

# **东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金**

## **2021 年年度报告**

2021 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: 2022 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2022年3月28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2021年7月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

<b>§1</b>	<b>重要提示及目录</b>	2
<b>1.1</b>	<b>重要提示</b>	2
<b>1.2</b>	<b>目录</b>	3
<b>§2</b>	<b>基金简介</b>	5
<b>2.1</b>	<b>基金基本情况</b>	5
<b>2.2</b>	<b>基金产品说明</b>	5
<b>2.3</b>	<b>基金管理人和基金托管人</b>	6
<b>2.4</b>	<b>信息披露方式</b>	7
<b>2.5</b>	<b>其他相关资料</b>	7
<b>§3</b>	<b>主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	8
<b>3.1</b>	<b>主要会计数据和财务指标</b>	8
<b>3.2</b>	<b>基金净值表现</b>	8
<b>3.3</b>	<b>过去三年基金的利润分配情况</b>	11
<b>§4</b>	<b>管理人报告</b>	11
<b>4.1</b>	<b>基金管理人及基金经理情况</b>	11
<b>4.2</b>	<b>管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明</b>	12
<b>4.3</b>	<b>管理人对报告期内公平交易情况的专项说明</b>	13
<b>4.4</b>	<b>管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明</b>	13
<b>4.5</b>	<b>管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望</b>	14
<b>4.6</b>	<b>管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况</b>	16
<b>4.7</b>	<b>管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明</b>	17
<b>4.8</b>	<b>管理人对报告期内基金利润分配情况的说明</b>	17
<b>4.9</b>	<b>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</b>	17
<b>§5</b>	<b>托管人报告</b>	17
<b>5.1</b>	<b>报告期内本基金托管人遵规守信情况声明</b>	17
<b>5.2</b>	<b>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</b>	17
<b>5.3</b>	<b>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</b>	18
<b>§6</b>	<b>审计报告</b>	18
<b>6.1</b>	<b>审计报告基本信息</b>	18
<b>6.2</b>	<b>审计报告的基本内容</b>	18
<b>§7</b>	<b>年度财务报表</b>	21
<b>7.1</b>	<b>资产负债表</b>	21
<b>7.2</b>	<b>利润表</b>	23
<b>7.3</b>	<b>所有者权益（基金净值）变动表</b>	24
<b>7.4</b>	<b>报表附注</b>	25
<b>§8</b>	<b>投资组合报告</b>	53
<b>8.1</b>	<b>期末基金资产组合情况</b>	53
<b>8.2</b>	<b>报告期末按行业分类的股票投资组合</b>	53
<b>8.3</b>	<b>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</b>	54
<b>8.4</b>	<b>报告期内股票投资组合的重大变动</b>	56
<b>8.5</b>	<b>期末按债券品种分类的债券投资组合</b>	58
<b>8.6</b>	<b>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</b>	59
<b>8.7</b>	<b>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</b>	59
<b>8.8</b>	<b>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</b>	59
<b>8.9</b>	<b>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</b>	59
<b>8.10</b>	<b>报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明</b>	59

---

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	61
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	61
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
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 .....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金	
基金简称	东方阿尔法产业先锋混合	
基金主代码	011704	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年07月21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	3,018,286,377.61份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方阿尔法产业先锋混合A	东方阿尔法产业先锋混合C
下属分级基金的交易代码	011704	011705
报告期末下属分级基金的份额总额	2,308,877,323.69份	709,409,053.92份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过产业精选和个股研究，力求选择景气度上行产业中具有先锋优势的优质个股，力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下10个方面内容：</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金根据对宏观经济周期的分析研究，结合基本面、市面场、政策面等多种因素的综合考量，研判所处经济周期的位置及未来发展方向，以确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过产业精选和个股研究相结合，一方面通过产业精选分析产业景气周期的变化和产业格局的变化，筛选具备投资机会的产业；另一方面，通过对公司定性分析、经营分析和估值探讨，判断公司投资价值。选择在景气度上行产业内具有先锋优势的优质上市公司，构成基金的投资组合。</p> <p>3、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</p>

	<p>存托凭证进行投资。</p> <p><b>4、债券类资产投资策略</b></p> <p>本基金的债券投资将采取较为积极的策略，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><b>5、可转债（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略</b></p> <p>对于可转换债券的投资，本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性，以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益。</p> <p><b>6、股指期货投资策略</b></p> <p>本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。</p> <p><b>7、融资业务的投资策略</b></p> <p>本基金将根据相关法律法规的规定参与融资业务。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、信用资质等条选择合适的交易对手方。同时，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><b>8、国债期货的投资策略</b></p> <p>基金管理人将结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。</p> <p><b>9、股票期权的投资策略</b></p> <p>本基金投资股票期权将以套期保值为主要目的，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>10、资产支持证券投资策略</b></p> <p>本基金可以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800指数收益率×80%+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。

## 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	张燕
联系电话	0755-21872901	0755-83199084	
电子邮箱	service@dfa66.com	yan_zhang@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	证券日报
登载基金年度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	本期2021年07月21日（基金合同生效日） - 2021年12月31日	
	东方阿尔法产业先锋混合A	东方阿尔法产业先锋混合C
本期已实现收益	-65,641,038.16	-17,316,126.84
本期利润	-246,109,061.75	-72,381,212.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1037	-0.1222
本期加权平均净值利润率	-10.39%	-12.29%
本期基金份额净值增长率	-11.15%	-11.35%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	
期末可供分配利润	-257,512,312.50	-80,521,517.49
期末可供分配基金份额利润	-0.1115	-0.1135
期末基金资产净值	2,051,365,011.19	628,887,536.43
期末基金份额净值	0.8885	0.8865
3.1.3 累计期末指标	2021年末	
基金份额累计净值增长率	-11.15%	-11.35%

