

东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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:2024 年 03 月 29 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。本年度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2024年3月27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已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2023年1月1日至2023年12月31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	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
8.3 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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 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	74
8.7 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	74
8.8 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	74
8.9 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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.3 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	76
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	77
§10 开放式基金份额变动	77
§11 重大事件揭示	78
11.1 基金份额持有人大会决议	78
11.2 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	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4 基金投资策略的改变	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	80
§12 影响投资者决策的其他重要信息	83
12.1 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	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§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	165,010,461.94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	119,388,910.30份	45,621,551.64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会。</p> <p>3、港股通标的股票投资策略</p>

	<p>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。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、债券类资产投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、可转债（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>8、融资业务的投资策略</p> <p>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。</p> <p>9、国债期货的投资策略</p> <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>10、股票期权投资策略</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</p>
--	--

	比例。 11、资产支持证券投资策略 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。
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
	联系电话	0755-21872900
	电子邮箱	service@dfa66.com
客户服务电话	400-930-6677	400-61-95555
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://www.dfa66.com

基金年度报告备置地点	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（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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023年		2022年03月30日（基金合同生效日）-2022年12月31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	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	-21,957,061.04	-9,067,515.17	11,890,820.14	1,958,531.72
本期利润	-17,040,324.35	-6,736,906.84	4,589,589.96	826,074.08
加权平均基金份额本期利润	-0.1138	-0.1339	0.0313	0.0191
本期加权平均净值利润率	-11.10%	-13.36%	3.09%	1.90%
本期基金份额净值增长率	-8.53%	-8.98%	5.01%	4.61%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	-4,713,165.52	-2,182,023.01	7,539,991.22	1,911,369.91
期末可供分配基金份额利润	-0.0395	-0.0478	0.0501	0.0461
期末基金资产净值	114,675,744.78	43,439,528.63	157,979,763.37	43,333,998.61

期末基金份额净值	0.9605	0.9522	1.0501	1.0461
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	-3.95%	-4.78%	5.01%	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
过去三个月	1.21%	1.11%	-1.42%	1.02%	2.63%	0.09%
过去六个月	-8.75%	1.11%	-2.88%	1.00%	-5.87%	0.11%
过去一年	-8.53%	1.14%	-11.08%	0.95%	2.55%	0.19%
自基金合同生效起至今	-3.95%	1.28%	-12.58%	1.20%	8.63%	0.08%

东方阿尔法医疗健康混合发起C

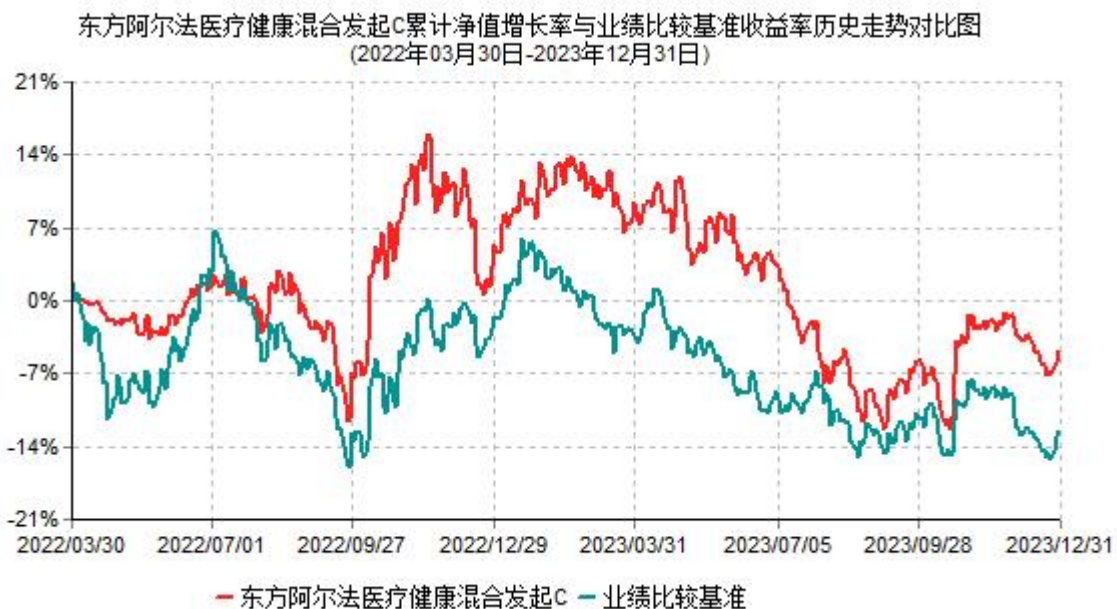
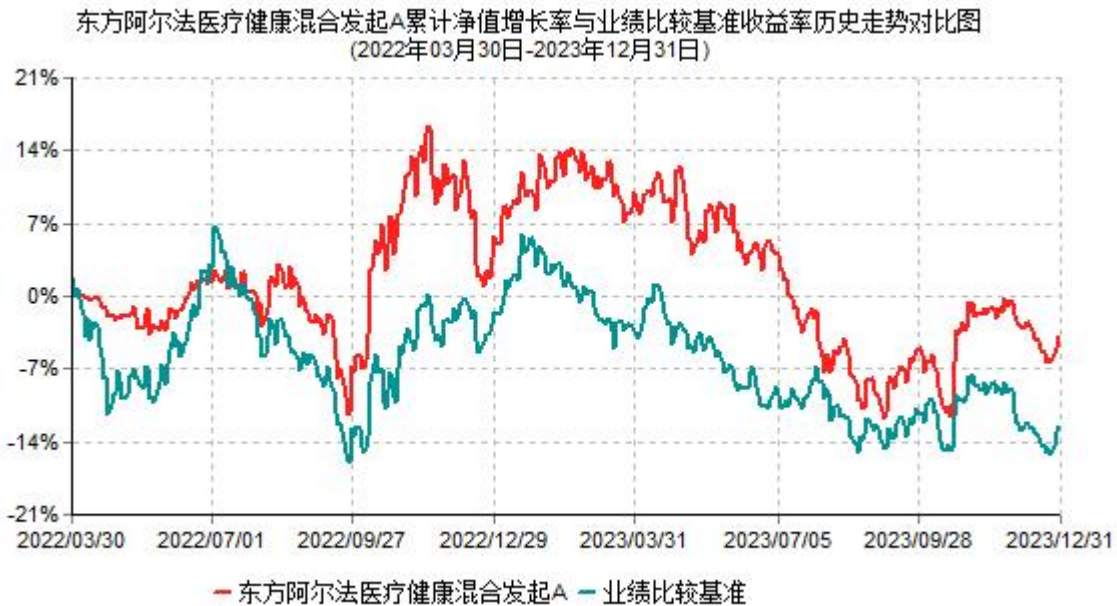
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.09%	1.11%	-1.42%	1.02%	2.51%	0.09%
过去六个月	-8.98%	1.11%	-2.88%	1.00%	-6.10%	0.11%
过去一年	-8.98%	1.14%	-11.08%	0.95%	2.10%	0.19%
自基金合同	-4.78%	1.28%	-12.58%	1.20%	7.80%	0.08%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

