

# 东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:东方阿尔法基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 28 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至2023年6月30日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7  |
| 2.4 信息披露方式                              | 8  |
| 2.5 其他相关资料                              | 8  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 8  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8  |
| 3.2 基金净值表现                              | 9  |
| §4 管理人报告                                | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 15 |
| §5 托管人报告                                | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 15 |
| 6.1 资产负债表                               | 16 |
| 6.2 利润表                                 | 17 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 19 |
| 6.4 报表附注                                | 22 |
| §7 投资组合报告                               | 53 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 53 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 53 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 54 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 58 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 61 |
| 7.6 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      | 61 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 62 |
| 7.8 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贵金属投资明细   | 62 |
| 7.9 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      | 62 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 62 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 62 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 62 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 63 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 63 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 64 |

|   |    |
|---|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 64 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                | 65 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 65 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 66 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 66 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....   | 66 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 66 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 66 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 66 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 66 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 66 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 68 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 69 |
| 11.1 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..... | 69 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 70 |
| §12 备查文件目录.....                         | 70 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 70 |
| 12.2 存放地点.....                          | 70 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 70 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                       |                |
|-----------------|-----------------------|----------------|
| 基金名称            | 东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 东方阿尔法医疗健康混合发起         |                |
| 基金主代码           | 014841                |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                |                |
| 基金合同生效日         | 2022年03月30日           |                |
| 基金管理人           | 东方阿尔法基金管理有限公司         |                |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司            |                |
| 报告期末基金份额总额      | 242,598,755.93份       |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                   |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 东方阿尔法医疗健康混合发起A        | 东方阿尔法医疗健康混合发起C |
| 下属分级基金的交易代码     | 014841                | 014842         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 180,536,528.16份       | 62,062,227.77份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | <p>本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资方法，以基本面分析为立足点，精选医疗健康相关行业证券，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。</p>  |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略主要有以下11个方面内容：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过定性与定量相结合的分析方法，对系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，制定本基金在各类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将通过系统和深入的基本面研究，专注于医疗健康产业投资，对行业发展进行密切跟踪，根据市场不同阶段充分把握各个子行业轮动带来的投资机</p> |

会。

### 3、港股通标的股票投资策略

本基金从治理结构与管理层：良好的公司治理结构，优秀、诚信的公司管理层；行业集中度及行业地位：具备独特的核心竞争优势和定价能力；公司业绩表现：具备中长期持续增长的能力；与A股同类公司相比具有估值优势的公司等方面筛选港股通标的股票。

### 4、存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

### 5、债券类资产投资策略

本基金将采取较为积极的债券投资策略，通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等，研判各类属固定收益类资产的风险趋势与收益预期，精选个券进行投资。

### 6、可转债（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略

本基金将重点关注可转债的转换价值、市场价值与其转换价值的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等方面，以及通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

### 7、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险。

### 8、融资业务的投资策略

本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件选择合适的交易对手方。在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。

### 9、国债期货的投资策略

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>本基金以套期保值为目的，以回避市场风险，通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。</p> <p><b>10、股票期权投资策略</b></p> <p>本基金以套期保值为主要目的参与股票期权交易，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p><b>11、资产支持证券投资策略</b></p> <p>基金将投资包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证医药卫生指数收益率×60%+恒生医疗保健指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率×20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。   |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                               | 基金托管人                       |
|---------|------|-------------------------------------|-----------------------------|
| 名称      |      | 东方阿尔法基金管理有限公司                       | 招商银行股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 曾健                                  | 张姗                          |
|         | 联系电话 | 0755-21872900                       | 0755-83077987               |
|         | 电子邮箱 | service@dfa66.com                   | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-930-6677                        | 95555                       |
| 传真      |      | 0755-21872902                       | 0755-83195201               |
| 注册地址    |      | 深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道6008号深圳特区报业大厦23BC | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦          |
| 办公地址    |      | 深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道6008号深圳特区报业大厦23BC | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦          |
| 邮政编码    |      | 518034                              | 518040                      |
| 法定代表人   |      | 刘明                                  | 缪建民                         |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="https://www.dfa66.com">https://www.dfa66.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道6008号深圳特区报业大厦23BC                       |

## 2.5 其他相关资料

| 项目       | 名称                       | 办公地址                         |
|----------|--------------------------|------------------------------|
| 会计师事务所   | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼       |
| 金融运营服务机构 | 招商证券股份有限公司               | 广东省深圳市南山区高新南九道9号金地威新软件科技园6号楼 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期<br>(2023年01月01日-2023年06月30日) |                |
|---------------|----------------------------------|----------------|
|               | 东方阿尔法医疗健康混合发起A                   | 东方阿尔法医疗健康混合发起C |
| 本期已实现收益       | -3,898,301.75                    | -905,938.76    |
| 本期利润          | -1,720,449.47                    | -817,280.15    |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0107                          | -0.0186        |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.98%                           | -1.72%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.24%                            | 0.00%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2023年06月30日)            |                |
| 期末可供分配利润      | 9,495,914.40                     | 2,859,780.03   |



|                     |                       |               |
|---------------------|-----------------------|---------------|
| 期末可供分配基金份额利润        | 0.0526                | 0.0461        |
| 期末基金资产净值            | 190,032,442.56        | 64,922,007.80 |
| 期末基金份额净值            | 1.0526                | 1.0461        |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | 报告期末<br>(2023年06月30日) |               |
| 基金份额累计净值增长率         | 5.26%                 | 4.61%         |

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.期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的"期末"均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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

东方阿尔法医疗健康混合发起A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | -3.15%   | 1.17%       | -2.83%     | 0.83%         | -0.32% | 0.34% |
| 过去三个月      | -4.35%   | 1.24%       | -6.92%     | 0.86%         | 2.57%  | 0.38% |
| 过去六个月      | 0.24%    | 1.18%       | -8.44%     | 0.90%         | 8.68%  | 0.28% |
| 过去一年       | 3.13%    | 1.47%       | -12.62%    | 1.22%         | 15.75% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.26%    | 1.34%       | -9.99%     | 1.27%         | 15.25% | 0.07% |

东方阿尔法医疗健康混合发起C

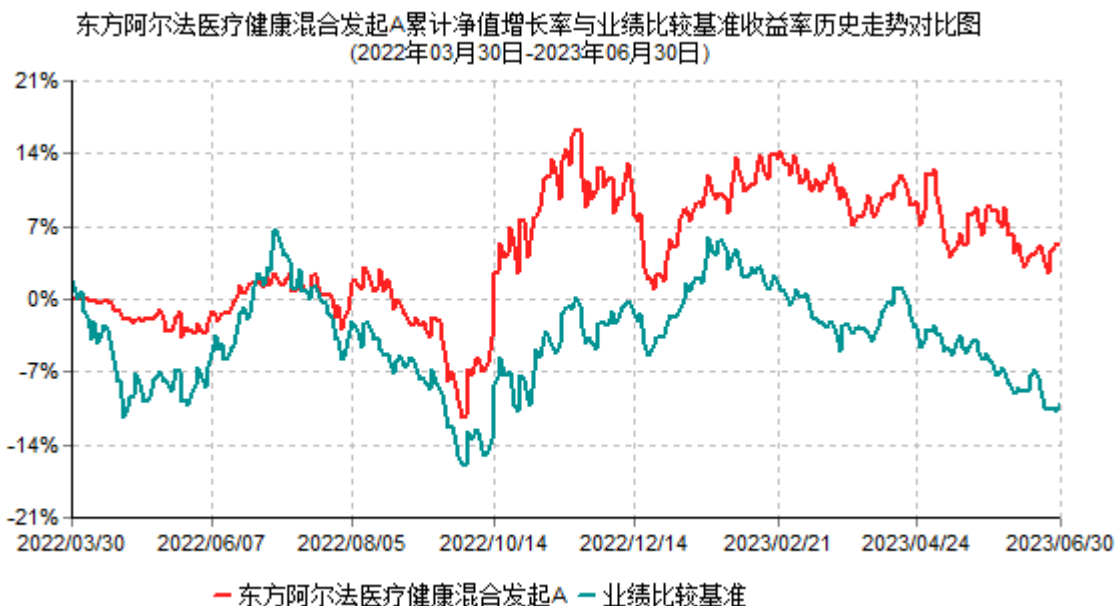
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|    |          |             |            |               |     |     |

|            |        |       |         |       |        |       |
|------------|--------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去一个月      | -3.18% | 1.17% | -2.83%  | 0.83% | -0.35% | 0.34% |
| 过去三个月      | -4.47% | 1.24% | -6.92%  | 0.86% | 2.45%  | 0.38% |
| 过去六个月      | 0.00%  | 1.18% | -8.44%  | 0.90% | 8.44%  | 0.28% |
| 过去一年       | 2.61%  | 1.47% | -12.62% | 1.22% | 15.23% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.61%  | 1.34% | -9.99%  | 1.27% | 14.60% | 0.07% |

注：1、本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×60%+恒生医疗保健指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率×20%。

2、本基金自2022年3月30日成立至今尚未满三年，无过去三年、过去五年的净值表现。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



东方阿尔法医疗健康混合发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年03月30日-2023年06月30日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东方阿尔法基金管理有限公司（以下简称“东方阿尔法基金”）于2017年6月24日经中国证监会批准，2017年7月4日注册成立，公司总部设在广东省深圳市，证券期货业务范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理。截至报告期末，注册资本为1亿元人民币。

东方阿尔法基金作为华南地区首家纯员工持股的公募基金管理公司，公司股权结构为刘明、珠海共同成长投资合伙企业（有限合伙）、肖冰、雷振锋、曾健分别持有公司39.96%、39.56%、13.98%、4.5%和2%的股权。

