

# 华宝可转债债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 月 22 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 2026 年 04 月 20 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 2026 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华宝可转债债券
基金主代码	240018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 27 日
报告期末基金份额总额	1, 556, 468, 109. 39 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，主要通过可转债的投资，力争为基金份额持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金采用自上而下的宏观投资策略，通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，在固定收益类资产和权益类资产之间进行动态灵活配置。 本基金将采用定性与定量相结合的方法来构建可转债投资组合，重点投资价值被市场低估、发债公司具有较好发展潜力、基础股票具有较高上升预期的个券品

	种。 对于因可转债转股形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等资产，本基金应在其可交易（即不受锁定期等任何交易限制）之日起的三个月内卖出。该部分权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。		
业绩比较基准	标普中国可转债指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%		
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金，高于货币市场基金。本基金重点配置可转债（含分离交易可转债），在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。		
基金管理人	华宝基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华宝可转债债券	华宝可转债债券 C	华宝可转债债券 D
下属分级基金的交易代码	240018	008817	025259
报告期末下属分级基金的份额总额	484,852,625.86 份	493,453,799.72 份	578,161,683.81 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（2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 3 月 31 日）		
	华宝可转债债券	华宝可转债债券 C	华宝可转债债券 D
1. 本期已实现收益	46,574,838.05	60,567,326.36	75,096,641.91
2. 本期利润	5,546,130.04	26,072,383.83	-5,158,754.38
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0114	0.0414	-0.0069
4. 期末基金资产净值	946,680,610.56	948,681,410.96	1,128,875,707.07
5. 期末基金份额净值	1.9525	1.9225	1.9525

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝可转债债券

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.74%	1.36%	-0.62%	0.74%	1.36%	0.62%
过去六个月	-0.18%	1.10%	0.36%	0.58%	-0.54%	0.52%
过去一年	16.99%	0.99%	9.59%	0.53%	7.40%	0.46%
过去三年	21.08%	0.85%	16.15%	0.43%	4.93%	0.42%
过去五年	50.25%	0.88%	28.09%	0.42%	22.16%	0.46%
自基金合同 生效起至今	95.25%	1.11%	73.48%	0.72%	21.77%	0.39%

华宝可转债债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.68%	1.36%	-0.62%	0.74%	1.30%	0.62%
过去六个月	-0.31%	1.10%	0.36%	0.58%	-0.67%	0.52%
过去一年	16.70%	0.99%	9.59%	0.53%	7.11%	0.46%
过去三年	20.18%	0.85%	16.15%	0.43%	4.03%	0.42%
过去五年	48.39%	0.88%	28.09%	0.42%	20.30%	0.46%
自基金合同 生效起至今	65.06%	0.89%	34.90%	0.44%	30.16%	0.45%