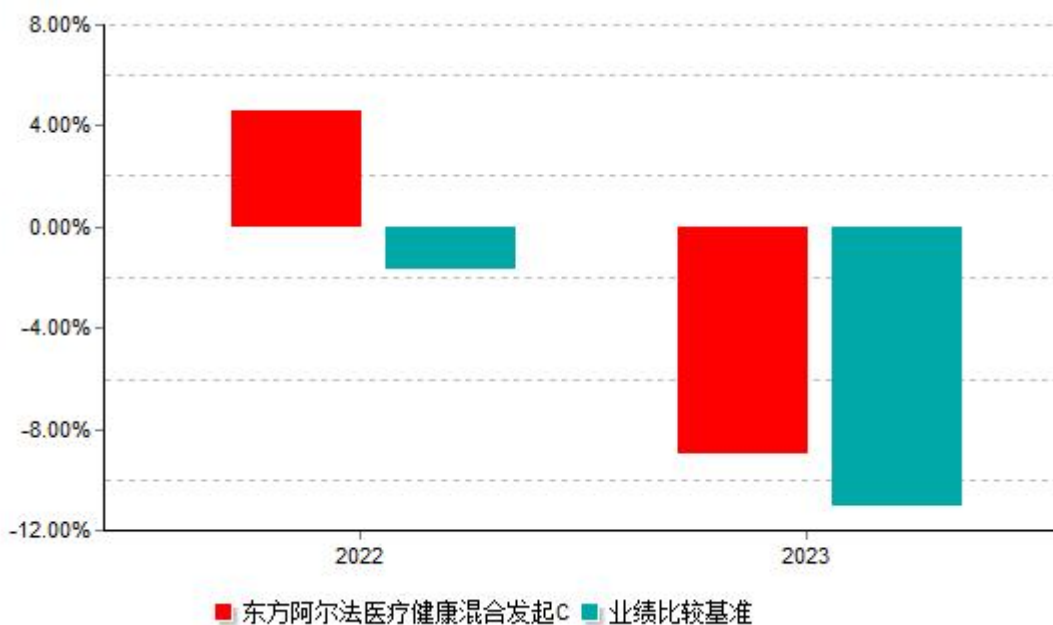
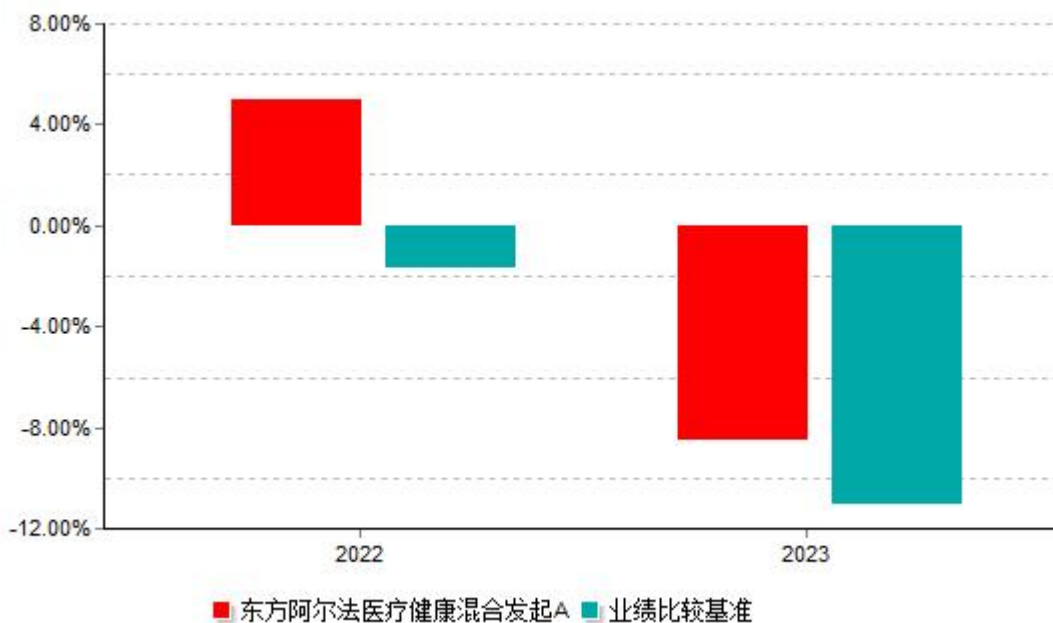
注：1、本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×60%+恒生医疗保健指数收益率×20%+中证综合债券指数收益率×20%。

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同于2022年3月30日生效。2022年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的基金合同于2022年3月30日生效。截至2023年12月31日，本基金成立未满三年。自合同生效起，本基金无利润分配事项。

§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65.17亿元，旗下管理8只公开募集证券投资基金和2只私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟昱	基金经理	2023-11-29	-	3年	孟昱先生，中山大学理学硕士，2020年8月至2021年9月，在深圳市涌容资产管理有限公司工作，任研究部研究员；2021年10月至2023年10月，在深圳市中欧瑞博投资管理股份有限公司工作，历任医药投研部研究员、基金经理；2023年10月，入职东方阿尔法基金管理有限公司公募投资部，现任东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金经理。
乔海英	基金经理（已离任）	2022-03-30	2023-11-29	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。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和东方阿尔法基金管理有限公司。
--	--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）等有关法律法规的规定，针对股票、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，制定了《东方阿尔法基金管理有限公司公平交易管理制度》、《东方阿尔法基金管理有限公司异常交易监控与报告管理制度》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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》等相关法律法规，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（包括当日内、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。

4.3.3 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非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

回顾2023年，我们可以看到美国的经济数据对全球市场的影响贯穿全年，而国内在高质量转型的过程中经济压力较大，部分行业表现疲软，年初的高预期不断下调。医药板块在2023年也呈现了前高后低的走势，但仍有细分板块在全年的不同时间段有所演绎。

年初，中药板块在疫情的带动下实现了一季度的业绩高增长，同时不断有重磅利好政策出台，多因素推动了中药行业高质量、高速发展。而创新药也实现了宏观周期、产品周期、政策周期的三周期共振，板块产业趋势较为明显。

年中，医药反腐的强势推行对医药行业影响较大。医药反腐在医药链条的生产、供应、销售等多个环节加强了管控，短期来看对部分医药企业的业绩造成了一定影响，但长期来看有利于医药行业高质量发展和集中度提升。

