

# 银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 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 7 月 19 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 07 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 04 月 01 日起至 06 月 30 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	590,989,297.70 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	529,670,924.14 份	61,318,373.56 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 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	1,024,454.16	51,259.64
2. 本期利润	8,795,726.09	963,076.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0161	0.0146
4. 期末基金资产净值	573,294,064.94	65,765,368.35
5. 期末基金份额净值	1.0824	1.0725

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	1.55%	0.17%	1.19%	0.22%	0.36%	-0.05%
过去六个月	-0.95%	0.18%	-0.54%	0.24%	-0.41%	-0.06%
过去一年	1.69%	0.16%	-0.91%	0.20%	2.60%	-0.04%
自基金合同	8.24%	0.13%	3.50%	0.19%	4.74%	-0.06%

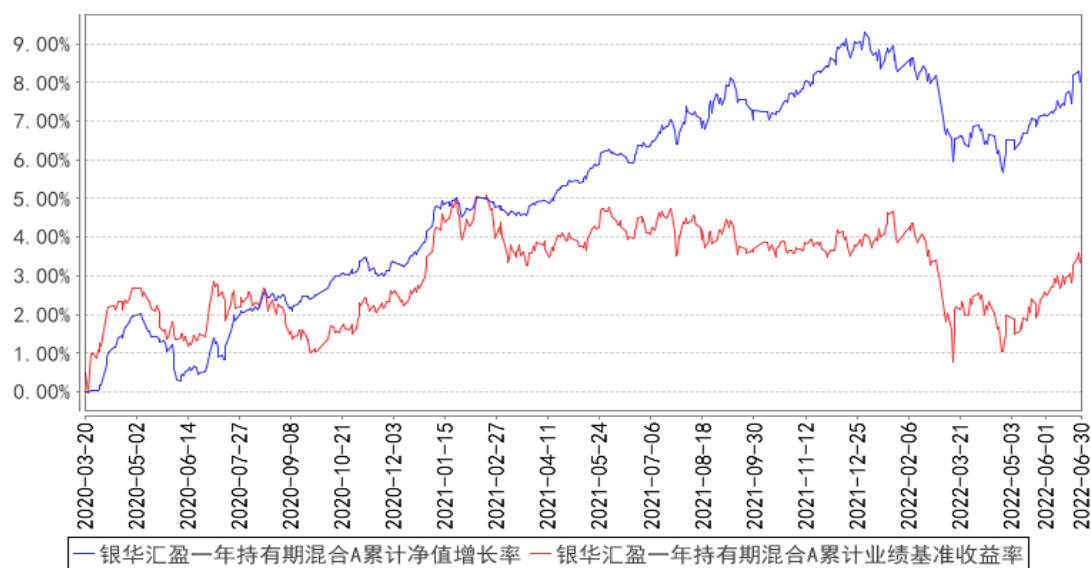
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

银华汇盈一年持有期混合 C

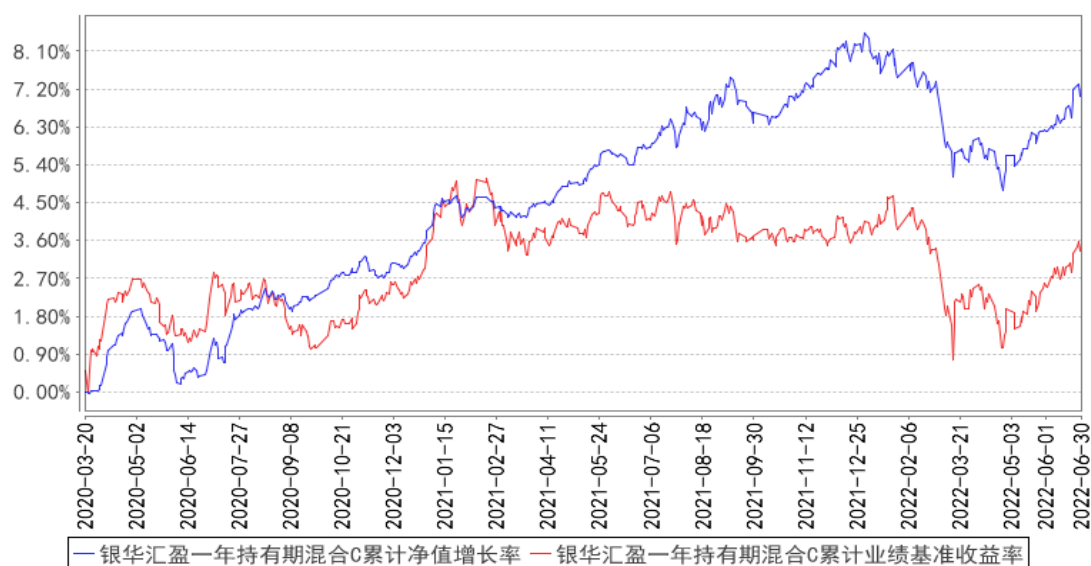
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.44%	0.16%	1.19%	0.22%	0.25%	-0.06%
过去六个月	-1.16%	0.18%	-0.54%	0.24%	-0.62%	-0.06%
过去一年	1.28%	0.16%	-0.91%	0.20%	2.19%	-0.04%
自基金合同生效起至今	7.25%	0.13%	3.50%	0.19%	3.75%	-0.06%