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）。
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。
4. 本基金合同生效日为2021年7月21日，截至2021年12月31日，本基金运作时间未满1年。

#### 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

东方阿尔法产业先锋混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	-10.21%	1.99%	1.88%	0.58%	-12.09%	1.41%
自基金合同 生效起至今	-11.15%	1.60%	-0.34%	0.74%	-10.81%	0.86%

## 东方阿尔法产业先锋混合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	-10.33%	1.99%	1.88%	0.58%	-12.21%	1.41%
自基金合同 生效起至今	-11.35%	1.60%	-0.34%	0.74%	-11.01%	0.86%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。

2、本基金自2021年7月21日成立至今尚未满六个月，无过去六个月、过去一年、过去三年、过去五年净值表现。

### 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

东方阿尔法产业先锋混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年07月21日-2021年12月31日)

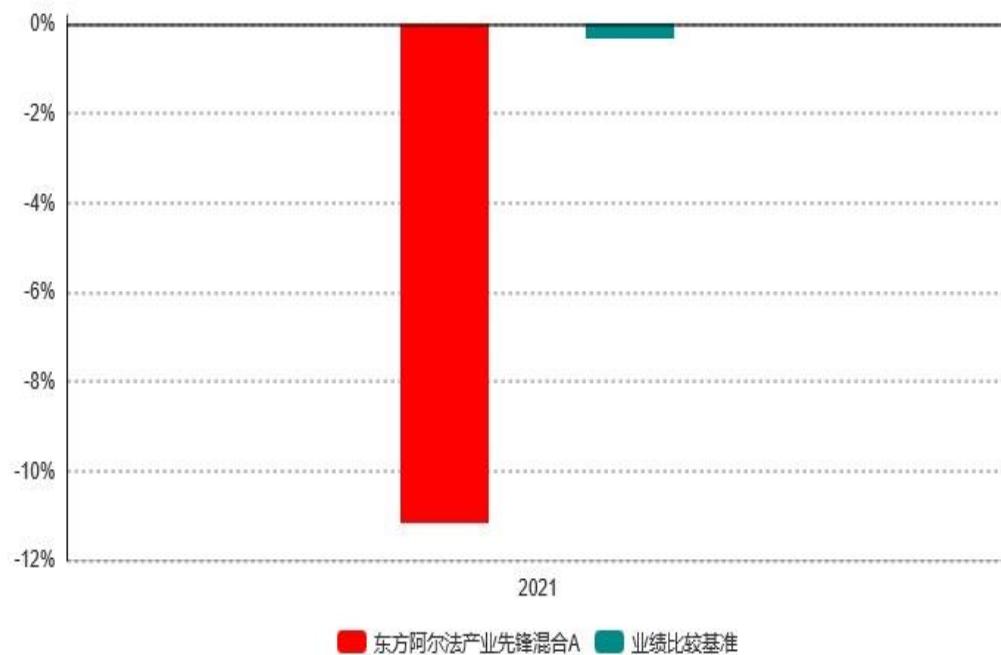


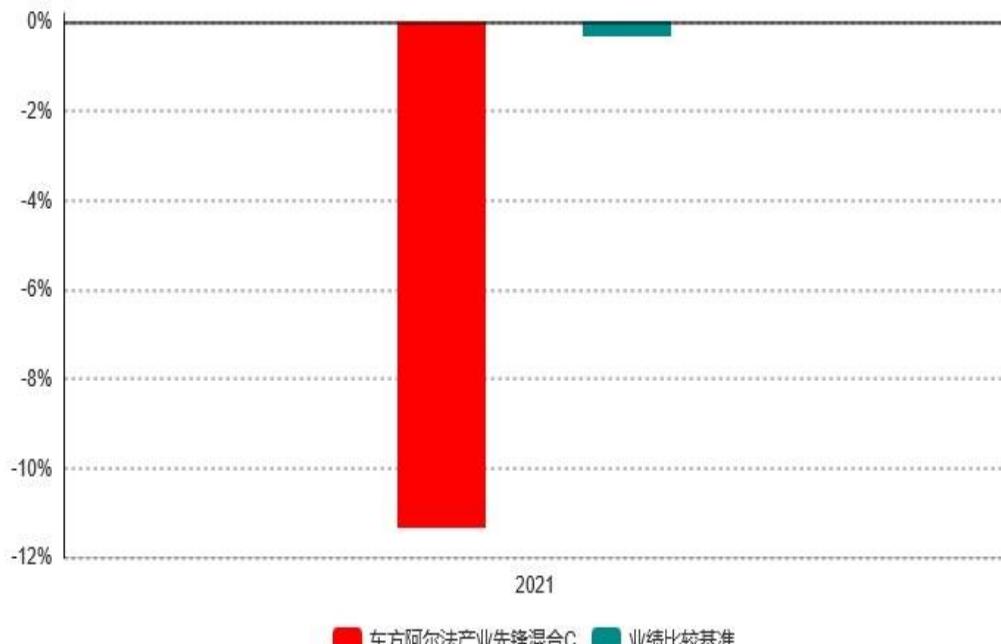
东方阿尔法产业先锋混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年07月21日-2021年12月31日)



