

银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

2024 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：2024 年 4 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 2024 年 04 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 2024 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 | 207,603,324.65 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 | 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。 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。 |
| 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 | 184,520,633.88 份 | 23,082,690.77 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（2024 年 1 月 1 日-2024 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 | -412,236.83 | -65,516.56 |
| 2. 本期利润 | 2,014,608.98 | 218,994.48 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0101 | 0.0091 |
| 4. 期末基金资产净值 | 199,114,761.10 | 24,509,233.08 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0791 | 1.0618 |

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 | 0.98% | 0.12% | 1.36% | 0.16% | -0.38% | -0.04% |
| 过去六个月 | 0.81% | 0.11% | 1.09% | 0.15% | -0.28% | -0.04% |
| 过去一年 | 1.06% | 0.11% | 0.60% | 0.15% | 0.46% | -0.04% |

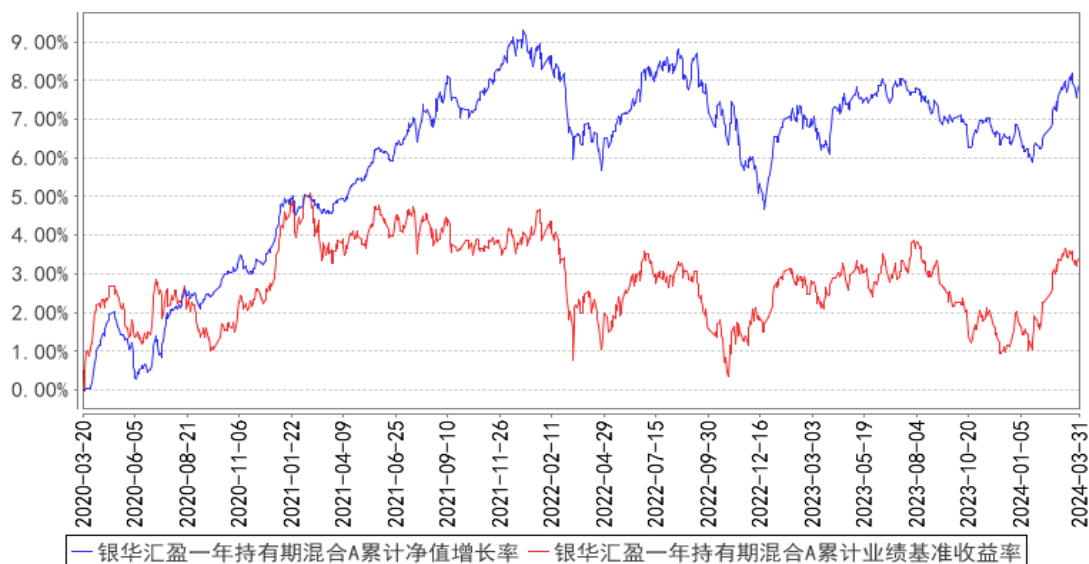
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去三年 | 2.94% | 0.15% | -0.25% | 0.17% | 3.19% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.91% | 0.14% | 3.40% | 0.18% | 4.51% | -0.04% |

银华汇盈一年持有期混合 C

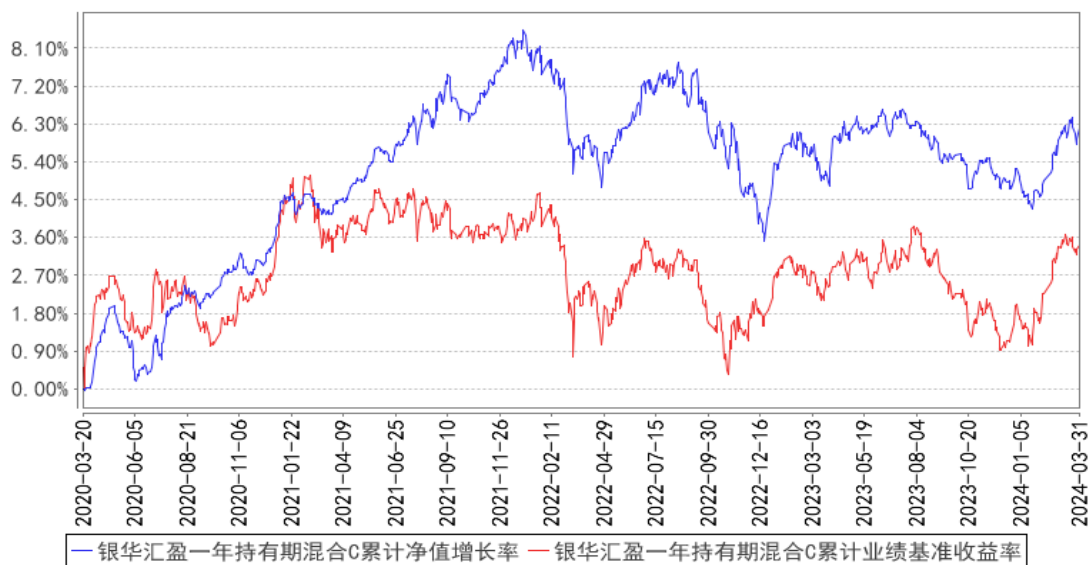
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.88% | 0.12% | 1.36% | 0.16% | -0.48% | -0.04% |
| 过去六个月 | 0.61% | 0.11% | 1.09% | 0.15% | -0.48% | -0.04% |
| 过去一年 | 0.65% | 0.11% | 0.60% | 0.15% | 0.05% | -0.04% |
| 过去三年 | 1.70% | 0.15% | -0.25% | 0.17% | 1.95% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.18% | 0.14% | 3.40% | 0.18% | 2.78% | -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 | | |
| 王智伟先生 | 本基金的基金经理 | 2021年10月28日 | - | 14.5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、银华汇益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。 |
| 龚美若女士 | 本基金的基金经理 | 2023 年 6 月 2 日 | - | 12.5 年 | 硕士学位。曾就职于西南证券股份有限公司、威海市商业银行股份有限公司。2019 年 2 月加入银华基金，曾任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。自 2021 年 7 月 22 日起担任银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自 2023 年 6 月 2 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 2023 年 7 月 14 日起兼任银华安盈短债债券型证券投资基金基金经理，自 2023 年 12 月 21 日起兼任银华致淳债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 3 月 20 日起兼任银华晶鑫债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 阚磊先生 | 本基金的基金经理 | 2023 年 8 月 11 日 | - | 14.5 年 | 硕士研究生。曾就职于中国人寿资产管理有限公司、兴业基金管理有限公司、国寿安保基金管理有限公司。2023 年 2 月加入银华基金，现任固定收益及资产配置部基金经理。自 2023 年 8 月 11 日起担任银华安盈短债债券型证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2023 年 9 月 22 日起兼任银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自 2023 年 12 月 21 日起兼任银华致淳债券型证券投资基金基金经理，自 2024 年 3 月 20 日起兼任银华晶鑫债券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

