

# 东方阿尔法优势产业混合型发起式证券投资基金

## 2021年第4季度报告

### 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

报告送出日期:2022年01月21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.....	9
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	10
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 投资组合报告.....	10
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	10
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	11
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.....	12
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	12
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.....	13
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.....	13
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.....	13
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.....	13
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	13
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	13
5.11 投资组合报告附注.....	14
§6 开放式基金份额变动.....	14
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	15
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	15
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	15
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	15
§9 影响投资者决策的其他重要信息.....	16
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.....	16
9.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	16
§10 备查文件目录.....	16
10.1 备查文件目录.....	16
10.2 存放地点.....	16
10.3 查阅方式.....	16

## § 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1月20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2021年10月01日起至2021年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东方阿尔法优势产业混合
基金主代码	009644
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年06月28日
报告期末基金份额总额	4,663,538,893.96份
投资目标	本基金通过全面深入地研究分析上市公司基本面，投资于可能从宏观经济结构、产业结构升级以及技术创新等变化趋势中获益的质地优良的优势产业和上市公司，在严格控制风险的前提下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。
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</p> <p>本基金采用自上而下的方法进行大类资产配置，通过对宏观经济、政策环境、证券市场走势的跟踪和综合分析，进行前瞻性的战略判断，合理确定基金在股票、债券、现金等各类别资产中的投资比例，并适时进行动态调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采用自上而下行业配置和自下而上个股精选相结合的股票投资策略，精选行业和公司。并通过深入研究宏观经济转型、产业结构转型背景下的产业升级与变革，对受益于国家经济转型和政策环境</p>

	<p>改变的相关产业中的上市公司进行系统分析，从定性和定量结合的角度综合分析其成长性和投资价值。</p> <p>3、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>4、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>5、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>6、融资业务的投资策略 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>7、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> <p>8、资产支持证券投资策略 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>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证800指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%</p>
<p>风险收益特征</p>	<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。</p>

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	
下属分级基金的基金简称	东方阿尔法优势产业混合A	东方阿尔法优势产业混合C
下属分级基金的交易代码	009644	009645
报告期末下属分级基金的份额总额	2,334,569,122.33份	2,328,969,771.63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(2021年10月01日 - 2021年12月31日)	
	东方阿尔法优势产业混合A	东方阿尔法优势产业混合C
1. 本期已实现收益	447,264,488.68	365,377,636.95
2. 本期利润	-454,537,775.33	-447,107,190.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2044	-0.2270
4. 期末基金资产净值	4,869,151,566.13	4,821,403,774.22
5. 期末基金份额净值	2.0857	2.0702

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

东方阿尔法优势产业混合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	-8.50%	2.24%	1.81%	0.51%	-10.31%	1.73%
过去六	19.58%	2.86%	-0.73%	0.65%	20.31%	2.21%

个月						
过去一年	58.93%	2.84%	1.30%	0.75%	57.63%	2.09%
自基金合同生效起至今	108.57%	2.55%	16.98%	0.82%	91.59%	1.73%