### 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2021年7月21日生效。2021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2021年7月21日生效，截至2021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144.77亿元，旗下管理5只开放式基金和1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		
唐雷	助理总经理、研究部总监、基金经理	2021-07-21	-	11年	唐雷先生，武汉大学物理学理学学士，北京大学光华管理学院工商管理硕士。曾先后任职于民生加银基金、安信证券资产管理部、金信基金。现任东方阿尔法基金助理总经理、研究部总监、基金经理。

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”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内，唐雷管理的1个私募资产管理计划已于2021年3月16日终止。本报告期末，唐雷未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

唐雷兼任私募资产管理计划投资经理期间的薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

#### 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管理机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金管理办法》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，没有损害基金份额持有人利益。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管理运作管理办法》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）和《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》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》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》及《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》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。

本报告期内，本基金管理人针对同一基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理的多个投资组合，加强了对投资指令、交易行为的管理，加强了事后报告机制。同时，本基金管理人按照不同的时间窗（包括当日内、3日内、5日内、10日内），进一步加强基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理的多个投资组合反向交易和同向交易的交易价差监控的分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。

##### 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

2021 年年初，A 股市场延续了 2020 年以来的上升态势。2021 年的农历春节之后，在社融收缩、经济预期下行、美债收益率快速上升的作用下，市场出现快速而剧烈的下跌，市场整体的弱势调整一直延续到 4 月份。

从二季度开始，市场产生了比较明显的结构分化，首先，高景气的电动车、光伏、风电、半导体等科技成长行业表现突出；其次，具有价格上升特征的有色、钢铁、煤炭、化工等周期板块崛起，其中尤其是煤炭、新能源汽车的上游资源锂板块、部分紧缺化工品板块涨幅巨大。与之对应的，以食品饮料、医药、社会服务为代表的消费板块跌幅较大。

2021 年四季度 A 股市场整体延续了三季度以来的弱势震荡格局。宏观经济下行压力持续增加，流动性没有明显改善是市场弱势震荡的原因。稳增长政策引导市场结构进一步分化。四季度以来，稳增长相关的板块表现较强，比如地产、金融、建筑、建材等行业，反映投资者对于政策的预期。另一方面，对于 2021 年前三季度表现突出的以新能源汽车为代表的高景气成长板块，投资者开始多重担忧，政策环境变化、对基本面的担忧以及本身板块交易拥挤的状况叠加，导致高景气成长板块遭遇持续调整。

#### 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产业先锋混合 A 基金份额净值为 0.8885 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 -11.15%，同期业绩比较基准收益率为 -0.34%；截至报告期末东方阿尔法产业先锋混合 C 基金份额净值为 0.8865 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 -11.35%，同期业绩比较基准收益率为 -0.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年开年以来市场的走势超出了绝大多数投资者的预期。截止 2022 年 3 月 15 日，各大指数今年以来的跌幅都在 20% 左右，短期内跌幅之大，在 A 股历史上也比较罕见。

我们认为 2 月份中旬之前，市场大体处在 2021 年 2 月以来的一轮经济下行和信用收缩周期的尾端，其下跌是前期地产对流动性冲击负反馈的反映，同时宽货币的效应并没有体现，资本市场流动性处于惯性收缩阶段。2 月社融增速见底之后，我们也看到了市场同步企稳，对流动性和市场本身走势来说，都是一个非常积极的信号。

比较遗憾的是，在 2 月下旬之后，“黑天鹅”出现了，俄乌冲突升级为大规模战争，而且迟迟无法缓解，随后欧美各国对于俄罗斯的制裁远远超过预期，引起了大宗商品价格快速上涨以及全球“滞涨”的担忧，同时也引起了海外资本对中美关系恶化的担忧。短中长期的多重担忧，导致 A 股市场快速下行，市场情绪进入冰点。

对于俄乌局势的走势，以及其对全球政治军事经济格局的长期影响，我们仍需要观察。以今年年内来看，我们判断大概率俄乌冲突对市场的影响将是一次性的，扰动周期在 1-2 个月左右。未来随着俄乌局势逐步缓解，外生变量的冲击逐步消退，市场将从前

期深跌中走出来，重新回到国内经济和国内流动性等内生变量主导的上行趋势中。站在3月中旬的时间点，我们建议对市场多一份积极乐观。

A股市场从2021年2月到2022年2月的持续弱势下跌，对应着一个相对完整的宏观经济走弱和流动性收紧的下行周期。而2022年春季之后我们将看到稳增长政策全面发力，前期的政策表述中已经罕见提及“以经济建设为中心”，在2022年“稳定宏观经济不仅是经济问题，更是政治问题”，可以预期的是稳增长的力度未来会越来越大。财政政策提质增效，货币政策边际宽松，国内流动性环境改善。2021年三季度货币政策执行报告删除“总闸门”提法，标志着货币政策已经开始正式转向偏宽松。2021年7月和12月两次降准，2022年1月降息，我们预计今年还会有多次降准和降息。在政策力度逐步加大之后，预计2022年能够看到信用实质性扩张，国内资本市场流动性环境显著改善将推动资本市场进入上升通道。

