

东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金

2022年第2季度报告

2022年06月30日

基金管理人:东方阿尔法基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月19日

目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示 | 3 |
| §2 基金产品概况 | 3 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 主要财务指标 | 5 |
| 3.2 基金净值表现 | 5 |
| 3.3 其他指标 | 7 |
| §4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 8 |
| 4.3 公平交易专项说明 | 8 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 | 8 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现 | 9 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 | 9 |
| §5 投资组合报告 | 9 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 | 9 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 9 |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 | 11 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 | 11 |
| 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 11 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 | 11 |
| 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 11 |
| 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 11 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 11 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 12 |
| 5.11 投资组合报告附注 | 12 |
| §6 开放式基金份额变动 | 12 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 | 13 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 13 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 13 |
| §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况 | 13 |
| §9 影响投资者决策的其他重要信息 | 14 |
| 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 14 |
| 9.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 14 |
| §10 备查文件目录 | 15 |
| 10.1 备查文件目录 | 15 |
| 10.2 存放地点 | 15 |
| 10.3 查阅方式 | 15 |

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2022年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年4月1日起至2022年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 东方阿尔法优选混合 |
| 基金主代码 | 007518 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019年09月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 177,524,902.37份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础之上,通过深入研究、优选个股、主动的投资管理方式力求实现组合资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略主要有以下8个方面内容:</p> <p>1、大类资产配置策略 基金管理人将根据国内外宏观经济情况、国内外证券市场估值水平阶段性不断调整权益类资产和其他资产之间的大类资产配置比例。</p> <p>2、个股优选策略 基金管理人将采用定量分析与定性分析相结合的方式对上市公司进行分析,建立备选股票池,并以备选股票池成份股未来两年的PE衡量动态性价比作为选择其进入投资组合的重要依据。</p> <p>3、港股投资策略 本基金港股投资将重点关注A股稀缺性行业个股,包括优质中资公司、A股缺乏投资标的行业;具有持续</p> |

| | | | |
|-------------|--|------------|------------|
| | <p>领先优势或核心竞争力的企业；符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；与A股同类公司相比具有估值优势的公司。</p> <p>4、存托凭证投资策略 本基金可投资存托凭证，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，选择投资价值高的存托凭证进行投资。</p> <p>5、债券类资产投资策略 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>6、股指期货投资策略 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>7、融资业务的投资策略 本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条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>8、国债期货的投资策略 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> | | |
| 业绩比较基准 | <p>中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×10%+恒生指数收益率×10%</p> | | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金。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。</p> | | |
| 基金管理人 | <p>东方阿尔法基金管理有限公司</p> | | |
| 基金托管人 | <p>招商银行股份有限公司</p> | | |
| 下属分级基金的基金简称 | <table border="1" style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 50%;">东方阿尔法优选混合A</td> <td style="width: 50%;">东方阿尔法优选混合C</td> </tr> </table> | 东方阿尔法优选混合A | 东方阿尔法优选混合C |
| 东方阿尔法优选混合A | 东方阿尔法优选混合C | | |

| | | |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 下属分级基金的交易代码 | 007518 | 007519 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 104,347,512.96份 | 73,177,389.41份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2022年04月01日 - 2022年06月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|---------------|
| | 东方阿尔法优选混合A | 东方阿尔法优选混合C |
| 1. 本期已实现收益 | -14,602,854.44 | -9,983,786.10 |
| 2. 本期利润 | -642,333.38 | -514,060.03 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0060 | -0.0070 |
| 4. 期末基金资产净值 | 116,620,794.79 | 80,646,204.83 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1176 | 1.1021 |

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、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

东方阿尔法优选混合A净值表现

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三 个月 | -0.45% | 0.95% | 4.29% | 1.31% | -4.74% | -0.36% |
| 过去六 个月 | -16.98% | 1.28% | -8.31% | 1.33% | -8.67% | -0.05% |
| 过去一 年 | -19.56% | 1.34% | -11.61% | 1.10% | -7.95% | 0.24% |
| 自基金 合同生 效起至 今 | 11.76% | 1.51% | 12.61% | 1.12% | -0.85% | 0.39% |