九月，海外迅速放量的GLP-1类减肥药映射到国内，每一款革命性药物的诞生都会带动相关产业链的发展，GLP-1类减肥药未来市场规模有望达到千亿美元级别。而减肥药的持续上涨为创新药板块带来了更高的关注度和资金偏好，同时国内pharma/biotech和BD交易数量不断创新高，创新药板块也持续受益于鼓励政策，多重因素推动创新药在9月至11月迎来估值提升。

本基金全年对拥有较高估值安全边际的公司进行了配置，前三个季度在低估值的医疗器械、药房、中药上配置较多，尽力为持有人带来低净值回撤的持有体验。而从四季度开始，中国创新药行业已经走出向上的行业趋势，本基金因此配置了部分创新药标的。

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0.9605元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.53%，同期业绩比较基准收益率为-11.08%；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0.9522元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.98%，同期业绩比较基准收益率为-11.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年，首先我们可以看到2023年初市场所期望的中国和美国的反转均没有发生，主要是美国的财政政策超预期而中国的通胀低于预期且货币政策未宽松。在经历2023年的反复拉扯后，我们对2024年的宏观不做精细的预测，只做大方向的判断。我们认为美国年内降息是大概率的事件，虽然时间和力度尚待商榷。而国内今年政策有宽松的可能性，这点从年初到现在的整体政策方向能窥得一二，同时经济底部可能会在今年出现。

基于以上判断，我们认为今年权益市场有望迎来反弹，其中医药板块在当前处于估值的相对底部，同时后续可能的利好政策值得期待。落实到具体的医药板块，我们依然看好创新药，某种程度上来说具有出海能力的国内创新药具有更高的定价空间、更高的投资回报率，这种商业模式在生产国较为稀缺，在对外BD数量创历史新高的大背景下，创新药的这种商业模式有望得到进一步验证。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人秉承“合规创造价值”的理念，坚持一切从合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的角度出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门完成整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据法律法规的颁布情况和公司的业务发展，对相关管理制度和业务流程规章进行适时修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

(2) 持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取实时监控、常规检查和专项稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制、事后完善纠偏的方式，全面加强了对公司产品日常投资运作的管理与监控，保证投资符合既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出意见和建议。

(5) 按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

(6) 引导并监督公司各业务部门根据中国人民银行的监管要求，开展客户身份识别、客户洗钱风险评级、可疑交易识别、黑名单筛查等反洗钱工作。

(7) 内部宣导、外聘律师和远程讲座等多种培训方式相结合，加强合规教育，对各业务部门进行相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高我公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

本基金管理人承诺将依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第23885号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年1月1日至2023年12月31日止期间的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p>

	<p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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，公允反映了东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金2023年12月31日的财务状况以及2023年1月1日至2023年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>无</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金的基金管理人东方阿尔法基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他</p>

	<p>现实的选择。基金管理人治理层负责监督东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注</p>

	<p>意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	叶尔甸	姜爱悦
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼	
审计报告日期	2024-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	39,060,685.00	8,188,604.26
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	120,046,320.82	188,989,407.42
其中：股票投资		110,865,589.95	179,850,755.64
基金投资		-	-
债券投资		9,180,730.87	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		165,946.63	6,344,681.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		159,272,952.45	203,522,693.34
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		612,081.29	1,336,774.29
应付赎回款		172,416.59	489,592.70
应付管理人报酬		160,656.18	237,611.10
应付托管费		26,776.04	39,601.86
应付销售服务费		17,748.42	15,335.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.35	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	168,000.17	90,015.56
负债合计		1,157,679.04	2,208,931.36
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	165,010,461.94	191,862,400.85

未分配利润	7.4.7.8	-6,895,188.53	9,451,361.13
净资产合计		158,115,273.41	201,313,761.98
负债和净资产总计		159,272,952.45	203,522,693.34

注：报告截止日2023年12月31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0.9605元，C类基金份额净值0.9522元，基金总份额165,010,461.94份，其中A类基金份额119,388,910.30份，C类基金份额45,621,551.64份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年03月30日(基 金合同生效日)至2 022年12月31日
一、营业总收入		-19,990,627.94	8,217,426.66
1.利息收入		92,766.75	557,703.48
其中：存款利息收入	7.4.7.9	32,633.69	209,914.96
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		60,133.06	347,788.52
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		-27,912,569.68	15,838,459.59
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-30,462,880.95	14,510,890.74
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	191,031.97	301,360.15
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-

衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,359,279.30	1,026,208.70
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7,247,345.02	-8,433,687.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	581,829.97	254,951.41
减：二、营业总支出		3,786,603.25	2,801,762.62
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,878,845.74	2,178,491.59
2.托管费	7.4.10.2.2	479,807.62	363,081.91
3.销售服务费	7.4.10.2.3	253,651.82	165,156.81
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		0.34	-
8.其他费用	7.4.7.19	174,297.73	95,032.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-23,777,231.19	5,415,664.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,777,231.19	5,415,664.04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-23,777,231.19	5,415,664.04

7.3 净资产变动表

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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	191,862,400.85	9,451,361.13	201,313,761.98
二、本期期初净资产	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）	-26,851,938.91	-16,346,549.66	-43,198,488.57
（一）、综合收益总额	-	-23,777,231.19	-23,777,231.19
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-26,851,938.91	7,430,681.53	-19,421,257.38
其中：1.基金申购款	233,003,152.61	13,213,512.91	246,216,665.52
2.基金赎回款	-259,855,091.52	-5,782,831.38	-265,637,922.90
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	165,010,461.94	-6,895,188.53	158,115,273.41
项目	上年度可比期间 2022年03月30日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-

二、本期期初净资产	245,309,957.58	-	245,309,957.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-53,447,556.73	9,451,361.13	-43,996,195.60
（一）、综合收益总额	-	5,415,664.04	5,415,664.04
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-53,447,556.73	4,035,697.09	-49,411,859.64
其中：1.基金申购款	104,767,350.25	10,454,822.42	115,222,172.67
2.基金赎回款	-158,214,906.98	-6,419,125.33	-164,634,032.31
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	191,862,400.85	9,451,361.13	201,313,761.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

本财务报表由本基金的基金管理人东方阿尔法基金管理有限公司于2024年3月27日批准报出。

7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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7.4.4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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2022年3月30日(基金合同生效日)至2022年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量

特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。

若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基

金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	1,388,597.53	1,378,899.25
等于：本金	1,388,449.03	1,378,749.43
加：应计利息	148.50	149.82
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	37,672,087.47	6,809,705.01
等于：本金	37,669,324.65	6,809,264.30
加：应计利息	2,762.82	440.71
减：坏账准备	-	-
合计	39,060,685.00	8,188,604.26

