

# 银华富利精选混合型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 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 10 月 20 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 07 月 01 日起至 09 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 | 3,428,736,507.69 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 | 3,423,200,957.91 份                                                                                       | 5,535,549.78 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 7 月 1 日-2023 年 9 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      | -132,480,162.49                     | -214,725.30  |
| 2. 本期利润         | -83,920,193.98                      | -136,351.26  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0242                             | -0.0249      |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,272,262,809.49                    | 3,635,454.87 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.6638                              | 0.6567       |

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 | -3.57%  | 1.07%     | -3.76%     | 0.77%         | 0.19%   | 0.30% |
| 过去六个月 | -16.65% | 1.10%     | -7.01%     | 0.73%         | -9.64%  | 0.37% |
| 过去一年  | -13.14% | 1.31%     | 0.09%      | 0.84%         | -13.23% | 0.47% |

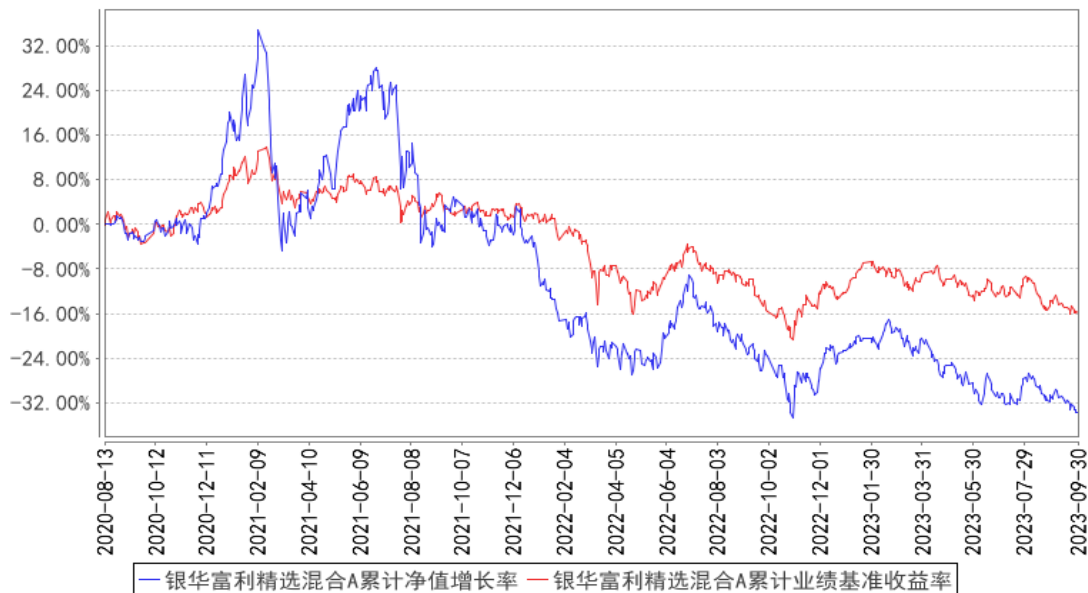
|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三年       | -32.13% | 1.63% | -12.64% | 0.89% | -19.49% | 0.74% |
| 自基金合同生效起至今 | -33.62% | 1.59% | -15.53% | 0.89% | -18.09% | 0.70% |

