

银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 21 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 19 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 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 银华汇盈一年持有期混合 |
| 基金主代码 | 008833 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 3 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 721,976,754.85 份 |
| 投资目标 | 本基金通过把握股票市场、债券市场的投资机会，采用较灵活的资产配置策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金将采用定量和定性相结合的分析方法，结合对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的定性分析，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极主动地对股票、债券、金融衍生品和现金等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。</p> <p>本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0-40%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%；同业存单投资比例为基金资产的 0-20%。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%+中债综合指数（全价）收益率×85% |

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金及货币市场基金。本基金可投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 银华基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 银华汇盈一年持有期混合 A | 银华汇盈一年持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 008833 | 008834 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 639,799,911.59 份 | 82,176,843.26 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（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|---------------|
| | 银华汇盈一年持有期混合 A | 银华汇盈一年持有期混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 4,637,943.59 | 530,520.48 |
| 2. 本期利润 | 13,545,353.24 | 1,700,463.20 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0202 | 0.0184 |
| 4. 期末基金资产净值 | 699,191,673.39 | 89,165,990.34 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0928 | 1.0851 |

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。

2、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，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

银华汇盈一年持有期混合 A

| 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 | 1.86% | 0.11% | 0.35% | 0.11% | 1.51% | 0.00% |
| 过去六个月 | 2.67% | 0.14% | -0.37% | 0.15% | 3.04% | -0.01% |
| 过去一年 | 4.92% | 0.11% | 0.56% | 0.17% | 4.36% | -0.06% |

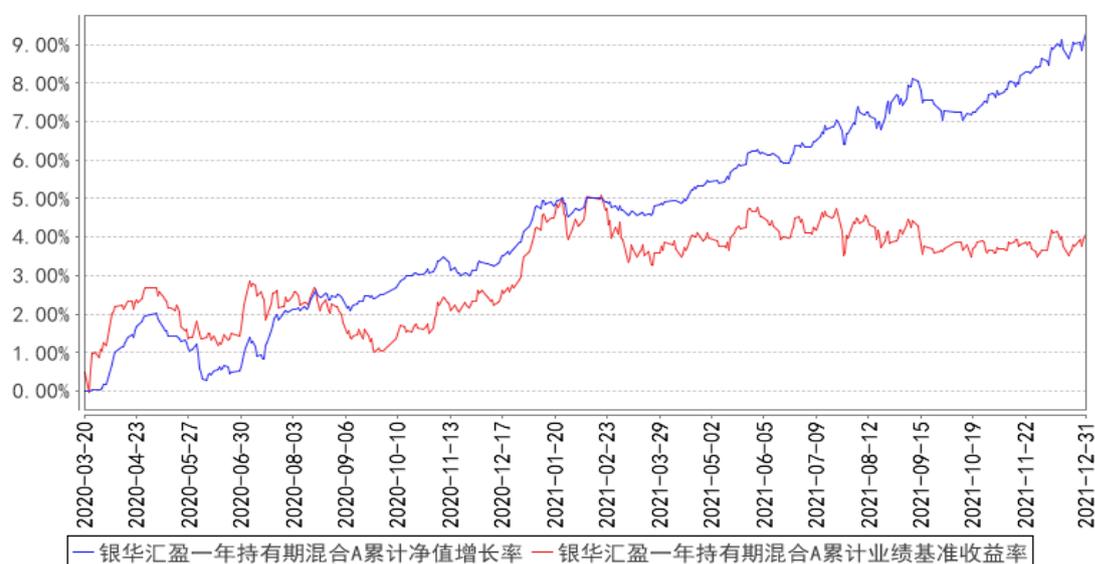
| | | | | | | |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 自基金合同 生效起至今 | 9.28% | 0.11% | 4.06% | 0.17% | 5.22% | -0.06% |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|

