

银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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 4 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 04 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 2023 年 01 月 01 日起至 03 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	385,642,509.49 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	346,707,244.30 份	38,935,265.19 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 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	-5,778,837.17	-687,806.66
2. 本期利润	4,771,806.89	473,475.76
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0128	0.0114
4. 期末基金资产净值	370,212,773.23	41,073,392.46
5. 期末基金份额净值	1.0678	1.0549

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	1.15%	0.17%	0.80%	0.14%	0.35%	0.03%
过去六个月	-0.37%	0.20%	1.21%	0.19%	-1.58%	0.01%
过去一年	0.18%	0.18%	0.49%	0.19%	-0.31%	-0.01%
过去三年	6.74%	0.15%	1.69%	0.18%	5.05%	-0.03%

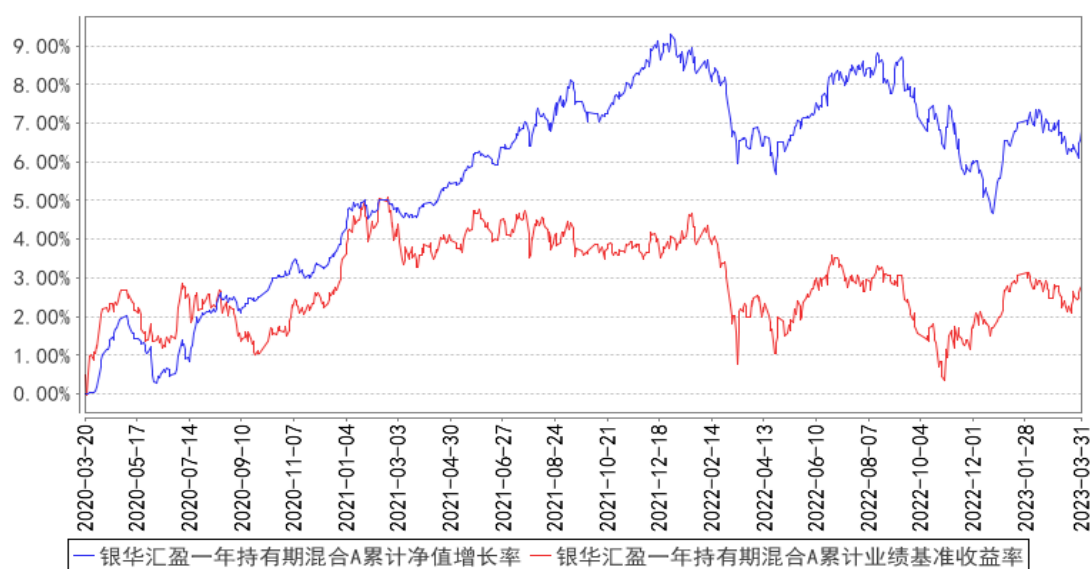
自基金合同生效起至今	6.78%	0.15%	2.79%	0.19%	3.99%	-0.04%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