东方阿尔法优选混合C净值表现

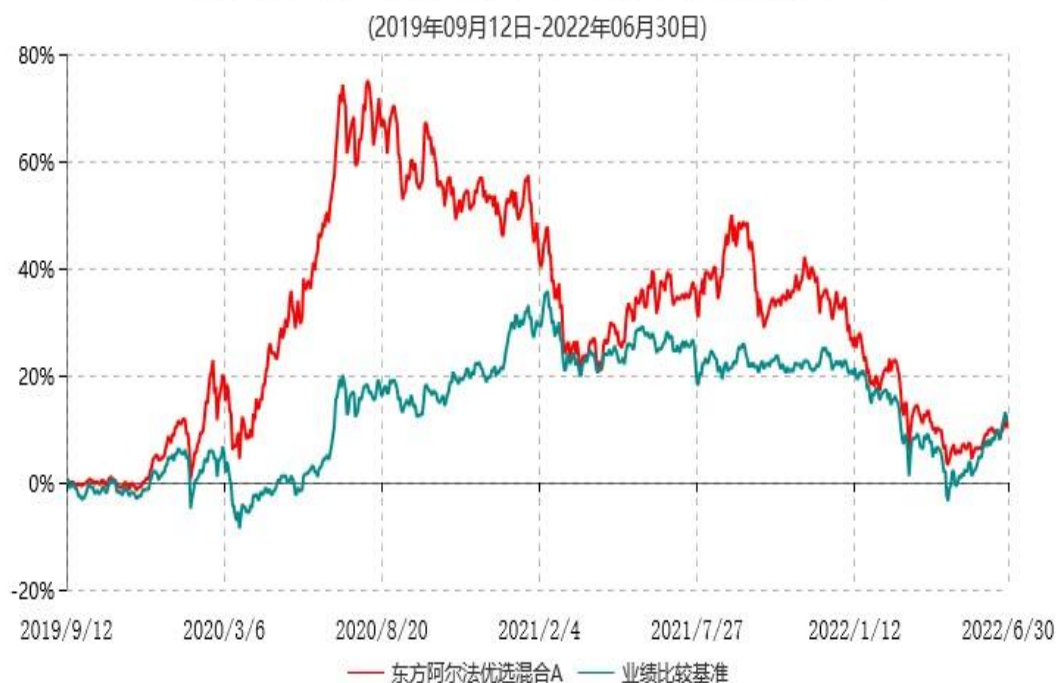
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三 个月 | -0.58% | 0.95% | 4.29% | 1.31% | -4.87% | -0.36% |
| 过去六 个月 | -17.19% | 1.28% | -8.31% | 1.33% | -8.88% | -0.05% |
| 过去一 年 | -19.95% | 1.34% | -11.61% | 1.10% | -8.34% | 0.24% |
| 自基金 合同生 效起至 今 | 10.21% | 1.51% | 12.61% | 1.12% | -2.40% | 0.39% |

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×10%+恒生指数收益率×10%。

2、本基金自2019年9月12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

东方阿尔法优选混合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



东方阿尔法优选混合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



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 乔春 | 基金经理 | 2021-08-25 | - | 12年 | 乔春先生，南开大学金融学硕士、中南大学环境工程专业工学学士。2010年加入长城基金管理有限公司，历任研究部行业研究员、基金经理助理、基金经理等职务；2017年9月加入金鹰基金管理有限公司，曾任基金经理。现就 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|------------------------------|
| | | | | | 职于东方阿尔法基金管理有限公司公募投资部，担任基金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------|

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”为根据公告确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指公告确定的任职日期和离任日期。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则等有关法律法规、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，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本报告期内，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季报时，我们讨论了保持策略一致性的意义。进入二季度后，伴随着上海疫情的严峻化，科技股继续下挫，赛道策略似乎陷入了绝境，但行情总是在绝望中诞生，5-6月随之而来的反弹回馈了坚持赛道策略的投资者。

但与此同时，我们的行业配置策略在反弹中表现不佳。两个月前摆在赛道策略投资者面前的问题是“还要不要继续坚守？”，现在同样的问题需要我们自己来回答，而答案当然也是肯定的。

