,876.71	0.68
33	127102	浙建转债	54,115,552.59	0.66
34	123178	花园转债	49,238,174.46	0.60

35	118028	会通转债	49,162,224.66	0.60
36	111000	起帆转债	48,488,942.46	0.59
37	113676	荣 23 转债	47,564,100.82	0.58
38	127054	双箭转债	44,884,817.33	0.55
39	123182	广联转债	43,528,438.36	0.53
40	113640	苏利转债	43,319,671.23	0.53
41	127045	牧原转债	42,744,584.03	0.52
42	123212	立中转债	41,778,424.89	0.51
43	123225	翔丰转债	41,332,816.44	0.50
44	110094	众和转债	40,846,215.62	0.50
45	113067	燃 23 转债	38,533,926.58	0.47
46	123226	中富转债	36,192,101.92	0.44
47	123240	楚天转债	36,160,087.67	0.44
48	123204	金丹转债	35,985,822.47	0.44
49	113052	兴业转债	33,856,931.51	0.41
50	113655	欧 22 转债	33,603,852.44	0.41
51	127069	小熊转债	33,513,545.21	0.41
52	123239	锋工转债	33,020,548.49	0.40
53	111018	华康转债	32,431,318.36	0.39
54	128135	洽洽转债	31,571,755.65	0.38
55	123191	智尚转债	30,600,801.37	0.37
56	127101	豪鹏转债	28,885,330.61	0.35
57	113673	岱美转债	28,531,923.29	0.35
58	113631	皖天转债	28,111,057.54	0.34
59	127105	龙星转债	27,788,275.48	0.34
60	113051	节能转债	27,387,895.89	0.33
61	113648	巨星转债	26,520,034.25	0.32
62	118038	金宏转债	24,881,663.01	0.30
63	113068	金铜转债	23,952,105.21	0.29
64	111016	神通转债	23,522,054.79	0.29
65	113663	新化转债	22,475,984.83	0.27
66	123221	力诺转债	21,970,220.46	0.27
67	113632	鹤 21 转债	21,925,416.52	0.27
68	127071	天箭转债	21,522,387.95	0.26
69	127073	天赐转债	21,239,215.07	0.26
70	123150	九强转债	19,518,300.86	0.24
71	113657	再 22 转债	19,415,024.66	0.24
72	113667	春 23 转债	19,289,671.23	0.23
73	123121	帝尔转债	19,102,378.08	0.23
74	118041	星球转债	18,827,252.06	0.23
75	127081	中旗转债	18,432,472.60	0.22
76	123201	纽泰转债	17,936,040.98	0.22
77	113682	益丰转债	17,229,313.15	0.21

78	127070	大中转债	16,037,071.06	0.19
79	111015	东亚转债	15,804,366.27	0.19
80	113658	密卫转债	15,453,687.67	0.19
81	127088	赫达转债	15,251,946.10	0.19
82	113605	大参转债	15,080,014.25	0.18
83	128137	洁美转债	15,040,484.69	0.18
84	123149	通裕转债	14,948,307.26	0.18
85	113644	艾迪转债	14,760,467.12	0.18
86	127030	盛虹转债	14,030,508.22	0.17
87	118025	奕瑞转债	13,383,506.88	0.16
88	123234	中能转债	13,254,825.21	0.16
89	128121	宏川转债	12,965,912.05	0.16
90	118008	海优转债	12,843,565.48	0.16
91	118011	银微转债	12,331,666.03	0.15
92	111007	永和转债	12,187,972.60	0.15
93	118033	华特转债	12,104,589.66	0.15
94	127095	广泰转债	11,744,617.81	0.14
95	113563	柳药转债	11,222,082.19	0.14
96	110084	贵燃转债	11,024,679.45	0.13
97	123233	凯盛转债	10,949,149.45	0.13
98	127099	盛航转债	10,361,806.68	0.13
99	123236	家联转债	10,287,086.30	0.13
100	127078	优彩转债	10,167,960.82	0.12
101	123064	万孚转债	9,739,952.26	0.12
102	118004	博瑞转债	9,633,873.97	0.12
103	128081	海亮转债	9,494,109.87	0.12
104	128132	交建转债	9,332,845.09	0.11
105	118037	上声转债	9,019,231.51	0.11
106	113664	大元转债	8,379,642.47	0.10
107	113045	环旭转债	8,117,433.97	0.10
108	113549	白电转债	7,601,761.64	0.09
109	128134	鸿路转债	7,438,851.75	0.09
110	123133	佩蒂转债	7,362,172.60	0.09
111	123190	道氏转 02	7,340,087.67	0.09
112	118043	福立转债	7,251,205.48	0.09
113	113643	风语转债	6,769,684.93	0.08
114	127100	神码转债	6,391,102.74	0.08
115	127039	北港转债	6,245,075.28	0.08
116	113675	新 23 转债	5,887,335.62	0.07
117	111002	特纸转债	5,871,945.21	0.07
118	123174	精锻转债	5,570,221.10	0.07
119	123168	惠云转债	5,558,662.80	0.07
120	113623	凤 21 转债	5,553,001.11	0.07

121	118029	富淼转债	5,351,617.81	0.07
122	118042	奥维转债	5,162,121.71	0.06
123	123119	康泰转 2	5,077,610.15	0.06
124	123076	强力转债	4,803,939.73	0.06
125	123217	富仕转债	4,062,331.68	0.05
126	128131	崇达转 2	3,943,411.59	0.05
127	127056	中特转债	2,155,030.14	0.03