银华富利精选混合 C

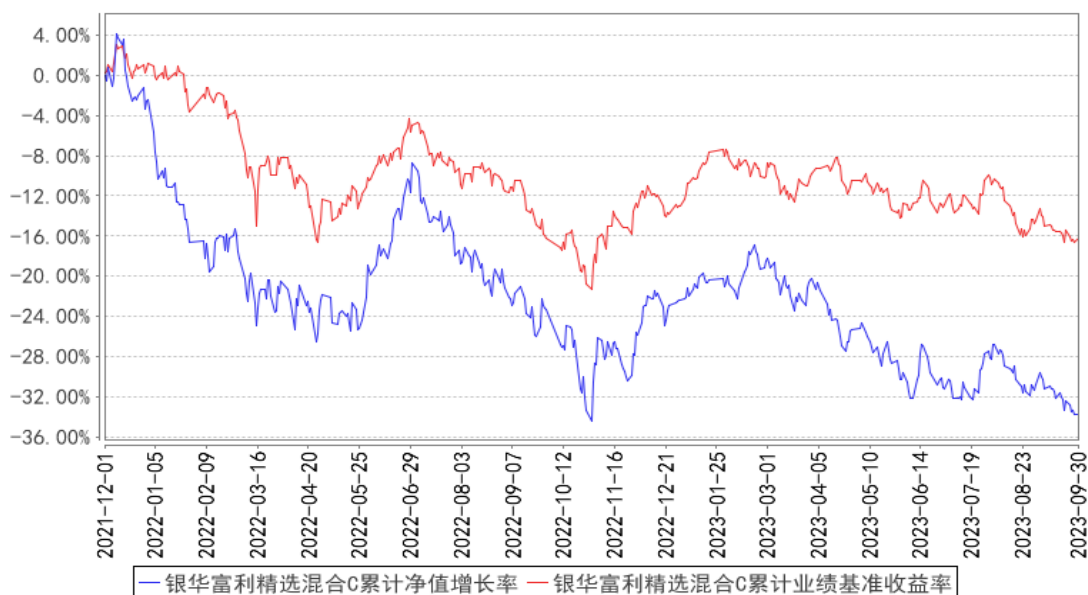
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -3.74%  | 1.07%     | -3.76%     | 0.77%         | 0.02%   | 0.30% |
| 过去六个月      | -16.90% | 1.10%     | -7.01%     | 0.73%         | -9.89%  | 0.37% |
| 过去一年       | -13.66% | 1.31%     | 0.09%      | 0.84%         | -13.75% | 0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | -33.77% | 1.42%     | -16.16%    | 0.94%         | -17.61% | 0.48% |

### 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 6 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

三季度国内外的市场环境对于投资来说依然是比较困难的，三对变量组合构成了当前复杂的局势：一是国内外经济数据的对比，直接影响到汇率、港股以及北上资金的流向；二是国内低于预期的经济数据和密集出台的政策组合拳，将决定未来基本面底部的时间点；三是全球经济复苏和地缘战争导致的逆全球化趋势，全球贸易供应链重构的影响仍在持续。相比于二季度，三季度国内宏观经济的低迷是超出此前市场的预期的，虽然我们看到了 7 月开始刺激政策层出不穷，但是经济数据改善并不明显，市场还在等待政策叠加从量变到质变的过程；与此同时海外经济数据则在持续超出预期，无论是欧美还是亚洲其他国家的股市今年以来都表现不错，这些跷跷板效应使得北上资金 8 月以来流出明显。

对于白酒部分，我们认为首先是在当前弱势的经济环境下，白酒价格带受到挤压，大品牌抢小品牌，全国性品牌抢夺地方品牌的经销商资源，这一行业的减量投资和龙头属性在继续加强，马太效应持续显现，而全国和特定区域范围内的领先者在不断扩大优势。我们过去在这一投资领域曾出现过判断失误，那就是延续了三年前头部企业上拉价格，次高端企业在扩张周期获利的传统套路。殊不知过去三年对这一行业格局和趋势产生了根本性的影响。在实地调研中可以发现，在逆周期环境下，次高端企业在行业整合期更加受制于高端企业的降维打击，而安徽江苏这些地方的龙头反倒受益于地方经济和根据地的牢固得以发展。正如经销商的经验判断，在这一轮行业整合中，在全国布局销售一个亿的企业不如在一个省销售一个亿的企业做得好，在一个省销售一个亿的企业不如在一个地区销售一个亿的企业做得好。白酒作为中国经济的缩影，率先反应了这种 k 字形的格局。当然这些变化也已经反映在股价之中。但是经济必有周期属性，面对调整了两年多的白酒板块来说，我们当前采取的布局是打散结构，分散突围，除了基本面最好的高端品牌白酒外，其他区域和次高端品牌我们都做了适量配置，一方面我们认为如果市场看到经济复苏的确定性和力度，整个白酒板块会有超额收益，另一方面，未来我们会密切观察哪个白酒公司有自身的阿尔法变化，再采取加仓的措施。

三季度我们增加了对红利投资的比重和配置。一方面，过去两年未能获得正收益的投资，使我们认识到必须面对现实，那就是在一个存量甚至减量博弈的市场，投资的难度在系统性增加。如果自忖没有即时参与博弈并事后果断退出的能力，那么事前 say no 也许是次优选择。我们的投资组合历经了从 2021 年 6 月到 2023 年 6 月为止长达 24 个月的市场调整。这一市场调整不断地以