截至报告期末，东方阿尔法基金管理资产规模82.86亿元，旗下管理8只公开募集证券投资基金和3只私募资产管理计划。

#### 4.1.2 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 | 说明 |
|----|----|-------------|------|-------|----|
|    |    | 任职日期        | 离任日期 |       |    |
|    |    |             |      |       |    |

|     |               |            |   | 限   |  |
|-----|---------------|------------|---|-----|--|
| 乔海英 | 基金经理、公募投资部副总监 | 2022-03-30 | - | 12年 | 乔海英女士，天津大学制药工程学士，南开大学金融学硕士，专注于医疗板块研究投资，拥有11年公募基金医疗行业投研经验。曾先后任职于博时基金管理有限公司、民生加银基金管理有限公司、平安基金管理有限公司。现任东方阿尔法基金公司公募投资部副总监。 |

注：1.对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公告确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，"任职日期"和"离任日期"分别指公告确定的任职日期和离任日期。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金《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。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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。

本报告期内，本基金管理人利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗（包括当日、3日内、5日内）对基金管理人管理的不同投资组合反向交易和同向交易的交易价差监控进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在参与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，且不存在其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金的长期投资目标是专注于极具成长性的医疗健康领域，为持有人创造长期可持续的超额收益。注重持有体验，兼顾长短期，力争做更有性价比的投资。在投资策略上我们追求重复胜率高的投资策略，淡化各细分领域的下注，均衡配置以互相对冲，降低组合承担的风险，把更多精力放在自下而上的个股选择上。即赛道分散，个股集中，专注于挖掘个股阿尔法的策略。个股选择上目标赚利润增长的钱，淡化对估值扩张收益的追逐。从成长性、确定性、估值水平三个角度衡量投资标的的性价比做动态调整，兼顾长短期，对短期波动给予与其确定性相匹配的持有久期和容忍度。

当前医药板块调整的时间和幅度较为充分，估值处于相对低位，但中长期企业盈利确定性高，短期疫情管控政策的变化带来的基本面向上修复确定，中报季医药上市公司的业绩值得期待。医疗开支相对支付意愿较强，叠加人口年龄结构的变化，医药产业整体中长期基本面向好。基金经理判断医药板块已进入中长期底部区域，从住院端筛选有产品创新能力和竞争格局稳定的企业，重点配置了较受益于医院端需求复苏的相关资产。从OTC筛选品牌认知度较高和渠道优势明显的、主要以自我诊疗为主要消费场景的相关标的，兼顾从科技创新和进口替代（制造升级）的思路进行布局。具体包括：零售药店和自我诊疗类药品、创新药、械及其产业链，以及与住院治疗相关性较强的精麻类资产。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东方阿尔法医疗健康混合发起A基金份额净值为1.0526元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.24%，同期业绩比较基准收益率为-8.44%；截至报告期末东方阿尔法医疗健康混合发起C基金份额净值为1.0461元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.00%，同期业绩比较基准收益率为-8.44%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于去年底国内疫情政策的调整，整体医药板块在春节前后业务逐步恢复，部分疫后复苏品种反弹充分，市场进入数据验证的基本面兑现阶段。故整体Q2在基本面改善趋

势确定性强的住院端需求复苏表现较好。同时以创新药为代表的政策边际向好，也给整体处于底部的医药板块增添信心。

近期市场对医疗行业的反腐政策表现出强烈担忧，板块整体出现较大幅度调整。为此我们有必要在此申明我们对医疗行业反腐的观点：长期看，这又是一次医药行业内的供给侧改革，只有在研发层面不断提升自身产品的创新性，在市场层面走规范学术营销的企业才有希望在历次行业规范中“剩者为王”。医疗行业的腐败可以分为两类：一类是各行业普遍存在的权力的延伸，特殊之处在于案例多表现为医疗行业内的优秀从业者。第二类是医疗行业存在极强的信息不对称，海外多通过给予高从业道德要求、高违法成本来约束从业者行为，用高薪酬来奖励规范从业者。第一类腐败数量少、金额大、易查处，可以通过运动式反腐短期快速出清，并有利于激励继任者。而第二类腐败涉及到的专业行为过多，属于行业普遍存在的数量极大，金额相对较小，查实违法行为需要专业机构配合且难度较大。这类腐败更多的是源于医患之间严重的信息不对称，唯有在制度层面逐步完善才能在一定程度上得到改善而非消除。为此我们总体上认为医疗反腐不同于互联网平台和教培行业的政策压力，并不会减少医疗需求，相反对行业内部极少数从业者的处罚有利于提高中长期的医疗供给，行业成长空间仍然广阔。同时也必须看到，我国的医疗保障制度也处于不断完善的过程，不断提高阳光化收入，规范各环节从业者的行为等各方面更为完善的建章立制才更有利于降低整体医疗负担，要意识到降低医疗费用并不是政策目标，然而后一类的变革并不能一蹴而就。

我们对医药行业继续保持乐观：行业基本面持续改善的趋势已经明朗，降价政策市场反应已经钝化，医疗反腐带来短期板块快速下跌已经迅速释放估值风险，整体又进入了底部区域选股阶段。我们注重个股性价比的选股策略将继续专注成长逻辑并未破坏，且估值匹配度高的优质标的挖掘。医药板块接下来面临常规医疗需求的复苏、自我诊疗的消费意愿和消费能力双提升。叠加估值水平和基金持仓双低，边际上政策持续良性引导、短期业绩表现强韧，我们有理由对行业转向乐观，基于中长期产业趋势的受益方向去筛选标的。努力寻找一些具有估值性价比、安全边际的个股对持仓进行优化，平衡持仓估值，平衡长短期风险与收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人已将本基金的基金估值核算业务外包给本基金的金融运营服务机构--招商证券股份有限公司。本基金金融运营服务机构按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金金融运营服务机构使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。金融运营服务机构改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的

适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人建立了估值小组，成员由运作保障部、公募投资部、专户投资部、研究部和监察稽核部业务骨干组成，负责指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 3,305,370.87       | 8,188,604.26        |
| 结算备付金      |         | -                  | -                   |
| 存出保证金      |         | -                  | -                   |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 252,356,487.01     | 188,989,407.42      |
| 其中：股票投资    |         | 239,498,436.20     | 179,850,755.64      |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | 12,858,050.81      | 9,138,651.78        |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资      |         | -                  | -                   |
| 其他投资       |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | -                  | -                   |
| 债权投资       |         | -                  | -                   |
| 其中：债券投资    |         | -                  | -                   |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |
| 其他投资       |         | -                  | -                   |
| 其他债权投资     |         | -                  | -                   |
| 其他权益工具投资   |         | -                  | -                   |
| 应收清算款      |         | -                  | -                   |
| 应收股利       |         | -                  | -                   |
| 应收申购款      |         | 94,152.21          | 6,344,681.66        |
| 递延所得税资产    |         | -                  | -                   |
| 其他资产       | 6.4.7.5 | -                  | -                   |



| 资产总计        |         | 255,756,010.09     | 203,522,693.34      |
|-------------|---------|--------------------|---------------------|
| 负债和净资产      | 附注号     | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
| <b>负债：</b>  |         |                    |                     |
| 短期借款        |         | -                  | -                   |
| 交易性金融负债     |         | -                  | -                   |
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3 | -                  | -                   |
| 卖出回购金融资产款   |         | -                  | -                   |
| 应付清算款       |         | -                  | 1,336,774.29        |
| 应付赎回款       |         | 329,699.46         | 489,592.70          |
| 应付管理人报酬     |         | 313,777.30         | 237,611.10          |
| 应付托管费       |         | 52,296.22          | 39,601.86           |
| 应付销售服务费     |         | 26,348.28          | 15,335.85           |
| 应付投资顾问费     |         | -                  | -                   |
| 应交税费        |         | 0.34               | -                   |
| 应付利润        |         | -                  | -                   |
| 递延所得税负债     |         | -                  | -                   |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 79,438.13          | 90,015.56           |
| 负债合计        |         | 801,559.73         | 2,208,931.36        |
| <b>净资产：</b> |         |                    |                     |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 242,598,755.93     | 191,862,400.85      |
| 其他综合收益      |         | -                  | -                   |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 12,355,694.43      | 9,451,361.13        |
| 净资产合计       |         | 254,954,450.36     | 201,313,761.98      |
| 负债和净资产总计    |         | 255,756,010.09     | 203,522,693.34      |

注：报告截止日2023年06月30日，东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.0526元，C类基金份额净值1.0461元，基金总份额242,598,755.93份，其中A类基金份额180,536,528.16份，C类基金份额62,062,227.77份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目                            | 附注号      | 本期<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年03月30日（基金<br>合同生效日）至2022<br>年06月30日 |
|-------------------------------|----------|-----------------------------------|---|
| 一、营业总收入                       |          | -405,931.86                       | 5,769,304.86  |
| 1.利息收入                        |          | 8,291.85                          | 491,511.53  |
| 其中：存款利息收入                     | 6.4.7.9  | 8,291.85                          | 200,652.34  |
| 债券利息收入                        |          | -                                 | -   |
| 资产支持证券利息<br>收入                |          | -                                 | -   |
| 买入返售金融资产<br>收入                |          | -                                 | 290,859.19  |
| 证券出借利息收入                      |          | -                                 | -   |
| 其他利息收入                        |          | -                                 | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”<br>填列）          |          | -3,113,905.77                     | 159,926.68  |
| 其中：股票投资收益                     | 6.4.7.10 | -4,962,767.56                     | -601,605.68   |
| 基金投资收益                        | 6.4.7.11 | -                                 | -   |
| 债券投资收益                        | 6.4.7.12 | 100,113.48                        | 150,114.00  |
| 资产支持证券投资<br>收益                | 6.4.7.13 | -                                 | -   |
| 贵金属投资收益                       | 6.4.7.14 | -                                 | -   |
| 衍生工具收益                        | 6.4.7.15 | -                                 | -   |
| 股利收益                          | 6.4.7.16 | 1,748,748.31                      | 611,418.36  |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认<br>产生的收益 |          | -                                 | -   |
| 其他投资收益                        |          | -                                 | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失<br>以“-”号填列）     | 6.4.7.17 | 2,266,510.89                      | 5,037,769.28  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”                 |          | -                                 | -   |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 号填列)                       |            |               |              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列)          | 6.4.7.18   | 433,171.17    | 80,097.37    |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 2,131,797.76  | 1,173,811.68 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,655,301.89  | 903,917.38   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 275,883.63    | 150,652.87   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 118,293.95    | 86,073.03    |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -            |
| 5. 利息支出                    |            | -             | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | -            |
| 6. 信用减值损失                  |            | -             | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 0.10          | -            |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.19   | 82,318.19     | 33,168.40    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)</b> |            | -2,537,729.62 | 4,595,493.18 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列)</b>   |            | -2,537,729.62 | 4,595,493.18 |
| 五、其他综合收益的税后净额              |            | -             | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -2,537,729.62 | 4,595,493.18 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |        |              |                |
|---------------|-------------------------------|--------|--------------|----------------|
|               | 实收基金                          | 其他综合收益 | 未分配利润        | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净 | 191,862,400.85                | -      | 9,451,361.13 | 201,313,761.98 |