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	112,092,391.40	-	110,865,589.95	-1,226,801.45	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,038,775.00	101,497.22	9,180,730.87	40,458.65
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,038,775.00	101,497.22	9,180,730.87	40,458.65
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	121,131,166.40	101,497.22	120,046,320.82	-1,186,342.80	
项目	上年度末 2022年12月31日				

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	188,265,488.41	-	179,850,755.64	-8,414,732.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	126,351.78	9,138,651.78	-18,955.05
	银行间市场	-	-	-
	合计	126,351.78	9,138,651.78	-18,955.05
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	197,296,743.46	126,351.78	188,989,407.42	-8,433,687.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.17	15.56
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	168,000.00	90,000.00
合计	168,000.17	90,015.56

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 东方阿尔法医疗健康混合发起A

金额单位：人民币元

项目 (东方阿尔法医疗健康混合发起A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31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	83,448,600.94	83,448,600.94
本期赎回（以“-”号填列）	-114,499,462.79	-114,499,462.79
本期末	119,388,910.30	119,388,910.30

7.4.7.7.2 东方阿尔法医疗健康混合发起C

金额单位：人民币元

项目 (东方阿尔法医疗健康混合发起C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31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	149,554,551.67	149,554,551.67
本期赎回（以“-”号填列）	-145,355,628.73	-145,355,628.73
本期末	45,621,551.64	45,621,551.64

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 东方阿尔法医疗健康混合发起A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

(东方阿尔法医疗健康混合发起A)			
上年度末	16,589,150.07	-9,049,158.85	7,539,991.22
本期期初	16,589,150.07	-9,049,158.85	7,539,991.22
本期利润	-21,957,061.04	4,916,736.69	-17,040,324.35
本期基金份额交易产生的变动数	1,006,968.78	3,780,198.83	4,787,167.61
其中：基金申购款	7,290,282.78	154,028.48	7,444,311.26
基金赎回款	-6,283,314.00	3,626,170.35	-2,657,143.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,360,942.19	-352,223.33	-4,713,165.52

7.4.7.8.2 东方阿尔法医疗健康混合发起C

单位：人民币元

项目 (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
上年度末	4,394,212.12	-2,482,842.21	1,911,369.91
本期期初	4,394,212.12	-2,482,842.21	1,911,369.91
本期利润	-9,067,515.17	2,330,608.33	-6,736,906.84
本期基金份额交易产生的变动数	2,625,753.80	17,760.12	2,643,513.92
其中：基金申购款	6,933,718.64	-1,164,516.99	5,769,201.65
基金赎回款	-4,307,964.84	1,182,277.11	-3,125,687.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,047,549.25	-134,473.76	-2,182,023.01

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年03月30日（基金合同生效日）至2022年12月31日

活期存款利息收入	5,482.85	24,769.15
定期存款利息收入	-	154,000.00
其他存款利息收入	27,150.84	31,145.81
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	32,633.69	209,914.96

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。

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年03月30日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,016,780,327.96	682,924,152.85
减：卖出股票成本总额	1,044,212,669.72	666,147,400.38
减：交易费用	3,030,539.19	2,265,861.73
买卖股票差价收入	-30,462,880.95	14,510,890.74

7.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年03月30日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	204,573.40	277,283.86
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-13,541.43	24,076.29

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	191,031.97	301,360.15

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年03月30日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,529,870.74	28,349,635.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,211,982.05	28,046,403.01
减：应计利息总额	329,259.74	272,775.37
减：交易费用	2,170.38	6,380.70
买卖债券差价收入	-13,541.43	24,076.29

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至 2023年12月31日	2022年03月30日(基金合同生效 日)至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,359,279.30	1,026,208.70
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	2,359,279.30	1,026,208.70

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至20 23年12月31日	2022年03月30日(基金合同生效日) 至2022年12月31日
1.交易性金融资产	7,247,345.02	-8,433,687.82
——股票投资	7,187,931.32	-8,414,732.77
——债券投资	59,413.70	-18,955.05
——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	7,247,345.02	-8,433,687.82

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2 023年12月31日	2022年03月30日(基金合同生效 日)至2022年12月31日
基金赎回费收入	577,917.53	250,880.53

转换费收入	3,912.44	4,070.88
合计	581,829.97	254,951.41

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。

7.4.7.19 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年03月30日(基金合同生效 日)至2022年12月31日
审计费用	48,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	6,297.73	3,832.31
账户维护费	-	1,200.00
合计	174,297.73	95,032.31

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年03月30日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,878,845.74	2,178,491.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	575,199.34	684,753.44
应支付基金管理人的净管理费	2,303,646.40	1,493,738.15

注：自2022年3月30日（基金合同生效日）至2023年8月20日，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5%/ 当年天数。

根据东方阿尔法基金管理有限公司2023年8月19日发布的《东方阿尔法基金管理有限公司关于调低旗下基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月21日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.2%/ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年03月30日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	479,807.62	363,081.91

注：自2022年3月30日（基金合同生效日）至2023年8月20日，支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25%/ 当年天数。

根据东方阿尔法基金管理有限公司2023年8月19日发布的《东方阿尔法基金管理有限公司关于调低旗下基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月21日起，支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年01月01日至2023年12月31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	-	7,891.55	7,891.55
东方阿尔法基金	-	52,419.24	52,419.24

合计	-	60,310.79	60,310.79
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12月31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	-	1,183.18	1,183.18
东方阿尔法基金	-	1,703.20	1,703.20
合计	-	2,886.38	2,886.38

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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12月31日	2022年03月30日（基金合同生效日）至2022年12月31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	4.19%	3.32%

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"。

7.4.10.5.2 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

东方阿尔法医疗健康混合发起A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 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	1,279,805.67	1.07%	1,001,024.72	0.67%

刘明	1,000,045.03	0.84%	1,000,045.03	0.66%
肖冰	3,316,287.89	2.78%	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.上述关联方投资本基金适用的认购、申购、赎回费率按照本基金招募说明书的费率执行。

3.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"。

7.4.10.6 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 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年03月30日(基金合同生效日) 至2022年12月31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	1,388,597.53	5,482.85	1,378,899.25	24,769.15

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 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。

7.4.12 期末(2023年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301487	盟固利	2023-08-01	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-

