

东方阿尔法产业先锋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	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	10
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	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	12
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	12
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	12
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	13
§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	14
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	14
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	15
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	15
9.2 影响投资者决策的其他重要信息	15
§10 备查文件目录	15
10.1 备查文件目录	15
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
报告期末基金份额总额	2,958,380,915.29份
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,构成本基金的投资组合。</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</p>

	<p>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、可转债（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略 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>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>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> <p>9、股票期权的投资策略 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>10、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>
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。
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	东方阿尔法产业先锋混合 东方阿尔法产业先锋混合

	A	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, 258, 587, 398. 96份	699, 793, 516. 33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)	
	东方阿尔法产业先锋混合A	东方阿尔法产业先锋混合C
1. 本期已实现收益	-221, 031, 742. 76	-71, 952, 089. 18
2. 本期利润	192, 605, 419. 02	56, 205, 641. 96
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0843	0. 0764
4. 期末基金资产净值	1, 802, 547, 911. 13	555, 873, 045. 03
5. 期末基金份额净值	0. 7981	0. 7943

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

东方阿尔法产业先锋混合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	12. 09%	2. 49%	4. 46%	1. 18%	7. 63%	1. 31%
过去六 个月	-10. 17%	2. 52%	-7. 54%	1. 17%	-2. 63%	1. 35%
自基金 合同生 效起至 今	-20. 19%	2. 12%	-7. 86%	0. 98%	-12. 33%	1. 14%

东方阿尔法产业先锋混合C净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	11.95%	2.49%	4.46%	1.18%	7.49%	1.31%
过去六个月	-10.40%	2.52%	-7.54%	1.17%	-2.86%	1.35%
自基金合同生效起至今	-20.57%	2.12%	-7.86%	0.98%	-12.71%	1.14%

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日成立至今尚未满一年，无过去一年、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-2022年06月30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



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	2021-07-21	-	12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

2022年上半年A股市场呈现剧烈波动的“V”型走势。

1月至4月，在俄乌战争、疫情扩散等黑天鹅事件的冲击之下，市场超预期快速下跌，短期跌幅之大，在A股历史上也比较罕见，其中科技成长板块跌幅尤为明显。4月份，疫情的扩散以及其对宏观经济的冲击导致社会层面预期悲观，资金不断流出资本市场，市场情绪极度低迷。

在基金一季报中，我们提到站在4月中旬极度悲观的市场氛围中，建议耐心等待转机，守望黎明，同时提出市场的转机需要两个方面因素出现边际好转：1) 疫情防控的转机：在疫情防控出现转机之后，经济预期和社会预期才能扭转，市场风险偏好才会恢复。2) 流动性的转机：随着房地产政策放松和疫情防控转机的出现，我们应该能够看

到宏观流动性的转机，以及资本市场流动性改善，市场估值体系，尤其是成长股估值体系将企稳。

4月底，市场终现曙光，我们的判断得到印证。随着疫情防控形势逐步好转，社会经济活动逐步修复，流动性开始释放，市场进入上行通道。在5-6月份市场上涨过程中，以新能源和新能源汽车为代表的科技成长股领涨市场，我们的基金净值也得到了较好的修复。

三季度疫情影响减弱，宏观经济快速修复。二季度疫情防控形势严峻，经济活动受到极大冲击，国内第二季度GDP同比仅增长0.4%。随着防疫政策调整、疫情管控更加精准有效，三季度疫情对经济的影响将会显著减弱，社会经济活动能够较大程度恢复正常。同时基建、地产等稳增长政策措施对经济的拉动作用开始显现。我们预计三季度宏观经济将快速修复，GDP同比增速将回到5%左右。

从宽货币到宽信用，宏观流动性环境进一步改善。随着宏观经济的快速修复，以及持续的宽货币政策，6月份社融显著扩张，社融存量增速提升0.3个百分点至10.8%，投向实体信贷总量明显扩张，信贷结构改善，居民和企业中长期信贷增量显著。我们判断三季度社融增速仍将震荡上行，结构继续优化，巩固宽货币到宽信用的效果，宏观流动性进一步充裕。

宏观经济修复，A股整体盈利增速向上修正。宏观流动性进一步改善，对应股票市场估值中枢缓慢上移。考虑到盈利和估值两个因素的正面作用，我们对A股市场下半年抱有乐观积极的态度，A股市场将延续4月底以来的上行趋势。

