

银华医疗健康量化优选股票型发起式证券  
投资基金  
2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 25 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 21 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 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 银华医疗健康量化优选股票发起式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金主代码      | 005237                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2017 年 11 月 9 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 报告期末基金份额总额 | 36,588,629.11 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资目标       | 本基金综合使用多种量化选股策略，重点投资于可以代表未来健康生活发展趋势的上市公司，在严格控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略       | 本基金投资于医疗健康主题，使用主动量化策略对医疗健康主题界定内的股票进行筛选并进行权重的优化，力争在跟踪医疗健康主题整体市场表现的同时，获得相对于业绩比较基准的超额收益。本基金债券投资的主要目的是风险防御及现金替代性管理。债券投资将坚持安全性、流动性和收益性作为资产配置原则，采取久期调整策略、类属配置策略、收益率曲线策略，以兼顾投资组合的安全性、收益性与流动性。本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；投资于医疗健康主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；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，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、应收申购款等。 |

|                 |                                            |                 |
|-----------------|--------------------------------------------|-----------------|
| 业绩比较基准          | 中证全指医药卫生指数收益率×90%+商业银行人民币活期存款利率（税后）×10%    |                 |
| 风险收益特征          | 本基金属于股票型证券投资基金，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。 |                 |
| 基金管理人           | 银华基金管理股份有限公司                               |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司                               |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 银华医疗健康量化股票发起式 A                            | 银华医疗健康量化股票发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 005237                                     | 005238          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 20,701,251.74 份                            | 15,887,377.37 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日） |                 |
|-----------------|-------------------------------------|-----------------|
|                 | 银华医疗健康量化股票发起式 A                     | 银华医疗健康量化股票发起式 C |
| 1. 本期已实现收益      | -1,567,518.27                       | -1,245,088.69   |
| 2. 本期利润         | -4,729,745.39                       | -3,626,973.60   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.2292                             | -0.2271         |
| 4. 期末基金资产净值     | 26,877,543.09                       | 20,290,910.72   |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.2984                              | 1.2772          |

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

银华医疗健康量化股票发起式 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 | -14.99% | 1.38%     | -14.87%    | 1.31%         | -0.12% | 0.07% |
| 过去六个月 | -14.80% | 1.47%     | -16.99%    | 1.42%         | 2.19%  | 0.05% |
| 过去一年  | -34.46% | 1.50%     | -26.69%    | 1.43%         | -7.77% | 0.07% |

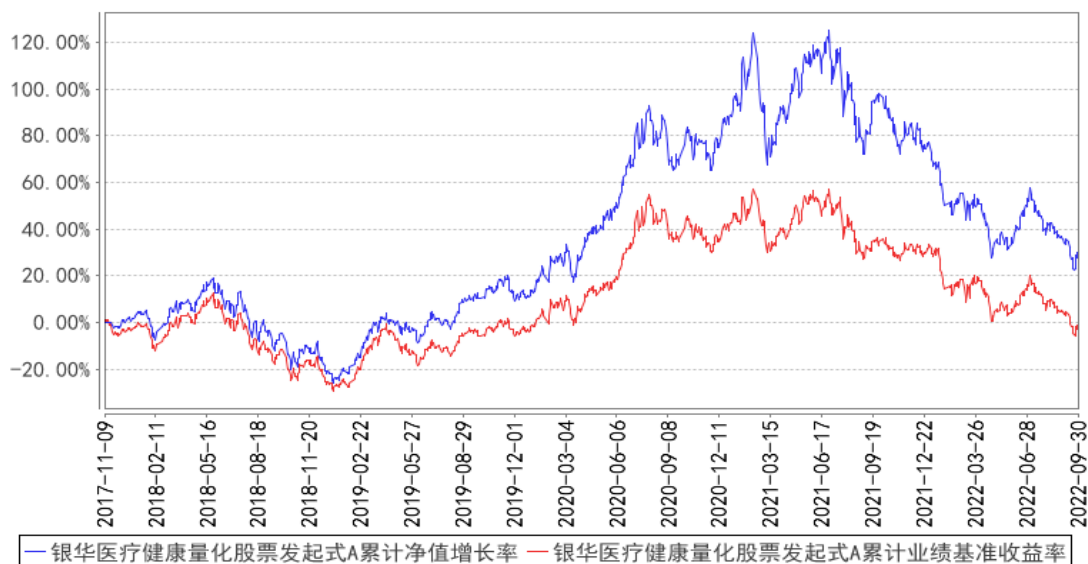
|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三年       | 17.78% | 1.73% | 5.20%  | 1.48% | 12.58% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.84% | 1.66% | -1.15% | 1.46% | 30.99% | 0.20% |