8.11.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华安可转 债债券 A 类	57,981	36,546.93	2,004,756,718.03	94.61	114,270,893.70	5.39
华安可转 债债券 B 类	23,410	98,830.04	2,236,979,734.42	96.69	76,631,559.58	3.31
合计	81,391	54,461.04	4,241,736,452.45	95.69	190,902,453.28	4.31

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 （%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	华安可转债债券 A 类	1,093,637.57	0.05
	华安可转债债券 B 类	321.75	0.00
	合计	1,093,959.32	0.02

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安可转债债券 A 类	10~50
	华安可转债债券 B 类	—
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华安可转债债券 A 类	10~50
	华安可转债债券 B 类	—
	合计	10~50

§ 10 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
基金合同生效日（2011 年 6 月 22 日）基金份额总额	706,745,673.56	581,235,497.87
本报告期期初基金份额总额	855,532,598.21	1,369,380,183.55
本报告期基金总申购份额	3,432,509,415.66	3,951,466,991.30
减：本报告期基金总赎回份额	2,169,014,402.14	3,007,235,880.85
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,119,027,611.73	2,313,611,294.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下： 2024 年 3 月 12 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》，范伊然女士新任本基金管理人的副总经理。 2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年 11 月 9 日起更换会计师事务所，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为上会会计师事务所（特殊普通合伙）。此次变更已经华安基金管理有限公司董事会审议通过，并已按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人。

报告年度应支付给上会会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 50,000.00 元。

目前该审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2024 年 11 月 9 日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	3	548,898,131.64	19.10	267,987.50	14.71	-
国泰君安	3	512,994,060.17	17.85	252,315.76	13.85	-
浙商证券	1	497,638,463.76	17.32	296,472.88	16.28	-
东吴证券	1	379,322,631.31	13.20	336,499.21	18.48	-
广发证券	1	344,220,678.88	11.98	281,419.30	15.45	-

野村东方 证券	1	307,237,471 .29	10.69	182,838.31	10.04	-
民生证券	1	187,601,279 .99	6.53	159,834.44	8.78	-
招商证券	1	94,560,017. 62	3.29	43,109.68	2.37	-
方正证券	2	845,224.00	0.03	791.03	0.04	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《华安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

1、选择证券公司参与证券交易的标准：

基金管理人负责选择证券公司，租用证券公司交易单元进行证券投资，或委托证券公司办理证券投资，选择标准为：

- （1）财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范，具备健全的内控制度；
- （2）提供研究服务的证券公司应当具备较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，提供高质量的研究报告和较为全面的投研服务与支持（被动股票型基金不适用）；
- （3）交易服务能力较强，具备证券交易所需的高效、安全的通讯条件，满足基金进行证券交易或结算的需要。

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

- （1）候选证券公司的尽职调查
根据证券公司选择标准及相关内控制度要求，对证券公司进行甄选并对其进行开展尽职调查。
- （2）候选证券公司的准入评估
对候选证券公司的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成证券公司准入。
- （3）候选证券公司的审批程序

依据各候选证券公司的综合评估结果，择优选出拟新增证券公司，公司领导对新增证券公司综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与入选的证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：国泰君安、中信建投、华泰证券。

撤销交易单元的证券公司：华创证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	1,518,138,186.37	10.61	6,877,000,000.00	31.46	-	-
国泰君安	2,101,496,525.75	14.68	1,550,000,000.00	7.09	-	-
浙商证券	2,758,101,397.32	19.27	-	-	-	-
东吴证券	2,688,211,019.91	18.78	6,090,500,000.00	27.86	-	-
广发证券	1,895,678,150.56	13.24	5,162,000,000.00	23.61	-	-
野村东方证券	894,310,640.45	6.25	2,180,000,000.00	9.97	-	-
民生证券	1,695,610,828.12	11.85	-	-	-	-
招商证券	727,192,491.23	5.08	-	-	-	-
方正证券	34,189,786.50	0.24	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证	-	-	-	-	-	-

券						
首创证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 1 月 12 日
2	华安可转换债券债券 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 1 月 19 日
3	华安基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 2 月 2 日
4	华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 12 日
5	华安可转换债券债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 27 日
6	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 27 日
7	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 4 月 22 日
8	华安可转债债券 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 4 月 22 日
9	华安可转债债券 A 类基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
10	华安可转债债券 B 类基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
11	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 19 日
12	华安可转债债券 2024 年第 2 季度报	中国证监会基金电子披	2024 年 7 月 19 日

	告	露网站及基金管理人网站	
13	关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 24 日
14	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 31 日
15	华安可转债 2024 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 31 日
16	华安基金管理有限公司关于暂停武汉市伯嘉基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 10 日
17	华安基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 12 日
18	关于终止中民财富基金销售(上海)有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 18 日
19	华安可转换债券债券型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
20	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
21	华安基金管理有限公司关于暂停上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 28 日
22	华安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 9 日
23	华安基金管理有限公司关于暂停北京展恒基金销售股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 13 日
24	华安基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 22 日
25	华安可转换债券债券型证券投资基金更新的招募说明书(2024 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 17 日
26	华安可转换债券债券型证券投资基金(华安可转债债券 A 类)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 17 日

27	华安可转换债券债券型证券投资基金（华安可转债债券 B 类）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 17 日
28	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 26 日
29	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 26 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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》
- 4、中国证监会批准华安可转换债券债券型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

13.2 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>。

13.3 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
2025 年 3 月 31 日