

银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：2020 年 10 月 27 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 2020 年 10 月 23 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 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 |
| 交易代码 | 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 | 4,239,462,750.53 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 | 3,672,362,237.55 份 | 567,100,512.98 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（2020年7月1日—2020年9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 | 79,188,694.81 | 11,563,238.10 |
| 2. 本期利润 | 68,823,606.21 | 9,940,111.64 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0188 | 0.0177 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,764,817,002.10 | 580,146,513.52 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0252 | 1.0230 |

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 | 1.88% | 0.12% | -0.59% | 0.19% | 2.47% | -0.07% |
| 过去六个 | 2.48% | 0.12% | -0.03% | 0.18% | 2.51% | -0.06% |

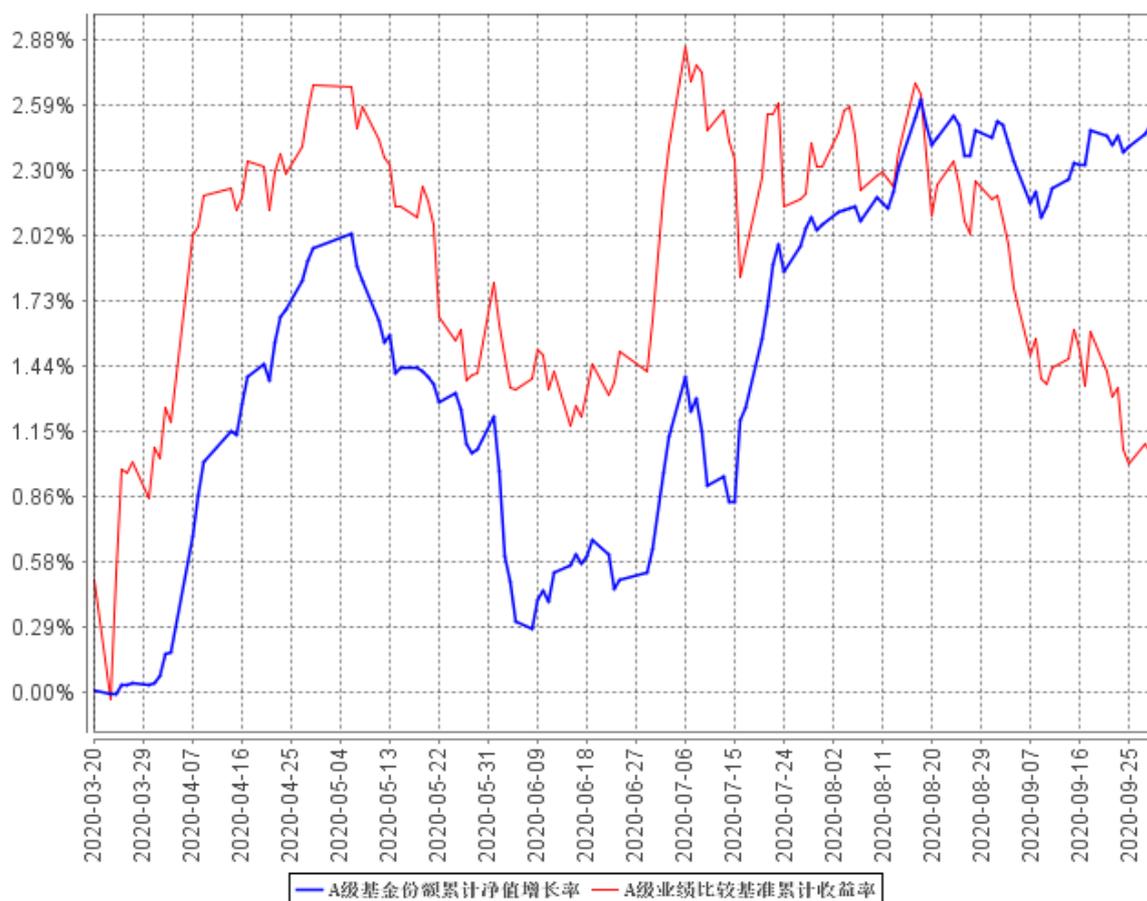
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 月 | | | | | | |
| 自基金合同生效起至今 | 2.52% | 0.12% | 1.04% | 0.20% | 1.48% | -0.08% |