2024年一季度,宏观数据开年表现不俗。由于同比基数时期仍受疫情扰动,我们结合两年复合同比视角观察数据。生产端看,1-2月工业增加值同比7%(去年12月的前值为6.8%),两年复合同比4.7%(前值4%);1-2月服务业生产指数同比5.8%(前值8.5%),两年复合同比5.6%(前值3.7%);工业和服务业的两年复合同比均有回升。需求端看,1-2月美元计价出口金额同比7.1%(前值2.2%),两年复合同比-0.9%(前值-5.5%),全球制造业周期回暖带动外需改善,春节日期较晚也容易抬升1-2月增速;1-2月社会零售同比5.5%(前值7.4%),两年复合同比4.5%(前值2.7%),今年迎来疫情消退后的首个春节,居民出行和消费热情较高;1-2月固定资产投

资同比 4.2%（前值 4%），两年复合同比 4.8%（前值 3.6%），其中制造业、基建、地产投资的两年复合同比分别为 8.7%（前值 7.8%）、10.6%（前值 10.5%），-7.4%（前值-12.5%），受益于政策支持的制造业和基建保持韧性，而地产投资跌幅收窄较明显。后续继续观察宏观数据的持续性。货币政策方面，央行为保持市场流动性的合理充裕、引导实体融资成本下行，在 1 月 24 日宣布降准 0.5 个百分点，并在 2 月引导 5 年期 LPR 利率下调 25bp。债券市场方面，年初市场对稳增长政策“强刺激”的担忧逐渐减轻，同时财政存款投放和降准等因素改善了流动性环境，资金面平稳性上升，各期限债券收益率均有明显下行。三月之后，债市转入震荡行情。与上季度末相比，1 年国开债收益率下行约 36bp，3 年国开债收益率下行约 17bp，10 年国开债收益率下行约 27bp，3 年 AAA 中票收益率下行约 21bp。本季度，本基金根据市场情况积极调整债券的配置。展望 Q2，预计经济继续处于温和复苏进程，需要持续观察实体融资需求的改善情况。尽管在外部均衡考量下，降息降准等传统工具的操作节奏存在不确定性，但货币政策大方向上仍是易松难紧。为缓解银行息差压力，进一步下调存款利率的概率较高。综合来看，利率中枢或仍处在震荡下行通道。当前市场关注超长期特别国债发行方式，反复博弈较为充分，预计落地后更多体现为阶段性扰动，不会改变债市趋势。基于以上分析，本基金将根据市场情况灵活调整组合的久期和杠杆水平，不断优化组合的配置结构。