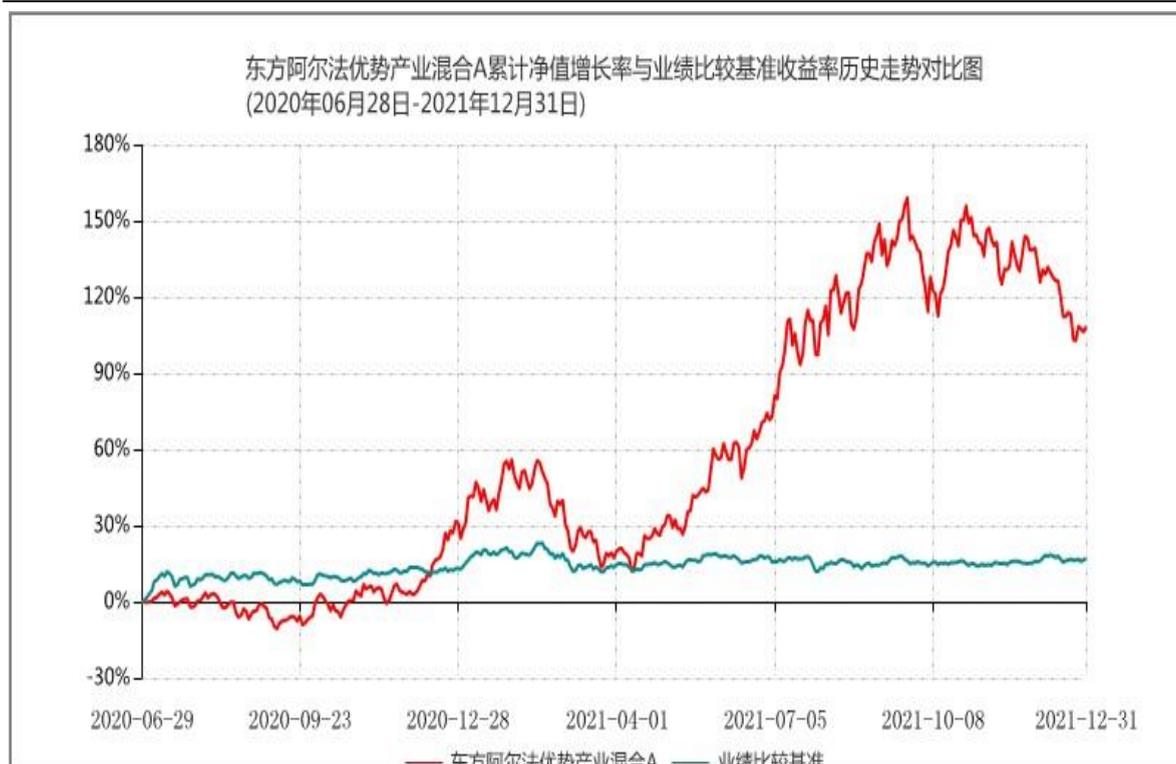
东方阿尔法优势产业混合C净值表现

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	-8.62%	2.24%	1.81%	0.51%	-10.43%	1.73%
过去六个月	19.29%	2.86%	-0.73%	0.65%	20.02%	2.21%
过去一年	58.15%	2.84%	1.30%	0.75%	56.85%	2.09%
自基金合同生效起至今	107.02%	2.55%	16.98%	0.82%	90.04%	1.73%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%。

2、本基金自2020年6月28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



### 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		
唐雷	助理总经理、研究部总监、基金经理	2020-06-28	-	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”分别指根据公告确定的任职日期和离任日期。

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。

#### 4.2 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》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、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

2021 年四季度的 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。新冠新变种病毒让疫情形势更加复杂多变，海外疫情泛滥带来输入压力增加，国内动态清零难度加大，四季度疫情管控对经济尤其是消费的压制作用更为显著。房地产行业下行拖累投资，新房销售增速、房地产新开工面积增速和房地产投资增速都出现了 15%以上的负增长，同时房地产对于宏观流动性的“虹吸效应”还未得到有效缓解。

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。由于我们前期集中投资于新能源汽车行业，在市场风格切换过程中，我们的基金净值在四季度出现了一定程度下跌。全年来看，2021 年东方阿尔法优势产业混合基金 A/C 净值增长率分别为 58.93%/58.15%。

站在目前的位置，对于我们的投资来说需要考虑两个重要问题：（1）市场是否会延续弱势震荡格局，市场风格是否会持续不利于高景气成长板块；（2）新能源汽车板块的景气如何？新能源汽车板块是否还有投资机会。第一个问题是关于市场趋势和风格结构，第二个问题是关于行业基本面和投资逻辑。

首先，对于市场趋势和风格结构。我们判断，在经历了长达半年以上的弱势震荡格局之后，A 股市场有望进入上升通道。在整体上行过程中，市场不会出现类似 2021 年极端分化的结构行情，“稳增长”板块和高成长板块都会上涨，而且中期来看高景气成长板块的弹性更大。

资本市场在 2021 年春节之后的大幅度调整，以及随之而来的持续弱势震荡，对应着宏观经济稳杠杆调结构的政策，以及社融增速快速下行带来的流动性环境持续收紧。而 2022 年我们将看到稳增长政策全面发力，“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。

其次，对于新能源汽车行业，我们的观点是新能源汽车基本面无忧，高景气维持，新能源汽车行业在 2022 年仍然具有显著的投资机会。

2021 年，新能源汽车经历了产业趋势爆发，全球电动车销量超过 600 万辆，增速超过 100%。由于预判新能源汽车的产业趋势爆发以及板块将经历强烈的“戴维斯双击”，我们在 2021 年上半年开始集中投资新能源汽车板块，获取了较好的收益率。在经历了一年的超预期增长之后，到 2021 年底，市场参与者担忧补贴退坡、原材料成本上涨、部分原材料供应限制、中游材料环节扩产等因素影响 2022 年新能源汽车行业尤其是中游电池材料环节的景气。