银华医疗健康量化股票发起式 C

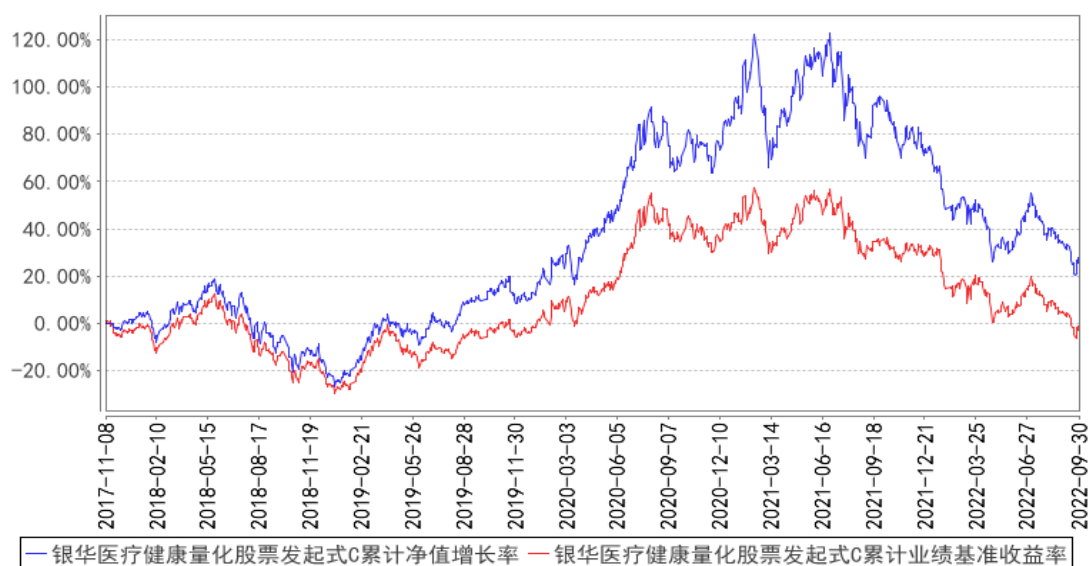
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -15.08% | 1.38%     | -14.87%    | 1.31%         | -0.21% | 0.07% |
| 过去六个月      | -14.97% | 1.47%     | -16.99%    | 1.42%         | 2.02%  | 0.05% |
| 过去一年       | -34.72% | 1.50%     | -26.69%    | 1.43%         | -8.03% | 0.07% |
| 过去三年       | 16.38%  | 1.73%     | 5.20%      | 1.48%         | 11.18% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 27.72%  | 1.66%     | -1.15%     | 1.46%         | 28.87% | 0.20% |

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

银华医疗健康量化股票发起式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



银华医疗健康量化股票发起式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：股票投资占基金投资的比例为 80%-95%；投资于医疗健康主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；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，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、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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 马君女士 | 本基金的基金经理 | 2017年11月9日  | -    | 13.5年  | 硕士学位。2008年7月至2009年3月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009年3月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。自2012年9月4日至2020年11月30日担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理，2013年12月16日至2015年7月16日兼任银华消费主题分级混合型证券投资基金基金经理，2015年8月6日至2016年8月5日兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理，2015年8月13日至2016年8月5日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自2016年1月14日至2021年2月25日兼任银 |

|      |          |                  |   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                           |
|------|----------|------------------|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |          |                  |   | <p>华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 9 月 15 日至 2020 年 12 月 10 日兼任银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日起兼任银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 15 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 5 月 11 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 9 月 22 日至 2022 年 8 月 9 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 12 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 20 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 6 月 2 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p> |                                                                                                           |
| 杨腾先生 | 本基金的基金经理 | 2021 年 11 月 29 日 | - | 9.5 年                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。2015 年 7 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员，量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2021 年 11</p> |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 月 29 日起担任银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF)、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华中证等权重 90 指数证券投资基金 (LOF) 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、《银华医疗健康量化优选股票型发起式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 20 次,原因是指数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

在报告期内，我们积极改进自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件。除此之外运用自行开发的量化投资模型，精选细分子行业个股，力争实现超越行业的阿尔法收益。

2022 年 3 季度 A 股市场单边下跌。3 季度沪深 300 指数下跌 15.16%，中证全指医药卫生指数下跌 16.45%，小幅跑输大盘。行业方面，表现相对较好的是煤炭、电力及公用事业、石油石化、房地产、交通运输、农林牧渔、国防军工等行业。