华宝可转债债券 D

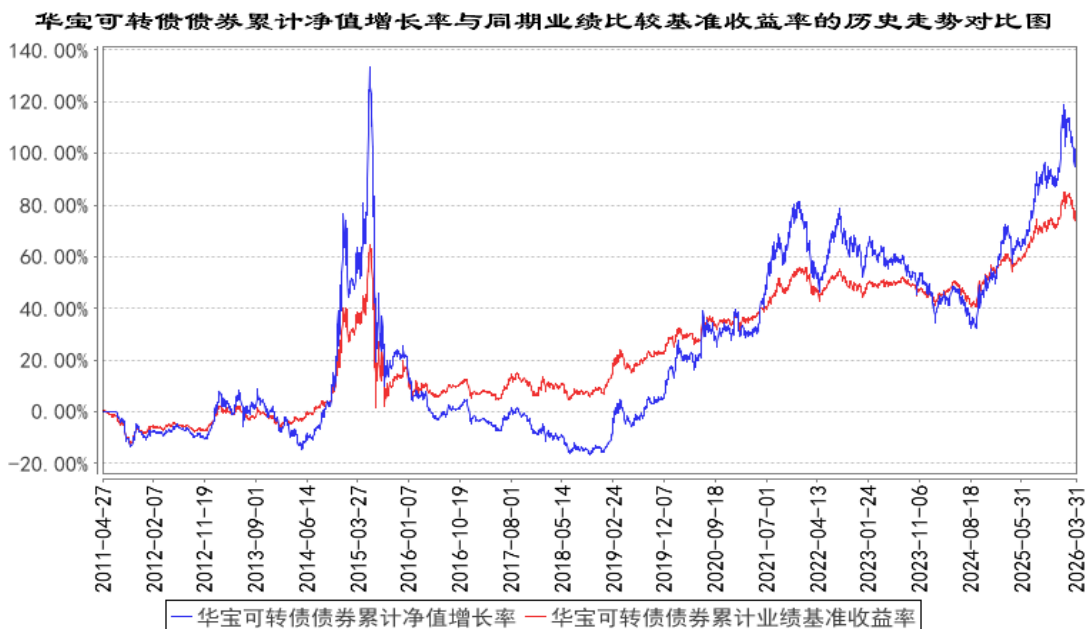
阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	0.74%	1.36%	-0.62%	0.74%	1.36%	0.62%
过去六个月	-0.19%	1.10%	0.36%	0.58%	-0.55%	0.52%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.92%	1.09%	1.01%	0.59%	2.91%	0.50%

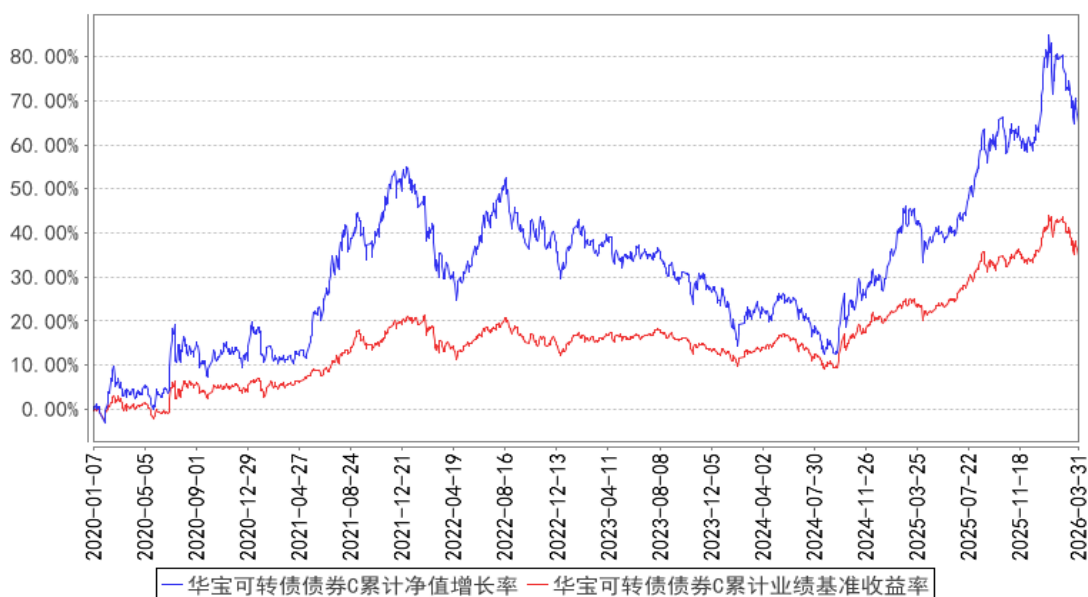
注：（1）基金业绩基准：标普中国可转债指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%；

