

# 东方阿尔法基金管理有限公司关于修改

## 旗下东方阿尔法招阳混合型证券投资基金基金合同及托管协议的公告

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《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规和基金合同、招募说明书等规定，同时为确保相关基金估值的合理性和公允性，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，并向中国证监会备案，东方阿尔法基金管理有限公司（以下简称“我司”）对旗下东方阿尔法招阳混合型证券投资基金的基金合同和托管协议进行了修订。根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，本次修改无需召开基金份额持有人大会审议。修订将自 2021 年 9 月 10 日起正式生效。现将基金合同的具体修订内容公告如下：

### 一、本次修订涉及投资范围中新增存托凭证条款的修订内容如下：

- （1）补充投资存托凭证的风险揭示；
- （2）在投资范围中增加存托凭证；
- （3）在投资策略中增加存托凭证投资策略；
- （4）在投资限制中增加存托凭证投资比例限制；
- （5）在估值方法中增加存托凭证估值核算方法。

具体请查看基金合同及托管协议修改对照表。同时，在基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。

### 二、本次修订涉及估值方法中“汇率”计算方法调整的具体基金名称及修订内容如下：

| 原合同表述   | 修订后表述   |
|---|---|
| 本基金外币资产价值计算中，涉及外币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准，先根据外币行情价格折算成保留两位小数的人民币估值价，再根据持仓量计算出市值。 | 如本基金投资股票市场交易互联互通机制允许买卖的境外证券市场上市的股票，涉及相关货币对人民币汇率的，届时根据相关法律法规及监管机构的要求确定汇率来源，如法律法规及监管机构无相关规定，基金管理人与基金托管人协商一致后确定本基金的估值汇率来源。 |

本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定，修订自 2021 年 9 月 10 日起生效。

投资者可通过我司网站 [www.dfa66.com](http://www.dfa66.com) 查阅更新后的基金合同、托管协议等法律文件，或拨打客服热线 400-930-6677 咨询有关详情。

**风险提示：**基金管理人承诺依照诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资者投资本基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，了解拟投资基金的风险收益特征，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者风险承受能力匹配。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

特此公告。

- 附件：1、《东方阿尔法招阳混合型证券投资基金基金合同修改对照表》；  
2、《东方阿尔法招阳混合型证券投资基金托管协议修改对照表》。

东方阿尔法基金管理有限公司

2021年9月10日

附件 1：东方阿尔法招阳混合型证券投资基金基金合同修改对照表

| 目录              | 《基金合同》原条款   | 《基金合同》修改后条款   |
|-----------------|---|---|
| 第一部分<br>前言      | 无   | <p>……</p> <p><u>五、本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险，详见本基金招募说明书。</u></p> <p>……</p>  |
| 第十二部分<br>基金的投资  | <p>二、投资范围</p> <p>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、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、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、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。</p> | <p>二、投资范围</p> <p>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、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、<u>存托凭证</u>）、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、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。</p> |
|                 | <p>三、投资策略</p> <p>无</p>  | <p>三、投资策略</p> <p>……</p> <p><u>5、存托凭证投资策略</u></p> <p><u>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。</u></p> <p>……</p>   |
|                 | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>……</p>  | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p><u>（18）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；</u></p> <p>……</p>  |
| 第十四部分<br>基金资产估值 | <p>四、估值方法</p> <p>……</p> <p>9、汇率</p> <p>本基金外币资产价值计算中，涉及外币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准，先根据外币行情价格折算成保留两位小数</p>  | <p>四、估值方法</p> <p>……</p> <p>9、汇率</p> <p><u>如本基金投资股票市场交易互联互通机制允许买卖的境外证券市场上市的股票，涉及相关货币对人民币汇率的，届时根据相关法律法规及监管机构的要求确定汇率来源，如法律法</u></p>  |

|                    |   |   |
|--------------------|---|---|
|                    | <p>的人民币估值价，再根据持仓量计算出市值。<br/>.....</p>   | <p><u>规及监管机构无相关规定，基金管理人与基金托管人协商一致后确定本基金的估值汇率来源。</u><br/>.....<br/><u>11、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。</u><br/>.....</p> |
|                    | <p>十、特殊情况的处理<br/>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 <b>11</b> 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> | <p>十、特殊情况的处理<br/>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 <b>12</b> 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>   |
| 第二十四部分<br>基金合同内容摘要 | (原基金合同内容摘要)   | (修订后的基金合同内容摘要)  |

附件 2：东方阿尔法招阳混合型证券投资基金托管协议修改对照表

| 目录                       | 《托管协议》原条款   | 《托管协议》修改后条款   |
|--------------------------|---|---|
| 第三部分 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 | <p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等进行监督。……</p> <p>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、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、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、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。</p> | <p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等进行监督。……</p> <p>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、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、<u>存托凭证</u>）、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、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。</p> |
|                          | <p>2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：<br/>.....</p>   | <p>2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：<br/>.....<br/><u>(18) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；</u><br/>.....</p>   |