展望 2022 年 4 季度，医药板块估值处于历史极低的位置。2022 年初以来，受多重因素干扰，医药板块与大盘均出现了较大度的调整，二季度消费医疗、医疗服务和中药部分股票涨幅较大，引领了医药板块的反弹，三季度该板块跟随行业出现了回调，但与此同时，部分器械和药品则呈现出抗跌甚至上涨的走势。三季度末，器械板块在财政贴息贷款鼓励医疗新基建及骨科集采价格好于预期的利好下开展了一波上涨，之前由于集采带来的利空也基本消化，后续随着具体订单的落地，可持续关注器械板块的相对收益机会。药品板块逻辑雷同于器械，随着医保谈判日渐成熟，药品降价幅度日趋温和，有并购能力的仿制药及创新药龙头也将是我们关注的方向，药企最艰难的时期已经过去，大规模的研发投入也进入尾声，即将迎来各管线放量的收获期，随着基本面见底回升，预计也会迎来一波投资热潮；消费医疗经历了大涨和回调后，后续随着疫情相关政策的调整，依旧是投资者备受关注的领域；过去一年多出台的鼓励中医药发展的政策奠定了中医药板块长期发展的基石，中药配方颗粒纳入医保，鼓励中医服务机构开展及建设，中药领域的国企改革，都将利好相应板块公司，中药 OTC 品种的发展同时将提升药店业务。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华医疗健康量化股票发起式 A 基金份额净值为 1.2984 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.99%；截至本报告期末银华医疗健康量化股票发起式 C 基金份额净值为 1.2772 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.08%；业绩比较基准收益率为-14.87%。

#### 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，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情形的时间范围为 2022 年 9 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日。

### § 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              | 43,996,659.61 | 92.13        |
|    | 其中：股票             | 43,996,659.61 | 92.13        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -            |
|    | 其中：债券             | -             | -            |
|    | 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      | 3,644,050.42  | 7.63         |
| 8  | 其他资产              | 113,426.70    | 0.24         |
| 9  | 合计                | 47,754,136.73 | 100.00       |

注：由于四舍五入的原因，市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

## 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         | 34,406.61     | 0.07         |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 32,511,986.60 | 68.93        |
| 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           | 4,223,859.12  | 8.95         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 29,372.00     | 0.06         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 22,563.59     | 0.05         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 25,376.00     | 0.05         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 2,364,575.23  | 5.01         |
| 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          | 4,559,838.86  | 9.67         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | 224,681.60    | 0.48         |

|    |               |       |
|----|---------------|-------|
| 合计 | 43,996,659.61 | 93.28 |
|----|---------------|-------|

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 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  | 300015 | 爱尔眼科 | 131,828 | 3,779,508.76 | 8.01         |
| 2  | 300896 | 爱美客  | 4,781   | 2,344,219.92 | 4.97         |
| 3  | 300760 | 迈瑞医疗 | 7,821   | 2,338,479.00 | 4.96         |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 61,125  | 2,145,487.50 | 4.55         |
| 5  | 000999 | 华润三九 | 52,722  | 2,025,052.02 | 4.29         |
| 6  | 600085 | 同仁堂  | 39,413  | 1,795,262.15 | 3.81         |
| 7  | 000963 | 华东医药 | 34,051  | 1,366,126.12 | 2.90         |
| 8  | 002223 | 鱼跃医疗 | 45,237  | 1,303,277.97 | 2.76         |
| 9  | 603259 | 药明康德 | 16,636  | 1,192,634.84 | 2.53         |
| 10 | 300595 | 欧普康视 | 22,433  | 926,482.90   | 1.96         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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   | 10,571.24  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 102,855.46 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 113,426.70 |

### 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                        | 银华医疗健康量化股票发起式 A | 银华医疗健康量化股票发起式 C |
|---------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 20,595,136.84   | 15,042,938.21   |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,598,485.54    | 3,765,210.22    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,492,370.64    | 2,920,771.06    |
| 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 | 20,701,251.74 | 15,887,377.37 |
|-------------|---------------|---------------|

## § 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总<br>份额比例(%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总<br>份额比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,005,000.50 | 27.34               | 10,005,000.50 | 27.34               | 3年             |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 基金经理等人员     | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 基金管理人股东     | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 其他          | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 合计          | 10,005,000.50 | 27.34               | 10,005,000.50 | 27.34               | 3年             |

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,005,000.50 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 5,000.50 份。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                          |               |      | 报告期末持有基金情况 |               |         |
|-------|----------------|--------------------------|---------------|------|------------|---------------|---------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额       | 持有份额          | 份额占比(%) |
| 机构    | 1              | 20220701-20220930        | 10,005,000.50 | -    | -          | 10,005,000.50 | 27.34   |

#### 产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基

金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；

4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；

5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50% 时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50% 的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

10.1.1 银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

10.1.2 《银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》

10.1.3 《银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》

10.1.4 《银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》

10.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

10.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

10.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

10.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 10.2 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。

### 10.3 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

2022 年 10 月 25 日