银华汇盈一年持有期混合 C

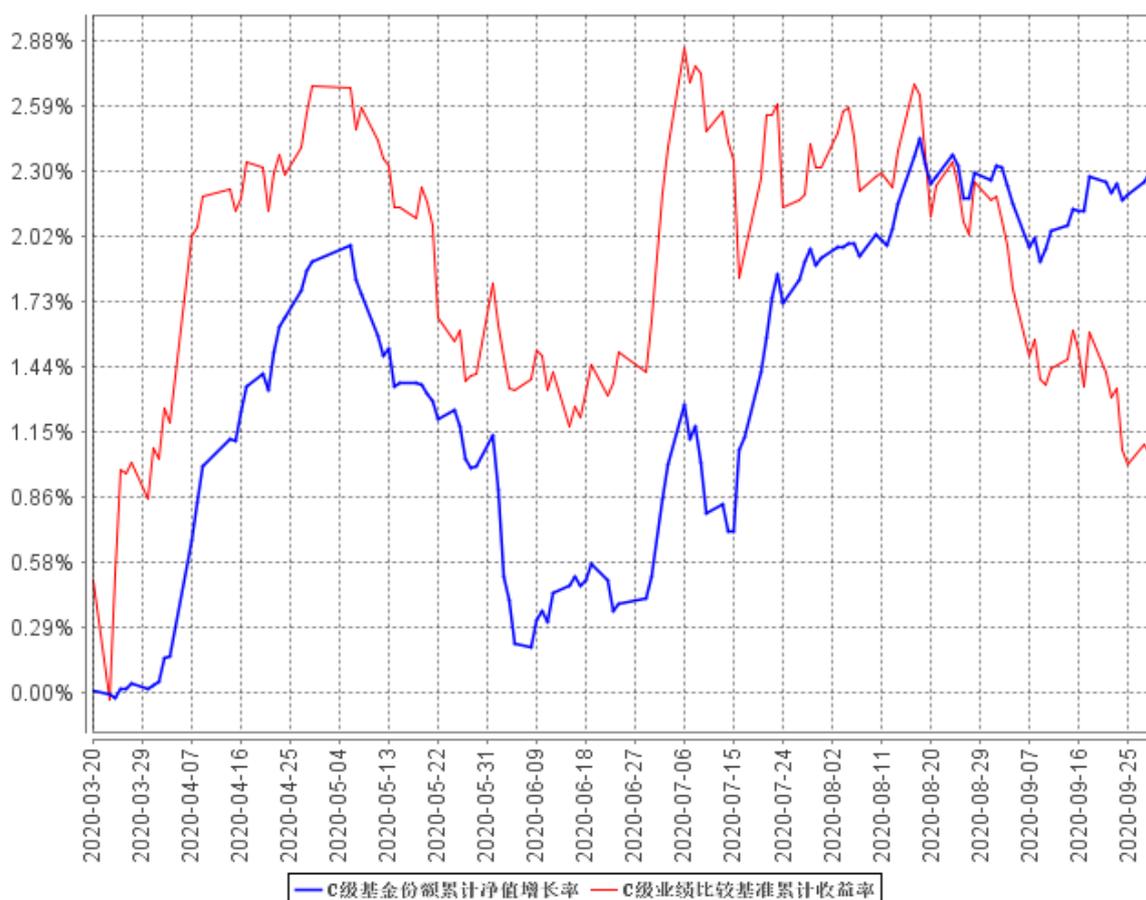
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.78% | 0.12% | -0.59% | 0.19% | 2.37% | -0.07% |
| 过去六个月 | 2.27% | 0.12% | -0.03% | 0.18% | 2.30% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.30% | 0.12% | 1.04% | 0.20% | 1.26% | -0.08% |