在社会融资总额增速下降、流动性环境趋紧的背景下，2021年的资本市场大体上处在存量博弈的状态。存量博弈反映在市场上就是结构极端分化，此消彼长，二三季度消费白马疲弱，新能源和周期股强势，四季度稳增长板块稳步上行，高景气成长下跌。但是一旦宽松的流动性带来增量资金，指数进入上行通道，市场估值中枢将整体上移，各板块都具有投资机会。从中期角度看，高景气成长板块在估值和盈利端都具有较大的弹性，所以其投资机会可能更为显著。

在东方阿尔法产业先锋基金的投资策略中，重点投资方向是代表中国经济未来转型升级方向的科技成长行业，具体到2022年，将重点关注三大科技成长领域的投资机会。首先是新能源汽车行业。我们预计今年新能源汽车全球销量能够继续维持高增长，增速达到50%以上，各环节主要上市公司利润增速普遍在100%左右，产业链增长趋势依然非常强劲。前期因为碳酸锂价格超预期上涨、终端涨价担忧销量等负面因素，板块调整已较为充分，目前估值水平合理，具有很好的投资价值。

其次是半导体行业。在创新驱动发展战略下，作为先进制造业和国家战略性产业集群的代表，半导体产业的发展可能进一步加速。半导体行业下游面对多个新兴产业的旺盛需求，国产替代紧迫，以功率半导体为代表的国产半导体行业在多个细分领域已经呈现加速赶超态势，其中的投资机会值得我们关注。

此外，还有新能源领域的风电和光伏行业。在“碳中和，碳达峰”的大背景下，新能源领域是政策中长期支持的重点，风电和光伏行业是重中之重，未来将成为主要的电力供应来源，发展空间巨大。我们尤其看好风电板块的投资机会，风力发电行业处于类似光伏行业在2018年底的产业阶段。国内陆上风电补贴结束之后，风机招标价格大幅度下降，陆上风电已经实现全面平价，2022年海上风电也将陆续平价。风电行业将进入由“平价”需求拉动的景气上行周期。

#### 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，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵循包括《公开募集证券投资基金管理信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金管理机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金管理暂行规定》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求。

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。公司监察稽核部门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，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系、制度和业务流程，制订和修订了包括《风险控制委员会议事规则》、《内部控制大纲》、《监察稽核制度》、《内幕交易防控制度》、《受托资产关联交易管理办法》、《基金流动性风险管理方法》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在遵循和完善制度机制建设的基础上，本基金管理人积极开展合规培训，加强员工行为规范检查、严格进行合规问责，强化全员合规、廉洁从业理念；对投研交易、市场营销、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期检查、专项检查及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；通过事前合规防范、事中系统控制和事后完善纠偏的方式，全面加强对公司产品日常投资运作的管理和监控，保证投资符合既定的投资决策程序和业务流程，基金投资组合及个股投资比例符合风控合规的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平；全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，通过研究监管形势，参考同业先进经验，按照风险为本的工作方法，积极主动的采取有效措施防控洗钱风险。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

#### 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(2022)第22930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	东方阿尔法产业先锋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产业先锋混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年7月21日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意見</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产业先锋混合型发起式证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年7月21日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定

	<p>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产业先锋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>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>东方阿尔法产业先锋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产业先锋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产业先锋混合型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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</p>

	<p>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。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产业先锋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产业先锋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。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范</p>
--	--

	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。
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	薛竟 金诗涛
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	2022-03-23

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	13,942,011.12
结算备付金		1,980,066.38
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,674,955,636.17
其中：股票投资		2,514,991,942.17
基金投资		-
债券投资		159,963,694.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	1,432,875.24
应收股利		-
应收申购款		5,639,825.91

递延所得税资产		-
其他资产	7. 4. 7. 6	-
资产总计		2, 697, 950, 414. 82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
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		10, 999, 890. 00
应付证券清算款		-
应付赎回款		2, 209, 577. 78
应付管理人报酬		3, 555, 875. 28
应付托管费		592, 645. 88
应付销售服务费		263, 358. 99
应付交易费用	7. 4. 7. 7	-
应交税费		-
应付利息		-6, 880. 99
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7. 4. 7. 8	83, 400. 26
负债合计		17, 697, 867. 20
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7. 4. 7. 9	3, 018, 286, 377. 61
未分配利润	7. 4. 7. 10	-338, 033, 829. 99
所有者权益合计		2, 680, 252, 547. 62
负债和所有者权益总计		2, 697, 950, 414. 82

注：1、报告截止日2021年12月31日，东方阿尔法产业先锋混合基金A类基金份额净值0.8885元，东方阿尔法产业先锋混合基金C类基金份额净值0.8865元，基金份额总额3,018,286,377.61份，其中东方阿尔法产业先锋混合基金A类基金份额2,308,877,323.69份，东方阿尔法产业先锋混合基金C类基金份额709,409,053.92份。

2、本财务报表的实际编制期间为2021年7月21日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年07月21日(基金合同 生效日)至2021年12月31 日
<b>一、收入</b>		-287,362,920.12
1. 利息收入		7,989,958.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,440,622.51
债券利息收入		539,761.35
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		9,574.27
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-61,171,408.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-61,224,168.02
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.2	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	52,759.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	7.4.7.18	-235,533,109.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,351,639.51
<b>减：二、费用</b>		31,127,354.51