|  |                 |   |                |                 |
|--|-----------------|---|----------------|-----------------|
| 值)                                       |                 |   |                |                 |
| 加：会计政策变更                                 | -               | - | -              | -               |
| 前期差错更正                                   | -               | - | -              | -               |
| 其他                                       | -               | - | -              | -               |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 191,862,400.85  | - | 9,451,361.13   | 201,313,761.98  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 50,736,355.08   | - | 2,904,333.30   | 53,640,688.38   |
| （一）、综合收益总额                               | -               | - | -2,537,729.62  | -2,537,729.62   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 50,736,355.08   | - | 5,442,062.92   | 56,178,418.00   |
| 其中：1.基金申购款                               | 166,244,829.92  | - | 16,426,431.22  | 182,671,261.14  |
| 2.基金赎回款                                  | -115,508,474.84 | - | -10,984,368.30 | -126,492,843.14 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -               | - | -              | -               |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -               | - | -              | -               |

|                                     |   |        |               |                |
|-------------------------------------|---|--------|---------------|----------------|
| 四、本期期末净资产（基金净值）                     | 242,598,755.93                              | -      | 12,355,694.43 | 254,954,450.36 |
| 项目                                  | 上年度可比期间<br>2022年03月30日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |        |               |                |
|                                     | 实收基金  | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                     | 245,309,957.58                              | -      | -             | 245,309,957.58 |
| 加：会计政策变更                            | -   | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                              | -   | -      | -             | -              |
| 其他                                  | -   | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                     | 245,309,957.58                              | -      | -             | 245,309,957.58 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -50,971,195.26                              | -      | 3,973,396.73  | -46,997,798.53 |
| （一）、综合收益总额                          | -   | -      | 4,595,493.18  | 4,595,493.18   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -50,971,195.26                              | -      | -622,096.45   | -51,593,291.71 |
| 其中：1.基金申购款                          | 899,114.38                                  | -      | 12,177.39     | 911,291.77     |
| 2.基金赎回款                             | -51,870,309.64                              | -      | -634,273.84   | -52,504,583.48 |
| （三）、本期向                             | -   | -      | -             | -              |

|                                   |                |   |              |                |
|-----------------------------------|----------------|---|--------------|----------------|
| 基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) |                |   |              |                |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                  | -              | - | -            | -              |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                   | 194,338,762.32 | - | 3,973,396.73 | 198,312,159.05 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

刘明

曹渊

张珂

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2021]第4076号《关于准予东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由东方阿尔法基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币245,267,687.42元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0240号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金合同》于2022年3月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为245,309,957.58份基金份额,其中认购资金利息折合42,270.16份基金份额。本基金的基金管理人为东方阿尔法基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,012,783.23份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金合同》和《东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金招募说明书》(含更新),本基金根据所收取认购/申

购费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。收取认购/申购费用、赎回费用而不计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为A类基金份额；不收取认购/申购费、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票(包括沪港通股票及深港通股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的60%-95%，其中对港股通标的股票(包括沪港通股票及深港通股票)的投资比例不超过股票资产的50%。本基金以医疗健康行业的上市公司股票为主要投资对象，投资于医疗健康相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×60%+恒生医疗保健指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。



对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2023年06月30日 |
|--------|--------------------|
| 活期存款   | 1,396,001.77       |
| 等于：本金  | 1,395,843.42       |
| 加：应计利息 | 158.35             |
| 减：坏账准备 | -                  |
| 定期存款   | -                  |
| 等于：本金  | -                  |

|              |              |
|--------------|--------------|
| 加：应计利息       | -            |
| 减：坏账准备       | -            |
| 其中：存款期限1个月以内 | -            |
| 存款期限1-3个月    | -            |
| 存款期限3个月以上    | -            |
| 其他存款         | 1,909,369.10 |
| 等于：本金        | 1,909,231.98 |
| 加：应计利息       | 137.12       |
| 减：坏账准备       | -            |
| 合计           | 3,305,370.87 |

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年06月30日 |               |                |               |           |
|---------------|--------------------|---------------|----------------|---------------|-----------|
|               | 成本                 | 应计利息          | 公允价值           | 公允价值变动        |           |
| 股票            | 245,699,417.38     | -             | 239,498,436.20 | -6,200,981.18 |           |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -             | -              | -             |           |
| 债券            | 交易所市场              | 12,668,198.50 | 156,048.06     | 12,858,050.81 | 33,804.25 |
|               | 银行间市场              | -             | -              | -             | -         |
|               | 合计                 | 12,668,198.50 | 156,048.06     | 12,858,050.81 | 33,804.25 |
| 资产支持证券        | -                  | -             | -              | -             |           |
| 基金            | -                  | -             | -              | -             |           |
| 其他            | -                  | -             | -              | -             |           |
| 合计            | 258,367,615.88     | 156,048.06    | 252,356,487.01 | -6,167,176.93 |           |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 94.97              |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | -                  |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 79,343.16          |
| 合计          | 79,438.13          |

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 东方阿尔法医疗健康混合发起A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(东方阿尔法医疗健康混合发<br>起A) | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                |
|----------------------------|-------------------------------|----------------|
|                            | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末                       | 150,439,772.15                | 150,439,772.15 |
| 本期申购                       | 74,702,882.98                 | 74,702,882.98  |
| 本期赎回（以“-”号填列）              | -44,606,126.97                | -44,606,126.97 |

|     |                |                |
|-----|----------------|----------------|
| 本期末 | 180,536,528.16 | 180,536,528.16 |
|-----|----------------|----------------|

#### 6.4.7.7.2 东方阿尔法医疗健康混合发起C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(东方阿尔法医疗健康混合发起C) | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                |
|------------------------|-------------------------------|----------------|
|                        | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末                   | 41,422,628.70                 | 41,422,628.70  |
| 本期申购                   | 91,541,946.94                 | 91,541,946.94  |
| 本期赎回（以“-”号填列）          | -70,902,347.87                | -70,902,347.87 |
| 本期末                    | 62,062,227.77                 | 62,062,227.77  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 东方阿尔法医疗健康混合发起A

单位：人民币元

| 项目<br>(东方阿尔法医疗健康混合发起A) | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初                   | 16,589,150.07 | -9,049,158.85 | 7,539,991.22  |
| 本期利润                   | -3,898,301.75 | 2,177,852.28  | -1,720,449.47 |
| 本期基金份额交易产生的变动数         | 2,996,121.72  | 680,250.93    | 3,676,372.65  |
| 其中：基金申购款               | 7,524,690.31  | 207,353.41    | 7,732,043.72  |
| 基金赎回款                  | -4,528,568.59 | 472,897.52    | -4,055,671.07 |
| 本期已分配利润                | -             | -             | -             |
| 本期末                    | 15,686,970.04 | -6,191,055.64 | 9,495,914.40  |

##### 6.4.7.8.2 东方阿尔法医疗健康混合发起C

单位：人民币元

| 项目<br>(东方阿尔法医疗健康混合发起C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------------------------|-------|-------|---------|
|------------------------|-------|-------|---------|

|                |               |               |               |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 混合发起C)         |               |               |               |
| 本期期初           | 4,394,212.12  | -2,482,842.21 | 1,911,369.91  |
| 本期利润           | -905,938.76   | 88,658.61     | -817,280.15   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,482,088.06  | 283,602.21    | 1,765,690.27  |
| 其中：基金申购款       | 8,130,710.29  | 563,677.21    | 8,694,387.50  |
| 基金赎回款          | -6,648,622.23 | -280,075.00   | -6,928,697.23 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 4,970,361.42  | -2,110,581.39 | 2,859,780.03  |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,640.72                      |
| 定期存款利息收入  | -                             |
| 其他存款利息收入  | 5,651.13                      |
| 结算备付金利息收入 | -                             |
| 其他        | -                             |
| 合计        | 8,291.85                      |

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 460,854,802.68                |
| 减：卖出股票成本总额 | 464,355,247.16                |
| 减：交易费用     | 1,462,323.08                  |
| 买卖股票差价收入   | -4,962,767.56                 |

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                      |
|------------------------------|-------------------------|
|                              | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 108,348.75              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -8,235.27               |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                       |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                       |
| 合计                           | 100,113.48              |

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                      |
|------------------------|-------------------------|
|                        | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 7,140,863.29            |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 7,006,870.55            |
| 减：应计利息总额               | 141,063.29              |
| 减：交易费用                 | 1,164.72                |
| 买卖债券差价收入               | -8,235.27               |

