

银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

2022 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：2023 年 1 月 20 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 2023 年 01 月 18 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 10 月 01 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	439,199,631.69 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	395,428,136.90 份	43,771,494.79 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 10 月 1 日-2022 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	1,104,092.06	68,590.33
2. 本期利润	-6,947,100.15	-847,706.80
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0163	-0.0174
4. 期末基金资产净值	417,454,209.71	45,697,302.77
5. 期末基金份额净值	1.0557	1.0440

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	-1.50%	0.23%	0.41%	0.23%	-1.91%	0.00%
过去六个月	-2.47%	0.20%	-1.47%	0.19%	-1.00%	0.01%
过去一年	-3.39%	0.19%	-2.00%	0.21%	-1.39%	-0.02%

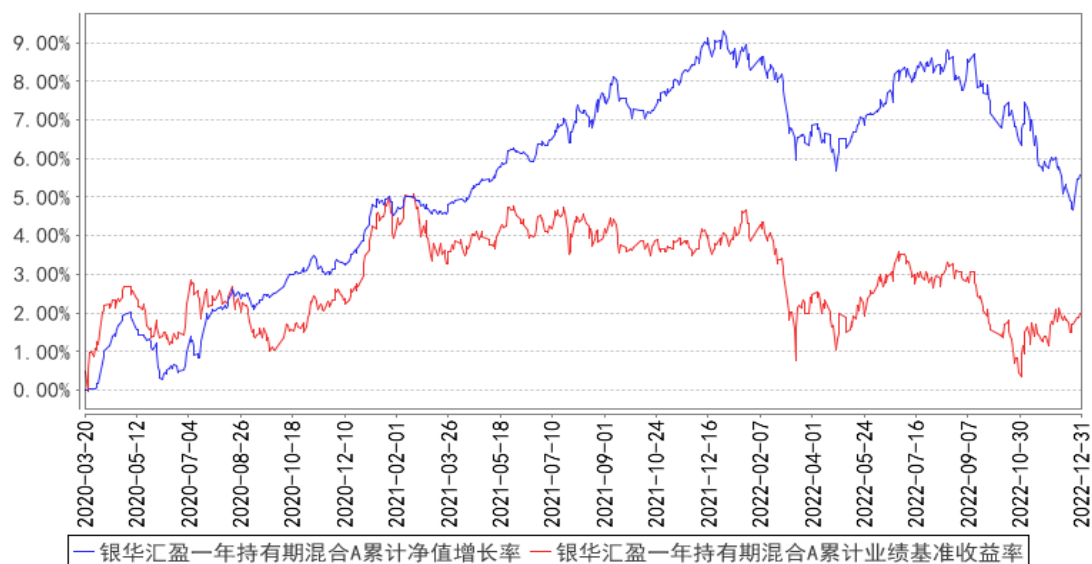
自基金合同生效起至今	5.57%	0.14%	1.98%	0.19%	3.59%	-0.05%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

银华汇盈一年持有期混合 C

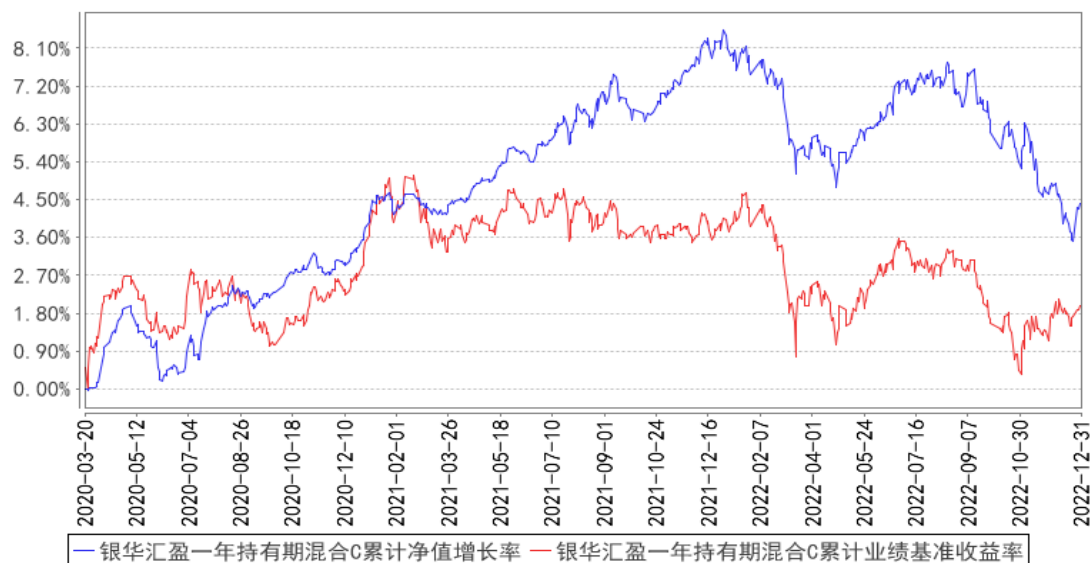
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.60%	0.23%	0.41%	0.23%	-2.01%	0.00%
过去六个月	-2.66%	0.20%	-1.47%	0.19%	-1.19%	0.01%
过去一年	-3.79%	0.19%	-2.00%	0.21%	-1.79%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.40%	0.14%	1.98%	0.19%	2.42%	-0.05%