1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	19, 825, 353. 88
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	3, 304, 225. 67
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	1, 312, 327. 80
4. 交易费用	7. 4. 7. 20	6, 418, 500. 75
5. 利息支出		132, 265. 58
其中：卖出回购金融资产支出		132, 265. 58
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7. 4. 7. 21	134, 680. 83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-318, 490, 274. 63
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-318, 490, 274. 63

注：本基金合同生效日为2021年7月21日，2021年度实际报告期间为2021年7月21日至2021年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日	实收基金	未分配利润
一、期初所有者权益（基金净值）	3, 003, 173, 765. 96	-	3, 003, 173, 765. 96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-318, 490, 274. 63	-318, 490, 274. 63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值）	15, 112, 611. 65	-19, 543, 555. 36	-4, 430, 943. 71

减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	648,339,597.79	-6,579,694.99	641,759,902.80
2. 基金赎回款	-633,226,986.14	-12,963,860.37	-646,190,846.51
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,018,286,377.61	-338,033,829.99	2,680,252,547.62

注：本基金合同生效日为2021年7月21日，2021年度实际报告期间为2021年7月21日至2021年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

东方阿尔法产业先锋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378号《关于准予东方阿尔法产业先锋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《东方阿尔法产业先锋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3,001,977,263.20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(2021)第0687号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》于2021年7月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,003,173,765.96份基金份额，

其中认购资金利息折合1,196,502.76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，基金金融运营服务机构为招商证券股份有限公司，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10,001,643.79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《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》和《东方阿尔法产业先锋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、赎回费用、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，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；不收取认购/申购费、赎回时收取赎回费用，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《东方阿尔法产业先锋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、中小板、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)、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%；其中投资于基金合同界定的产业先锋相关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800指数收益率×80%+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2022年3月23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》、《东方阿尔法产业先锋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2021年7月21日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的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2021年12月31日的财务状况以及2021年7月21日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值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。本期财务报表的实际编制期间为2021年7月21日(基金合同生效日)至2021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

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

#### 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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或者发行价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利息收入。

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。

其他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所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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《中国证券投资基金管理核算工作小组关于2015年1季度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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 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[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]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。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
活期存款	10,198,394.26
定期存款	-
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	3,743,616.86
合计	13,942,011.12

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 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,750,510,951.20	2,514,991,942.17	-235,519,009.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	159,977,794.60	159,963,694.00	-14,100.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	159,977,794.60	159,963,694.00	-14,100.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计	2,910,488,745.80	2,674,955,636.17	-235,533,109.63	

#### 7.4.7.3 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	1,091.27
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	389.24
应收结算备付金利息	531.61
应收债券利息	1,430,863.12
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,432,875.24

注：应收其他存款利息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所产生的应收利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,400.26
应付证券出借违约金	-
预提费用	80,000.00
合计	83,400.26

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 东方阿尔法产业先锋混合A

金额单位：人民币元

项目 (东方阿尔法产业先锋混合A)	本期 2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,430,634,085.33	2,430,634,085.33
本期申购	298,250,717.71	298,250,717.71
本期赎回（以“-”号填列）	-420,007,479.35	-420,007,479.35
本期末	2,308,877,323.69	2,308,877,323.69

##### 7.4.7.9.2 东方阿尔法产业先锋混合C

金额单位：人民币元

项目 (东方阿尔法产业先锋混合C)	本期	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	572,539,680.63	572,539,680.63
本期申购	350,088,880.08	350,088,880.08
本期赎回(以“-”号填列)	-213,219,506.79	-213,219,506.79
本期末	709,409,053.92	709,409,053.92

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2021年6月28日至2021年7月16日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币3,001,977,263.20元，折合为3,001,977,263.20份基金份额(其中A类基金份额2,429,602,815.99份，C类基金份额572,374,447.21份)。根据《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币1,196,502.76元在本基金成立后，折合为1,196,502.76份基金份额(其中A类基金份额1,031,269.34份，C类基金份额165,233.42份)，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》、《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书》及《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》的相关规定，本基金于2021年7月21日(基金合同生效日)至2021年10月19日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务和转换业务自2021年10月20日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 东方阿尔法产业先锋混合A

单位：人民币元

项目 (东方阿尔法产业先锋 混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-65,641,038.16	-180,468,023.59	-246,109,061.75
本期基金份额交易产 生的变动数	1,734,093.89	-13,137,344.64	-11,403,250.75
其中：基金申购款	-6,712,446.20	5,593,524.46	-1,118,921.74
基金赎回款	8,446,540.09	-18,730,869.10	-10,284,329.01

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-63,906,944.27	-193,605,368.23	-257,512,312.50

#### 7.4.7.10.2 东方阿尔法产业先锋混合C

单位：人民币元

项目 (东方阿尔法产业先锋 混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-17,316,126.84	-55,065,086.04	-72,381,212.88
本期基金份额交易产 生的变动数	-3,868,879.77	-4,271,424.84	-8,140,304.61
其中：基金申购款	-8,658,198.17	3,197,424.92	-5,460,773.25
基金赎回款	4,789,318.40	-7,468,849.76	-2,679,531.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,185,006.61	-59,336,510.88	-80,521,517.49

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	389,454.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	270,569.98
结算备付金利息收入	6,780,597.99
其他	-
合计	7,440,622.51

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。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,194,163,721.13
减：卖出股票成本总额	1,255,387,889.15
买卖股票差价收入	-61,224,168.02