在乐观积极的同时，我们也时刻警惕海外风险。海外通胀高企、经济衰退形势严峻、资产价格大幅度波动，下半年可能将会对国内经济和国内市场产生比较大的负面扰动，尤其是需要关注海外出现金融风险的可能性。

在A股下半年的上行趋势中，从盈利和估值两端，高景气的科技成长行业均会有更大的向上空间。三季度，我们看好以光伏、储能、风电为代表的新能源发电板块，看好新能源旺盛需求叠加国产替代跨越式推进的功率半导体行业。在1-2年的时间维度，我们建议关注半导体国产替代的巨大机会。

大通胀时代下，全球能源价格高企，新旧能源结构切换加速，新能源发电行业进入新一轮高景气周期。海外光伏组件需求旺盛，户用储能爆发式增长，未来随着上游硅料产能逐步释放和价格下行，光伏各环节供应瓶颈解除、利润空间大幅增加，光伏储能行业量利双升。风力发电行业处于类似光伏行业在2019年的产业阶段。风机招标价格大幅度下降，陆上风电已经实现全面平价，2022年海上风电也陆续平价，同时上游原材料价格下降，成本压力解除，风电行业将进入由“平价”需求拉动的景气上行周期。

功率半导体下游受益于光伏、储能、风电和新能源汽车的高速增长。同时，其国产替代进程跨越式发展，在过去2-3年完成从0到1的积累之后，正在迅速实现从1到10的跨越。国内功率半导体行业整体需求旺盛，持续高景气。

在功率半导体之外，纵观整个半导体行业，众多细分领域已经在主流技术和主流产品上突破了国产替代的阈值，只是短期受制于下游消费电子需求低迷，行业发展略显乏

力。但是考虑1-2年的时间维度，随着消费类电子需求的企稳，在终端需求恢复与国产替代加速的共振下，整个半导体行业都将迎来巨大的投资机遇。

4.5 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0.7981元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.09%，同期业绩比较基准收益率为4.46%；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0.7943元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.95%，同期业绩比较基准收益率为4.46%。

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	2,235,893,290.27	92.15
	其中：股票	2,235,893,290.27	92.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,949,599.18	5.11
	其中：债券	123,949,599.18	5.11
	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	10,888,970.80	0.45
8	其他资产	55,504,222.17	2.29
9	合计	2,426,236,082.42	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	2,235,531,833.03	94.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,684.08	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	37,894.59	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	13,298.10	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	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,235,893,290.27	94.80

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	601012	隆基绿能	2,289,280	152,534,726.40	6.47
2	002459	晶澳科技	1,972,495	152,204,839.25	6.45
3	600522	中天科技	5,826,207	134,585,381.70	5.71
4	002129	TCL中环	1,857,700	109,399,953.00	4.64

5	300373	扬杰科技	1,412,277	100,624,736.25	4.27
6	600460	士兰微	1,794,091	93,292,732.00	3.96
7	300274	阳光电源	947,800	93,121,350.00	3.95
8	688223	晶科能源	6,124,499	91,340,790.07	3.87
9	688599	天合光能	1,364,669	89,044,652.25	3.78
10	603606	东方电缆	1,147,212	87,876,439.20	3.73

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	123,949,599.18	5.26
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	123,949,599.18	5.26

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	019658	21国债10	1,000,000	101,904,931.51	4.32
2	019666	22国债01	218,000	22,044,667.67	0.93

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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。

5.11 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。

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	49,999,982.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,504,239.94
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	55,504,222.17

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002459	晶澳科技	43,572,163.25	1.85	非公开发行流通受限
2	688223	晶科能源	3,082,110.00	0.13	新股流通受限

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

	东方阿尔法产业先锋混合A	东方阿尔法产业先锋混合C
报告期期初基金份额总额	2,305,395,619.69	755,424,500.51
报告期期间基金总申购份额	74,931,134.04	115,861,384.10
减：报告期期间基金总赎回份额	121,739,354.77	171,492,368.28
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	2,258,587,398.96	699,793,516.33

§ 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

	东方阿尔法产业先锋混合A	东方阿尔法产业先锋混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,225.04	-
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	5,000,225.04	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.17	-

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	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	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,643.79	0.34%	10,001,643.79	0.34%	-

§ 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》；
- 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