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                      |
|---------------|-------------------------|
|               | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 1,748,748.31            |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                       |
| 基金投资产生的股利收益   | -                       |
| 合计            | 1,748,748.31            |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                      |
|------------------------|-------------------------|
|                        | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 1.交易性金融资产              | 2,266,510.89            |
| ——股票投资                 | 2,213,751.59            |
| ——债券投资                 | 52,759.30               |
| ——资产支持证券投资             | -                       |
| ——贵金属投资                | -                       |
| ——其他                   | -                       |
| 2.衍生工具                 | -                       |
| ——权证投资                 | -                       |
| 3.其他                   | -                       |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                       |
| 合计                     | 2,266,510.89            |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 429,539.29              |
| 转换费收入   | 3,631.88                |
| 合计      | 433,171.17              |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中A类份额不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额赎回费全部归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 审计费用    | 19,835.79               |
| 信息披露费   | 59,507.37               |
| 证券出借违约金 | -                       |
| 汇划手续费   | 2,975.03                |
| 合计      | 82,318.19               |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方



| 关联方名称                    | 与本基金的关系      |
|--------------------------|--------------|
| 东方阿尔法基金管理有限公司(“东方阿尔法基金”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”)       | 基金托管人、基金销售机构 |
| 珠海共同成长投资合伙企业(有限合伙)       | 基金管理人股东      |
| 刘明                       | 基金管理人股东      |
| 肖冰                       | 基金管理人股东      |
| 雷振锋                      | 基金管理人股东      |
| 曾健                       | 基金管理人股东      |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2023年01月01日<br>至2023年06月30<br>日 | 上年度可比期间<br>2022年03月30日（基金合同<br>生效日）至2022年06月30日 |
|----|---------------------------------------|---|
|    |                                       |   |

|                 |              |            |
|-----------------|--------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,655,301.89 | 903,917.38 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 320,952.12   | 330,522.11 |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年01月01日<br>至2023年06月30<br>日 | 上年度可比期间<br>2022年03月30日（基金合同生<br>效日）至2022年06月30日 |
|----------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 275,883.63                            | 150,652.87                                      |

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

|      |    |
|------|----|
| 获得销售 | 本期 |
|------|----|

| 服务费的各关联方名称     | 2023年01月01日至2023年06月30日          |                |           |
|----------------|----------------------------------|----------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |                |           |
|                | 东方阿尔法医疗健康混合发起A                   | 东方阿尔法医疗健康混合发起C | 合计        |
| 招商银行           | 0.00                             | 3,422.20       | 3,422.20  |
| 东方阿尔法基金        | 0.00                             | 18,077.12      | 18,077.12 |
| 合计             | 0.00                             | 21,499.32      | 21,499.32 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                          |                |           |
|                | 2022年03月30日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |                |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |                |           |
| 东方阿尔法医疗健康混合发起A | 东方阿尔法医疗健康混合发起C                   | 合计             |           |
| 招商银行股份有限公司     | 0.00                             | 191.34         | 191.34    |
| 东方阿尔法基金管理有限公司  | 0.00                             | 149.38         | 149.38    |
| 合计             | 0.00                             | 340.72         | 340.72    |

注：1、本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.5%。

2、本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

东方阿尔法医疗健康混合发起A

份额单位：份

| 项目                          | 本期                      | 上年度可比期间                          |
|-----------------------------|-------------------------|----------------------------------|
|                             | 2023年01月01日至2023年06月30日 | 2022年03月30日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
| 基金合同生效日（2022年03月30日）持有的基金份额 | -                       | 5,001,125.22                     |
| 报告期初持有的基金份额                 | 5,001,125.22            | -                                |
| 报告期间申购/买入总份额                | -                       | -                                |
| 报告期间因拆分变动份额                 | -                       | -                                |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额              | -                       | -                                |
| 报告期末持有的基金份额                 | 5,001,125.22            | 5,001,125.22                     |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 2.77%                   | 3.33%                            |

注:1. 以上表中"报告期末持有的基金份额占基金总份额比例"的计算中,对下属不同类别基金比例的分母采用各自级别的份额。

2.报告期内基金管理人未运用固有资金投资"东方阿尔法医疗健康混合发起C"。

### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

东方阿尔法医疗健康混合发起A

| 关联方名称 | 本期末<br>2023年06月30日 |                  | 上年度末<br>2022年12月31日 |                  |
|-------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 曾健    | 1,001,024.72       | 0.55%            | 1,001,024.72        | 0.67%            |
| 刘明    | 1,000,045.03       | 0.55%            | 1,000,045.03        | 0.66%            |
| 肖冰    | 1,000,045.03       | 0.55%            | 1,000,045.03        | 0.66%            |

注:1.以上表中"持有的基金份额占基金总份额的比例"的计算中,对下属不同类别基金比例的分母采用各自级别的份额。

2.报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资"东方阿尔法医疗健康混合发起C"。

### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |          | 上年度可比期间<br>2022年03月30日（基金合同生效日）<br>至2022年06月30日 |           |
|------------|-------------------------------|----------|---|-----------|
|            | 期末余额                          | 当期利息收入   | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 招商银行股份有限公司 | 1,396,001.77                  | 2,640.72 | 939,537.03                                      | 22,312.33 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |       |        |       |        |          |           |            |    |
|----------------------|------|------------|-------|--------|-------|--------|----------|-----------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期   | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额    | 期末估值总额     | 备注 |
| 688435               | 英方软件 | 2023-01-12 | 6个月   | 新股流通受限 | 38.66 | 73.03  | 1,980    | 76,546.80 | 144,599.40 | -  |
| 301395               | 仁信新材 | 2023-06-21 | 6个交易日 | 新股未上市  | 26.68 | 26.68  | 3,467    | 92,499.56 | 92,499.56  | -  |
| 301292               | 海科新源 | 2023-06-29 | 6个交易日 | 新股未上市  | 19.99 | 19.99  | 4,193    | 83,818.07 | 83,818.07  | -  |
| 688603               | 天承科技 | 2023-06-30 | 6个交易日 | 新股未上市  | 55.00 | 55.00  | 1,251    | 68,805.00 | 68,805.00  | -  |
| 301261               | 恒工精密 | 2023-06-29 | 7个交易日 | 新股未上市  | 36.90 | 36.90  | 1,471    | 54,279.90 | 54,279.90  | -  |
| 301202               | 朗威股份 | 2023-06-28 | 5个交易日 | 新股未上市  | 25.82 | 25.82  | 2,060    | 53,189.20 | 53,189.20  | -  |
| 001286               | 陕西能源 | 2023-03-31 | 6个月   | 新股流通受限 | 9.60  | 9.41   | 3,767    | 36,163.20 | 35,447.47  | -  |
| 688249               | 晶合集成 | 2023-04-24 | 6个月   | 新股流通受限 | 19.86 | 18.06  | 1,284    | 25,500.24 | 23,189.04  | -  |
| 688472               | 阿特斯  | 2023-06-02 | 6个月   | 新股流通受限 | 11.10 | 17.04  | 1,030    | 11,433.00 | 17,551.20  | -  |
| 301310               | 鑫宏业  | 2023-05-26 | 6个月   | 新股流通受限 | 67.28 | 65.43  | 224      | 15,070.72 | 14,656.32  | -  |

|        |      |            |     |                |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|----------------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 301320 | 豪江智能 | 2023-06-01 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 13.06 | 20.62  | 642   | 8,384.52  | 13,238.04 | - |
| 688629 | 华丰科技 | 2023-06-16 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 9.26  | 18.59  | 708   | 6,556.08  | 13,161.72 | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023-04-28 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 5.69  | 5.41   | 2,402 | 13,667.38 | 12,994.82 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 26.74 | 40.68  | 304   | 8,128.96  | 12,366.72 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023-05-04 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 76.80 | 107.95 | 114   | 8,755.20  | 12,306.30 | - |
| 301291 | 明阳电气 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 38.13 | 31.03  | 338   | 12,887.94 | 10,488.14 | - |
| 688593 | 新相微  | 2023-05-25 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 11.18 | 14.59  | 711   | 7,948.98  | 10,373.49 | - |
| 301395 | 仁信新材 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 26.68 | 26.68  | 386   | 10,298.48 | 10,298.48 | - |
| 688543 | 国科军工 | 2023-06-14 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 43.67 | 53.05  | 192   | 8,384.64  | 10,185.60 | - |
| 688620 | 安凯微  | 2023-06-15 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 10.68 | 12.34  | 816   | 8,714.88  | 10,069.44 | - |
| 301225 | 恒勃股份 | 2023-06-08 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 35.66 | 33.26  | 302   | 10,769.32 | 10,044.52 | - |
| 301358 | 湖南裕能 | 2023-02-01 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 23.77 | 42.89  | 229   | 5,443.33  | 9,821.81  | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023-06-29 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 19.99 | 19.99  | 466   | 9,315.34  | 9,315.34  | - |
| 68852  | 航天   | 2023-0     | 6个月 | 新股             | 21.86 | 23.85  | 385   | 8,416.    | 9,182.    | - |

|        |      |            |     |        |        |        |     |           |          |   |
|--------|------|------------|-----|--------|--------|--------|-----|-----------|----------|---|
| 3      | 环宇   | 5-26       |     | 流通受限   |        |        |     | 10        | 25       |   |
| 301262 | 海看股份 | 2023-06-13 | 6个月 | 新股流通受限 | 30.22  | 25.50  | 351 | 10,607.22 | 8,950.50 | - |
| 301260 | 格力博  | 2023-01-20 | 6个月 | 新股流通受限 | 30.85  | 23.63  | 372 | 11,476.20 | 8,790.36 | - |
| 301210 | 金杨股份 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股流通受限 | 57.88  | 49.17  | 173 | 10,013.24 | 8,506.41 | - |
| 301382 | 蜂助手  | 2023-05-09 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.80  | 32.84  | 248 | 5,902.40  | 8,144.32 | - |
| 688458 | 美芯晟  | 2023-05-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 75.00  | 90.76  | 87  | 6,525.00  | 7,896.12 | - |
| 688531 | 日联科技 | 2023-03-24 | 6个月 | 新股流通受限 | 152.38 | 135.97 | 58  | 8,838.04  | 7,886.26 | - |
| 301397 | 溯联股份 | 2023-06-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 53.27  | 40.20  | 192 | 10,227.84 | 7,718.40 | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023-06-08 | 6个月 | 新股流通受限 | 72.50  | 58.42  | 132 | 9,570.00  | 7,711.44 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.00  | 55.00  | 140 | 7,700.00  | 7,700.00 | - |
| 301307 | 美利信  | 2023-04-14 | 6个月 | 新股流通受限 | 32.34  | 31.86  | 238 | 7,696.92  | 7,582.68 | - |
| 301376 | 致欧科技 | 2023-06-14 | 6个月 | 新股流通受限 | 24.66  | 22.51  | 336 | 8,285.76  | 7,563.36 | - |
| 688552 | 航天南湖 | 2023-05-08 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.17  | 23.50  | 321 | 6,795.57  | 7,543.50 | - |
| 688570 | 天玛智控 | 2023-05-29 | 6个月 | 新股流通   | 30.26  | 25.33  | 296 | 8,956.96  | 7,497.68 | - |