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

A级基金份额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



C级基金份额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：本基金合同生效日期为 2020 年 03 月 20 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置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 | | |
| 邹维娜女士 | 本基金的基金经理 | 2020 年 3 月 20 日 | - | 11.5 年 | 硕士学位。历任国家信息中心下属中经网公司宏观经济分析人员；中再资产管理股份有限公司固定收益部投资经理助理、自有账户投资经 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>理。2012 年 10 月加入银华基金管理有限公司，曾担任基金经理助理职务，自 2013 年 8 月 7 日起担任银华信用四季红债券型证券投资基金基金经理，自 2013 年 9 月 18 日起兼任银华信用季季红债券型证券投资基金基金经理，2014 年 1 月 22 日至 2018 年 9 月 6 日兼任银华永利债券型证券投资基金基金经理，2014 年 5 月 22 日至 2017 年 7 月 13 日兼任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，自 2014 年 10 月 8 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 2016 年 3 月 22 日起兼任银华添益定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 11 月 11 日起兼任银华添泽定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 7 日起兼任银华添润定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 7 月 25 日起兼任银华岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 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。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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年三季度，中国经济延续回升态势。从需求端看，固定资产投资、出口延续较强表现，消费渐进式修复。固定资产投资累计同比由 1-6 月的-3.1% 升至 1-8 月的-0.3%，估算当月同比由 6 月的 5.3% 升至 8 月的 7.6%，其中地产投资在宽信用环境下保持强劲，基建投资略不及预期但总体平稳，制造业投资修复在 8 月有所加快。美元计价的出口金额当月同比由 6 月的 0.5% 升至 8 月的 9.5%，主要受益于海外需求修复，防疫物资等结构性拉动因素边际弱化但仍有一定支撑。随着疫情防控措施放松，以及经济活动回暖带动居民收入改善，消费逐渐修复，社会零售总额当月同比由 6 月的-1.8% 转正至 8 月的 0.5%，但较去年全年仍有较大距离。从生产端来看，工业生产小幅改善，工业增加值当月同比由 6 月的 4.8% 升至 8 月的 5.6%，累计增速年内首次转正至 0.4%；服务业继续修复，服务业生产指数当月同比由 6 月的 2.3% 升至 8 月的 4%，较去年全年 6.9% 的增速仍有差距。通胀方面，7 月 CPI 当月同比受降雨影响阶段性回升，由 6 月的 2.5% 升至 2.7%，8 月回落至 2.4%，高频数据显示 9 月将延续较快回落；核心 CPI 当月同比由 6 月的 0.9% 回落至 8 月的 0.5%。PPI 同比跌幅有所收窄，尚未转正，当月同比由 6 月的-3% 回升至 8 月的-2%。总体来看通胀压力不大。

三季度债券收益率整体呈现上行走势。7 月上半月，A 股大涨，风险偏好与资金流动令市场呈现一定“股债跷跷板”效应，债券收益率较快上行。7 月下半月，中美关系紧张，股市表现偏弱，债券收益率有所回落。8-9 月，经济基本面改善，同时市场预期新冠疫苗问世时点逐渐临近，对

疫情担忧下降。市场对资金面预期不稳定，政府债券供给较大、结构性存款持续压降等因素也构成一定扰动，同业存单利率不断上行，债券市场情绪较为低迷，债券收益率震荡上行。

从债券收益率表现来看，三季度各期限、各品种债券收益率延续上行走势。利率债方面，短端的 1 年国债收益率较二季度末上行 47BP 至 2.65%、1 年国开债收益率上行 65BP 至 2.84%，10 年国债上行 33BP 至 3.15%，10 年国开债收益率上行 62BP 至 3.72%。信用债方面，1/3/5 年 AAA 中票收益率分别上行 44BP、53BP、28BP，1/3/5 年 AA+ 中票收益率分别上行 42BP、48BP、22BP，1/3/5 年 AA 中票收益率分别上行 28BP、31BP、22BP，中短久期品种收益率上行幅度相对更大。

权益市场方面，三季度 A 股进一步走强，节奏上看，7 月上半月股市大幅上涨，随后市场延续震荡行情。三季度上证综指上涨 7.8%，创业板和中小板指数分别上涨 5.6%、8.2%，沪深 300 指数上涨 10.2%，A 股估值分化格局边际收敛。

三季度，本基金根据市场情况对组合资产配置进行了适当调整。

展望后市，短期经济仍处在向上修复状态中，包括消费在内的顺周期部门仍有自发性回升的空间，但这一过程相对前期由复工和逆周期政策推动的经济修复而言，或较为渐进、平缓。随着国内疫情得到有效控制，货币、财政等方面的非常规政策均会逐步退出，二季度以来货币政策已经先行调整，回归到相对中性的状态。因此从总量的角度来看，经济增速进一步大幅上行的空间相对有限。考虑到目前的经济状况距离疫情前水平仍有距离，通胀压力有限，疫情、外部形势等因素仍有较大不确定性，不支持货币政策进一步趋势性收紧，短期可能处于观望状态。在此背景下，银行间资金价格基于前期货币政策边际变化的调整已进入尾声，资金利率中枢已进入新的平衡状态，短期大幅上行的空间有限，从而限制了中短端品种的波动空间。基于以上对基本面状况的分析，本基金认为未来一段时间债券类资产将出现投资机会。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。

