

# 银华富利精选混合型证券投资基金

## 2023 年第 2 季度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 17 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 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 银华富利精选混合                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金主代码      | 009542                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金合同生效日    | 2020 年 8 月 13 日                                                                                                                                                                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 3,504,466,176.91 份                                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资目标       | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，精选符合中国经济发展方向、具备利润创造能力、并且估值水平具备竞争力的优势上市公司，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                                               |
| 投资策略       | 本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对经济基本面、宏观政策、市场情绪、行业周期等因素进行定量与定性相结合的分析研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。<br>本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%（投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 |
| 业绩比较基准     | 中证 800 指数收益率*60%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*20%+中债综合指数收益率*20%                                                                                                                                                                                                       |
| 风险收益特征     | 本基金是混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。<br>本基金将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。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。 |                |
| 基金管理人           | 银华基金管理股份有限公司                                                                                             |                |
| 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     | 银华富利精选混合 A                                                                                               | 银华富利精选混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 009542                                                                                                   | 014044         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,499,163,927.95 份                                                                                       | 5,302,248.96 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 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日） |              |
|-----------------|-------------------------------------|--------------|
|                 | 银华富利精选混合 A                          | 银华富利精选混合 C   |
| 1. 本期已实现收益      | 52,637,241.98                       | 79,487.70    |
| 2. 本期利润         | -383,523,329.65                     | -627,248.96  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1082                             | -0.1117      |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,408,962,608.15                    | 3,617,036.95 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.6884                              | 0.6822       |

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、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

银华富利精选混合 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 | -13.56% | 1.15%     | -3.38%     | 0.69%         | -10.18% | 0.46% |
| 过去六个月 | -11.09% | 1.07%     | 0.15%      | 0.69%         | -11.24% | 0.38% |
| 过去一年  | -24.23% | 1.35%     | -8.36%     | 0.84%         | -15.87% | 0.51% |

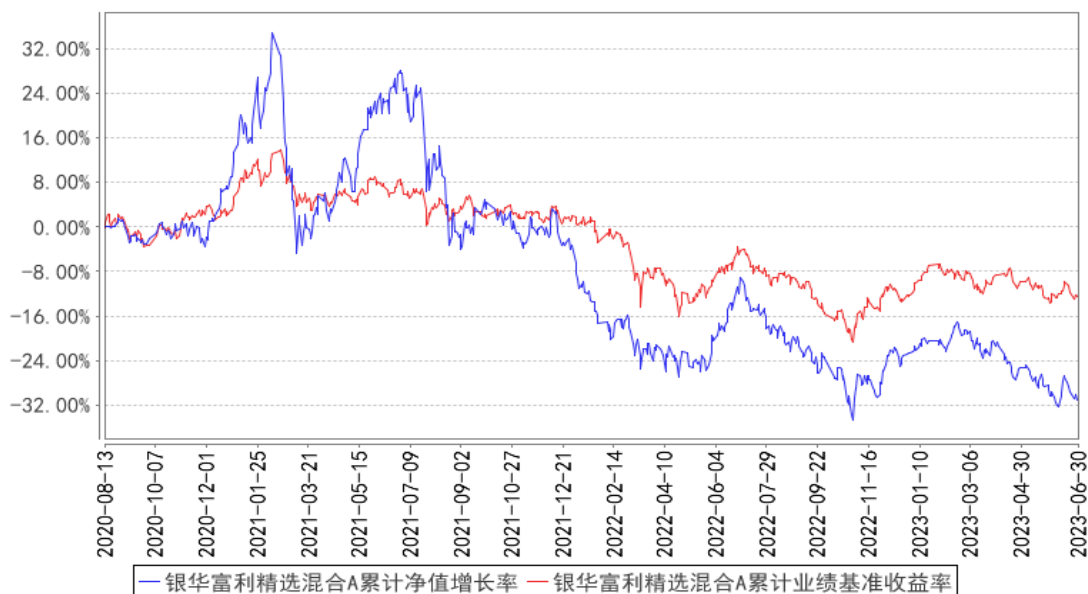
|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -31.16% | 1.63% | -12.23% | 0.90% | -18.93% | 0.73% |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|