极端方式考验我们底层逻辑到底如何，策略是否具有长期性，以及每一笔投资和每一个策略是否在这种最差的情况下依然能够安然度过。当初在过高 pe 时买入的乐观假设，在悲观环境下能否实现或者至少逻辑坚持自洽。否则，这些投资都在市场调整的考验下轰然崩塌。在这种情况下，与其期盼或者预期市场调整过去和市场能对自己的组合重新赋予高估值，不如搞清周期的位置。我们在疫情前的投资中，过度强调了“买好的”，而忽视了“买的好”，这是我们对组合最大的反思和调整之处。美好的成长愿望现在看来，往往是阶段性的，而终局的分红回报才是投资的归宿。一旦组合的估值过高，现金流和 peg 的增长不匹配，这些投资就会在市场调整中显出原形。而真正拥有持续现金流分红能力和持续增长壁垒的公司，只要估值合理，反倒在市场调整这个试金石下可以逆流而上。抛开短期的资金博弈和喜好因素，投资最终还是回到买公司、市场先生、安全边际和能力圈四个基本因素上。而只有具备充分过冬能力的公司和投资策略，才能保证我们不是在不停追逐某个时间点流行的趋势，却逐渐走在舒适而方向错误的道路上渐行渐远，对真正的冬天无法应对。

虽然投资环境复杂，困难很多，但我们现在最需要做的是守住价值，等待大势，价值投资的春天可能即将走过黎明。我们相信在牛市中估值不可能在高位持续，同样的市场调整也有自己周期结束的时候。展望未来 3-6 个月，消费和医药板块可能依然处于底部磨底周期，市场会等待和继续寻找业绩可能实现超预期的子行业，与此同时在春天没有明确之前，分红策略仍然是较好的防御配置，可以有效对冲组合的一部分回撤风险。四季度我们的重点配置的依然是经济复苏的顺周期板块和业绩高增长板块，并且紧跟当前全球市场政治和经济格局的变化，思考 2024 年的布局。

#### 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 0.6638 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.57%；截至本报告期末银华富利精选混合 C 基金份额净值为 0.6567 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.74%；业绩比较基准收益率为-3.76%。

#### 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 | 2,094,474,984.60 | 91.73        |



|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：股票             | 2,094,474,984.60 | 91.73  |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 10,396,835.62    | 0.46   |
|   | 其中：债券             | 10,396,835.62    | 0.46   |
|   | 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      | 166,661,787.67   | 7.30   |
| 8 | 其他资产              | 11,808,491.18    | 0.52   |
| 9 | 合计                | 2,283,342,099.07 | 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 4,316,531.52 元，占期末净值比例为 0.19%。

## 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              | 127,679,010.00   | 5.61         |
| C  | 制造业              | 1,700,011,022.42 | 74.70        |
| 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           | 244,292,299.86   | 10.73        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,660,048.80     | 0.20         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 13,516,072.00    | 0.59         |
| 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               | 2,090,158,453.08 | 91.84        |

## 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    | -            | -            |
| 工业      | -            | -            |
| 信息技术    | -            | -            |
| 电信服务    | 4,316,531.52 | 0.19         |
| 公用事业    | -            | -            |
| 地产建筑业   | -            | -            |
| 合计      | 4,316,531.52 | 0.19         |

## 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  | 600519 | 贵州茅台 | 105,097   | 189,022,209.35 | 8.31         |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 1,197,901 | 186,992,346.10 | 8.22         |
| 3  | 000568 | 泸州老窖 | 833,880   | 180,660,102.00 | 7.94         |
| 4  | 600085 | 同仁堂  | 3,282,095 | 179,793,164.10 | 7.90         |
| 5  | 000799 | 酒鬼酒  | 1,527,641 | 134,753,212.61 | 5.92         |
| 6  | 600702 | 舍得酒业 | 916,533   | 114,566,625.00 | 5.03         |
| 7  | 600197 | 伊力特  | 3,191,194 | 73,588,933.64  | 3.23         |
| 8  | 603939 | 益丰药房 | 2,051,880 | 71,959,431.60  | 3.16         |
| 9  | 002304 | 洋河股份 | 441,625   | 57,146,275.00  | 2.51         |
| 10 | 000596 | 古井贡酒 | 208,915   | 56,783,097.00  | 2.49         |

## 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      | 10,396,835.62 | 0.46         |
| 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        | 10,396,835.62 | 0.46         |

**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 | 10,396,835.62 | 0.46         |

**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   | 321,646.83    |
| 2  | 应收证券清算款 | 11,370,315.94 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 116,528.41    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 11,808,491.18 |

### 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               | 3,499,163,927.95 | 5,302,248.96 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 17,899,327.44    | 829,891.52   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 93,862,297.48    | 596,590.70   |
| 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               | 3,423,200,957.91 | 5,535,549.78 |

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

本基金管理人于 2023 年 7 月 8 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起本基金管理费率调低至 1.2%，托管费率调低至 0.2%，并对本基金基金合同有关条款进行了修订。

# § 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 10 月 24 日