银华汇盈一年持有期混合 C

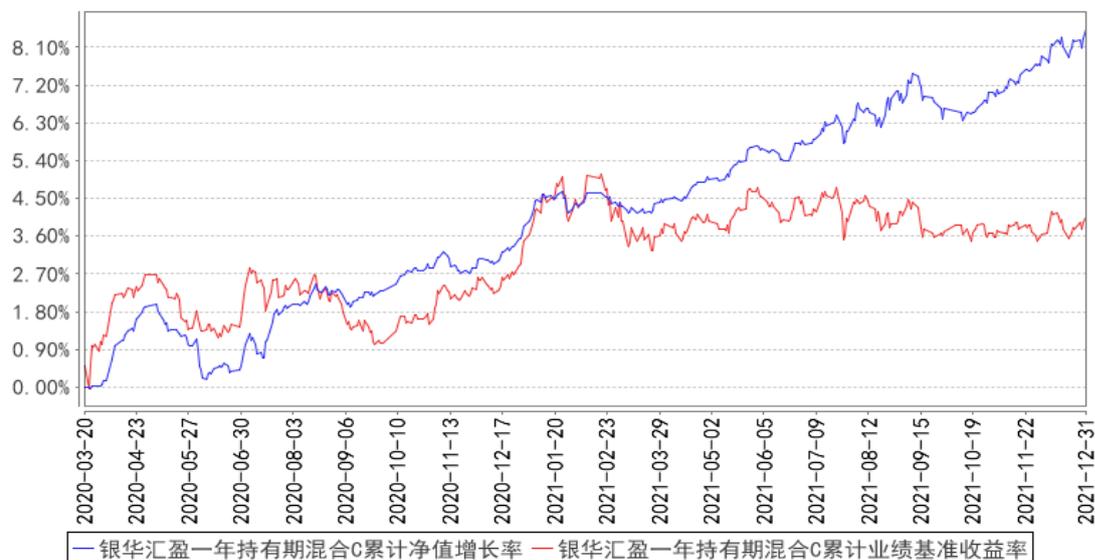
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准 差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.76% | 0.11% | 0.35% | 0.11% | 1.41% | 0.00% |
| 过去六个月 | 2.47% | 0.14% | -0.37% | 0.15% | 2.84% | -0.01% |
| 过去一年 | 4.50% | 0.11% | 0.56% | 0.17% | 3.94% | -0.06% |
| 自基金合同 生效起至今 | 8.51% | 0.11% | 4.06% | 0.17% | 4.45% | -0.06% |

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

银华汇盈一年持有期混合A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



银华汇盈一年持有期混合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图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资比例为基金资产的 0-40%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%；同业存单投资比例为基金资产的 0-20%。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

§ 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 | | |
| 边慧女士 | 本基金的基金经理 | 2021年3月26日 | - | 10.5年 | 硕士学位。曾就职于中国中投证券有限责任公司，2016年12月加入银华基金，曾任投资管理三部基金经理助理。现任投资管理三部基金经理兼基金经理助理。自2021年3月26日起担任银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 李丹女士 | 本基金的基金经理 | 2021年5月27日 | - | 8.5年 | 硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司。2015年4月加入银华基金，历任投资管理三部固收研究部宏观利率研究员、投资管理三部基金经理助理，现任投资管理三部基金经理兼基金经理助理。自2020年10月20日至2021年10月18日担任银华岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理，自2021年2月23日起兼 |

| | | | | | |
|-------|----------|------------------|---|--------|---|
| | | | | | 任银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 3 月 24 日起兼任银华信用季季红债券型证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金及银华添泽定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 27 日起兼任银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月 23 日起兼任银华华茂定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 王智伟先生 | 本基金的基金经理 | 2021 年 10 月 28 日 | - | 12.5 年 | 硕士学位。曾就职于天相投资顾问有限公司、中国证券报有限责任公司、方正证券股份有限公司，2015 年 6 月加盟银华基金管理有限公司，曾任基金经理助理职务。自 2016 年 7 月 26 日至 2019 年 7 月 5 日担任银华合利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 7 月 26 日至 2019 年 3 月 2 日兼任银华双动力债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 7 月 30 日兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 11 月 20 日起兼任银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 27 日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 28 日起兼任银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 23 日起兼任银华汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年四季度，供给约束边际缓解，但需求端地产拖累加深，疫情扰动仍在，经济仍处偏弱格局。从生产端来看，工业增加值两年平均增速由 9 月的 5.0% 回升至 11 月的 5.4%，保供顺价政策措施令供给约束有所减轻；服务业生产指数两年平均增速由 9 月的 5.3% 略升至 11 月的 5.5%。从需求端来看，固定资产投资两年平均增速由 1-9 月的 4% 降至 1-11 月的 3.9%，其中地产链条下行压力从销售和拿地环节向投资端传导，基建投资维持低迷，唯制造业投资延续修复，可能受到前期利润增长较快的滞后性拉动。社会消费品零售总额两年平均增速由 9 月的 3.8% 回升至 11 月的 4.4%，国内疫情反复对消费的冲击较三季度稍有缓解，但仍构成一定拖累，11 月餐饮收入同比仍为负增长。美元计价的出口金额两年平均增速由 9 月的 18.4% 上升至 11 月的 21.3%，出口维持较强表现。就业方面，城镇调查失业率由 9 月的 4.9% 略升至 11 月的 5%，而历史同期变化多为小