银华汇盈一年持有期混合 C

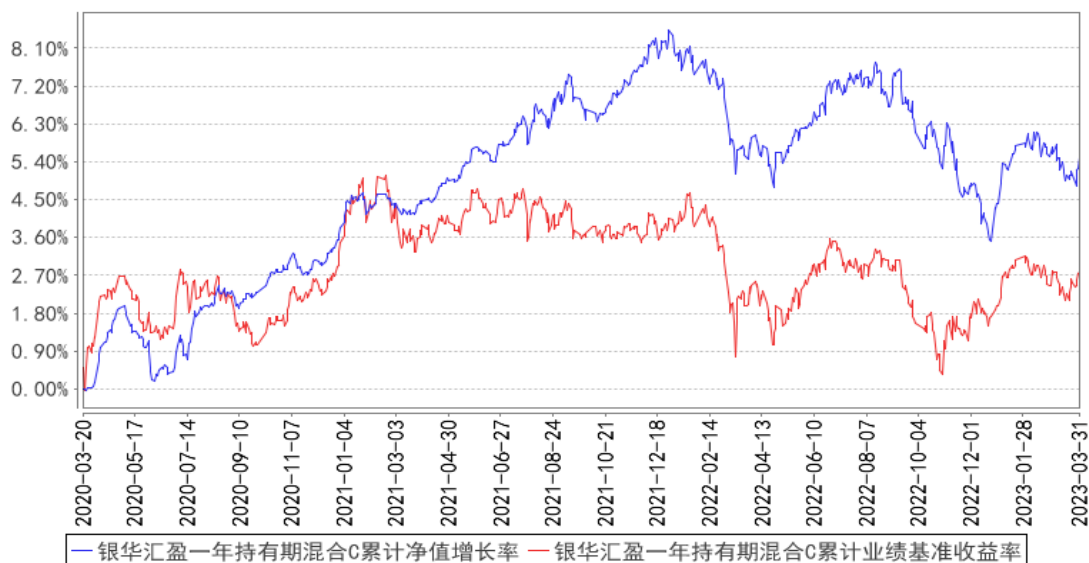
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.04%	0.17%	0.80%	0.14%	0.24%	0.03%
过去六个月	-0.57%	0.20%	1.21%	0.19%	-1.78%	0.01%
过去一年	-0.23%	0.18%	0.49%	0.19%	-0.72%	-0.01%
过去三年	5.46%	0.15%	1.69%	0.18%	3.77%	-0.03%
自基金合同生效起至今	5.49%	0.15%	2.79%	0.19%	2.70%	-0.04%

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	-	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、投资管理三部基金经理兼基金经理助理，现任固定收益及资产配置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、基金经理，现任固定收益及资产配置部基金经理。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。
王智伟先生	本基金的基金经理	2021 年 10 月 28 日	-	13.5 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，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、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 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 2 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

2023 年一季度，经济处于疫后复苏过程，此前“强预期”与“弱现实”高度分化的格局呈现相互收敛。具体上看，1 月，疫情快速过峰，春节期间也并出现第二波疫情冲击，经济开启修复过程。春节返乡对生产有所影响，需求恢复相对快于生产，特别是居民出行活动明显活跃，带动消费改善。2 月，随着节后人员陆续返岗，生产端加速修复。如果观察 1-2 月经济表现：1-2 月固

定资产投资增速 5.5%，较 12 月单月增速回升 2.4 个百分点，基建、制造业投资维持较强韧性，而地产投资增速回升较多主要受土地购置费影响，地产建筑工程分项仍较低迷；1-2 月社会零售增速回升 5.3 个百分点至 3.5%，剔除汽车项则为回升 7.6 个百分点至 5%，疫情政策优化对消费的拉动较为明显；以美元计价下的 1-2 月出口金额增速回升 3.2 个百分点至 -6.8%，生产活动修复可能对出口构成阶段性利好。整体上看，1-2 月经济是从疫情冲击“解冻”，且部分领域存在积压需求的集中释放效应，因而呈现全面的、较高斜率的修复。此外，1-2 月信贷环境宽松、新增贷款大幅高增，也对经济修复提供了支撑。进入 3 月，在两会确定经济增长目标 5%、高层在不同场合强调高质量发展之后，市场对稳增长政策力度的预期有所下修。同时，随着疫后修复脉冲效应淡化，高频数据表现开始分化，部分高频数据修复势头放缓或边际走弱。从 3 月 PMI 来看，制造业 PMI 较 2 月回落 0.7 个点至 51.9，不过读数仍为近年同期较高水平，而非制造业 PMI 则较 2 月继续上行 1.9 个点至 58.2 的高位。总体来看，经济复苏的方向大概率还在延续，但复苏最快的阶段可能已过，且政策态度较为克制，市场对地产改善持续性也仍存顾虑，因而此前“强预期”与“弱现实”分化的格局呈现为相互收敛。物价方面，CPI 同比由 12 月的 1.8% 下降至 2 月的 1%，核心 CPI 同比由 0.7% 略降至 0.6%，PPI 同比由 -0.7% 下降至 -1.4%，当前需求动能尚不强劲，且猪价仍处周期低位，通胀压力短期不大。