银华富利精选混合 C

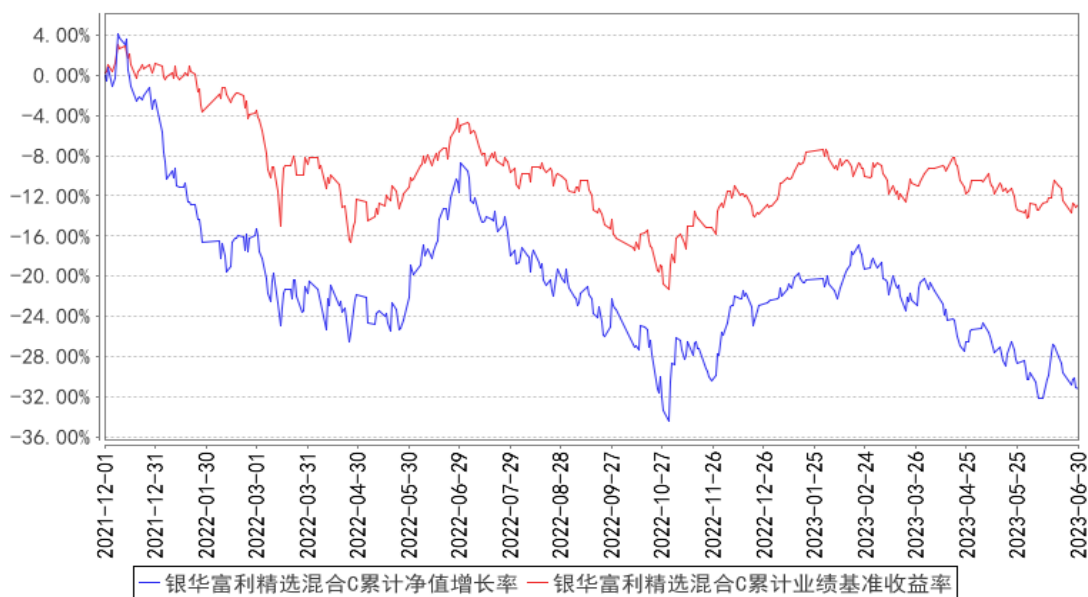
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -13.68% | 1.14%     | -3.38%     | 0.69%         | -10.30% | 0.45% |
| 过去六个月      | -11.36% | 1.07%     | 0.15%      | 0.69%         | -11.51% | 0.38% |
| 过去一年       | -24.67% | 1.35%     | -8.36%     | 0.84%         | -16.31% | 0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | -31.20% | 1.47%     | -12.88%    | 0.96%         | -18.32% | 0.51% |

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

银华富利精选混合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



银华富利精选混合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：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%（投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 焦巍先生 | 本基金的基金经理 | 2020年8月13日  | -    | 23.5年  | 博士学位。曾就职于中国银行海南分行、湘财荷银基金管理有限公司、平安大华基金管理有限公司、大成基金管理有限公司、信达澳银基金管理有限公司、平安信托有限责任公司，于 2018 年 10 月加入银华基金，现任投资管理一部基金经理。自 2018 年 11 月 26 日至 2019 年 12 月 13 日担任银华泰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 12 月 27 日起兼任银华富裕主题混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 26 日至 2021 年 9 月 15 日兼任银华国企改革混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 8 月 13 日起兼任银华富利精选混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 28 |

|      |          |                 |   |        |                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------|----------|-----------------|---|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |          |                 |   |        | 日起兼任银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月 3 日起兼任银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理。具有证券从业资格。国籍：中国。                                                                                                                                                       |
| 秦锋先生 | 本基金的基金经理 | 2020 年 8 月 13 日 | - | 11.5 年 | 硕士学位。曾就职于航天科技财务有限责任公司，2011 年 2 月加入银华基金管理有限公司，曾任助理行业研究员、行业研究员、基金经理助理，现任基金经理。自 2017 年 9 月 28 日起担任银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金基金经理，自 2018 年 2 月 13 日至 2021 年 5 月 12 日兼任银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 8 月 13 日起兼任银华富利精选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、《银华富利精选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 3 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