幅下降，指向就业压力边际有所增加。物价方面，11 月 CPI 同比较 9 月上升 1.6 个百分点至 2.3%，主要受到食品价格阶段性上涨影响，核心 CPI 同比仍维持在 1.2% 的低位；11 月 PPI 同比较 9 月上升 2.2 个百分点至 12.9%，但较 10 月回落 0.6 个百分点，随着保供顺价政策取得一定成效，PPI 同比读数或已见顶。总体来看，中央经济工作会议指出经济面临“需求收缩、供给冲击、预期转弱”三重压力，目前供给约束边际有所减轻，但内需和预期方面的弱势格局可能尚待逆转。

2021 年四季度，债券收益率呈现先上后下走势，整体较三季度末有所下行，货币宽松预期的变化可能是影响收益率走势的主导因素。10 月前两句，全球工业品价格上涨，市场对通胀担忧上升，同时央行金融数据发布会表态降低了市场的降准预期，收益率出现一轮快速上行。但此后资金面维持平稳，市场情绪逐渐修复。同时，地产链条压力显性化，宏观政策基调开始向稳增长倾斜，总理提出降准并迅速落地，都令市场对货币进一步宽松的预期升温，债券收益率震荡下行。四季度各债券品种收益率均有下行，利率债方面，短端的 1 年国债收益率较三季度末下行 9bp 至 2.24%，1 年国开债收益率下行 8bp 至 2.32%；长端的 10 年国债收益率下行 10bp 至 2.78%，10 年国开债收益率下行 11bp 至 3.08%；信用债方面，1、3、5 年 AAA 中票收益率分别下行 10bp、28bp、25bp，1、3、5 年 AA+ 中票收益率分别下行 12bp、25bp、21bp，1、3、5 年 AA 中票收益率分别下行 15bp、24bp、22bp。

权益市场方面，2021 年第 4 季度，市场风格再次出现变化，供给驱动的价格型板块快速回调，前期受到压制的中游制造业企稳反弹，同时消费板块也通过提价向下游传导成本压力，板块修复式上涨。数个新的赛道再次成为市场关注热点，汽车电子、元宇宙、军工、农业在 Q4 表现强势。临近年底，逆周期预期也逐步强化，地产、金融、建筑建材等相继企稳反弹。

四季度，本基金在债券配置上采取中性久期、适度杠杆的票息策略，根据市场变化不断优化持仓结构，并始终严格控制信用风险敞口。本基金在权益配置上继续维持消费、科技为主的配置，前期周期板块参与较少，回调也没有参与。金融板块相对安全，加仓了地产和非银行业的龙头。消费板块增配了食品子行业和农业，科技板块则是加仓了军工。对于光伏、电动车等做了适当减仓。

展望后市，中央经济工作会议定调后，政策重心将会把稳增长放在更加突出位置。2022 年一季度既是从基数角度来看增长压力较大的季度，同时也是将财政、货币、产业等政策密集出台的时间窗口。短期经济数据有一定走弱压力，但出口韧性仍存，经济失速风险不大，资本市场对于政策边际变化的关注程度远超当前经济实际表现。考虑到高层仍强调“跨周期和逆周期宏观调整政策有机结合”“处理好当前和长远、总量和结构、速度和效益的关系”，经济大起大落的风险有所降低，而市场对于政策的解读和预期的摇摆可能会使得各类资产在估值都不算低的背景下波