我们通过对整车厂 2022 年动力电池采购订单、中游环节 2022 年一季度排产情况、终端需求状况以及新兴产业发展规律多个角度分析之后，预测 2022 年新能源汽车销量增速仍然可能超过 60%，超过市场目前的预期，新能源汽车高增长和高景气仍将维持。

此前新能源汽车板块的交易比较拥挤，估值略显饱满，预期较为充分，导致板块的筹码结构脆弱，在 2021 年四季度以来出现非基本面因素的快速下跌。但是，经历调整过后，板块的交易拥挤度已经回归到均值水平之下，估值回归到与增速匹配的合理水平，预期也在板块的调整中得到下修。借鉴历史经验，新能源汽车板块本轮的调整无论是在时间上还是空间上都已达到平均水平。基本面维持高景气高增速，未来业绩有可能继续超预期，估值合理，新能源汽车行业在 2022 年仍然具有显著的投资机会。

东方阿尔法优势产业混合基金重点关注科技成长领域的投资机会，通过把握科技成长行业的景气周期，追求成长的确定性。2022 年一季度我们除了继续重点配置新能源汽车行业之外，也会重点关注风电、消费电子、军工等科技成长领域的投资机会。

#### 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势产业混合A基金份额净值为2.0857元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.50%，同期业绩比较基准收益率为1.81%；截至报告期末东方阿尔法优势产业混合C基金份额净值为2.0702元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.62%，同期业绩比较基准收益率为1.81%。

#### 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	9,095,302,594.34	93.13
	其中：股票	9,095,302,594.34	93.13

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	543,629,396.20	5.57
	其中：债券	543,629,396.20	5.57
	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	95,956,893.51	0.98
8	其他资产	30,943,044.91	0.32
9	合计	9,765,831,928.96	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,094,962,627.57	93.85
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	39,911.04	0.00
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	135,978.23	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.00

0	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	37,932.31	0.00
S	综合	-	-
	合计	9,095,302,594.34	93.86

### 5.2.2 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。

### 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	002709	天赐材料	4,479,842	513,613,885.30	5.30
2	300014	亿纬锂能	4,245,804	501,769,116.72	5.18
3	603799	华友钴业	4,070,509	449,017,847.79	4.63
4	601615	明阳智能	14,985,252	391,115,077.20	4.04
5	002812	恩捷股份	1,541,936	386,100,774.40	3.98
6	002531	天顺风能	18,902,500	366,519,475.00	3.78
7	002594	比亚迪	1,334,786	357,882,822.32	3.69
8	300207	欣旺达	8,181,656	344,938,616.96	3.56
9	603659	璞泰来	2,123,146	340,998,479.06	3.52
10	300750	宁德时代	568,557	334,311,516.00	3.45

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	543,629,396.20	5.61
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	543,629,396.20	5.61

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21国债06	1,993,430	199,402,802.90	2.06
2	019649	21国债01	1,795,590	179,594,911.80	1.85
3	019658	21国债10	1,648,790	164,631,681.50	1.70

注：本基金本报告期仅持有上述债券。

#### 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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 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 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	-
4	应收利息	8,878,396.64
5	应收申购款	22,064,648.27
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	30,943,044.91

### 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

	东方阿尔法优势产业混合A	东方阿尔法优势产业混合C
报告期期初基金份额总额	2,041,237,354.78	1,674,630,196.97
报告期期间基金总申购份额	1,618,820,553.01	2,639,162,748.55

减：报告期期间基金总赎回份额	1,325,488,785.46	1,984,823,173.89
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	2,334,569,122.33	2,328,969,771.63

## § 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

	东方阿尔法优势产业 混合A	东方阿尔法优势产业 混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,004,500.45	-
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	10,004,500.45	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.21	-

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	10,004,500.45	0.21%	10,004,500.45	0.21%	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	10,004,500.45	0.21%	10,004,500.45	0.21%	-
----	---------------	-------	---------------	-------	---

## § 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

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。

### 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势产业混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《东方阿尔法优势产业混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方阿尔法优势产业混合型发起式证券投资基金托管协议》。

### 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01月21日