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.14.2 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。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	52,759.89
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	52,759.89

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期

	2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-235,533,109.63
——股票投资	-235,519,009.03
——债券投资	-14,100.60
——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	-235,533,109.63

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	1,349,016.86
转换费收入	2,622.65
合计	1,351,639.51

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。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	6,418,500.75

银行间市场交易费用	-
合计	6,418,500.75

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,480.83
账户维护费	1,200.00
合计	134,680.83

#### 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

截至财务报表报出日，本基金并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：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据监管部门相关要求，公司股东“珠海共同成长投资合伙企业（有限合伙）”（更名前为“珠海共同成长股权投资基金合伙企业（有限合伙）”）的名称于2022年1月5日在横琴粤澳深度合作区商事服务局完成工商变更登记。

#### 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

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有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
	2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,825,353.88
其中：支付销售机构的客户维护费	6,878,361.12

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。

3. 本基金的基金合同于2021年7月21日生效，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,304,225.67

注：1. 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。

2. 本基金的基金合同于2021年7月21日生效，无上年度可比期间数据。

#### 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		
	2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
东方阿尔法产业先锋混合A	东方阿尔法产业先锋混合C	合计	
东方阿尔法基金	0.00	7,992.33	7,992.33
招商银行	0.00	57,090.97	57,090.97
合计	0.00	65,083.30	65,083.30

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类基金份额前一日的基金资产净值

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。

3. 本基金的基金合同于2021年7月21日生效，无上年度可比期间数据。

#### 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

本基金本报告期内未与关联方进行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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 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

东方阿尔法产业先锋混合A

份额单位：份

项目	本期 2021年07月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金合同生效日（2021年07月21日）持有的基金份额	5,000,225.04
报告期初持有的基金份额	-
报告期内申购/买入总份额	-
报告期内因拆分变动份额	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-

报告期末持有的基金份额	5,000,225.04
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.22%

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. 基金管理人东方阿尔法基金管理有限公司在本会计期间认购本基金的交易委托直销柜台办理,适用费率为每笔1000元。

3. 报告期末基金管理人未运用固有资金投资“东方阿尔法产业先锋混合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

份额单位:份

##### 东方阿尔法产业先锋混合A

关联方名称	本期末 2021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
曾健	1,438,404.27	0.06%
刘明	2,000,450.36	0.09%
肖冰	3,336,110.04	0.14%

##### 东方阿尔法产业先锋混合C

关联方名称	本期末 2021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
曾健	1,000.00	0.00%
肖冰	6,000.00	0.00%

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。

#### 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 2021年07月21日(基金合同生效日)至2021年12月31日
-------	--

	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	10,198,394.26	389,454.54

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

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的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（2021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	可流通日	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
300919	中伟股份	2021-11-16	2022-06-02	非公开发行锁定	138.80	138.04	216,139	30,000,093.20	29,835,827.56	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	新股流通受限	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股流通受限	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股流通受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301066	万里石	2021-09-13	2022-03-22	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-

301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-

注：1. 根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

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。

#### 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

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金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10,999,890.00元，截至2022年1月4日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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、各机构、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2021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。

#### 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2021年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有10,999,890.00元将在一个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约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、流通受限制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)。

本基金所持部分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2021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1.12%。

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2021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、结算备付金、存出保证金、债券投资和卖出回购金融资产款等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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							
银行存款	13,942,011.12	-	-	-	-	-	13,942,011.12
结算备付金	1,980,066.38	-	-	-	-	-	1,980,066.38
交易性金融资产	-	-	159,963,694.00	-	-	2,514,991,942.17	2,674,955,636.17
应收利息	-	-	-	-	-	1,432,875.24	1,432,875.24
应收申购款	-	-	-	-	-	5,639,825.91	5,639,825.91
资产总计	15,922,077.50	-	159,963,694.00	-	-	2,522,064,643.32	2,697,950,414.82
负债							
卖出回购金融资产款	10,999,890.00	-	-	-	-	-	10,999,890.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,209,577.78	2,209,577.78
应付管	-	-	-	-	-	3,555,875.28	3,555,875.28

理人报 酬							
应付托 管费	-	-	-	-	-	592,645.88	592,645.88
应付销 售服务 费	-	-	-	-	-	263,358.99	263,358.99
应付利 息	-	-	-	-	-	-6,880.99	-6,880.99
其他负 债	-	-	-	-	-	83,400.26	83,400.26
负债总 计	10,999,890.00	-	-	-	-	6,697,977.20	17,697,867.20
利率敏 感度缺 口	4,922,187.50	-	159,963,694.00	-	-	2,515,366,666.12	2,680,252,547.62

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2021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资产净值的比例为5.97%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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%；其中投资于基金合同界定的产业先锋相关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。

#### 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 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	2,514,991,942.17	93.83
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
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	2,514,991,942.17	93.83

#### 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 2021年12月31日
	1. 沪深300指数上升5%	133,664,399.93
	2. 沪深300指数下降5%	-133,664,399.93

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 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。

- (b) 持续的以公允价值计量的金融工具
  - (i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，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中属于第一层次的余额为2,484,959,837.58元，属于第二层次的余额为159,969,198.49元，属于第三层次的余额为30,026,600.10元。