宏观经济在经历了疫情政策优化后的快速反弹后，在二季度特别是消费层面的低于预期和汇率的快速贬值主导了二季度市场的行情。回顾去年年底市场对于 2023 年宏观判断是预期国内经济复苏，担心美国衰退，而站在 2023 年年中的时点，市场对于宏观的预期已经转变为担心国内经济复苏乏力，相信美国经济走强的持续性，也因此映射到了当前的资本市场的表现，二季度主要体现为围绕 AI 的主题行情，而经济顺周期和消费医药类公司业绩和股价表现较差的情况，消费类核心资产的弱势体现了市场对此类资产长期增长的担忧，我们确实需要从长考虑、从国际视角考虑我们的资产配置倾向和平衡程度问题。

从国内消费基本面来看，二季度是消费的相对淡季，今年南北方极端天气较多，再加上各地轮番出现二次感染和其他病毒类疾病的情况，较大程度影响了出行和线下消费的同比数据，最终我们看到的宏观数据体现的就是消费利润占 GDP 的比重又回到了去年疫情政策优化前的水平，从而导致二季度消费板块持续走弱。但我们也需要关注另一方面积极的因素，就是经济本身是有其周期属性，海外很多国家都有疫情后经济二次探底的先例，叠加我们这轮二次感染并没有集中爆发，对于消费端的负面影响是高于市场此前预期的。当前我们面临的国内外宏观环境和市场环境可能都已经压倒了一个跷跷板的极限位置，未来有任何的利好政策或者基本面数据的好转，都可能带来股价先于基本面见底。三季度将迎来疫情政策优化后的第一个暑假和中秋节，也就是很多消费场景的旺季，预计不少企业有望走出业绩的拐点，我们依然维持对于未来半年消费板块乐观的心态，因为在所有风格赛道的比较当中，只有大消费大健康板块，是同时兼具“长期成长、估值区间可放大和业绩能够兑现”三者选股标准的，这或许也是机构投资者重要的选股标准，使得大家会觉得宏观经济增速不差的情况下，一旦消费占 GDP 比重较低的情况，A 股市场和公募基金的整体表现就较弱的原因。

对于今年市场我们也有了对于投资框架跟进进一步的总结和反思：

我们首先要对市场有敬畏之心。无论在任何经济环境下，企业做高增长是一件非常难的事情，因此好的投资标的在任何时候都是稀缺资源。更何况相比于国内 GDP 增速在 8% 以上的时代，我们比较容易找到 15% 增速的行业，也就相对容易可以找到 30% 增速的龙头企业，但今天经济体量较大，增速放缓的大背景下，我们寻找高增长公司需要慎之又慎。因此我们要有自己严谨的投资框架和对于个股相对准确的定价能力，并且对于围绕核心价值的股价方差波动要有较好的判

断能力，这样我们才有可能逆水行舟，在别人恐慌时候，做到多看两步棋，也就多看到一丝高概率成功的希望。

其次，资本市场最大的魅力之一可能就是“变化”，而我们投资框架最重要的能力之一可能就是应对市场变化的能力。从基本面的变化要核心映射到我们的投资交易层面，就是对同一个股票在景气期高点和预期低点持仓权重的操作标准化，希望在我们遵从长期价值投资理念的同时，可以很好的控制回撤，并提升投资回报。而这种必须具备的应变能力的底层基础来自于对于“全球宏观和利率环境的周期性，产业发展的周期性，企业竞争运行变化的周期性”的清醒认知和相对准确的应对。在我们的投资风格和板块遇到比较负面的宏观环境的时候，卖出交易的理由很容易，但是坚定持有的理由确实非常艰难。反过来，当我们的赛道处于景气周期和动量周期的时候，我们卖出的理由是很艰难的，买入其他板块的理由和框架可能显得更加难得。如果能够总结好过去几轮牛熊的演绎，那么从投资的角度，我们才有可能勇敢，果断的做到逆人性，逆市场的思维方式。产业的周期性和均值回归等可能是我们框架中最需要坚守的原则。

最后，要想清楚我们的投资框架适合什么市场，不适合哪些场景组合，在比较困难的外部环境的时候做怎样分化的方式，并且实现对回撤的控制。同样的，在预期和景气度来的时候，我们如何把波动率做大，把持仓进一步集中，做出正向弹性，为投资者提供较好的年化收益率。