债券市场方面，在“强预期”和“弱现实”收敛的过程中，债券收益率呈现震荡走势。1 月，市场降息预期落空，同时信贷“开门红”预期升温，权益市场持续上涨也压制债市情绪，债券收益率连续上行。春节假期后至 2 月月中，尽管经济继续改善，但债市由于前期谨慎预期过于一致，反而走出修复行情。2 月下半月，资金面趋紧，DR007 一度连续在逆回购利率上方运行，或与大行大量投放信贷消耗了超储、且增加了资金面结构性摩擦有关，资金面变化带动了债券收益率曲线平坦化上移。3 月，先是增长目标和决策层定调使得市场下修稳增长预期；随后是海外硅谷银行和瑞信等事件一度对风险偏好产生影响，且促使了美债收益率大幅下行；再是央行于 3 月 17 日宣布降准，并于月末开展大额逆回购操作，3 月资金利率中枢较 2 月回落，也缓解了市场对于资金面的担忧。多重因素作用下，3 月债券收益率震荡下行。整个一季度来看，利率债方面，短端的 1 年国债、1 年国开债收益率分别上行 14bp、16bp 至 2.23%、2.39%，长端的 10 年国债、10 年国开债收益率分别上行 2bp、3bp 至 2.85%、3.02%，资金利率中枢向政策利率回归带动了短端利率上移，而长端利率此前可能已隐含了经济修复预期，变动不大；信用债方面，1 年 AAA 中票收益率上行 6bp，3 年和 5 年 AAA 中票收益率分别下行 11bp 和 20bp，1、3、5 年 AA+ 中票收益率分别下行 13bp、38bp、37bp，1、3、5 年 AA 中票收益率分别下行 50bp、36bp、34bp，去年四季度受理财“负反馈”冲击而超调的信用债在一季度明显修复，信用利差大幅压缩。一季度，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。

股票市场方面，先呈现疫后复苏的反弹修复，大部分行业均有一定程度的反弹，再呈现结构分化的特征，数字经济、AI+为首的 TMT 板块一枝独秀，中特估板块表现尚可，其余大部分板块出现较为明显的回落。本基金考虑市场波动性、结构特征等适当调整仓位水平。

展望二季度，国内经济延续修复态势，而一季度资产价格已对政策相对克制下的温和复苏予以定价。从基本面维度来看，市场仍对开年以来不弱的经济数据的持续性存在一定疑虑，在开年积压需求相对充分释放后，二季度的经济成色将提供重要的基本面线索。后续房地产和出口走势可能是我们判断年内经济增速较为重要的变量。尽管一季度房地产领域出现了一些的积极信号，例如新房/二手房销售数据强劲反弹，但土地成交总体偏弱、房地产开发资金来源同比仍然负增，绝大多数房企的资产负债表修复仍在进行中，本轮周期中“销售—拿地—新开工”的传导时间可能更长。后续，我们在密切跟踪基本面边际变化的同时，也将持续关注增量政策对于市场风险偏好的影响、全球通胀走势以及欧美银行业风险的演化情况等可能导致债市波动的潜在风险点。流动性方面，降准资金的释放以及信贷投放节奏的边际放缓，资金面大幅波动的风险有所下降。但考虑到在当前经济回暖、外部不确定性仍大的背景下，包含货币政策在内的政策工具箱需要兼顾稳增长和防风险，政策基调可能相对克制并留有空间，所以我们认为短期对货币宽松不宜做过多博弈，资金利率在政策利率附近波动将是常态，债券收益率与政策利率的利差水平将是重要的安全边际指标。从资产配置角度来看，经历了一季度信用利差的显著修复，当前债券资产估值水平回归到一个相对中性的位置。二季度的债券市场有望延续年初以来的“结构性资产荒”行情，而中短端品种的估值性价比相对占优，有安全边际的中短端票息资产仍是市场关注的重点。投资策略上倾向于维持中性久期，根据资金面变化情况动态调整杠杆水平。

股票市场方面，能否有增量资金进入影响较大，若没有增量资金，股市可能继续呈现结构化或板块间轮动的特征。中长期看，TMT 板块具备政策支持、安全替代、AI+的大产业逻辑，需要重点关注。股票方面更注重对组合的配置进行优化，适度分散配置。