|        |      |            |     |        |        |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-----|--------|--------|-------|-----|----------|----------|---|
|        |      |            |     | 受限     |        |       |     |          |          |   |
| 301355 | 南王科技 | 2023-06-02 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.55  | 16.75 | 441 | 7,739.55 | 7,386.75 | - |
| 300804 | 广康生化 | 2023-06-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 42.45  | 32.97 | 222 | 9,423.90 | 7,319.34 | - |
| 301141 | 中科磁业 | 2023-03-27 | 6个月 | 新股流通受限 | 41.20  | 42.69 | 170 | 7,004.00 | 7,257.30 | - |
| 688429 | 时创能源 | 2023-06-20 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.20  | 25.53 | 284 | 5,452.80 | 7,250.52 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023-04-17 | 6个月 | 新股流通受限 | 71.88  | 92.60 | 77  | 5,534.76 | 7,130.20 | - |
| 301387 | 光大同创 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股流通受限 | 58.32  | 45.36 | 154 | 8,981.28 | 6,985.44 | - |
| 301303 | 真兰仪表 | 2023-02-13 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.80  | 22.32 | 312 | 8,361.60 | 6,963.84 | - |
| 301332 | 德尔玛  | 2023-05-09 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.81  | 13.73 | 505 | 7,479.05 | 6,933.65 | - |
| 301429 | 森泰股份 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.75  | 21.02 | 327 | 9,401.25 | 6,873.54 | - |
| 688146 | 中船特气 | 2023-04-13 | 6个月 | 新股流通受限 | 36.15  | 38.13 | 175 | 6,326.25 | 6,672.75 | - |
| 301170 | 锡南科技 | 2023-06-16 | 6个月 | 新股流通受限 | 34.00  | 34.93 | 191 | 6,494.00 | 6,671.63 | - |
| 301408 | 华人健康 | 2023-02-22 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.24  | 16.95 | 386 | 6,268.64 | 6,542.70 | - |
| 688623 | 双元科技 | 2023-05-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 125.88 | 86.79 | 75  | 9,441.00 | 6,509.25 | - |

|        |      |            |     |                |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-----|----------------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 301323 | 新莱福  | 2023-05-29 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 39.06 | 39.36 | 163 | 6,366.78 | 6,415.68 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023-06-19 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 25.28 | 29.87 | 212 | 5,359.36 | 6,332.44 | - |
| 301246 | 宏源药业 | 2023-03-10 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 50.00 | 30.71 | 199 | 9,950.00 | 6,111.29 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 36.90 | 36.90 | 164 | 6,051.60 | 6,051.60 | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023-01-20 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 33.73 | 31.85 | 190 | 6,408.70 | 6,051.50 | - |
| 688433 | 华曙高科 | 2023-04-07 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 26.66 | 31.50 | 188 | 5,012.08 | 5,922.00 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 25.82 | 25.82 | 229 | 5,912.78 | 5,912.78 | - |
| 688512 | 慧智微  | 2023-05-08 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 20.92 | 19.16 | 296 | 6,192.32 | 5,671.36 | - |
| 301357 | 北方长龙 | 2023-04-11 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 50.00 | 48.39 | 105 | 5,250.00 | 5,080.95 | - |
| 001287 | 中电港  | 2023-03-30 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 11.88 | 21.02 | 241 | 2,863.08 | 5,065.82 | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023-03-01 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 56.50 | 52.93 | 93  | 5,254.50 | 4,922.49 | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023-03-21 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 29.99 | 23.79 | 196 | 5,878.04 | 4,662.84 | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股<br>流通<br>受限 | 6.58  | 7.58  | 604 | 3,974.32 | 4,578.32 | - |
| 68847  | 友车   | 2023-0     | 6个月 | 新股             | 33.99 | 29.49 | 153 | 5,200.   | 4,511.   | - |

|        |      |            |     |        |        |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-----|--------|--------|-------|-----|----------|----------|---|
| 9      | 科技   | 5-04       |     | 流通受限   |        |       |     | 47       | 97       |   |
| 301203 | 国泰环保 | 2023-03-28 | 6个月 | 新股流通受限 | 46.13  | 34.40 | 128 | 5,904.64 | 4,403.20 | - |
| 301322 | 绿通科技 | 2023-02-27 | 6个月 | 新股流通受限 | 131.11 | 53.24 | 81  | 7,079.94 | 4,312.44 | - |
| 001380 | 华纬科技 | 2023-05-09 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.84  | 30.78 | 128 | 3,691.52 | 3,939.84 | - |
| 603135 | 中重科技 | 2023-03-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.80  | 17.89 | 197 | 3,506.60 | 3,524.33 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.36  | 11.84 | 206 | 2,134.16 | 2,439.04 | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.66  | 12.26 | 195 | 2,273.70 | 2,390.70 | - |
| 603137 | 恒尚节能 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.90  | 17.09 | 139 | 2,210.10 | 2,375.51 | - |
| 001328 | 登康口腔 | 2023-03-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.68  | 25.49 | 86  | 1,778.48 | 2,192.14 | - |
| 603172 | 万丰股份 | 2023-04-28 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.58  | 16.13 | 122 | 1,778.76 | 1,967.86 | - |
| 001360 | 南矿集团 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.38  | 14.87 | 111 | 1,707.18 | 1,650.57 | - |
| 603125 | 常青科技 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股流通受限 | 25.98  | 24.53 | 64  | 1,662.72 | 1,569.92 | - |
| 001367 | 海森药业 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股流通受限 | 44.48  | 39.48 | 34  | 1,512.32 | 1,342.32 | - |

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁

定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

4. 基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末未持有因参与转融通证券出借业务的证券。

### **6.4.13 金融工具风险及管理**

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、定期存款和交易所回购等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的三级风险防控体系。一级风险防范指基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等。二级风险防范指在公司投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。公司经理层设投资决策委员会，对涉及基金投资的重大问题进行决策，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部在督察长的领导下，独立于公司各业务部门，对各岗位、各部门、各项业务中的风险控制情况实施监督。三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。本基金在交易所进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金目前暂未开展银行间同业市场业务，无此类信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部债券信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于2023年6月30日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产比例为0.04%（于2022年12月31日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，监察稽核部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监察稽核部对本基金的综合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持的证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计占基金资产净值的比例为0.41%（2022年12月31日：0.13%）。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2023年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 年<br>06 月 30<br>日 | 1 个月以内       | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计           |
|-------------------------------|--------------|--------|----------|-------|-------|-----|--------------|
| 资产                            |              |        |          |       |       |     |              |
| 银行存款                          | 3,305,370.87 | -      | -        | -     | -     | -   | 3,305,370.87 |

东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金 2023 年中期报告

|                                |              |              |               |       |           |                |                |
|--------------------------------|--------------|--------------|---------------|-------|-----------|----------------|----------------|
| 交易性金融资产                        | -            | -            | 12,767,594.47 | -     | 90,456.34 | 239,498,436.20 | 252,356,487.01 |
| 应收申购款                          | -            | -            | -             | -     | -         | 94,152.21      | 94,152.21      |
| 资产总计                           | 3,305,370.87 | -            | 12,767,594.47 | -     | 90,456.34 | 239,592,588.41 | 255,756,010.09 |
| 负债                             |              |              |               |       |           |                |                |
| 应付赎回款                          | -            | -            | -             | -     | -         | 329,699.46     | 329,699.46     |
| 应付管理人报酬                        | -            | -            | -             | -     | -         | 313,777.30     | 313,777.30     |
| 应付托管费                          | -            | -            | -             | -     | -         | 52,296.22      | 52,296.22      |
| 应付销售服务费                        | -            | -            | -             | -     | -         | 26,348.28      | 26,348.28      |
| 应交税费                           | -            | -            | -             | -     | -         | 0.34           | 0.34           |
| 其他负债                           | -            | -            | -             | -     | -         | 79,438.13      | 79,438.13      |
| 负债总计                           | -            | -            | -             | -     | -         | 801,559.73     | 801,559.73     |
| 利率敏感度缺口                        | 3,305,370.87 | -            | 12,767,594.47 | -     | 90,456.34 | 238,791,028.68 | 254,954,450.36 |
| 上年度末<br>2022 年<br>12 月 31<br>日 | 1 个月以内       | 1-3 个月       | 3 个月-1 年      | 1-5 年 | 5 年以上     | 不计息            | 合计             |
| 资产                             |              |              |               |       |           |                |                |
| 银行存款                           | 8,188,604.26 | -            | -             | -     | -         | -              | 8,188,604.26   |
| 交易性金融资产                        | -            | 6,113,602.19 | 3,025,049.59  | -     | -         | 179,850,755.64 | 188,989,407.42 |
| 应收申购款                          | -            | -            | -             | -     | -         | 6,344,681.66   | 6,344,681.66   |
| 资产总计                           | 8,188,604.26 | 6,113,602.19 | 3,025,049.59  | -     | -         | 186,195,437.30 | 203,522,693.34 |
| 负债                             |              |              |               |       |           |                |                |
| 应付清算款                          | -            | -            | -             | -     | -         | 1,336,774.29   | 1,336,774.29   |
| 应付赎回款                          | -            | -            | -             | -     | -         | 489,592.70     | 489,592.70     |
| 应付管理人报酬                        | -            | -            | -             | -     | -         | 237,611.10     | 237,611.10     |
| 应付托管费                          | -            | -            | -             | -     | -         | 39,601.86      | 39,601.86      |
| 应付销                            | -            | -            | -             | -     | -         | 15,335.85      | 15,335.85      |