301510	固高科技	2023-08-04	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	360	11,278.80	13,737.60	-
688627	精智达	2023-07-11	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	143	6,688.11	12,543.96	-
301421	波长光电	2023-08-16	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	209	6,140.42	12,408.33	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	304	8,128.96	11,755.68	-
688563	航材股份	2023-07-12	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	190	15,008.10	11,493.10	-
301499	维科精密	2023-07-13	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	1,220	6,319.60	9,869.80	-
301372	科净源	2023-08-03	6个月	新股流通受限	45.00	43.59	226	10,170.00	9,851.34	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股流通受限	38.13	28.36	338	12,887.94	9,585.68	-
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月	新股流通受限	73.33	51.00	187	13,712.71	9,537.00	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	729	7,195.23	9,294.75	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	466	9,315.34	9,017.10	-
301558	三态股份	2023-09-21	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	655	4,801.15	8,777.00	-
301509	金凯生科	2023-07-26	6个月	新股流通受限	56.56	62.23	137	7,748.72	8,525.51	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	164	6,051.60	8,339.40	-
301272	英华特	2023-07-06	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	156	8,016.84	8,327.28	-
688573	信宇人	2023-08-09	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
301362	民爆光电	2023-07-27	6个月	新股流通受限	51.05	38.52	210	10,720.50	8,089.20	-

301329	信音电子	2023-07-05	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	360	7,560.00	8,002.80	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股流通受限	57.88	45.48	173	10,013.24	7,868.04	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	130	8,798.40	7,718.10	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	99	7,999.20	7,697.25	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	273	6,819.54	7,649.46	-
688653	康希通信	2023-11-10	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	466	4,893.00	7,451.34	-
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	468	4,680.00	7,417.80	-
301468	博盈特焊	2023-07-12	6个月	新股流通受限	47.58	30.22	245	11,657.10	7,403.90	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	229	5,912.78	7,282.20	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	654	5,663.64	7,233.24	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股流通受限	26.68	18.69	386	10,298.48	7,214.34	-
688638	誉辰智能	2023-07-04	6个月	新股流通受限	83.90	59.68	119	9,984.10	7,101.92	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	233	8,844.68	7,080.87	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301533	威马农机	2023-08-07	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	209	6,165.50	6,930.44	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	341	7,137.13	6,891.61	-
301518	长华化学	2023-07-26	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	294	7,570.50	6,764.94	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	166	6,638.34	6,442.46	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	192	7,023.36	6,353.28	-

301489	思泉新材	2023-10-16	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	98	4,082.68	6,282.78	-
301511	德福科技	2023-08-08	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	271	7,588.00	6,143.57	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	127	5,417.82	6,118.86	-
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	174	5,025.12	6,018.66	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	129	3,466.23	5,636.01	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	新股流通受限	31.16	28.27	197	6,138.52	5,569.19	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	107	5,551.16	5,371.40	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	139	7,739.52	5,223.62	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	116	4,356.96	5,054.12	-
688716	中研股份	2023-09-13	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	136	4,033.76	4,949.04	-
688693	锆威特	2023-08-10	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	110	4,491.30	4,775.10	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	126	4,611.60	4,772.88	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	125	5,911.25	4,746.25	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	75	5,248.50	4,507.50	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	55	5,476.35	4,480.30	-
301559	中集环科	2023-09-26	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	226	5,473.72	4,122.24	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	195	4,674.15	4,073.55	-
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	130	4,118.40	4,065.10	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	46	4,756.40	3,598.58	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	67	4,547.96	3,533.58	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	148	2,267.36	3,532.76	-

301548	崇德科技	2023-09-11	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	58	3,874.40	3,421.42	-
001326	联域股份	2023-11-01	6个月	新股流通受限	41.18	48.64	70	2,882.60	3,404.80	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	107	2,329.39	3,165.06	-
603273	天元智能	2023-10-16	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	155	1,472.50	2,940.35	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	38	2,037.94	2,863.68	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	135	1,921.05	2,455.65	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	41	2,381.28	2,370.21	-
603193	润本股份	2023-10-09	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	120	2,085.60	1,999.20	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	77	1,981.21	1,915.76	-
603075	热威股份	2023-09-01	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	78	1,801.80	1,818.18	-

注：1、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中需要限售的部分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。

2、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例为0.06%(2022年12月31日：0.00%)。

7.4.13.3 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12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

7.4.13.3.1 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组合持仓集中度指标、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7.4.12。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12月31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0.33%（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12月31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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年 12月31 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							
货币资金	39,060,685.00	-	-	-	-	-	39,060,685.00
交易性金融资产	3,058,287.12	-	6,031,397.26	-	91,046.49	110,865,589.95	120,046,320.82
应收申购款	-	-	-	-	-	165,946.63	165,946.63
资产总计	42,118,972.12	-	6,031,397.26	-	91,046.49	111,031,536.58	159,272,952.45
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	612,081.29	612,081.29
应付赎回款	-	-	-	-	-	172,416.59	172,416.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	160,656.18	160,656.18
应付托管费	-	-	-	-	-	26,776.04	26,776.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,748.42	17,748.42
应交税费	-	-	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	-	-	168,000.17	168,000.17
负债总计	-	-	-	-	-	1,157,679.04	1,157,679.04
利率敏感度缺口	42,118,972.12	-	6,031,397.26	-	91,046.49	109,873,857.54	158,115,273.41
上年度末 2022年 12月31	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

日							
资产							
货币资金	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
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,335.85	15,335.85
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年12月31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5.81%(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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023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
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	31,557,161.32	-	31,557,161.32
资产合计	-	31,557,161.32	-	31,557,161.32
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	-	31,557,161.32	-	31,557,161.32
项目	上年度末 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
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

7.4.13.4.2.2 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 (单位：人民币元)	
		本期末	上年度末

		2023年12月31日	2022年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值5%	1,577,858.07	738,770.02
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	-1,577,858.07	-738,770.02

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	110,865,589.95	70.12	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	110,865,589.95	70.12	179,850,755.64	89.34

7.4.13.4.3.2 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.沪深300指数上升5%	5,789,730.65	8,287,291.64
	2.沪深300指数下降5%	-5,789,730.65	-8,287,291.64

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	110,427,191.01	179,581,866.66
第二层次	9,089,684.38	9,138,651.78
第三层次	529,445.43	268,888.98

合计	120,046,320.82	188,989,407.42
----	----------------	----------------

7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	268,888.98	268,888.98
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,013,631.77	1,013,631.77
转出第三层次	-	1,009,906.09	1,009,906.09
当期利得或损失总额	-	256,830.77	256,830.77
其中：计入损益的利得或损失	-	256,830.77	256,830.77
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	529,445.43	529,445.43
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	63,307.81	63,307.81

项目	上年度可比期间		
	2022年03月30日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	284,929.03	284,929.03
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-16,040.05	-16,040.05
其中：计入损益的利得或损失	-	-16,040.05	-16,040.05
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	268,888.98	268,888.98
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-16,040.05	-16,040.05

注：于2023年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	529,445.43	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	4.62%~21.9.88%	负相关
项目	上年度末公	采用的估值技	不可观察输入值		

	允价值	术	名称	范围/加权 平均值	与公允价值之 间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	268,888.98	平均价格亚式 期权模型	预期年化 波动率	21.27%~24 7.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31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）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	110,865,589.95	69.61
	其中：股票	110,865,589.95	69.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,180,730.87	5.76
	其中：债券	9,180,730.87	5.76
	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	39,060,685.00	24.52