股票方面，四季度基本面延续修复，相关政策有望进一步回归正常化，流动性支撑因素有所弱化。考虑到三季度股债性价比回归平衡，股票资产内部估值分化仍较显著，而海外疫情发展和美国大选带来的中美关系变化仍有较大不确定性，短期权益资产大概率以结构性行情为主。中长期来看，在“双循环”的新发展格局下，国内消费结构和产业结构仍有望不断优化升级，部分优质企业具备长期投资价值。未来我们仍将根据经济增长、企业盈利恢复、逆周期政策和估值水平等因素的变化，动态调整权益仓位。

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 1.0252 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.88%；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 1.0230 元，本报

告期基金份额净值增长率为 1.78%；同期业绩比较基准收益率为-0.59%。

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 | 209,451,132.60 | 4.57 |
| | 其中：股票 | 209,451,132.60 | 4.57 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,227,709,342.84 | 92.22 |
| | 其中：债券 | 4,227,709,342.84 | 92.22 |
| | 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 | 62,597,221.82 | 1.37 |
| 8 | 其他资产 | 84,580,837.95 | 1.84 |
| 9 | 合计 | 4,584,338,535.21 | 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 | 4,534,760.00 | 0.10 |
| B | 采矿业 | 2,357,720.00 | 0.05 |
| C | 制造业 | 113,100,319.18 | 2.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,016,240.91 | 0.07 |
| E | 建筑业 | 2,810,869.12 | 0.06 |
| F | 批发和零售业 | 592,024.03 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,013,373.36 | 0.07 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,020,681.32 | 0.07 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|------|
| J | 金融业 | 61,272,326.72 | 1.41 |
| K | 房地产业 | 8,098,120.00 | 0.19 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,090,285.44 | 0.05 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,317,340.90 | 0.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,348.36 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 3,166,590.00 | 0.07 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 45,133.26 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 209,451,132.60 | 4.82 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

5.3 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 | 601318 | 中国平安 | 230,900 | 17,608,434.00 | 0.41 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 7,000 | 11,679,500.00 | 0.27 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 217,100 | 7,815,600.00 | 0.18 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 33,100 | 7,315,100.00 | 0.17 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 128,600 | 6,854,380.00 | 0.16 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 85,000 | 6,171,000.00 | 0.14 |
| 7 | 002475 | 立讯精密 | 85,986 | 4,912,380.18 | 0.11 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 127,000 | 4,889,500.00 | 0.11 |
| 9 | 601012 | 隆基股份 | 54,400 | 4,080,544.00 | 0.09 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 135,200 | 4,060,056.00 | 0.09 |

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 | 308,835,914.00 | 7.11 |
| | 其中：政策性金融债 | 308,835,914.00 | 7.11 |
| 4 | 企业债券 | 1,014,283,000.00 | 23.34 |
| 5 | 企业短期融资券 | 199,972,000.00 | 4.60 |
| 6 | 中期票据 | 2,286,562,000.00 | 52.63 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 77,251,428.84 | 1.78 |
| 8 | 同业存单 | 340,805,000.00 | 7.84 |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|------------------|-------|
| 10 | 合计 | 4,227,709,342.84 | 97.30 |
|----|----|------------------|-------|

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 | 091900026 | 19 中国华融债 01(品种一) | 1,700,000 | 171,054,000.00 | 3.94 |
| 2 | 102000175 | 20 淄博城运 MTN001 | 1,500,000 | 147,570,000.00 | 3.40 |
| 3 | 200406 | 20 农发 06 | 1,400,000 | 139,258,000.00 | 3.21 |
| 4 | 200206 | 20 国开 06 | 1,400,000 | 138,670,000.00 | 3.19 |
| 5 | 163353 | 20 华泰 G1 | 1,400,000 | 138,152,000.00 | 3.18 |

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

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

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

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

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|---------------|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -1,197,480.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | - |

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

本基金在股指期货的投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约，采取套期策略及单边策略提高组合收益。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|--------------|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | 2,945,700.00 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 599,350.00 |

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受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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 | 167,581.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | 16,706,007.88 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 67,707,248.73 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 84,580,837.95 |

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 | 110065 | 淮矿转债 | 15,202,560.00 | 0.35 |
| 2 | 113013 | 国君转债 | 12,237,000.00 | 0.28 |
| 3 | 110051 | 中天转债 | 7,177,200.00 | 0.17 |
| 4 | 128029 | 太阳转债 | 3,353,161.50 | 0.08 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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 | 3,626,660,242.82 | 547,817,837.61 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 45,701,994.73 | 19,282,675.37 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 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 | 3,672,362,237.55 | 567,100,512.98 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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**

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

2020 年 10 月 27 日