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	-	11.5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	-	9.5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，自 2022 年 9 月 8 日起兼任银华绿色低碳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	-	<p>13.5 年</p> <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，自</p>

					2022 年 9 月 29 日起兼任银华多元机遇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 12 次,原因是量化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

2022 年四季度,地产和疫情管控政策出现密集调整,但在疫情冲击下经济短期承压加重,形成了“强预期”和“弱现实”高度分化的格局。地产政策方面,11 月 8 日交易商协会提出扩大民营企业债券融资支持工具(即“第二支箭”)以支持包括房企在内的民企发债融资,11 月 23 日央行和银保监会发布支持房地产平稳健康发展的“金融十六条”,11 月 28 日证监会宣布放松房企股权融资限制(即“第三支箭”),中央经济工作会议也提出要“有效防范化解优质头部房企

风险，改善资产负债状况”，显示出地产政策开始在“保企业”方向上实质加力。疫情管控政策方面，国务院联防联控机制先后于 11 月 11 日和 12 月 7 日发布“二十条”和“新十条”，并于 12 月 26 日宣布将对新型冠状病毒感染实施“乙类乙管”。政策的重大调整带动了市场的经济预期改善，但与此同时，经济的现实表现在四季度进一步恶化。9 月至 12 月，中采制造业 PMI 分别为 50.1、49.2、48、47，非制造业 PMI 分别为 50.6、48.7、46.7、41.6，均滑落至荣枯线下方并持续走低，尤其是 12 月读数下行至与 4 月相近的历史极低位。其他数据方面，无论是生产端视角的工业增加值和服务业生产指数，还是需求端视角的投资、零售、出口增速，11 月读数都较 9 月大幅回落。疫情冲击应是导致四季度经济下行的主要原因，首先是国庆假期之后全国疫情反弹对经济形成压制，随后在管控措施调整之后，第一波感染高峰形成了更显著的阶段性冲击。不过市场对疫情冲击逐渐消退和稳增长政策进一步发力有所期待，由此形成了经济“弱现实”和“强预期”的高度分化，是四季度宏观面的一大特征。物价方面，CPI 同比读数由 9 月的 2.8% 下降至 11 月的 1.6%，核心 CPI 同比持平于 0.6%，而 PPI 同比读数由 0.9 转负至 -1.3%，物价表现仍受到经济“弱现实”的抑制。

债券市场方面，政策密集调整冲击市场预期，叠加机构行为因素的影响，引发四季度债市大幅波动。10 月，受到国内疫情发酵，以及权益市场大跌、风险偏好下降影响，中长端债券收益率有所回落。但进入 11 月后，先是资金面出现阶段性收敛，带动短端品种收益率上行；随后，防疫和地产政策调整的信号密集出现，尤其是防疫优化“二十条”以及地产“金融十六条”传闻引发债券收益率出现脉冲式大幅上行；由于市场短期调整过快，一定程度引发了部分资管产品的赎回压力，导致了“负反馈”式的持续调整，资管产品持仓更多的信用债调整幅度明显大于利率债。11 月 17 日之后的一周左右时间里，资金面转松和国常会预告降准一度令债券收益率回落，但随后地产和防疫优化政策继续密集出台，且理财赎回“负反馈”压力延续，债券收益率进一步大幅上行。直到 12 月下半月，央行持续开展大额逆回购呵护年末资金面，同时随着政策调整“靴子落地”，市场关注点边际上向“弱现实”回归，并且理财“负反馈”压力有所缓和，债券收益率逐渐回落。整个四季度来看，利率债方面，短端的 1 年国债、1 年国开债收益率分别上行 24bp、34bp 至 2.10%、2.23%，长端的 10 年国债、10 年国开债收益率分别上行 8bp、6bp 至 2.84%、2.99%；信用债方面，1、3、5 年 AAA 中票收益率分别上行 55bp、50bp、52bp，1、3、5 年 AA+ 中票收益率分别上行 72bp、74bp、68bp，1、3、5 年 AA 中票收益率分别上行 108bp、98bp、65bp，理财“负反馈”压力带来信用债大幅调整，信用利差、等级利差显著走阔。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。