- (ii) 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。

- (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具30,026,600.10元。本基金本年度购买或转入第三层次的金融工具30,150,865.58元，计入损益的利得或损失金额为-124,265.48元，均为2021年12月31日仍持有的资产计入未实现利得或损失的变动(公允价值变动损益)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层次交易性金融资产均为股票投资，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

- (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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。

- (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，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	2,514,991,942.17	93.22
	其中：股票	2,514,991,942.17	93.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	159,963,694.00	5.93
	其中：债券	159,963,694.00	5.93
	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	15,922,077.50	0.59
8	其他各项资产	7,072,701.15	0.26
9	合计	2,697,950,414.82	100.00

### 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	2,514,835,684.71	93.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	25,722.00	0.00
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	69,749.68	0.00
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	16,406.44	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	5,539.87	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,517.67	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,514,991,942.17	93.83

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 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	002709	天赐材料	1,293,742	148,327,520.30	5.53
2	300014	亿纬锂能	1,238,849	146,407,174.82	5.46
3	603799	华友钴业	1,171,487	129,226,730.97	4.82
4	002812	恩捷股份	448,200	112,229,280.00	4.19
5	300207	欣旺达	2,657,800	112,052,848.00	4.18
6	601615	明阳智能	4,228,488	110,363,536.80	4.12
7	002594	比亚迪	407,500	109,258,900.00	4.08

8	688005	容百科技	902,788	104,344,237.04	3.89
9	603659	璞泰来	649,371	104,295,476.31	3.89
10	300750	宁德时代	174,301	102,488,988.00	3.82
11	002326	永太科技	1,969,714	100,869,053.94	3.76
12	002074	国轩高科	1,919,100	98,353,875.00	3.67
13	300450	先导智能	1,207,400	89,794,338.00	3.35
14	300035	中科电气	2,961,300	89,579,325.00	3.34
15	002531	天顺风能	4,372,085	84,774,728.15	3.16
16	603501	韦尔股份	267,882	83,249,689.14	3.11
17	300432	富临精工	2,731,100	80,294,340.00	3.00
18	002241	歌尔股份	1,453,473	78,632,889.30	2.93
19	300769	德方纳米	143,000	70,235,880.00	2.62
20	300568	星源材质	1,854,727	68,124,122.71	2.54
21	300850	新强联	344,400	61,478,844.00	2.29
22	300772	运达股份	1,321,656	58,126,430.88	2.17
23	002008	大族激光	1,017,974	54,970,596.00	2.05
24	600522	中天科技	3,047,907	51,692,502.72	1.93
25	603218	日月股份	1,516,166	49,957,669.70	1.86
26	300443	金雷股份	741,800	42,846,368.00	1.60
27	002487	大金重工	894,750	34,671,562.50	1.29
28	300919	中伟股份	216,139	29,835,827.56	1.11
29	603063	禾望电气	734,700	29,615,757.00	1.10
30	688008	澜起科技	332,757	27,908,329.59	1.04
31	603606	东方电缆	501,986	25,681,603.76	0.96
32	002475	立讯精密	507,300	24,959,160.00	0.93
33	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
34	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
35	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
36	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
37	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
38	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00

39	001296	长江材料	310	18, 376. 80	0.00
40	301091	深城交	524	16, 406. 44	0.00
41	301089	拓新药业	220	14, 944. 60	0.00
42	301066	万事利	344	7, 856. 96	0.00
43	301081	严牌股份	403	7, 028. 32	0.00
44	301072	中捷精工	181	6, 047. 21	0.00
45	300854	中兰环保	203	5, 539. 87	0.00
46	301063	海锅股份	153	5, 524. 83	0.00
47	001234	泰慕士	333	5, 504. 49	0.00
48	603176	N汇通	1, 924	4, 713. 80	0.00
49	301073	君亭酒店	144	4, 608. 00	0.00
50	301068	大地海洋	144	4, 086. 72	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002709	天赐材料	181, 585, 122. 65	6. 77
2	002812	恩捷股份	151, 099, 977. 92	5. 64
3	300014	亿纬锂能	150, 676, 690. 69	5. 62
4	603799	华友钴业	150, 472, 445. 38	5. 61
5	002594	比亚迪	141, 053, 738. 63	5. 26
6	300750	宁德时代	141, 001, 124. 31	5. 26
7	601615	明阳智能	135, 390, 328. 31	5. 05
8	002326	永太科技	123, 342, 997. 80	4. 60
9	600111	北方稀土	122, 204, 173. 75	4. 56
10	002074	国轩高科	121, 473, 780. 76	4. 53
11	603659	璞泰来	120, 886, 169. 71	4. 51
12	688005	容百科技	106, 821, 205. 35	3. 99
13	300432	富临精工	106, 276, 508. 76	3. 97
14	300207	欣旺达	103, 939, 412. 50	3. 88

15	300450	先导智能	92,681,448.43	3.46
16	002531	天顺风能	90,522,826.56	3.38
17	600110	诺德股份	90,184,805.97	3.36
18	300035	中科电气	90,143,785.08	3.36
19	300568	星源材质	89,717,762.48	3.35
20	300769	德方纳米	89,681,847.45	3.35
21	603501	韦尔股份	82,576,641.18	3.08
22	300772	运达股份	80,511,821.77	3.00
23	002241	歌尔股份	79,989,200.97	2.98
24	300850	新强联	78,579,551.93	2.93
25	600711	盛屯矿业	61,691,429.50	2.30
26	603218	日月股份	61,047,074.70	2.28
27	002460	赣锋锂业	59,871,469.00	2.23
28	002466	天齐锂业	59,771,915.42	2.23
29	002756	永兴材料	59,717,866.79	2.23
30	600522	中天科技	55,457,701.99	2.07
31	002008	大族激光	54,112,476.74	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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600111	北方稀土	110,142,912.54	4.11
2	600110	诺德股份	83,011,899.55	3.10
3	002756	永兴材料	64,813,459.94	2.42
4	300390	天华超净	57,338,438.76	2.14
5	002466	天齐锂业	54,442,235.01	2.03
6	002460	赣锋锂业	53,709,913.00	2.00
7	600711	盛屯矿业	46,558,933.67	1.74