|         |              |              |              |   |   |                |                |
|---------|--------------|--------------|--------------|---|---|----------------|----------------|
| 售服务费    |              |              |              |   |   |                |                |
| 其他负债    | -            | -            | -            | - | - | 90,015.56      | 90,015.56      |
| 负债总计    | -            | -            | -            | - | - | 2,208,931.36   | 2,208,931.36   |
| 利率敏感度缺口 | 8,188,604.26 | 6,113,602.19 | 3,025,049.59 | - | - | 183,986,505.94 | 201,313,761.98 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.04%（2022年12月31日：4.54%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022年12月31日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年06月30日  |              |           |              |
|---------------|---------------------|--------------|-----------|--------------|
|               | 美元折合人民币             | 港币折合人民币      | 其他币种折合人民币 | 合计           |
| 以外币计价的资产      |                     |              |           |              |
| 交易性金融资产       | -                   | 7,067,428.47 | -         | 7,067,428.47 |
| 资产合计          | -                   | 7,067,428.47 | -         | 7,067,428.47 |
| 以外币计价的负债      |                     |              |           |              |
| 负债合计          | -                   | -            | -         | -            |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                   | 7,067,428.47 | -         | 7,067,428.47 |
| 项目            | 上年度末<br>2022年12月31日 |              |           |              |
|               | 美元折合人民币             | 港币折合人民币      | 其他币种折合人民币 | 合计           |

|               | 人民币 | 币             | 折合人民币 |               |
|---------------|-----|---------------|-------|---------------|
| 以外币计价的资产      |     |               |       |               |
| 交易性金融资产       | -   | 14,775,400.42 | -     | 14,775,400.42 |
| 资产合计          | -   | 14,775,400.42 | -     | 14,775,400.42 |
| 以外币计价的负债      |     |               |       |               |
| 负债合计          | -   | -             | -     | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -   | 14,775,400.42 | -     | 14,775,400.42 |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

| 分析               | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币元) |                     |
|------------------|-------------|---------------------------------|---------------------|
|                  |             | 本期末<br>2023年06月30日              | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|                  |             | 1. 所有外币相对人民币升值5%                | 353,371.42          |
| 2. 所有外币相对人民币贬值5% | -353,371.42 | -738,770.02                     |                     |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的60%-95%，其中对港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）的投资比例不超过股票资产的50%。本基金以医疗健康行业的上市公司股票为主要投资对象，投资于医疗健康相关行业上市公司证券的资产占非现金基金资产的比例不低于80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年06月30日 |                          | 上年度末<br>2022年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 239,498,436.20     | 93.94                    | 179,850,755.64      | 89.34                    |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 其他            | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 合计            | 239,498,436.20     | 93.94                    | 179,850,755.64      | 89.34                    |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|----|-----------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动             | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                     |
|    |                       | 本期末<br>2023年06月30日          | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|    | 1.沪深300指数上升5%         | 3,415,866.54                | 8,287,291.64        |
|    | 2.沪深300指数下降5%         | -3,415,866.54               | -8,287,291.64       |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 238,543,623.86     | 179,581,866.66      |
| 第二层次          | 13,159,464.40      | 9,138,651.78        |
| 第三层次          | 653,398.75         | 268,888.98          |
| 合计            | 252,356,487.01     | 188,989,407.42      |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022年12月31日：同）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 239,498,436.20 | 93.64        |
|    | 其中：股票             | 239,498,436.20 | 93.64        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 12,858,050.81  | 5.03         |
|    | 其中：债券             | 12,858,050.81  | 5.03         |
|    | 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      | 3,305,370.87   | 1.29         |
| 8  | 其他各项资产            | 94,152.21      | 0.04         |
| 9  | 合计                | 255,756,010.09 | 100.00       |

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值合计7,067,428.47元，占基金资产净值的比例为2.77%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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              | 196,702,714.98 | 77.15        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,447.47      | 0.01         |
| E  | 建筑业              | 4,766.21       | 0.00         |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| F | 批发和零售业          | 31,357,127.24  | 12.30 |
| 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 | 172,538.63     | 0.07  |
| 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      | 3,771,060.00   | 1.48  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 4,403.20       | 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         | 382,950.00     | 0.15  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -              | -     |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 232,431,007.73 | 91.17 |

### 7.2.2 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 (%) |
|------|--------------|---------------|
| 医疗保健 | 7,067,428.47 | 2.77          |
| 合计   | 7,067,428.47 | 2.77          |

注：以上分类采用全球行业分类标准GICS。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 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  | 301363 | 美好医疗 | 490,462 | 21,575,423.38 | 8.46         |
| 2  | 301097 | 天益医疗 | 416,049 | 19,899,623.67 | 7.81         |
| 3  | 605266 | 健之佳  | 230,088 | 19,288,277.04 | 7.57         |
| 4  | 600079 | 人福医药 | 700,000 | 18,858,000.00 | 7.40         |
| 5  | 600557 | 康缘药业 | 670,000 | 18,398,200.00 | 7.22         |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 6  | 600479 | 千金药业   | 960,000   | 10,828,800.00 | 4.25 |
| 7  | 002262 | 恩华药业   | 340,000   | 10,482,200.00 | 4.11 |
| 8  | 002317 | 众生药业   | 590,000   | 10,024,100.00 | 3.93 |
| 9  | 600587 | 新华医疗   | 240,000   | 8,479,200.00  | 3.33 |
| 10 | 300705 | 九典制药   | 300,000   | 7,929,000.00  | 3.11 |
| 11 | 000919 | 金陵药业   | 1,000,000 | 7,820,000.00  | 3.07 |
| 12 | 002422 | 科伦药业   | 260,000   | 7,716,800.00  | 3.03 |
| 13 | 688065 | 凯赛生物   | 110,000   | 6,848,600.00  | 2.69 |
| 14 | 002223 | 鱼跃医疗   | 180,000   | 6,478,200.00  | 2.54 |
| 15 | 603235 | 天新药业   | 200,012   | 6,272,376.32  | 2.46 |
| 16 | 300298 | 三诺生物   | 230,000   | 6,219,200.00  | 2.44 |
| 17 | 600511 | 国药股份   | 160,000   | 6,216,000.00  | 2.44 |
| 18 | 301033 | 迈普医学   | 140,000   | 6,154,400.00  | 2.41 |
| 19 | 003020 | 立方制药   | 150,000   | 5,551,500.00  | 2.18 |
| 20 | 603439 | 贵州三力   | 300,000   | 5,118,000.00  | 2.01 |
| 21 | 600062 | 华润双鹤   | 233,000   | 4,058,860.00  | 1.59 |
| 22 | 688076 | 诺泰生物   | 80,000    | 2,846,400.00  | 1.12 |
| 23 | 02273  | 固生堂    | 60,000    | 2,749,344.36  | 1.08 |
| 24 | 06606  | 诺辉健康   | 100,000   | 2,521,615.30  | 0.99 |
| 25 | 301367 | 怡和嘉业   | 15,000    | 2,225,100.00  | 0.87 |
| 26 | 603896 | 寿仙谷    | 50,000    | 2,215,000.00  | 0.87 |
| 27 | 300668 | 杰恩设计   | 90,000    | 2,101,500.00  | 0.82 |
| 28 | 688468 | 科美诊断   | 220,000   | 2,090,000.00  | 0.82 |
| 29 | 688506 | 百利天恒   | 28,000    | 2,026,080.00  | 0.79 |
| 30 | 688315 | 诺禾致源   | 60,000    | 1,593,000.00  | 0.62 |
| 31 | 09996  | 沛嘉医疗-B | 220,000   | 1,249,467.30  | 0.49 |
| 32 | 06639  | 瑞尔集团   | 79,000    | 547,001.51    | 0.21 |
| 33 | 600276 | 恒瑞医药   | 10,000    | 479,000.00    | 0.19 |
| 34 | 301293 | 三博脑科   | 4,500     | 382,950.00    | 0.15 |
| 35 | 688581 | 安杰思    | 3,000     | 367,470.00    | 0.14 |
| 36 | 301015 | 百洋医药   | 10,000    | 277,600.00    | 0.11 |
| 37 | 002603 | 以岭药业   | 10,056    | 258,338.64    | 0.10 |
| 38 | 603222 | 济民医疗   | 20,000    | 208,600.00    | 0.08 |