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对比图



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，自2022年2月23日起兼任银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华信用精选18个月定期开放债券型证券投资基金、银华信用精选15个月定期开放债券型证券投资基金、银华信用精选两年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。
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

				<p>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。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 日至 2022 年 1 月 25 日兼任银华添泽定期开放债券型证券投资基金基金经理, 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, 自 2022 年 1 月 26 日兼任银华永盛债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍: 中国。</p>	
王智伟先生	本基金的基金经理	2021 年 10 月 28 日	-	12.5 年	<p>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, 自 2022 年 7 月 4 日起兼任银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇益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。</p>

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合规守信情况的说明

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

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去一个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

##### 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不存在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。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年二季度经济主要受到疫情影响,先下后上,波动较大。具体来看,4月经济受疫情影响严重,停工停产、物流和供应链受阻、线下需求场景缺失等因素对供需两端都形成巨大冲击,工业增加值(当月同比-2.9%)、社会消费品零售总额(当月同比-11.1%)、商品房销售面积(当月同比-39%)等数据的负增长幅度仅次于2020年疫情时期,出口同比增速也较3月大幅回落10.7个百分点至3.9%。5月全国疫情形势趋向改善,政策层着力缓解物流梗阻,并逐步推动复工复产。积压订单集中释放带动5月出口增速大幅反弹至16.9%,基建投资在政策支持下也表现较强。不过5月上海尚未解封,北京也出现一轮疫情,5月社会消费品零售总额同比增速-6.7%,仍然受到疫情压制,同时5月商品房销售面积同比增速-31.8%仍较低迷。进入6月,上海解封并全面推动复工复产,叠加政策环境宽松,经济继续修复。从6月PMI数据看,生产指数回升3.1个点至52.8,

新订单指数回升 2.2 个点至 50.4，相比 5 月明显进一步恢复，生产恢复快于需求。此外，5 月以来地产政策出现显著变化，全国平均房贷利率快速下降至历史低点附近，诸多城市也对限购限贷政策有所调整。6 月 30 大中城市商品房成交面积同比跌幅显著收窄（剔除数据异常的青岛市后，同比跌幅由 5 月的-52.1%收窄至-27.5%），可能反映出地产政策调整有所成效。物价方面，CPI 同比读数由 3 月的 1.5%升至 5 月的 2.1%，核心 CPI 同比由 3 月的 1.1%降至 5 月的 0.9%，内需动能不强继续压制核心通胀；PPI 同比读数由 3 月的 8.3%降至 5 月的 6.4%，在高基数下如期回落。