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

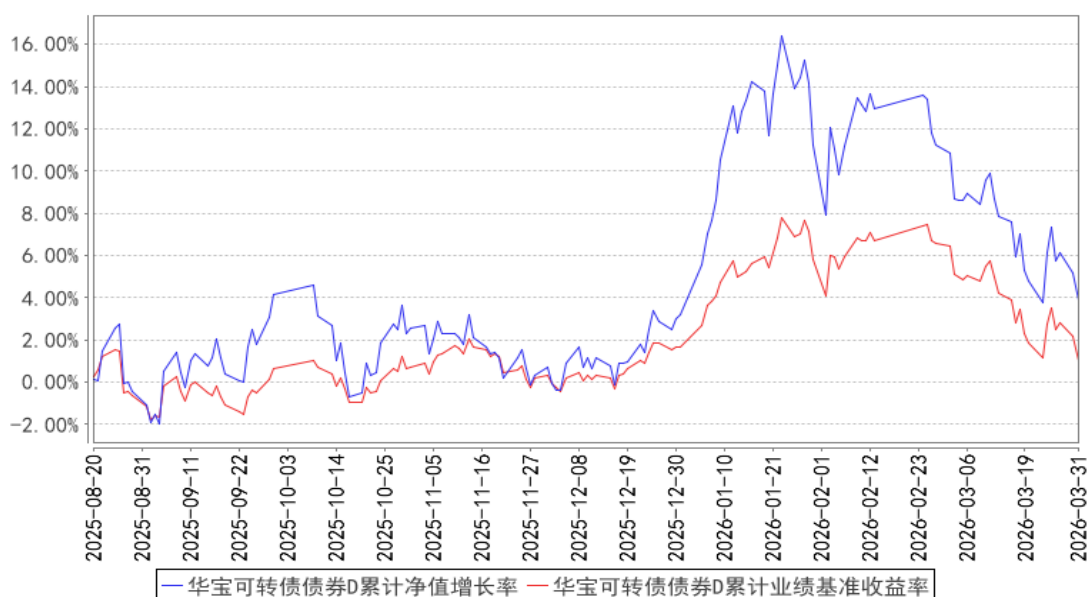
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



华宝可转债债券C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



华宝可转债债券D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



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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李栋梁	本基金基金经理、固定收益	2016-06-01	-	23 年	硕士。曾在国联证券有限责任公司、华宝信托有限责任公司和太平资产管理有限公司从事固定收益的证券研究和投资

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

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝可转债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下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% 的交易共有 2 次，系指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025 年 12 月中央经济工作会议召开，会议指出 2026 年要坚持稳中求进工作总基调，更好统筹国内经济工作和国际经贸斗争，更好统筹发展和安全，实施更加积极有为的宏观政策，增强政策前瞻性针对性协同性，持续扩大内需、优化供给，做优增量、盘活存量，因地制宜发展新质生产力，纵深推进全国统一大市场建设，持续防范化解重点领域风险，着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期，推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。会议指出，明年经济工作在政策取向上，要坚持稳中求进、提质增效，发挥存量政策和增量政策集成效应，加大逆周期和跨周期调

节力度，提升宏观经济治理效能。要继续实施更加积极的财政政策。保持必要的财政赤字、债务总规模和支出总量，要继续实施适度宽松的货币政策。把促进经济稳定增长、物价合理回升作为货币政策的重要考量，灵活高效运用降准降息等多种政策工具，保持流动性充裕，畅通货币政策传导机制，引导金融机构加力支持扩大内需、科技创新、中小微企业等重点领域。保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定。要增强宏观政策取向一致性和有效性。将各类经济政策和非经济政策、存量政策和增量政策纳入宏观政策取向一致性评估。健全预期管理机制，提振社会信心。

2026 年名义 GDP 增速有望回升，名义 GDP 增速回升的幅度取决于 GDP 增速和物价水平的上升幅度。1 到 2 月份国内经济数据较好，出口超预期，投资增速转正。春节以来油价大幅上涨，推升了通胀预期，油价的大幅上涨也可能抑制需求，油气等能源行业相对受益，中下游可能小幅受损，导致利润在不同行业之间重新分配。海外通胀水平的上升可能导致主要央行的货币政策转向。