|    |        |      |       |            |      |
|----|--------|------|-------|------------|------|
| 39 | 688435 | 英方软件 | 1,980 | 144,599.40 | 0.06 |
| 40 | 301395 | 仁信新材 | 3,853 | 102,798.04 | 0.04 |
| 41 | 301292 | 海科新源 | 4,659 | 93,133.41  | 0.04 |
| 42 | 300759 | 康龙化成 | 2,000 | 76,560.00  | 0.03 |
| 43 | 688603 | 天承科技 | 1,391 | 76,505.00  | 0.03 |
| 44 | 301261 | 恒工精密 | 1,635 | 60,331.50  | 0.02 |
| 45 | 301202 | 朗威股份 | 2,289 | 59,101.98  | 0.02 |
| 46 | 001286 | 陕西能源 | 3,767 | 35,447.47  | 0.01 |
| 47 | 688249 | 晶合集成 | 1,284 | 23,189.04  | 0.01 |
| 48 | 300573 | 兴齐眼药 | 100   | 21,380.00  | 0.01 |
| 49 | 688472 | 阿特斯  | 1,030 | 17,551.20  | 0.01 |
| 50 | 301310 | 鑫宏业  | 224   | 14,656.32  | 0.01 |
| 51 | 301320 | 豪江智能 | 642   | 13,238.04  | 0.01 |
| 52 | 688629 | 华丰科技 | 708   | 13,161.72  | 0.01 |
| 53 | 688469 | 中芯集成 | 2,402 | 12,994.82  | 0.01 |
| 54 | 688582 | 芯动联科 | 304   | 12,366.72  | 0.00 |
| 55 | 301325 | 曼恩斯特 | 114   | 12,306.30  | 0.00 |
| 56 | 301291 | 明阳电气 | 338   | 10,488.14  | 0.00 |
| 57 | 688593 | 新相微  | 711   | 10,373.49  | 0.00 |
| 58 | 688543 | 国科军工 | 192   | 10,185.60  | 0.00 |
| 59 | 688620 | 安凯微  | 816   | 10,069.44  | 0.00 |
| 60 | 301225 | 恒勃股份 | 302   | 10,044.52  | 0.00 |
| 61 | 301358 | 湖南裕能 | 229   | 9,821.81   | 0.00 |
| 62 | 688523 | 航天环宇 | 385   | 9,182.25   | 0.00 |
| 63 | 301262 | 海看股份 | 351   | 8,950.50   | 0.00 |
| 64 | 301260 | 格力博  | 372   | 8,790.36   | 0.00 |
| 65 | 301210 | 金杨股份 | 173   | 8,506.41   | 0.00 |
| 66 | 301382 | 蜂助手  | 248   | 8,144.32   | 0.00 |
| 67 | 688458 | 美芯晟  | 87    | 7,896.12   | 0.00 |
| 68 | 688531 | 日联科技 | 58    | 7,886.26   | 0.00 |
| 69 | 301397 | 溯联股份 | 192   | 7,718.40   | 0.00 |
| 70 | 301232 | 飞沃科技 | 132   | 7,711.44   | 0.00 |
| 71 | 301307 | 美利信  | 238   | 7,582.68   | 0.00 |



|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 72  | 301376 | 致欧科技 | 336 | 7,563.36 | 0.00 |
| 73  | 688552 | 航天南湖 | 321 | 7,543.50 | 0.00 |
| 74  | 688570 | 天玛智控 | 296 | 7,497.68 | 0.00 |
| 75  | 301355 | 南王科技 | 441 | 7,386.75 | 0.00 |
| 76  | 300804 | 广康生化 | 222 | 7,319.34 | 0.00 |
| 77  | 301141 | 中科磁业 | 170 | 7,257.30 | 0.00 |
| 78  | 688429 | 时创能源 | 284 | 7,250.52 | 0.00 |
| 79  | 301360 | 荣旗科技 | 77  | 7,130.20 | 0.00 |
| 80  | 301387 | 光大同创 | 154 | 6,985.44 | 0.00 |
| 81  | 301303 | 真兰仪表 | 312 | 6,963.84 | 0.00 |
| 82  | 301332 | 德尔玛  | 505 | 6,933.65 | 0.00 |
| 83  | 301429 | 森泰股份 | 327 | 6,873.54 | 0.00 |
| 84  | 688146 | 中船特气 | 175 | 6,672.75 | 0.00 |
| 85  | 301170 | 锡南科技 | 191 | 6,671.63 | 0.00 |
| 86  | 301408 | 华人健康 | 386 | 6,542.70 | 0.00 |
| 87  | 688623 | 双元科技 | 75  | 6,509.25 | 0.00 |
| 88  | 301323 | 新莱福  | 163 | 6,415.68 | 0.00 |
| 89  | 688631 | 莱斯信息 | 212 | 6,332.44 | 0.00 |
| 90  | 301246 | 宏源药业 | 199 | 6,111.29 | 0.00 |
| 91  | 301373 | 凌玮科技 | 190 | 6,051.50 | 0.00 |
| 92  | 688433 | 华曙高科 | 188 | 5,922.00 | 0.00 |
| 93  | 688512 | 慧智微  | 296 | 5,671.36 | 0.00 |
| 94  | 301357 | 北方长龙 | 105 | 5,080.95 | 0.00 |
| 95  | 001287 | 中电港  | 241 | 5,065.82 | 0.00 |
| 96  | 301157 | 华塑科技 | 93  | 4,922.49 | 0.00 |
| 97  | 301386 | 未来电器 | 196 | 4,662.84 | 0.00 |
| 98  | 601061 | 中信金属 | 604 | 4,578.32 | 0.00 |
| 99  | 688479 | 友车科技 | 153 | 4,511.97 | 0.00 |
| 100 | 301203 | 国泰环保 | 128 | 4,403.20 | 0.00 |
| 101 | 301322 | 绿通科技 | 81  | 4,312.44 | 0.00 |
| 102 | 001380 | 华纬科技 | 128 | 3,939.84 | 0.00 |
| 103 | 603135 | 中重科技 | 197 | 3,524.33 | 0.00 |
| 104 | 601065 | 江盐集团 | 206 | 2,439.04 | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 105 | 601133 | 柏诚股份 | 195 | 2,390.70 | 0.00 |
| 106 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 107 | 001328 | 登康口腔 | 86  | 2,192.14 | 0.00 |
| 108 | 603172 | 万丰股份 | 122 | 1,967.86 | 0.00 |
| 109 | 001360 | 南矿集团 | 111 | 1,650.57 | 0.00 |
| 110 | 603125 | 常青科技 | 64  | 1,569.92 | 0.00 |
| 111 | 001367 | 海森药业 | 34  | 1,342.32 | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 688506 | 百利天恒 | 19,979,515.80 | 9.92            |
| 2  | 600587 | 新华医疗 | 16,790,529.00 | 8.34            |
| 3  | 300705 | 九典制药 | 15,808,202.47 | 7.85            |
| 4  | 002422 | 科伦药业 | 14,658,597.00 | 7.28            |
| 5  | 002603 | 以岭药业 | 14,474,970.00 | 7.19            |
| 6  | 600479 | 千金药业 | 14,032,816.00 | 6.97            |
| 7  | 605266 | 健之佳  | 12,495,417.00 | 6.21            |
| 8  | 002262 | 恩华药业 | 11,544,765.00 | 5.73            |
| 9  | 603896 | 寿仙谷  | 11,529,208.00 | 5.73            |
| 10 | 000919 | 金陵药业 | 10,768,324.00 | 5.35            |
| 11 | 600079 | 人福医药 | 10,386,918.00 | 5.16            |
| 12 | 600521 | 华海药业 | 9,725,242.00  | 4.83            |
| 13 | 003020 | 立方制药 | 9,458,492.50  | 4.70            |
| 14 | 600557 | 康缘药业 | 9,192,233.88  | 4.57            |
| 15 | 301363 | 美好医疗 | 9,191,455.61  | 4.57            |
| 16 | 301033 | 迈普医学 | 8,302,513.91  | 4.12            |
| 17 | 603439 | 贵州三力 | 8,270,912.00  | 4.11            |
| 18 | 002727 | 一心堂  | 8,268,733.97  | 4.11            |
| 19 | 600085 | 同仁堂  | 8,263,058.54  | 4.10            |
| 20 | 603108 | 润达医疗 | 7,649,018.78  | 3.80            |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 21 | 688677 | 海泰新光   | 7,318,533.93 | 3.64 |
| 22 | 002223 | 鱼跃医疗   | 7,204,238.00 | 3.58 |
| 23 | 301097 | 天益医疗   | 7,199,714.18 | 3.58 |
| 24 | 688065 | 凯赛生物   | 7,017,075.03 | 3.49 |
| 25 | 300298 | 三诺生物   | 6,424,572.00 | 3.19 |
| 26 | 603235 | 天新药业   | 6,409,971.16 | 3.18 |
| 27 | 600511 | 国药股份   | 6,386,818.00 | 3.17 |
| 28 | 002317 | 众生药业   | 6,327,341.00 | 3.14 |
| 29 | 301015 | 百洋医药   | 6,306,816.00 | 3.13 |
| 30 | 02162  | 康诺亚－B  | 5,906,322.62 | 2.93 |
| 31 | 603811 | 诚意药业   | 5,221,626.20 | 2.59 |
| 32 | 300723 | 一品红    | 5,130,466.00 | 2.55 |
| 33 | 002462 | 嘉事堂    | 5,087,866.00 | 2.53 |
| 34 | 002737 | 葵花药业   | 5,085,473.00 | 2.53 |
| 35 | 301267 | 华夏眼科   | 5,060,482.00 | 2.51 |
| 36 | 688076 | 诺泰生物   | 4,874,646.57 | 2.42 |
| 37 | 600062 | 华润双鹤   | 4,841,713.00 | 2.41 |
| 38 | 600276 | 恒瑞医药   | 4,789,682.00 | 2.38 |
| 39 | 688687 | 凯因科技   | 4,369,824.74 | 2.17 |
| 40 | 02137  | 腾盛博药－B | 4,289,333.54 | 2.13 |
| 41 | 002864 | 盘龙药业   | 4,082,479.92 | 2.03 |
| 42 | 301093 | 华兰股份   | 4,066,598.16 | 2.02 |