2022 年二季度，债券收益率呈先下后上走势。自 4 月开始，银行间资金面持续处于高度宽松状态，4-6 月 R001 均值分别为 1.54%、1.43%、1.55%，DR007 均值分别为 1.82%、1.63%、1.72%。央行实施降准、财政开展大规模留抵退税等因素增大了超储供给，可能是直接原因，但央行容忍资金利率长时间偏离政策利率，可能也体现出了在疫情冲击下的呵护意图。4 月至 5 月间，资金面宽松是驱动债市走势的核心因素，债券收益率陡峭化下行。自 5 月末开始，随着疫情形势缓解、上海解封并全面推动复工复产，市场风险偏好得到提升，隔夜回购利率也出现一定抬升，带动债券收益率由降转升。6 月最后一周，市场关注到地产成交高频数据回暖，债券收益率继续有所上行。整体来看，二季度债券收益率与经济表现一样，也呈现先下后上走势。不过债券市场对宽松的资金面较为敏感，拐点相对滞后，同时短端表现好于长端，信用债表现好于利率债。利率债方面，短端的 1 年国债收益率较一季度末下行 18bp 至 1.95%，1 年国开债收益率下行 27bp 至 2.02%；长端的 10 年国债收益率上行 3bp 至 2.82%，10 年国开债收益率上行 1bp 至 3.05%；信用债方面，1、3、5 年 AAA 中票收益率分别下行 27bp、13bp、15bp，1、3、5 年 AA+中票收益率分别下行 29bp、17bp、19bp，1、3、5 年 AA 中票收益率分别下行 32bp、30bp、25bp。二季度，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。

权益市场方面，今年 1-4 月，受多重因素影响，市场整体趋势性下跌，其中成长风格受到估值和业绩前景双重压制，调整幅度较消费、金融和周期风格更深。尤其是 4 月份国内疫情再次发酵，市场出现二次反复。但 5 月以来，随着国内疫情好转以及海外通胀预期见顶影响，市场整体快速反弹，至 6 月份，已经出现成长、消费、金融、周期先后轮动及扩散的迹象。二季度，本基金适当提高了权益仓位，但配置结构变化不大，还是集中在消费、成长和金融方向，周期依然相对较少。

三季度，宏观经济进入疫情扰动后的修复期。目前来看，基建仍是稳增长的主要抓手，政策层通过调增政策性银行 8000 亿元信贷额度、运用政策性和开发性金融工具筹资 3000 亿元用于补充重大项目资本金或为专项债项目资本金搭桥、提前储备 2023 年专项债项目等方式不断提升对基



建端的支持力度。而地产链条的走势也进入政策放松后的重要观察期，在 4 月 29 日政治局会议提出“支持各地从当地实际出发完善房地产政策，支持刚性和改善性住房需求”的背景下，5 月以来地产政策出现较为实质性的放松。从高频数据观察，6 月以来 30 大中城市商品房成交数据增速出现回升，一定程度上反映出了地产政策放松的效果，但受到居民收入增速放缓、民企地产企业信用风险事件频发等因素影响，地产销售反弹的高度仍存在不确定。后续需要通过信贷社融数据、建筑业链条高频数据等多方面对其表现进行交叉验证。短期来看，在复工复产和宽松政策环境的作用下，三季度经济修复是大概率事件。不过与 2020 年疫后复苏相比，经济修复的高度可能面临至少两大制约因素。一是疫情反复的风险难以完全消除。二是外需回落压力可能逐渐显现。随着美联储坚决加息以遏制通胀，美国金融条件快速收紧，经济动能开始走弱，中美经济周期的错位增加了下半年经济复苏的不确定性。

货币政策有望维持偏宽松环境，但暂难形成增量利好。在前期构成较大规模流动性供给的留抵退税因素结束后，货币当局的态度和货币政策的操作对金融市场流动性的影响程度将上升，资金面面临的潜在波动或有所增加。

展望三季度债券市场，我们认为把握票息确定性的同时，需要适度采取逆向思维，在波动中寻找机会。相比于 2020 年，2022 年的债券收益率波动区间较窄，可能存在多方面原因：一是货币政策相对克制；二是市场对于稳增长政策的空间和效果始终存在预期，对于 2020 年行情反转的记忆深刻，因此持续处于“短多长空”的心态，收益率曲线陡峭化显著，多数 3 年以上债券品种今年以来收益率并未下行；三是政策需要兼顾疫情防控、稳增长和防风险等多方面，国内外政策和经济周期也存在错位，使得基本面形势较为复杂。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，展望三季度，国内经济企稳存在进一步强化的可能，而货币政策宽松预期反应的则相对比较充分。总体来看，经过二季度快速反弹，权益市场波动可能会有所加大，市场将更看重分子端的增长动能持续性和兑现度。第三季度，本基金将对组合的配置进行优化，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。