我们看好市场中长期的投资机会，但也认为天下没有不散的筵席，风格切换将渐行渐至，低迷已久的低估值因子有望持续创造超额收益。道阻且长，行则将至；行而不辍，未来可期。我们将遵循策略的一致性，维持对银行、地产和基建的配置，同时挖掘中报业绩超预期的个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东方阿尔法优选混合A基金份额净值为1.1176元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.45%，同期业绩比较基准收益率为4.29%；截至报告期末东方阿尔法优选混合C基金份额净值为1.1021元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.58%，同期业绩比较基准收益率为4.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 163,864,231.44 | 82.18 |
| | 其中：股票 | 163,864,231.44 | 82.18 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 34,581,730.89 | 17.34 |
| 8 | 其他资产 | 947,462.46 | 0.48 |
| 9 | 合计 | 199,393,424.79 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,299,950.00 | 1.67 |
| B | 采矿业 | 7,801,913.25 | 3.96 |
| C | 制造业 | 86,690,282.02 | 43.95 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 5,638,488.00 | 2.86 |
| F | 批发和零售业 | 6,458,450.00 | 3.27 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,487,900.00 | 1.77 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 16,884.52 | 0.01 |
| J | 金融业 | 15,321,100.00 | 7.77 |
| K | 房地产业 | 8,969,350.00 | 4.55 |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,995.25 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,426,703.28 | 1.74 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 290,354.30 | 0.15 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 903,276.92 | 0.46 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 142,311,647.54 | 72.14 |

5.2.2 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 (%) |
|-------|---------------|---------------|
| 原材料 | 215,080.29 | 0.11 |
| 日常消费品 | 2,112,319.30 | 1.07 |
| 能源 | 5,987,185.19 | 3.04 |
| 金融 | 3,489,175.20 | 1.77 |
| 房地产 | 9,748,823.92 | 4.94 |
| 合计 | 21,552,583.90 | 10.93 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 600919 | 江苏银行 | 600,000 | 4,272,000.00 | 2.17 |
| 2 | 601838 | 成都银行 | 250,000 | 4,145,000.00 | 2.10 |
| 3 | 601009 | 南京银行 | 380,000 | 3,959,600.00 | 2.01 |
| 4 | 601225 | 陕西煤业 | 180,000 | 3,812,400.00 | 1.93 |
| 5 | 02328 | 中国财险 | 500,000 | 3,489,175.20 | 1.77 |
| 6 | 600325 | 华发股份 | 440,000 | 3,330,800.00 | 1.69 |
| 7 | 300498 | 温氏股份 | 155,000 | 3,299,950.00 | 1.67 |
| 8 | 600085 | 同仁堂 | 60,000 | 3,172,800.00 | 1.61 |
| 9 | 00688 | 中国海外发展 | 147,000 | 3,117,680.66 | 1.58 |
| 10 | 00883 | 中国海洋石油 | 350,000 | 3,100,918.94 | 1.57 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 791,884.39 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 155,578.07 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 947,462.46 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | | |
|--|------------|------------|
| | 东方阿尔法优选混合A | 东方阿尔法优选混合C |
|--|------------|------------|

| | | |
|-------------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 108,027,786.14 | 74,055,665.98 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 925,086.42 | 3,629,847.90 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,605,359.60 | 4,508,124.47 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 104,347,512.96 | 73,177,389.41 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | 东方阿尔法优选混合A | 东方阿尔法优选混合C |
|--------------------------|---------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,001,800.18 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,001,800.18 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 5.63 | - |

注：报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例的分母采用期末基金份额总额，不区分下属不同类别基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或转换本基金的情况。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 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 | 10,001,800.18 | 5.63% | 10,001,800.18 | 5.63% | 自合同生效之日起不少于3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------|---------------|-------|---------------|-------|---|
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,001,800.18 | 5.63% | 10,001,800.18 | 5.63% | - |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|-------|----------------|------------------------|---------------|------|------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20220401-20220630 | 46,624,906.51 | - | - | 46,624,906.51 | 26.26% |

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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准的东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照

10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 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

2022年07月19日