1 季度债券市场中短端表现较好，收益率小幅下行，长债收益率先下后上，长债收益率主要受到海外油价大幅上涨的影响。1 季度股票市场先上涨后调整，成长板块年初表现较好，油价大幅上涨之后成长板块调整，能源板块上涨。转债和股票的走势基本一致，年初新增资金推升了转债的估值，随着股票市场的调整和少数个券的赎回，转债整体的价格水平下降，估值水平压缩。

基金年初保持了转债的配置，春节前后降低了转债的配置比例，减持了部分高价品种。3 月份转债调整之后小幅提升了转债的投资比例。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 0.74%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 0.68%，本报告期基金份额 D 类净值增长率为 0.74%；同期业绩比较基准收益率为-0.62%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,958,880,753.26	96.36
	其中：债券	2,958,880,753.26	96.36
	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	30,000,000.00	0.98
	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	22,564,019.10	0.73
8	其他资产	59,334,387.66	1.93
9	合计	3,070,779,160.02	100.00

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

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	177,963,000.27	5.88
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）	2,780,917,752.99	91.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	2,958,880,753.26	97.84
----	----	------------------	-------

### 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	113052	兴业转债	1,339,520	160,339,076.03	5.30
2	019785	25 国债 13	1,573,000	158,795,858.35	5.25
3	127089	晶澳转债	810,000	101,280,757.81	3.35
4	113696	伯 25 转债	751,730	99,709,508.39	3.30
5	127066	科利转债	544,412	79,548,288.21	2.63

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

#### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

#### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

华宝可转债债券截止 2026 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 兴业银行股份有限公司因未依法履行其他职责; 于 2025 年 07 月 11 日收到中国银行间市场交易商协会立案调查的处罚措施。

华宝可转债债券截止 2026 年 03 月 31 日持仓前十名证券的发行主体中, 兴业银行股份有限公司因外包机构管理不到位、企业划型不准确等; 于 2025 年 12 月 05 日收到金融监管总局罚款的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他分析, 认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响, 因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内, 本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	338,281.97
2	应收证券清算款	50,478,793.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,517,312.69
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	59,334,387.66

### 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	113052	兴业转债	160,339,076.03	5.30
2	127089	晶澳转债	101,280,757.81	3.35
3	113696	伯 25 转债	99,709,508.39	3.30
4	127066	科利转债	79,548,288.21	2.63
5	123107	温氏转债	78,061,967.54	2.58
6	110090	爱迪转债	74,729,476.26	2.47
7	113066	平煤转债	73,207,974.83	2.42
8	113692	保隆转债	67,572,776.77	2.23
9	123252	银邦转债	58,397,793.97	1.93
10	118003	华兴转债	58,365,267.19	1.93
11	127045	牧原转债	57,204,043.89	1.89
12	118025	奕瑞转债	57,012,528.77	1.89
13	113070	渝水转债	53,269,170.18	1.76
14	113652	伟 22 转债	52,188,096.70	1.73
15	123257	安克转债	52,039,662.95	1.72