转债投资方面，2022 年初转债估值不断抬升接近历史高点，本基金谨慎看待该类资产大幅降低仓位，基本规避了后续市场波动对组合净值的拖累；二季度转债估值阶段性大幅收敛，中长期配置价值小幅提升，不过出于控制组合整体权益风险敞口的需要，本基金继续维持中性偏低仓位。未来我们仍以增厚性策略看待转债资产，灵活调整仓位，挖掘行业及个券机会，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 1.0824 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.55%；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 1.0725 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.44%；业绩比较基准收益率为 1.19%。

#### 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	93,968,619.07	12.13
	其中：股票	93,968,619.07	12.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	670,981,995.31	86.59
	其中：债券	670,981,995.31	86.59
	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	6,744,198.24	0.87
8	其他资产	3,193,989.94	0.41
9	合计	774,888,802.56	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	2,499,559.00	0.39
B	采矿业	4,270,684.12	0.67
C	制造业	50,763,752.57	7.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,564,814.00	0.56
F	批发和零售业	1,680,802.00	0.26
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	1,304,800.00	0.20
J	金融业	20,721,201.00	3.24
K	房地产业	3,291,135.00	0.51
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	88,096,747.69	13.79

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	1,826,856.88	0.29
消费者常用品	1,420,043.00	0.22
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	1,442,962.09	0.23
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	1,182,009.41	0.18
公用事业	-	-
地产建筑业	-	-
合计	5,871,871.38	0.92

### 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	601658	邮储银行	1,747,400	9,418,486.00	1.47
2	600519	贵州茅台	3,600	7,362,000.00	1.15
3	300059	东方财富	206,900	5,255,260.00	0.82
4	600036	招商银行	101,300	4,274,860.00	0.67
5	300750	宁德时代	8,000	4,272,000.00	0.67
6	600809	山西汾酒	12,720	4,131,456.00	0.65
7	600491	龙元建设	522,700	3,564,814.00	0.56
8	603979	金诚信	164,052	3,167,844.12	0.50
9	002179	中航光电	47,997	3,039,170.04	0.48
10	603218	日月股份	115,200	2,926,080.00	0.46

#### 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	370,113,901.92	57.92
	其中：政策性金融债	41,106,684.93	6.43
4	企业债券	31,785,835.07	4.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	256,004,381.37	40.06
7	可转债（可交换债）	13,077,876.95	2.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	670,981,995.31	105.00

#### 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	102002050	20 苏国信 MTN008	400,000	41,575,217.53	6.51
2	200312	20 进出 12	400,000	41,106,684.93	6.43
3	163568	20 海通 06	400,000	40,199,583.56	6.29
4	2028041	20 工商银行二级 01	300,000	31,958,260.27	5.00
5	2128028	21 邮储银行二级 01	300,000	30,978,718.36	4.85

#### 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	53,232.35
2	应收证券清算款	3,097,472.27
3	应收股利	25,240.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,045.13
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,193,989.94

### 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	113052	兴业转债	2,233,430.69	0.35
2	113044	大秦转债	2,181,161.64	0.34
3	113037	紫银转债	2,077,621.37	0.33
4	110061	川投转债	702,542.47	0.11
5	110052	贵广转债	697,138.03	0.11
6	127039	北港转债	675,357.05	0.11
7	110083	苏租转债	665,784.34	0.10
8	113545	金能转债	657,349.32	0.10
9	113033	利群转债	656,576.71	0.10
10	123125	元力转债	648,974.23	0.10

11	113048	晶科转债	638,978.08	0.10
12	127018	本钢转债	589,982.88	0.09

### 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	564,561,876.84	69,718,567.23
报告期期间基金总申购份额	886,807.52	563,786.90
减：报告期期间基金总赎回份额	35,777,760.22	8,963,980.57
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	529,670,924.14	61,318,373.56

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

无。

## § 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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2022 年 7 月 19 日