

东方阿尔法聚利 63 个月封闭式债券型证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2026 年 10 月 28 日

送出日期：2026 年 10 月 29 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	东方阿尔法聚利 63 个月 封闭债券	基金代码	029544
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
基金合同生效日	—	上市交易所及上市 日期	暂未上市
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	封闭式	开放频率	封闭期为 63 个月
基金经理	吴谢彬	开始担任本基金基 金经理的日期	—
		证券从业日期	2015 年 08 月 08 日

注：本基金自基金合同生效之日起进入封闭期，封闭期为本基金基金合同生效之日起至 63 个日历月后月度对日的前一日（若该日为非工作日，顺延至下一工作日）。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

本基金将在封闭期到期日对基金份额进行自动赎回，按已变现的基金财产支付部分赎回款项，基金管理人将在 T+7 个工作日内（含）将已变现的基金财产对应款项按基金份额持有人持有的基金份额比例自动赎回给本基金全体基金份额持有人。

封闭期到期日的次日，本基金基金合同自动终止并进入基金财产清算程序。进入基金财产清算程序时，若存在未变现的资产，登记机构将于该部分资产变现完成后，将对应款项按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给本基金全体基金份额持有人，单位基金份额所分配的资产金额按照资产变现完成后的净额进行计算，单位基金份额对应的总到账款项可能与封闭期到期日基金份额净值不一致。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

详见《东方阿尔法聚利 63 个月封闭式债券型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工

	具，包括国内依法发行的债券（国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单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）。 本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券、可交换债券。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在封闭期结束前 3 个月可不受前述投资组合比例的限制。 如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金封闭期围绕六大核心策略开展投资运作。一是封闭期投资策略，整体采用买入并持有到期模式，所有投资标的到期或回售日不晚于封闭期到期日；含回售权债券需提前确定行权时间，超期债券应当行使回售权，在合规前提下处置未到期固定收益品种。二是信用债投资策略，根据宏观经济形势、发行人公司所在行业状况、以及公司自身在行业内的竞争力、公司财务状况和现金流状况、公司治理等信息，发掘具备相对价值的个券并严格控制组合的投资风险。三是杠杆投资策略，在法律法规允许、风险可控的基础上，结合债券收益与回购成本，审慎开展债券回购操作。四是资产支持证券投资策略，结合基本面与量化模型分析基础资产质量及现金流，合理评估个券价值，严控投资规模、分散投资以降低流动性风险。五是封闭期现金管理策略，建仓期配置期限匹配的固收品种并持有到期，针对持仓兑付、付息形成的现金头寸，结合市场环境与剩余期限灵活再投资或开展现金分红。六是证券公司短期公司债券投资策略，综合评估发行主体基本面、财务现金流、经营稳定性及债券信用、流

	动性、违约风险等指标，在持有到期框架下优选优质、具备价格优势的债券投资。
业绩比较基准	中债-1-5 年债券综合全价(总值)指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

注：不同的代销机构采用的评价方法不同，本法律文件风险收益特征表述与代销机构基金风险评价可能存在不一致的风险，投资人在认购本基金时需按照代销机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

暂无。

（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

暂无。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
认购费	M<100 万元	0.30%	
	100 万元≤M<500 万元	0.20%	
	M≥500 万元	1000.00 元/笔	

注：1、上表中认购费仅适用于投资者通过代销机构认购本基金基金份额。

2、通过直销机构认购本基金基金份额的不收取认购费。

3、投资人重复认购，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、诉讼费和仲裁费等费用；基金份额持有人大会费用；基金的证券交易费用；基金的银行汇划费用；基金相关的开户费用、账户维护费用；按照国家有关规定和《基	相关服务机构

金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、本基金审计费用、信息披露费为年金额，由基金整体承担，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

暂无。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金主要风险包括市场风险、信用风险、管理风险、操作或技术风险、本基金采用证券经纪商交易结算模式的风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、基金管理人职责终止风险及其他风险等。本基金特有风险如下：

（1）本基金为债券型基金，债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，因此本基金需承担债券价格变动导致的风险。

（2）投资者无法主动申请赎回的风险。本基金为封闭式基金，自基金合同生效之日起进入封闭期，封闭期为自基金合同生效之日起至 63 个月后月度对日的前一日，若该日为非工作日则顺延至下一工作日。本基金在封闭期内不办理申购、赎回、转换等业务，投资者无法主动申请赎回，将导致投资者在需要使用投资于本基金的资金时无法随时赎回到账和进行其他投资。

（3）采用摊余成本法估值的风险

本基金固定收益类证券采用摊余成本法估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。据此计算的资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值可能存在偏差。

本基金采用摊余成本法估值不等于保本保收益，存在无法获得收益甚至亏损本金的风险，包括但不限于以下情形：1）在不违反会计准则的前提下，基金管理人可以对尚未到期的固定收益品种进行处置，资产变现价格与摊余成本法估值价格的差异将于变现当日集中反映，届时被处置资产的实际变现价格可能大幅低于按照摊余成本法估值的价格；2）本基金应当按照企业会计准则的要求，评估金融资产是否发生减值，如有客观证据表明发生减值的，应当计提减值准备，基金资产发生计提减值准备可能对净值表现产生不利影响；3）可能对基金净值产生不利影响的其他情形。基金管理人承诺投资者投资于本基金的本金安全，也不承诺最低收益，不承担因提前处置未到期固定收益品种或计提减值准备等情形导致的基金资产的损失。请投资者充分了解按摊余成本法估值带来的风险，谨慎作出投资决策，并自行承担投资本基金所面临的相关风险及后果。

（4）资产支持证券投资风险

本基金可能投资于资产支持证券。本基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易

过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，可能造成基金财产损失。此外，受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

(5) 持有至到期策略相关风险

本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日或回售日不得晚于封闭运作期到期日。在融资成本及市场风险发生变化等不同市场环境下，本基金无法灵活地进行投资组合的调整，由此可能给本基金资产造成不利影响。

(6) 本基金可投资证券公司短期公司债券，由于证券公司短期公司债券非公开发行和交易，且限制投资者数量上限，潜在流动性风险相对较大。若发行主体信用质量恶化，受流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债券，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应友好协商解决；如经友好协商未能解决的，则任何一方应当按《基金合同》的约定提交仲裁。详情见本基金《基金合同》第二十一部分“争议的处理和适用的法律”。

五、其他资料查询方式

以下资料详见东方阿尔法基金官方网站【www.dfa66.com】【客服电话：400-930-6677】

- (1) 基金合同、托管协议、招募说明书
- (2) 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (3) 基金份额净值
- (4) 基金销售机构及联系方式
- (5) 其他重要资料

六、其他情况说明

无