16	118012	微芯转债	51,162,608.16	1.69
17	118024	冠宇转债	51,094,150.69	1.69
18	113648	巨星转债	49,438,042.88	1.63
19	127085	韵达转债	49,314,605.11	1.63
20	123237	佳禾转债	49,054,832.43	1.62
21	123253	永贵转债	46,943,077.45	1.55
22	111004	明新转债	44,992,516.44	1.49
23	111010	立昂转债	43,945,107.05	1.45
24	127095	广泰转债	43,593,690.09	1.44
25	123196	正元转 02	43,310,506.62	1.43
26	127026	超声转债	42,638,307.95	1.41
27	127067	恒逸转 2	42,232,520.55	1.40
28	111005	富春转债	41,645,591.64	1.38
29	123194	百洋转债	35,225,378.63	1.16
30	113673	岱美转债	35,071,156.16	1.16
31	113667	春 23 转债	34,788,273.44	1.15
32	123172	漱玉转债	34,307,317.71	1.13
33	123119	康泰转 2	34,163,605.84	1.13
34	127064	杭氧转债	33,649,317.90	1.11
35	113053	隆 22 转债	32,492,897.26	1.07
36	123258	胜蓝转 02	32,010,019.14	1.06
37	128136	立讯转债	31,798,819.18	1.05
38	113643	风语转债	31,694,740.47	1.05
39	127072	博实转债	30,361,488.85	1.00
40	118013	道通转债	29,891,242.96	0.99
41	113691	和邦转债	29,343,860.27	0.97
42	118057	甬矽转债	28,419,933.49	0.94
43	127049	希望转 2	28,022,503.46	0.93
44	127050	麒麟转债	27,682,677.68	0.92
45	127082	亚科转债	27,617,479.43	0.91
46	118022	锂科转债	27,468,082.52	0.91
47	127056	中特转债	25,060,547.95	0.83
48	113067	燃 23 转债	24,683,821.37	0.82
49	113644	艾迪转债	23,892,163.15	0.79
50	123225	翔丰转债	21,757,334.30	0.72
51	113654	永 02 转债	21,253,134.04	0.70
52	127104	姚记转债	20,624,718.37	0.68
53	123124	晶瑞转 2	19,942,426.03	0.66
54	111000	起帆转债	19,897,378.41	0.66
55	113062	常银转债	18,488,251.12	0.61
56	118042	奥维转债	18,463,224.53	0.61
57	113638	台 21 转债	17,191,540.95	0.57

58	113051	节能转债	16,882,426.21	0.56
59	123223	九典转 02	16,360,490.21	0.54
60	113660	寿 22 转债	14,753,436.65	0.49
61	113659	莱克转债	13,492,488.73	0.45
62	123254	亿纬转债	13,406,701.37	0.44
63	123179	立高转债	13,364,120.09	0.44
64	127108	太能转债	12,349,579.93	0.41
65	110087	天业转债	11,509,396.65	0.38
66	113046	金田转债	10,172,306.85	0.34
67	111021	奥锐转债	9,908,377.11	0.33
68	113056	重银转债	8,713,860.95	0.29
69	110093	神马转债	8,020,925.34	0.27
70	118004	博瑞转债	7,884,335.62	0.26
71	113048	晶科转债	7,365,152.71	0.24
72	118036	力合转债	6,924,384.78	0.23
73	127093	章鼓转债	6,712,872.60	0.22
74	123114	三角转债	5,415,618.46	0.18
75	113679	芯能转债	3,936,162.67	0.13
76	123071	天能转债	3,806,263.21	0.13
77	113656	嘉诚转债	3,124,174.66	0.10
78	127030	盛虹转债	3,046,754.19	0.10
79	127103	东南转债	2,018,697.28	0.07
80	127068	顺博转债	1,612,495.09	0.05
81	127038	国微转债	1,007,973.95	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**

本基金本报告期末未持有股票投资。

**5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	华宝可转债债券	华宝可转债债券 C	华宝可转债债券 D
报告期期初基金份额总额	484,887,594.72	658,878,403.41	614,998,100.55
报告期期间基金总申购份额	105,775,945.27	464,129,346.85	972,474,546.62
减：报告期期间基金总赎回份额	105,810,914.13	629,553,950.54	1,009,310,963.36
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	484,852,625.86	493,453,799.72	578,161,683.81
-------------	----------------	----------------	----------------

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20260203~20260204	318,447,866.36	91,440,654.71	289,344,985.48	120,543,535.59	7.74
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。</p> <p>在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p>							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝可转债债券型证券投资基金基金合同；

华宝可转债债券型证券投资基金招募说明书；

华宝可转债债券型证券投资基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

## 9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

## 9.3 查阅方式

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

华宝基金管理有限公司

2026 年 4 月 22 日