转债投资方面，一季度根据资产比价关系灵活调整仓位，行业配置更加均衡。年初权益市场情绪较好，加之理财赎回压力缓解，转债市场出现普涨、估值快速恢复，随后进入震荡区间回吐部分盈利。相对权益资产，转债尚未出现明显的比价优势，尤其季初反弹后估值再次接近历史高位，因此我们继续维持中性略低仓位，并根据市场节奏灵活调整持仓。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 1.0678 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.15%；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 1.0549 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.04%；业绩比较基准收益率为 0.80%。

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	57,632,149.53	12.33
	其中：股票	57,632,149.53	12.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	397,471,441.25	85.04
	其中：债券	397,471,441.25	85.04
	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	10,052,196.86	2.15
8	其他资产	2,217,854.76	0.47
9	合计	467,373,642.40	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 5,652,933.81 元，占期末净值比例为 1.37%。

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	2,138,400.00	0.52
C	制造业	30,698,688.34	7.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,148,619.60	0.52

E	建筑业	1,139,895.46	0.28
F	批发和零售业	2,482,492.60	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	810,579.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,237,594.00	1.27
J	金融业	2,476,178.00	0.60
K	房地产业	836,949.00	0.20
L	租赁和商务服务业	1,279,564.92	0.31
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	2,730,254.80	0.66
S	综合	-	-
	合计	51,979,215.72	12.64

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	829,100.81	0.20
消费者常用品	772,111.62	0.19
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	1,566,178.52	0.38
电信服务	2,485,542.86	0.60
公用事业	-	-
地产建筑业	-	-
合计	5,652,933.81	1.37

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	688111	金山办公	6,611	3,127,003.00	0.76
2	603019	中科曙光	67,400	2,583,442.00	0.63
3	600900	长江电力	100,800	2,142,000.00	0.52
4	000858	五粮液	10,800	2,127,600.00	0.52
5	600809	山西汾酒	7,720	2,102,928.00	0.51
6	002223	鱼跃医疗	56,400	1,795,776.00	0.44
7	600872	中炬高新	46,000	1,706,600.00	0.41

8	603466	风语筑	98,184	1,664,218.80	0.40
9	601225	陕西煤业	65,800	1,338,372.00	0.33
10	600941	中国移动	14,700	1,322,559.00	0.32

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	3,037,475.34	0.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	317,301,542.00	77.15
	其中：政策性金融债	20,305,857.53	4.94
4	企业债券	11,576,494.24	2.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,250,027.39	10.03
7	可转债（可交换债）	14,329,102.28	3.48
8	同业存单	-	-
9	其他	9,976,800.00	2.43
10	合计	397,471,441.25	96.64

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	188567	21 招证 G9	300,000	30,562,847.67	7.43
2	2028041	20 工商银行二级 01	200,000	20,927,967.12	5.09
3	2028025	20 浦发银行二级 01	200,000	20,816,841.64	5.06
4	2028024	20 中信银行二级	200,000	20,796,180.82	5.06
5	102100884	21 恒健 MTN001(权益出资)	200,000	20,784,575.34	5.05

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他分析，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	28,889.40
2	应收证券清算款	2,182,563.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,401.82
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,217,854.76

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	1,693,750.68	0.41
2	110053	苏银转债	1,590,785.07	0.39
3	113052	兴业转债	1,216,239.45	0.30
4	127012	招路转债	626,899.25	0.15

5	128130	景兴转债	609,484.25	0.15
6	113017	吉视转债	581,723.97	0.14
7	110083	苏租转债	567,151.27	0.14
8	127036	三花转债	556,386.08	0.14
9	110064	建工转债	545,074.19	0.13
10	127058	科伦转债	521,706.82	0.13
11	128121	宏川转债	514,061.92	0.12
12	113532	海环转债	507,765.21	0.12
13	113609	永安转债	507,762.19	0.12
14	128081	海亮转债	507,202.74	0.12
15	110080	东湖转债	466,991.78	0.11
16	113549	白电转债	451,631.56	0.11
17	110087	天业转债	449,774.47	0.11
18	110085	通 22 转债	433,200.47	0.11
19	127054	双箭转债	154,730.81	0.04

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	395,428,136.90	43,771,494.79
报告期期间基金总申购份额	367,729.57	180,122.79
减：报告期期间基金总赎回份额	49,088,622.17	5,016,352.39
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	346,707,244.30	38,935,265.19

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）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2023 年 4 月 20 日