动有所加大。当然，我们也需要理性地看待本轮稳增长发力期，在新旧经济动能切换的背景下，经济增长中枢以及因此带来的无风险利率中枢的下移或不可避免。短期，我们需要持续跟踪并评估出口韧性+积极财政能够多大程度上对冲地产链条的惯性下行，以及相机抉择下这些经济部门的表现是否会受到一些超预期政策的刺激。此外，新冠疫情的不断反复仍在持续扰动全球供应链，国内通胀压力或较 2021 年有所缓解，但全球范围内的通胀压力演变以及对于海外货币政策的影响仍要保持一份关注。

货币政策有望维持温和宽松，流动性延续合理充裕状态，但宽松方式和节奏仍有不确定性。近年，央行价格型调控手段对债券市场短端引导的有效性是在不断增强的，目前的资金面仍处在对央行操作依赖度不低的阶段，资金利率围绕政策利率波动仍将是常态。因此，货币政策取向是决定年内收益率下行空间的关键因素。

我们认为 2022 年的债券市场仍然存在投资机会，但操作难度或较 2021 年明显加大，2022 年的债券市场对于投资者的宏观分析能力、政策分析应对能力、交易能力等都提出更高的要求。操作上，把握票息确定性的同时，仍需要采取逆向思维，在波动中寻找收益。策略上，本基金将维持适度杠杆水平，采取中性久期，在严格控制信用风险的前提下，对组合配置进行优化调整。

权益市场方面，展望 2022 年第 1 季度，经济动能趋缓，但逆周期预期强化，且有望见到自上而下动作落地。预计股票市场仍会是结构分化的走势，前期强势的成长主线也会出现一定轮动，需求确定性高的赛道和自主替代将有较好表现。逆周期板块的配置仍不高，且基本面预期有望逐步改善，也有一定的增配价值。第 1 季度，本基金将对安全边际看的更为重要，组合的配置也将更加均衡化，对乐观预期较满的高位行业适度谨慎，而对前期回调较多且有望出现边际改善的板块更加关注。

此外，我们以增厚性策略的思路看待可转债资产，积极探索多种策略，充分利用转债风险收益特征在控制波动的同时增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华汇盈一年持有期混合 A 基金份额净值为 1.0928 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.86%；截至本报告期末银华汇盈一年持有期混合 C 基金份额净值为 1.0851 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.76%；同期业绩比较基准收益率为 0.35%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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数量不满二百人或者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 | 98,193,914.54 | 9.97 |
| | 其中：股票 | 98,193,914.54 | 9.97 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 857,218,845.72 | 87.00 |
| | 其中：债券 | 857,218,845.72 | 87.00 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 18,842,840.61 | 1.91 |
| 8 | 其他资产 | 11,064,183.45 | 1.12 |
| 9 | 合计 | 985,319,784.32 | 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 | 747,840.00 | 0.09 |
| B | 采矿业 | 4,305,032.96 | 0.55 |
| C | 制造业 | 60,645,169.86 | 7.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,373,559.00 | 0.43 |
| E | 建筑业 | 758,466.80 | 0.10 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,239,089.91 | 0.41 |
| J | 金融业 | 14,324,264.00 | 1.82 |
| K | 房地产业 | 6,960,437.00 | 0.88 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,465,867.34 | 0.31 |
| 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 | 1,374,187.67 | 0.17 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 98,193,914.54 | 12.46 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 2,900 | 5,945,000.00 | 0.75 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 101,300 | 4,934,323.00 | 0.63 |
| 3 | 601012 | 隆基股份 | 53,531 | 4,614,372.20 | 0.59 |
| 4 | 600048 | 保利发展 | 275,200 | 4,301,376.00 | 0.55 |
| 5 | 603979 | 金诚信 | 164,052 | 3,523,836.96 | 0.45 |
| 6 | 002179 | 中航光电 | 34,770 | 3,496,471.20 | 0.44 |
| 7 | 002025 | 航天电器 | 40,000 | 3,358,000.00 | 0.43 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 125,700 | 3,319,737.00 | 0.42 |
| 9 | 601799 | 星宇股份 | 15,600 | 3,186,300.00 | 0.40 |
| 10 | 688608 | 恒玄科技 | 9,786 | 2,984,730.00 | 0.38 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 294,027,000.00 | 37.30 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,194,000.00 | 6.37 |
| 4 | 企业债券 | 102,926,000.00 | 13.06 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 384,509,000.00 | 48.77 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 75,756,845.72 | 9.61 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 857,218,845.72 | 108.73 |