截止到 6 月底，其实整个消费类资产受到疫情等相关因素冲击，从指数高点已经调整了 2 年的时间，如果我们长期投资大消费和大健康的底层逻辑没有发生较大变化，我们相信中国经济周期的属性和大国经济增长的韧性。展望下半年，目前市场的宏观数据、行业数据以及市场预期都处于相对低迷的周期中，同时消费股股价也已经较大程度的反映了此前不景气的情况和对未来较低信心的预期，那么从基金投资者的角度，现在或许是买入消费类基金最好的时点，别人恐惧的时候我们为什么不能乐观一些呢。

组合整体持仓和一季度差别不大，遵从了年初以来的投资想法，重点配置经济复苏相关的白酒板块，对于业绩兑现度较高和有政策支持的部分医药细分板块依然维持了此前的持仓配置，我们组合的基点是希望时间站在我们这一方，也就是时间越往后，我们持有公司的业绩兑现度越好，组合获得风险调整后的回报率约有吸引力。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华富利精选混合 A 基金份额净值为 0.6884 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.56%；截至本报告期末银华富利精选混合 C 基金份额净值为 0.6822 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.68%；业绩比较基准收益率为-3.38%。



#### 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              | 2,245,827,660.85 | 92.02        |
|    | 其中：股票             | 2,245,827,660.85 | 92.02        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 10,496,569.86    | 0.43         |
|    | 其中：债券             | 10,496,569.86    | 0.43         |
|    | 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      | 169,245,843.75   | 6.93         |
| 8  | 其他资产              | 15,090,474.98    | 0.62         |
| 9  | 合计                | 2,440,660,549.44 | 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 3,807,639.10 元，占期末净值比例为 0.16%。

#### 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              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 1,673,595,703.43 | 69.37        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | 568,424,318.32   | 23.56        |
| 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  | -                | -            |
| J  | 金融业              | -                | -            |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| K | 房地产业          |                  |       |
| 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            | 2,242,020,021.75 | 92.93 |

### 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 | -            | -            |
| 消费者常用品  | -            | -            |
| 能源      | -            | -            |
| 金融      | -            | -            |
| 医疗保健    | 3,807,639.10 | 0.16         |
| 工业      | -            | -            |
| 信息技术    | -            | -            |
| 电信服务    | -            | -            |
| 公用事业    | -            | -            |
| 地产建筑业   | -            | -            |
| 合计      | 3,807,639.10 | 0.16         |

### 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  | 000858 | 五粮液  | 1,197,901 | 195,940,666.57 | 8.12         |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 909,780   | 190,662,594.60 | 7.90         |
| 3  | 600085 | 同仁堂  | 3,056,095 | 175,908,828.20 | 7.29         |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 102,497   | 173,322,427.00 | 7.18         |
| 5  | 000799 | 酒鬼酒  | 1,794,421 | 161,767,053.15 | 6.71         |
| 6  | 603939 | 益丰药房 | 3,492,300 | 129,215,100.00 | 5.36         |
| 7  | 605266 | 健之佳  | 1,538,853 | 129,002,046.99 | 5.35         |
| 8  | 603883 | 老百姓  | 3,960,742 | 118,228,148.70 | 4.90         |
| 9  | 603233 | 大参林  | 3,965,783 | 111,081,581.83 | 4.60         |
| 10 | 600702 | 舍得酒业 | 859,733   | 106,563,905.35 | 4.42         |

### 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      | 10,496,569.86 | 0.44 |
| 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） | -             | -    |
| 8  | 同业存单      | -             | -    |
| 9  | 其他        | -             | -    |
| 10 | 合计        | 10,496,569.86 | 0.44 |

### 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  | 019547 | 16 国债 19 | 100,000 | 10,496,569.86 | 0.44         |

### 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的发行主体本期不存在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。

#### 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   | 667,530.71    |
| 2  | 应收证券清算款 | 13,936,339.02 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 486,605.25    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 15,090,474.98 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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的情况。

### 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，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                        | 银华富利精选混合 A       | 银华富利精选混合 C   |
|---------------------------|------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 3,580,591,852.29 | 6,202,811.37 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 26,535,764.27    | 945,032.75   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 107,963,688.61   | 1,845,595.16 |
| 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               | 3,499,163,927.95 | 5,302,248.96 |

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、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：本基金本报告期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

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 银华富利精选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 《银华富利精选混合型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《银华富利精选混合型证券投资基金招募说明书》
- 9.1.4 《银华富利精选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办公场所。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

2023 年 7 月 19 日