权益市场方面，2022 年 4 季度，市场总体上先抑后扬。在重要会议落地后，市场对于后续的经济预期开始强化，低位的早周期金融消费开始出现上涨，前期业绩确定性较高的安全和成长方向开始回落。总体上表现为存量市场的行业轮动。科技板块前期表现较为坚挺，但 Q4 受到风格转换影响较大。内部细分方向看，一方面，军工得益于高业绩确定性、储能得益于高业绩增速，板块股价此前表现均相对坚挺，但第 4 季度轮动时，出现了系统性的强势回调。另一方面，一些新的技术方向和前期下跌相对充分的赛道，如汽车链条、电子半导体、通用机械等，相对收益表现较好。第 4 季度，基于大类资产配置性价比的判断，本基金的权益仓位适度做了上调。结构方面，科技和消费还是主要配置方向，适度增持了一些地产、金融行业，以及稳定类的股票。总体上兼顾了业绩确定性和拐点弹性的方向。

2022 年 11 月，地产和防疫政策密集调整；12 月以来，各地病毒感染率陆续攀升。而资本市场“强预期”与经济“弱现实”呈现出较大分化。2023 年经济增速较 2022 年回升已成为市场一致预期，但推动经济回升的抓手和力度方面市场仍存分歧。对于市场非常关注的地产领域，近期供给端政策已基本调整，但房企现金流压力的根本性缓解仍有赖于地产销售趋势性回暖，因此后续关键是推动需求端政策发力配合。在“房住不炒”的定位下，需求端政策放松的制约可能在于房价，尤其是一线城市房价。后续地产需求端政策尤其是一线城市政策能否进一步放松，有待观察。我们倾向于认为 2023 年上半年疫情扰动持续、需求端刺激政策尚存不确定性，经济复苏的力度是偏温和的；同时，考虑到经济恢复的基础尚不牢靠，包括货币政策在内的宏观政策仍将协同发力，货币宽松的基调有望维持不变，强预期与弱现实交织影响下，仍存在宽货币持续兑现的可能性。

债券投资上，我们认为 2023 年相对确定的投资机会来自于信用债跌出来的机会。2022 年四季度诸多政策调整带来的市场预期变化叠加流动性冲击带来的债券市场调整导致信用债品种收益率大幅上行至近年高位，信用利差水平和杠杆利差空间都回升至近年偏高位置，当前信用债尤其是中短端品种具备较高的配置性价比。2023 年可以把握相对确定的票息资产投资机会以及供需关系均衡后的信用利差修复行情。同时也需要持续关注疫后经济恢复过程中基本面走势可能带来的预期差机会。策略上，本基金将维持适度杠杆水平，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 2023 年 1 季度，总体上经济逐步恢复的大逻辑仍会延续，市场风险偏好应该逐步恢复，且进入业绩披露窗口，资金边际上对于业绩较好的板块会给予更高关注。科技方向，继续看好储能、军工，以及基本面出现底部信号的电子和汽车链条，估值有过回调且业绩兑现度仍在，预计会表现出一定的相对收益。大消费和地产链方向，短期在政策催化下已出现一波

估值修复，接下来将进入基本面数据是否能够改善的验证期，预计股价波动可能会有所加大，但是中期方向仍在难以证伪的窗口期。

转债投资方面，四季度维持中性偏低仓位，行业配置更加均衡。前期转债跟随股市震荡下行，估值小幅压缩但仍处于历史高位，转债资产性价比偏低，操作难度较大，我们维持低仓位等待机会；12 月以来受理财赎回及纯债快速调整的影响，中证转债指数十连跌，估值显著压缩，我们开始关注部分标的的配置价值，不过操作上仍保持耐心，重点在优化结构而非提升仓位。展望后市，从中长期维度看，股市已具备底部特征，伴随主动压缩估值，转债资产性价比也略有回升，2023 年转债录得正收益概率较高。但是不宜对空间期望过高，一方面股票处于风险偏好和估值修复阶段，本身存在不确定性；另一方面转债估值仍不便宜，会损耗收益。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 1.0557 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.50%；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 1.0440 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.60%；业绩比较基准收益率为 0.41%。