权益市场方面，开年在多重因素共振下经历了罕见的情绪性下跌，投资者非理性的看空最终也造成了后续逼空式的上涨，指数在一季度收红。结构上，一方面，高股息伴随国债利率的快速下行冲至高位震荡，在 CPI 转正后通胀类股票取而代之，公用事业、食品饮料、生猪养殖、有色、油气化工等相继上涨；另一方面，TMT 在海外映射的持续催化下展开强劲反弹，业绩能落地的光模块以及应用能落地的传媒领涨。此外，在中游制造端，车和家电表现出色，其同时具备出口和消费品以旧换新的逻辑。主题方面，“低空经济”持续性最好，自上而下均在加速推进；油运板块也在继续定价地缘政治风险。往后看，国外方面，降息预期从最多的 7 次回落至 3 次，高频数据显示美国经济仍然处于扩张阶段，24 年下半年，随着再融资规模的攀升，需要关注意外降息的潜在情景假设，如美国中小银行的商业地产贷款到期的情况，据不完全统计，2024 年约 9340 亿美元的低息商业贷款到期。国内方面，投资者对经济过分悲观的预期正在从钟摆的一端逐渐摆回。3 月制造业 PMI 主要受外需拉动，生产端弱于往年，财政发力节奏是影响经济环比动能的重要因素。政策层面，“推动第一轮大规模设备更新和消费品以旧换新”以及“加快发展新质生产力”是后续的重要线索。权益市场在经历了大幅的估值和情绪修复后，将重新回归业绩主导。展望 Q2，成长方向，我们主要关注业绩动能维持向上的出口链如汽车、家电；以及景气度有望非线性变化的新质生产力相关板块，如低空经济相关基础设施建设、工业母机、科学仪器、机器人、军工。

价值方向，持续关注央国企的估值修复，关注有色、油气、油运等全球定价资产。关注生猪养殖，其企业的出清速度超出了预期，银行端和再融资的收紧将成为常态，生猪养殖将成为时间友好型板块。

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 1.0791 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.98%；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 1.0618 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.88%；业绩比较基准收益率为 1.36%。

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 | 26,016,532.14 | 10.21 |
| | 其中：股票 | 26,016,532.14 | 10.21 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 220,110,582.48 | 86.34 |
| | 其中：债券 | 220,110,582.48 | 86.34 |
| | 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 | 8,782,829.64 | 3.45 |
| 8 | 其他资产 | 17,969.49 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 254,927,913.75 | 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 274,911.29 元，占期末净值比例为 0.12%。

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 | 886,537.00 | 0.40 |
| B | 采矿业 | 4,375,222.00 | 1.96 |
| C | 制造业 | 13,523,550.85 | 6.05 |
| 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 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,649,986.00 | 0.74 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,800,600.00 | 1.25 |
| J | 金融业 | 1,817,239.00 | 0.81 |
| K | 房地产业 | 913.00 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 210,087.00 | 0.09 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 477,486.00 | 0.21 |
| 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 | 25,741,620.85 | 11.51 |

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 | 274,911.29 | 0.12 |
| 消费者常用品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 地产建筑业 | - | - |
| 合计 | 274,911.29 | 0.12 |

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 | 000625 | 长安汽车 | 69,400 | 1,165,920.00 | 0.52 |
| 2 | 600256 | 广汇能源 | 109,300 | 813,192.00 | 0.36 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 4,200 | 798,672.00 | 0.36 |
| 4 | 600809 | 山西汾酒 | 3,100 | 759,748.00 | 0.34 |
| 5 | 600938 | 中国海油 | 23,600 | 689,828.00 | 0.31 |
| 6 | 601899 | 紫金矿业 | 41,000 | 689,620.00 | 0.31 |
| 7 | 000550 | 江铃汽车 | 20,200 | 609,838.00 | 0.27 |
| 8 | 600919 | 江苏银行 | 73,300 | 579,070.00 | 0.26 |
| 9 | 600050 | 中国联通 | 122,700 | 573,009.00 | 0.26 |
| 10 | 601939 | 建设银行 | 83,200 | 571,584.00 | 0.26 |

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 | 4,375,393.15 | 1.96 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 196,481,464.65 | 87.86 |
| | 其中：政策性金融债 | 31,466,409.84 | 14.07 |
| 4 | 企业债券 | 14,555,587.40 | 6.51 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 4,698,137.28 | 2.10 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 220,110,582.48 | 98.43 |

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 | 220210 | 22 国开 10 | 200,000 | 21,277,803.28 | 9.51 |
| 2 | 092280080 | 22 光大银行二级资本债 01A | 200,000 | 20,688,721.31 | 9.25 |
| 3 | 138871 | 23 中证 G1 | 200,000 | 20,173,243.84 | 9.02 |
| 4 | 188128 | 21 国君 G4 | 100,000 | 10,501,380.82 | 4.70 |
| 5 | 2028041 | 20 工商银行二级 01 | 100,000 | 10,478,426.23 | 4.69 |

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

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 | 15,484.75 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,484.74 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 17,969.49 |

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 | 110073 | 国投转债 | 1,223,981.75 | 0.55 |
| 2 | 113024 | 核建转债 | 1,223,649.67 | 0.55 |
| 3 | 132026 | G 三峡 EB2 | 1,202,966.30 | 0.54 |
| 4 | 110062 | 烽火转债 | 789,962.10 | 0.35 |
| 5 | 113061 | 拓普转债 | 257,577.46 | 0.12 |

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差异。

§ 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 | 212,312,031.29 | 25,053,786.04 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 183,545.77 | 55,244.19 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 27,974,943.18 | 2,026,339.46 |
| 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 | 184,520,633.88 | 23,082,690.77 |

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

2024 年 4 月 19 日