8	300702	天宇股份	43,987,932.28	1.64
9	300750	宁德时代	38,597,884.67	1.44
10	600765	中航重机	37,381,162.70	1.39
11	002240	盛新锂能	35,134,443.25	1.31
12	002049	紫光国微	31,652,479.86	1.18
13	002594	比亚迪	31,373,300.00	1.17
14	002497	雅化集团	31,031,899.53	1.16
15	300077	国民技术	29,908,625.00	1.12
16	600893	航发动力	29,671,241.00	1.11
17	300496	中科创达	29,081,104.85	1.09
18	600171	上海贝岭	27,529,621.95	1.03
19	000792	盐湖股份	27,101,212.00	1.01
20	600399	抚顺特钢	26,918,414.00	1.00

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	4,005,898,840.35
卖出股票收入（成交）总额	1,194,163,721.13

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	159,963,694.00	5.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	159,963,694.00	5.97

注，截止至报告期末，本基金仅持有上述债券。

#### 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	019658	21国债10	1,602,040	159,963,694.00	5.97

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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期内未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,432,875.24
5	应收申购款	5,639,825.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,072,701.15

### 8.12.4 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。

### 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	40,793	56,599.84	22,944,720.65	0.99%	2,285,932.60	99.0

法产业先 锋混合A					3. 04	1%
东方阿尔 法产业先 锋混合C	44, 868	15, 811. 02	3, 107, 134. 82	0. 44%	706, 301, 919. 1 0	99. 5 6%
合计	85, 661	35, 235. 25	26, 051, 855. 47	0. 86%	2, 992, 234, 52 2. 14	99. 1 4%

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	东方阿尔法产业先 锋混合A	12, 818, 280. 28	0. 56%
	东方阿尔法产业先 锋混合C	1, 775, 689. 60	0. 25%
	合计	14, 593, 969. 88	0. 48%

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	东方阿尔法产业先锋混合A	>100
	东方阿尔法产业先锋混合C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	东方阿尔法产业先锋混合A	50~100
	东方阿尔法产业先锋混合C	0
	合计	50~100

## 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	5,000,225.04	0.17%	5,000,225.04	0.17%	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	5,001,418.75	0.17%	5,001,418.75	0.17%	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	10,001,643.79	0.33%	10,001,643.79	0.33%	自合同生效之日起不少于3年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	东方阿尔法产业先锋混合A	东方阿尔法产业先锋混合C
基金合同生效日(2021年07月21日)基金份额总额	2,430,634,085.33	572,539,680.63
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	298,250,717.71	350,088,880.08
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	420,007,479.35	213,219,506.79
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	2,308,877,323.69	709,409,053.92
--------------	------------------	----------------

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。

## § 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

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

自2021年10月27日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 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，无涉及基金管理业务、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8万元。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

本报告期内，基金管理人、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	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	佣金	占当期佣金总量的	

	元 数 量		额的比例		比例	
安信证券	2	1,821,271,757.79	35.25%	1,671,956.50	34.86%	-
中信建投证券	2	1,633,699,051.56	31.62%	1,521,639.26	31.73%	-
中信证券(山东)	2	1,712,461,310.81	33.14%	1,602,544.93	33.41%	-

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、个股分析的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 的比例	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
安信证券	-	-	36,000,000.00	2.39%	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	100,000,000.00	6.65%	-	-	-	-
中信证券(山东)	160,868,896.37	100.00%	1,368,000,000.00	90.96%	-	-	-	-

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	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报	2021-06-12
2	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券日报	2021-06-12
3	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-12
4	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金托管协议	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-12
5	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-12
6	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-12
7	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-12
8	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加北京蛋卷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	2021-06-25
9	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下部分基金增加珠	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网	2021-07-22

	海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告	站、中国证券报、上海证券报、证券日报	
10	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报	2021-07-22
11	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加中国人寿保险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	2021-08-16
12	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报	2021-10-15
13	东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金2021年第三季度报告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-10-23
14	东方阿尔法基金管理有限公司旗下基金2021年第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	2021-10-23
15	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成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、中国证券报、证券日报	2021-11-12
16	关于东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金增加申万宏源证券有限公司等机构为基金销售服务机构的公告	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报	2021-12-02
17	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加众惠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	2021-12-02
18	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非	基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网	2021-12-04

	公开发行股票的公告	站、中国证券报、证券日报	
19	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加国信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	2021-12-13
20	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加上海好买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	2021-12-15
21	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加上海基煜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	2021-12-24
22	关于提醒投资者防范不法分子冒用我司名义进行非法活动的重要提示	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	2021-12-25

## § 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

### 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产业先锋混合型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《东方阿尔法产业先锋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  
二〇二二年三月二十九日