8	其他各项资产	165,946.63	0.10
9	合计	159,272,952.45	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31,557,161.32元，占基金资产净值的比例为19.96%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	62,094,355.42	39.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,844,806.60	6.86
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	31,651.94	0.02
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	10,480.72	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	16,742.95	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,310,391.00	3.99
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	79,308,428.63	50.16

8.2.2 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	31,557,161.32	19.96
合计	31,557,161.32	19.96

8.3 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	300122	智飞生物	162,400	9,924,264.00	6.28
2	688050	爱博医疗	38,683	6,655,023.32	4.21
3	600422	昆药集团	303,900	6,339,354.00	4.01
4	000516	国际医学	778,100	6,310,391.00	3.99
5	02273	固生堂	128,100	5,850,773.81	3.70
6	605266	健之佳	95,604	5,678,877.60	3.59
7	603939	益丰药房	128,800	5,157,152.00	3.26
8	301367	怡和嘉业	39,500	4,809,125.00	3.04
9	09688	再鼎医药	235,700	4,592,315.16	2.90
10	06185	康希诺生物	194,600	4,153,052.20	2.63
11	01789	爱康医疗	712,000	4,039,131.29	2.55
12	09996	沛嘉医疗—B	515,000	3,448,937.39	2.18
13	09926	康方生物	82,000	3,447,985.86	2.18
14	600557	康缘药业	155,400	3,188,808.00	2.02
15	603658	安图生物	54,800	3,124,148.00	1.98
16	688799	华纳药厂	63,303	3,098,048.82	1.96
17	002223	鱼跃医疗	83,900	2,901,262.00	1.83
18	600285	羚锐制药	167,600	2,867,636.00	1.81
19	000661	长春高新	19,600	2,857,680.00	1.81
20	603309	维力医疗	170,200	2,421,946.00	1.53
21	01167	加科思—B	635,400	2,084,440.12	1.32

22	688677	海泰新光	31,011	1,650,715.53	1.04
23	300723	一品红	53,200	1,586,956.00	1.00
24	01177	中国生物制药	501,000	1,575,436.28	1.00
25	301363	美好医疗	42,500	1,564,000.00	0.99
26	688351	微电生理	59,415	1,523,994.75	0.96
27	603998	方盛制药	133,800	1,466,448.00	0.93
28	00570	中国中药	400,000	1,424,577.84	0.90
29	300896	爱美客	4,200	1,236,186.00	0.78
30	300049	福瑞股份	27,000	1,176,930.00	0.74
31	000915	华特达因	31,100	900,656.00	0.57
32	688091	上海谊众	12,544	802,816.00	0.51
33	300181	佐力药业	74,900	798,434.00	0.50
34	01093	石药集团	72,000	473,699.32	0.30
35	01530	三生制药	68,500	466,812.05	0.30
36	600276	恒瑞医药	10,000	452,300.00	0.29
37	688670	金迪克	9,287	264,308.02	0.17
38	301487	盟固利	867	35,512.32	0.02
39	688629	华丰科技	708	15,505.20	0.01
40	301510	固高科技	396	13,863.96	0.01
41	301172	君逸数码	360	13,737.60	0.01
42	688627	精智达	143	12,543.96	0.01
43	301421	波长光电	209	12,408.33	0.01
44	688582	芯动联科	304	11,755.68	0.01
45	688563	航材股份	190	11,493.10	0.01
46	301499	维科精密	371	10,733.03	0.01
47	688603	天承科技	140	10,379.60	0.01
48	688549	中巨芯	1,220	9,869.80	0.01
49	301372	科净源	226	9,851.34	0.01
50	301291	明阳电气	338	9,585.68	0.01
51	688610	埃科光电	187	9,537.00	0.01

52	688548	广钢气体	729	9,294.75	0.01
53	301292	海科新源	466	9,017.10	0.01
54	301558	三态股份	655	8,777.00	0.01
55	301509	金凯生科	137	8,525.51	0.01
56	301261	恒工精密	164	8,339.40	0.01
57	301272	英华特	156	8,327.28	0.01
58	688573	信宇人	285	8,208.00	0.01
59	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.01
60	301362	民爆光电	210	8,089.20	0.01
61	301329	信音电子	360	8,002.80	0.01
62	301210	金杨股份	173	7,868.04	0.00
63	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
64	301393	昊帆生物	130	7,718.10	0.00
65	603296	华勤技术	99	7,697.25	0.00
66	688591	泰凌微	273	7,649.46	0.00
67	688653	康希通信	466	7,451.34	0.00
68	301507	民生健康	468	7,417.80	0.00
69	301468	博盈特焊	245	7,403.90	0.00
70	301202	朗威股份	229	7,282.20	0.00
71	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
72	688602	康鹏科技	654	7,233.24	0.00
73	301395	仁信新材	386	7,214.34	0.00
74	688638	誉辰智能	119	7,101.92	0.00
75	301456	盘古智能	233	7,080.87	0.00
76	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
77	301533	威马农机	209	6,930.44	0.00
78	301519	舜禹股份	341	6,891.61	0.00
79	301518	长华化学	294	6,764.94	0.00
80	301498	乖宝宠物	166	6,442.46	0.00
81	301469	恒达新材	192	6,353.28	0.00
82	301489	思泉新材	98	6,282.78	0.00