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 | 2028041 | 20 工商银行二级 01 | 500,000 | 51,865,000.00 | 6.58 |

| | | | | | |
|---|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| 2 | 1928004 | 19 农业银行 二级 02 | 400,000 | 41,432,000.00 | 5.26 |
| 3 | 102002050 | 20 苏国信 MTN008 | 400,000 | 40,656,000.00 | 5.16 |
| 4 | 102100807 | 21 光明 MTN001 | 400,000 | 40,632,000.00 | 5.15 |
| 5 | 102102263 | 21 京国资 MTN002 | 400,000 | 40,248,000.00 | 5.11 |

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

注：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

注：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

注：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股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券包括 20 海通 06（证券代码：163568）。

根据海通证券 2021 年 9 月 8 日披露的公告，该公司收到中国证监会《立案告知书》和《调查通知书》。

上述处罚信息公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司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证券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。

5.11.2 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没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 40,763.40 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,023,420.05 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,064,183.45 |

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 | 113044 | 大秦转债 | 20,793,600.00 | 2.64 |
| 2 | 113037 | 紫银转债 | 15,202,600.00 | 1.93 |
| 3 | 113033 | 利群转债 | 7,685,054.40 | 0.97 |
| 4 | 110053 | 苏银转债 | 7,101,600.00 | 0.90 |
| 5 | 123111 | 东财转 3 | 2,354,520.00 | 0.30 |
| 6 | 128116 | 瑞达转债 | 2,056,939.20 | 0.26 |
| 7 | 127005 | 长证转债 | 2,040,802.05 | 0.26 |
| 8 | 113024 | 核建转债 | 1,696,370.00 | 0.22 |
| 9 | 113606 | 荣泰转债 | 1,279,500.00 | 0.16 |
| 10 | 123046 | 天铁转债 | 1,116,786.00 | 0.14 |
| 11 | 113048 | 晶科转债 | 792,264.00 | 0.10 |
| 12 | 127026 | 超声转债 | 526,348.91 | 0.07 |
| 13 | 123099 | 普利转债 | 433,551.16 | 0.05 |
| 14 | 123035 | 利德转债 | 432,050.00 | 0.05 |
| 15 | 123071 | 天能转债 | 427,220.00 | 0.05 |
| 16 | 128121 | 宏川转债 | 411,030.00 | 0.05 |
| 17 | 128140 | 润建转债 | 408,675.00 | 0.05 |
| 18 | 123107 | 温氏转债 | 404,940.00 | 0.05 |
| 19 | 123067 | 斯莱转债 | 395,415.00 | 0.05 |
| 20 | 123085 | 万顺转 2 | 392,575.00 | 0.05 |
| 21 | 128078 | 太极转债 | 383,800.00 | 0.05 |
| 22 | 118000 | 嘉元转债 | 379,980.00 | 0.05 |
| 23 | 127024 | 盈峰转债 | 367,620.00 | 0.05 |
| 24 | 123050 | 聚飞转债 | 355,100.00 | 0.05 |
| 25 | 128123 | 国光转债 | 338,940.00 | 0.04 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 26 | 113619 | 世运转债 | 140,440.00 | 0.02 |
|----|--------|------|------------|------|

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 银华汇盈一年持有期混合 A | 银华汇盈一年持有期混合 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 580,722,302.62 | 104,530,376.37 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 148,221,758.10 | 5,644,018.57 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 89,144,149.13 | 27,997,551.68 |
| 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 | 639,799,911.59 | 82,176,843.26 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人于本报告期末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

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2021 年 12 月 24 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》，本基金自 2021 年 12 月 24 日起可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 9.1.2 《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 9.1.4 《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 9.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的住所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2022 年 1 月 21 日