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	79,203,002.84	13.19
	其中：股票	79,203,002.84	13.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	504,840,906.56	84.10
	其中：债券	504,840,906.56	84.10
	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	1,600,000.00	0.27
	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	12,405,214.37	2.07
8	其他资产	2,204,898.39	0.37
9	合计	600,254,022.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,547,478.60	1.20
C	制造业	51,375,173.84	11.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,410,800.00	0.52
E	建筑业	3,287,783.00	0.71
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	3,598,388.11	0.78
J	金融业	5,769,664.00	1.25
K	房地产业	2,464,727.80	0.53
L	租赁和商务服务业	4,748,987.49	1.03
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	79,203,002.84	17.10

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	601888	中国中免	21,983	4,748,987.49	1.03
2	300059	东方财富	222,400	4,314,560.00	0.93
3	600809	山西汾酒	12,720	3,625,072.80	0.78
4	603606	东方电缆	52,500	3,561,075.00	0.77
5	600491	龙元建设	522,700	3,287,783.00	0.71

6	000858	五 粮 液	17,600	3,180,144.00	0.69
7	301268	铭利达	62,600	3,143,146.00	0.68
8	600519	贵州茅台	1,800	3,108,600.00	0.67
9	000519	中兵红箭	132,800	2,608,192.00	0.56
10	600522	中天科技	149,400	2,412,810.00	0.52

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	324,920,947.38	70.15
	其中：政策性金融债	30,314,416.44	6.55
4	企业债券	41,589,689.86	8.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	111,884,087.66	24.16
7	可转债（可交换债）	16,651,532.34	3.60
8	同业存单	-	-
9	其他	9,794,649.32	2.11
10	合计	504,840,906.56	109.00

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	163353	20 华泰 G1	300,000	30,579,453.70	6.60
2	188567	21 招证 G9	300,000	30,353,579.18	6.55
3	220206	22 国开 06	300,000	30,314,416.44	6.55
4	2028041	20 工商银行二级 01	200,000	20,660,268.49	4.46
5	102100884	21 恒健 MTN001（权益出资）	200,000	20,610,493.15	4.45

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 21 招证 G9（证券代码：188567）。

根据招商证券 2022 年 8 月 12 日披露的公告，因公司 2014 年在开展上海飞乐股份有限公司（现中安科股份有限公司）独立财务顾问业务工作期间未勤勉尽责，涉嫌违法违规，该公司收到中国证监会《立案告知书》。

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	40,039.35
2	应收证券清算款	2,161,790.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,068.95
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,204,898.39

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	1,647,141.78	0.36
2	110079	杭银转债	1,626,852.16	0.35
3	110053	苏银转债	1,608,321.53	0.35
4	113609	永安转债	596,273.08	0.13

5	127012	招路转债	593,598.55	0.13
6	128048	张行转债	571,786.30	0.12
7	128130	景兴转债	566,797.95	0.12
8	127058	科伦转债	556,488.40	0.12
9	113017	吉视转债	549,898.63	0.12
10	127043	川恒转债	549,586.96	0.12
11	113634	珀莱转债	549,145.68	0.12
12	110087	天业转债	547,320.82	0.12
13	110083	苏租转债	542,991.21	0.12
14	123077	汉得转债	539,079.66	0.12
15	127049	希望转 2	534,396.49	0.12
16	113033	利群转债	531,163.70	0.11
17	110064	建工转债	522,060.49	0.11
18	127036	三花转债	502,310.47	0.11
19	113051	节能转债	499,800.33	0.11
20	113532	海环转债	492,168.70	0.11
21	128121	宏川转债	487,592.88	0.11
22	128081	海亮转债	484,619.18	0.10
23	113045	环旭转债	479,441.85	0.10
24	110080	东湖转债	445,877.26	0.10
25	127054	双箭转债	146,045.95	0.03

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	483,624,767.10	53,054,704.95
报告期期间基金总申购份额	356,351.14	131,630.12
减：报告期期间基金总赎回份额	88,552,981.34	9,414,840.28
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	395,428,136.90	43,771,494.79

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

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）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2023 年 1 月 20 日