83	301511	德福科技	271	6,143.57	0.00
84	688702	盛科通信	127	6,118.86	0.00
85	301251	威尔高	174	6,018.66	0.00
86	688429	时创能源	284	6,017.96	0.00
87	301517	陕西华达	129	5,636.01	0.00
88	301515	港通医疗	197	5,569.19	0.00
89	301418	协昌科技	107	5,371.40	0.00
90	301371	敷尔佳	139	5,223.62	0.00
91	301550	斯菱股份	116	5,054.12	0.00
92	688716	中研股份	136	4,949.04	0.00
93	688693	锆威特	110	4,775.10	0.00
94	301529	福赛科技	126	4,772.88	0.00
95	688612	威迈斯	125	4,746.25	0.00
96	688719	爱科赛博	75	4,507.50	0.00
97	301525	儒竞科技	55	4,480.30	0.00
98	301559	中集环科	226	4,122.24	0.00
99	301500	飞南资源	195	4,073.55	0.00
100	001378	德冠新材	130	4,065.10	0.00
101	688657	浩辰软件	46	3,598.58	0.00
102	301520	万邦医药	67	3,533.58	0.00
103	603119	浙江荣泰	148	3,532.76	0.00
104	301548	崇德科技	58	3,421.42	0.00
105	001326	联域股份	70	3,404.80	0.00
106	603270	金帝股份	107	3,165.06	0.00
107	603273	天元智能	155	2,940.35	0.00
108	001306	夏厦精密	38	2,863.68	0.00
109	603107	上海汽配	135	2,455.65	0.00
110	603062	麦加芯彩	41	2,370.21	0.00
111	603193	润本股份	120	1,999.20	0.00
112	603276	恒兴新材	77	1,915.76	0.00
113	603075	热威股份	78	1,818.18	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	37,668,154.50	18.71
2	600587	新华医疗	26,107,865.00	12.97
3	002262	恩华药业	21,297,974.00	10.58
4	600079	人福医药	20,657,422.78	10.26
5	300705	九典制药	19,859,092.47	9.86
6	002727	一心堂	19,059,209.97	9.47
7	301363	美好医疗	18,316,680.16	9.10
8	600479	千金药业	17,357,639.00	8.62
9	603896	寿仙谷	15,713,591.00	7.81
10	300122	智飞生物	15,108,421.00	7.50
11	688677	海泰新光	14,829,268.70	7.37
12	600521	华海药业	14,772,578.90	7.34
13	002422	科伦药业	14,658,597.00	7.28
14	002603	以岭药业	14,474,970.00	7.19
15	300723	一品红	14,063,353.72	6.99
16	002317	众生药业	14,046,058.60	6.98
17	02162	康诺亚-B	13,621,561.75	6.77
18	605266	健之佳	13,537,438.94	6.72
19	300298	三诺生物	13,534,374.00	6.72
20	688065	凯赛生物	13,274,871.64	6.59
21	600085	同仁堂	12,899,906.54	6.41
22	600557	康缘药业	12,662,906.88	6.29
23	02273	固生堂	12,377,101.43	6.15
24	003020	立方制药	12,036,579.02	5.98

25	301015	百洋医药	11,998,626.00	5.96
26	603439	贵州三力	11,577,419.00	5.75
27	603939	益丰药房	10,965,345.28	5.45
28	000919	金陵药业	10,768,324.00	5.35
29	600422	昆药集团	10,397,599.00	5.16
30	688050	爱博医疗	10,290,050.07	5.11
31	002223	鱼跃医疗	10,037,503.00	4.99
32	603108	润达医疗	9,700,335.78	4.82
33	000516	国际医学	9,121,962.00	4.53
34	600436	片仔癀	8,998,457.00	4.47
35	06160	百济神州	8,607,110.51	4.28
36	03692	翰森制药	8,565,847.65	4.25
37	301367	怡和嘉业	8,511,461.00	4.23
38	300759	康龙化成	8,458,331.64	4.20
39	301033	迈普医学	8,302,513.91	4.12
40	688236	春立医疗	7,993,803.55	3.97
41	09688	再鼎医药	7,655,691.34	3.80
42	09926	康方生物	7,559,067.75	3.75
43	301097	天益医疗	7,199,714.18	3.58
44	603658	安图生物	7,067,981.00	3.51
45	688076	诺泰生物	6,830,847.97	3.39
46	300347	泰格医药	6,823,591.00	3.39
47	06185	康希诺生物	6,587,875.99	3.27
48	603235	天新药业	6,409,971.16	3.18
49	600511	国药股份	6,386,818.00	3.17
50	01789	爱康医疗	6,365,245.23	3.16
51	688273	麦澜德	6,354,215.56	3.16
52	688600	皖仪科技	6,051,588.38	3.01
53	688351	微电生理	5,857,418.73	2.91
54	09996	沛嘉医疗-B	5,752,242.56	2.86
55	603998	方盛制药	5,653,050.00	2.81

56	301393	昊帆生物	5,385,549.23	2.68
57	02269	药明生物	5,367,569.94	2.67
58	603811	诚意药业	5,221,626.20	2.59
59	002462	嘉事堂	5,087,866.00	2.53
60	002737	葵花药业	5,085,473.00	2.53
61	301267	华夏眼科	5,060,482.00	2.51
62	603233	大参林	4,969,978.40	2.47
63	688197	首药控股	4,922,951.60	2.45
64	600062	华润双鹤	4,841,713.00	2.41
65	600276	恒瑞医药	4,789,682.00	2.38
66	603883	老百姓	4,747,280.00	2.36
67	300558	贝达药业	4,736,768.00	2.35
68	000661	长春高新	4,733,312.00	2.35
69	603309	维力医疗	4,678,279.00	2.32
70	300601	康泰生物	4,623,502.80	2.30
71	688581	安杰思	4,610,767.01	2.29
72	688108	赛诺医疗	4,605,264.97	2.29
73	688687	凯因科技	4,369,824.74	2.17
74	02137	腾盛博药-B	4,289,333.54	2.13
75	301293	三博脑科	4,130,951.30	2.05
76	605369	拱东医疗	4,094,161.00	2.03
77	002864	盘龙药业	4,082,479.92	2.03
78	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。

8.4.2 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	688506	百利天恒	41,155,529.29	20.44
2	301363	美好医疗	31,143,946.22	15.47
3	600079	人福医药	31,107,181.00	15.45
4	600521	华海药业	25,900,088.00	12.87
5	300705	九典制药	25,775,635.00	12.80
6	002727	一心堂	25,213,848.40	12.52
7	600587	新华医疗	23,278,020.00	11.56
8	002317	众生药业	22,923,560.20	11.39
9	002262	恩华药业	21,196,755.00	10.53
10	605266	健之佳	21,128,012.00	10.50
11	600557	康缘药业	20,091,171.00	9.98
12	301097	天益医疗	19,456,127.75	9.66
13	300723	一品红	16,100,816.25	8.00
14	600479	千金药业	16,066,610.60	7.98
15	002422	科伦药业	14,941,477.00	7.42
16	603896	寿仙谷	14,907,544.70	7.41
17	002603	以岭药业	14,732,480.88	7.32
18	300298	三诺生物	14,498,569.64	7.20
19	02162	康诺亚-B	13,977,707.70	6.94
20	301367	怡和嘉业	13,882,537.57	6.90
21	600085	同仁堂	13,366,912.06	6.64
22	688677	海泰新光	12,918,573.95	6.42
23	301015	百洋医药	12,747,412.00	6.33
24	688065	凯赛生物	11,711,183.70	5.82
25	603439	贵州三力	11,569,679.00	5.75
26	003020	立方制药	11,327,844.82	5.63
27	603233	大参林	10,830,313.40	5.38
28	002223	鱼跃医疗	10,540,412.83	5.24
29	000919	金陵药业	10,424,019.00	5.18
30	02273	固生堂	10,279,874.94	5.11