注：“买入”包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 600521 | 华海药业 | 21,556,933.00 | 10.71           |
| 2  | 688506 | 百利天恒 | 21,231,802.72 | 10.55           |
| 3  | 300705 | 九典制药 | 16,292,161.00 | 8.09            |

|    |        |           |               |      |
|----|--------|-----------|---------------|------|
| 4  | 002727 | 一心堂       | 15,538,451.40 | 7.72 |
| 5  | 002603 | 以岭药业      | 14,516,075.76 | 7.21 |
| 6  | 301367 | 怡和嘉业      | 11,671,501.57 | 5.80 |
| 7  | 603896 | 寿仙谷       | 9,130,013.70  | 4.54 |
| 8  | 605266 | 健之佳       | 8,682,566.00  | 4.31 |
| 9  | 600587 | 新华医疗      | 8,569,267.00  | 4.26 |
| 10 | 603233 | 大参林       | 8,270,161.84  | 4.11 |
| 11 | 600085 | 同仁堂       | 8,240,843.00  | 4.09 |
| 12 | 300723 | 一品红       | 7,869,357.00  | 3.91 |
| 13 | 603108 | 润达医疗      | 7,779,000.00  | 3.86 |
| 14 | 688677 | 海泰新光      | 7,462,147.70  | 3.71 |
| 15 | 002422 | 科伦药业      | 7,343,700.00  | 3.65 |
| 16 | 600557 | 康缘药业      | 7,199,539.00  | 3.58 |
| 17 | 603301 | 振德医疗      | 7,088,396.00  | 3.52 |
| 18 | 688197 | 首药控股      | 6,703,159.34  | 3.33 |
| 19 | 603811 | 诚意药业      | 6,359,035.00  | 3.16 |
| 20 | 301015 | 百洋医药      | 6,099,532.00  | 3.03 |
| 21 | 688513 | 苑东生物      | 6,060,250.74  | 3.01 |
| 22 | 301122 | 采纳股份      | 5,710,589.20  | 2.84 |
| 23 | 301267 | 华夏眼科      | 5,675,476.88  | 2.82 |
| 24 | 02162  | 康诺亚一<br>B | 5,672,912.12  | 2.82 |
| 25 | 01951  | 锦欣生殖      | 5,639,434.88  | 2.80 |
| 26 | 301363 | 美好医疗      | 5,319,143.18  | 2.64 |
| 27 | 600566 | 济川药业      | 5,269,623.00  | 2.62 |
| 28 | 002737 | 葵花药业      | 5,076,128.00  | 2.52 |
| 29 | 600079 | 人福医药      | 4,873,722.00  | 2.42 |
| 30 | 688687 | 凯因科技      | 4,811,997.20  | 2.39 |
| 31 | 002462 | 嘉事堂       | 4,755,307.40  | 2.36 |
| 32 | 02096  | 先声药业      | 4,666,694.64  | 2.32 |
| 33 | 003020 | 立方制药      | 4,663,904.00  | 2.32 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 34 | 301093 | 华兰股份 | 4,396,525.00 | 2.18 |
| 35 | 002864 | 盘龙药业 | 4,226,000.00 | 2.10 |
| 36 | 002317 | 众生药业 | 4,186,078.00 | 2.08 |
| 37 | 600276 | 恒瑞医药 | 4,176,395.00 | 2.07 |
| 38 | 002223 | 鱼跃医疗 | 4,118,357.00 | 2.05 |

注：“卖出”包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 521,789,176.13 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 460,854,802.68 |

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 12,767,594.47 | 5.01         |
| 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) | 90,456.34     | 0.04         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 12,858,050.81 | 5.04         |

### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019688 | 22国债23 | 66,000 | 6,673,871.18 | 2.62         |
| 2  | 019663 | 21国债15 | 30,000 | 3,060,433.97 | 1.20         |
| 3  | 019694 | 23国债01 | 30,000 | 3,033,289.32 | 1.19         |
| 4  | 123194 | 百洋转债   | 655    | 90,456.34    | 0.04         |

注：截止至报告期末，本基金仅持有上述债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未参与股指期货投资，报告期末无股指期货持仓。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

#### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本报告编制前一年内，本基金持有的“人福医药”的发行主体人福医药集团股份有限公司因重大交易未履行董事会审议程序及信息披露义务等行为，受到上海证券交易所通报批评的处分。本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对人福医药进行了投资。

本基金持有的“康缘药业”的发行主体人江苏康缘药业股份有限公司因2019年研发费用确认不符合《企业会计准则——基本准则》，违反《上市公司信息披露管理办法》，收到江苏监管局出具的警示函。本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对康缘药业进行了投资。

本基金投资前十名的其余证券的发行主体本期未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。

**7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。**

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | -         |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 94,152.21 |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 94,152.21 |

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 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。

**7.12.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 58 基金份额持有人信息

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构          |        |               |        |
|------|----------|-----------|----------------|--------|---------------|--------|
|      |          |           | 机构投资者          |        | 个人投资者         |        |
|      |          |           | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例 |
| 东方阿  | 2,297    | 78,596.66 | 117,156,639.93 | 64.89% | 63,379,888.23 | 35.11% |

|                                |        |           |                |        |                |        |
|--------------------------------|--------|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
| 尔法医<br>疗健康<br>混合发<br>起A        |        |           |                |        |                |        |
| 东方阿<br>尔法医<br>疗健康<br>混合发<br>起C | 8,210  | 7,559.35  | 19,248,912.49  | 31.02% | 42,813,315.28  | 68.98% |
| 合计                             | 10,507 | 23,089.25 | 136,405,552.42 | 56.23% | 106,193,203.51 | 43.77% |

注：本基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属不同类别的基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别           | 持有份额总数<br>(份) | 占基金总份额<br>比例 |
|------------------|----------------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 东方阿尔法医疗健康混合发起A | 6,041,305.98  | 3.35%        |
|                  | 东方阿尔法医疗健康混合发起C | 173,932.00    | 0.28%        |
|                  | 合计             | 6,215,237.98  | 2.56%        |

注：基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属不同类别基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                     | 份额级别           | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--|----------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有<br>本开放式基金 | 东方阿尔法医疗健康混合发起A | >100              |
|  | 东方阿尔法医疗健康混合发起C | 0~10              |
|  | 合计             | >100              |
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金                    | 东方阿尔法医疗健康混合发起A | >100              |
|  | 东方阿尔法医疗健康混合发起C | -                 |
|  | 合计             | >100              |



### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限    |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|---------------|
| 基金管理人固有资金   | 5,001,125.22  | 2.06%        | 5,001,125.22  | 2.06%        | 自合同生效之日起不少于3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 5,011,658.01  | 2.07%        | 5,011,658.01  | 2.07%        | 自合同生效之日起不少于3年 |
| 基金经理等人员     | 0.00          | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -             |
| 基金管理人股东     | 0.00          | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -             |
| 其他          | 0.00          | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -             |
| 合计          | 10,012,783.23 | 4.13%        | 10,012,783.23 | 4.13%        | -             |

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 东方阿尔法医疗健康混合发起A | 东方阿尔法医疗健康混合发起C |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2022年03月30日)基金份额总额 | 174,233,585.21 | 71,076,372.37  |
| 本报告期期初基金份额总额               | 150,439,772.15 | 41,422,628.70  |
| 本报告期基金总申购份额                | 74,702,882.98  | 91,541,946.94  |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 44,606,126.97  | 70,902,347.87  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 180,536,528.16 | 62,062,227.77  |

注：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。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内无改聘会计师事务所的事项。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 兴业证券 | 1      | 41,718,548.80  | 4.27%        | 30,157.99  | 3.41%      | -  |
| 安信   | 2      | 493,605,991.24 | 50.55%       | 461,753.01 | 52.27%     | -  |

|          |   |                |        |            |        |   |
|----------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 证券       |   |                |        |            |        |   |
| 国信证券     | 2 | 102,378,693.07 | 10.48% | 75,137.73  | 8.51%  | - |
| 中信证券(山东) | 3 | 338,827,452.69 | 34.70% | 316,358.59 | 35.81% | - |

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。本报告期内本基金与证券经纪商不存在关联方关系。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；

4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下T+0估值的时效性要求。

3、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定证券经营机构，然后基金管理人、基金托管人和证券经纪商签订证券经纪服务协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易      |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------|-----------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额      | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 兴业证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 安信证券 | 65,500.43 | 0.56%        | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国信证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

|              |               |        |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---------------|--------|---|---|---|---|---|---|
| 中信证券<br>(山东) | 11,647,187.33 | 99.44% | - | - | - | - | - | - |
|--------------|---------------|--------|---|---|---|---|---|---|

注：该表格中的债券成交金额是按全价计算的金额。

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式   | 法定披露日期     |
|----|---|--|------------|
| 1  | 东方阿尔法基金管理有限公司旗下全部基金2022年4季度报告提示性公告          | 证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报                          | 2023-01-18 |
| 2  | 东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金2022年第4季度报告            | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2023-01-18 |
| 3  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告 | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-02-22 |
| 4  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告     | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-02-23 |
| 5  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加华西证券股份有限公司为销售机构的公告     | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-02-24 |
| 6  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加东北证券股份有限公司为销售机构的公告     | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-03-20 |
| 7  | 东方阿尔法基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告             | 证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报                          | 2023-03-29 |
| 8  | 东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金2022年年度报告              | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2023-03-29 |

|    |  |  |            |
|----|--|--|------------|
| 9  | 东方阿尔法基金管理有限公司旗下全部基金2023年1季度报告提示性公告                         | 证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报                          | 2023-04-21 |
| 10 | 东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金2023年第1季度报告                           | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2023-04-21 |
| 11 | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加海通证券股份有限公司为销售机构的公告                    | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-05-11 |
| 12 | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金增加中信银行股份有限公司为销售机构的公告 | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-05-11 |
| 13 | 东方阿尔法基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示                               | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-06-08 |
| 14 | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加光大证券股份有限公司为销售机构的公告                    | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-06-09 |

### §11 影响投资者决策的其他重要信息

#### 11.1 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              | 20230101-20230423、<br>20230505-20230630 | 50,000,000.00 | -    | -          | 50,000,000.00 | 20.61% |
| 产品特有风险                              |                |   |               |      |            |               |        |
| 基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资 |                |   |               |      |            |               |        |

者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：

1、本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响。

2、持有基金份额占比较高的投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响。

3、单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会导致基金仓位调整困难，发生流动性风险。

4、持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额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。

5、超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准的东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金设立的文件；

2、《东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金招募说明书》（含更新）；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东方阿尔法基金管理有限公司，客户服务电话：400-930-6677（免长途话费）。

3、投资者可通过中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund/>）和基金管理人网站（<https://www.dfa66.com>）查阅本报告书。

东方阿尔法基金管理有限公司  
二〇二三年八月二十八日