31	03692	翰森制药	10,067,553.32	5.00
32	300759	康龙化成	9,982,815.00	4.96
33	06160	百济神州	9,741,738.21	4.84
34	603108	润达医疗	9,709,352.00	4.82
35	688273	麦澜德	8,608,618.11	4.28
36	01951	锦欣生殖	8,570,247.10	4.26
37	600436	片仔癀	8,253,194.00	4.10
38	688197	首药控股	7,995,020.20	3.97
39	688236	春立医疗	7,429,623.14	3.69
40	301033	迈普医学	7,349,547.00	3.65
41	603301	振德医疗	7,088,396.00	3.52
42	688076	诺泰生物	6,880,502.36	3.42
43	603939	益丰药房	6,368,514.80	3.16
44	603811	诚意药业	6,359,035.00	3.16
45	300347	泰格医药	6,305,461.00	3.13
46	002390	信邦制药	6,281,600.00	3.12
47	688513	苑东生物	6,060,250.74	3.01
48	300122	智飞生物	5,992,101.00	2.98
49	603235	天新药业	5,849,654.12	2.91
50	301122	采纳股份	5,710,589.20	2.84
51	301267	华夏眼科	5,675,476.88	2.82
52	301393	昊帆生物	5,559,267.92	2.76
53	688600	皖仪科技	5,541,544.25	2.75
54	02269	药明生物	5,434,906.70	2.70
55	600566	济川药业	5,269,623.00	2.62
56	600511	国药股份	5,223,484.00	2.59
57	300601	康泰生物	5,104,198.86	2.54
58	688351	微电生理	5,085,948.69	2.53
59	002737	葵花药业	5,076,128.00	2.52
60	09926	康方生物	5,029,517.12	2.50
61	688687	凯因科技	4,811,997.20	2.39

62	688108	赛诺医疗	4,795,203.43	2.38
63	002462	嘉事堂	4,755,307.40	2.36
64	02096	先声药业	4,666,694.64	2.32
65	688581	安杰思	4,619,526.37	2.29
66	300558	贝达药业	4,510,717.00	2.24
67	301093	华兰股份	4,396,525.00	2.18
68	603883	老百姓	4,315,297.43	2.14
69	002864	盘龙药业	4,226,000.00	2.10
70	301293	三博脑科	4,201,232.00	2.09
71	600276	恒瑞医药	4,176,395.00	2.07
72	600422	昆药集团	4,119,855.00	2.05
73	688566	吉贝尔	4,106,010.91	2.04
74	603998	方盛制药	4,082,300.00	2.03
75	600062	华润双鹤	4,038,617.00	2.01

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。

8.4.3 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	968,039,572.71
卖出股票收入（成交）总额	1,016,780,327.96

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。

8.5 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	9,089,684.38	5.75
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)	91,046.49	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,180,730.87	5.81

8.6 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	019709	23国债16	60,000	6,031,397.26	3.81
2	019694	23国债01	30,000	3,058,287.12	1.93
3	123194	百洋转债	655	91,046.49	0.06

注：截止至报告期末，本基金仅持有上述债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	165,946.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	165,946.63

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123194	百洋转债	91,046.49	0.06

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
东方阿尔法医疗健康混合发起A	2,034	58,696.61	64,012,721.07	53.62%	55,376,189.23	46.38%
东方阿尔法医疗健康混合发起C	7,104	6,421.95	7,204,581.52	15.79%	38,416,970.12	84.21%
合计	9,138	18,057.61	71,217,302.59	43.16%	93,793,159.35	56.84%

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

9.2 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(份)	占基金总份额比例
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	9,752,637.32	8.17%
	东方阿尔法医疗健康混合发起C	397,665.38	0.87%
	合计	10,150,302.70	6.15%

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。

9.3 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 研究部门负责人持有本开放式基金	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	东方阿尔法医疗健康混合发起A	-

持有本开放式基金	东方阿尔法医疗健康混合发起C	-
	合计	-

9.4 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	3.03%	5,001,125.22	3.03%	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	3.04%	5,011,658.01	3.04%	自合同生效之日起不少于3年
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,012,783.23	6.07%	10,012,783.23	6.07%	-

§10 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	83,448,600.94	149,554,551.67
减：本报告期基金总赎回份额	114,499,462.79	145,355,628.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	119,388,910.30	45,621,551.64

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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），本年度应付的审计费用为48,000.00元。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本报告期内无改聘会计师事务所的事项。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 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未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	68,340,819.74	3.46%	51,967.12	2.85%	-
国投 证券	2	934,749,199.84	47.33%	886,787.31	48.66%	-
国信 证券	2	289,200,344.95	14.64%	220,605.37	12.11%	-
中信 证券 (山东)	3	682,463,410.70	34.56%	662,895.27	36.38%	-

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。

11.7.2 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	成交 金额	占当 期基 金成 交总 额的

						比例		比例
兴业证券	-	-	2,190,000.00	0.66%	-	-	-	-
国投证券	3,613,146.02	16.65%	77,090,000.00	23.38%	-	-	-	-
国信证券	-	-	79,983,000.00	24.25%	-	-	-	-
中信证券(山东)	18,090,555.88	83.35%	170,520,000.00	51.71%	-	-	-	-

注：该表格中的债券成交金额是按全价计算的金额。

11.8 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	证券时报、中国证券报、上海	2023-03-29

	旗下基金2022年年度报告提示性公告	证券报、证券日报	
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	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
15	东方阿尔法基金管理有限公司旗下全部基金2023年2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	2023-07-15
16	东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金2023年第2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	2023-07-15
17	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子、披露网站、	2023-08-01

	金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报	
18	东方阿尔法基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	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	2023-08-02
19	东方阿尔法基金管理有限公司关于调低旗下基金费率并修订基金合同的公告	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	2023-08-19
20	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（2023年8月修订）	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-19
21	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（2023年8月修订）	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-19
22	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（更新）（2023年第1期）	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-21
23	东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（A类份额/C类份额）	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-21
24	东方阿尔法基金管理有限公司旗下证券投资基金招募说明书更新的提示性公告	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报	2023-08-21
25	东方阿尔法基金管理有限公司旗下全部基金2023年中期报告提示性公告	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报	2023-08-28
26	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	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-28
27	东方阿尔法基金管理有限公司旗下全部基金2023年3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	2023-10-24
28	东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金2023年第3	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-24

	季度报告		
29	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安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	2023-09-20
30	东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	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	2023-11-29
31	东方阿尔法基金管理有限公司关于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更新的提示性公告	证券时报	2023-12-01
32	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（更新）（2023年第2期）	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-01
33	东方阿尔法医疗健康混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（A类份额/C类份额）	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-01

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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、20230505-20231231	50,000,000.00	0.00	0.00	50,000,000.00	30.30%
	2	20231020-20231031	0.00	58,969,285.50	51,784,329.14	7,184,956.36	4.35%
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 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

二〇二四年三月二十九日