

东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金

2023年第2季度报告

2023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:2023年07月15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.....	9
4.3 公平交易专项说明.....	9
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....	10
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	11
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 投资组合报告.....	11
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	11
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	12
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.....	13
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	14
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.....	14
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.....	15
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.....	15
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.....	15
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	15
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	15
5.11 投资组合报告附注.....	15
§6 开放式基金份额变动.....	16
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	16
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	17
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	17
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况.....	17
§9 影响投资者决策的其他重要信息.....	17
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.....	17
9.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	18
§10 备查文件目录.....	18
10.1 备查文件目录.....	18
10.2 存放地点.....	18
10.3 查阅方式.....	18

§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2023年7月14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2023年4月1日起至2023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	141,695,245.40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</p> <p>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</p> <p>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</p>

	<p>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</p> <p>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</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，选择投资价值高的存托凭证进行投资。</p> <p>5、债券类资产投资策略</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>6、股指期货投资策略</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>7、融资业务的投资策略</p> <p>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</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>业绩比较基准</p>	<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>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币</p>

	型基金、债券型基金。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。	
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	95,995,288.17份	45,699,957.23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(2023年04月01日 - 2023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	-4,462,297.66	-2,226,035.10
2.本期利润	-5,692,797.76	-2,825,144.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0589	-0.0605
4.期末基金资产净值	82,053,337.44	38,327,617.40
5.期末基金份额净值	0.8548	0.8387

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	-6.43%	1.67%	-4.71%	0.73%	-1.72%	0.94%
过去六个月	-10.45%	1.46%	-0.07%	0.74%	-10.38%	0.72%
过去一年	-23.51%	1.26%	-10.89%	0.88%	-12.62%	0.38%
过去三年	-43.76%	1.41%	-4.87%	1.03%	-38.89%	0.38%
自基金合同生效起至今	-14.52%	1.45%	0.35%	1.06%	-14.87%	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	-6.54%	1.67%	-4.71%	0.73%	-1.83%	0.94%
过去六个月	-10.68%	1.46%	-0.07%	0.74%	-10.61%	0.72%
过去一年	-23.90%	1.26%	-10.89%	0.88%	-13.01%	0.38%
过去三年	-44.60%	1.41%	-4.87%	1.03%	-39.73%	0.38%
自基金合同生效起至今	-16.13%	1.45%	0.35%	1.06%	-16.48%	0.39%

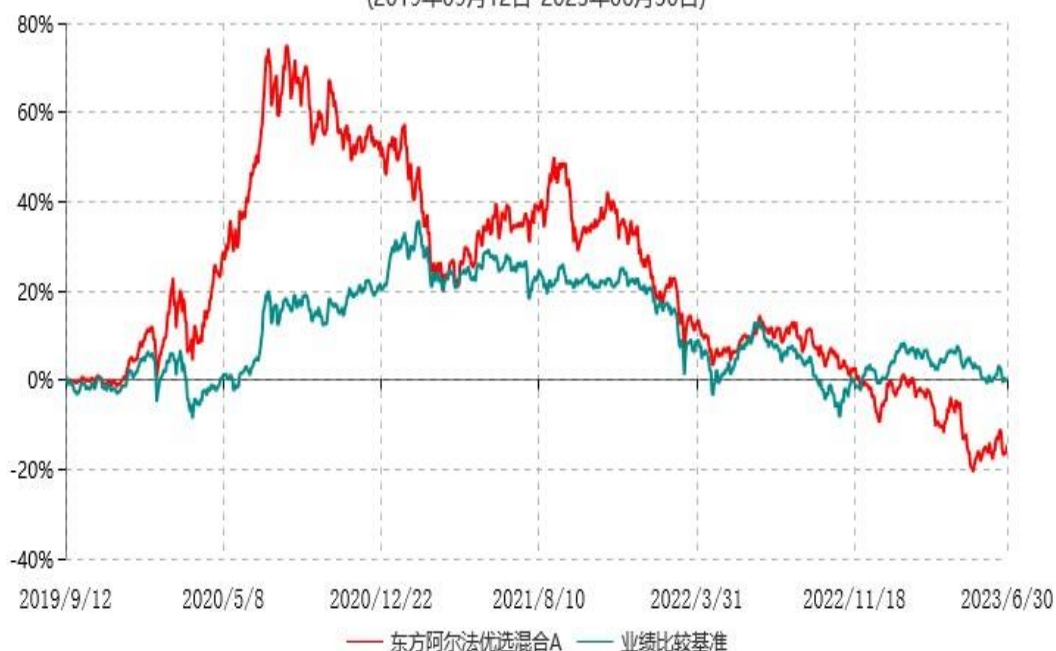
注：1、本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×10%+恒生指数收益率×10%。

2、本基金自2019年9月12日成立至今尚未满五年，无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

(2019年09月12日-2023年06月30日)



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

(2019年09月12日-2023年06月30日)



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

第 7 页，共 18 页

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		
刘明	基金经理、投资经理、公司总经理、投资总监	2023-01-09	-	23年	刘明先生,毕业于厦门大学统计专业和金融专业,经济学硕士。曾任厦门证券公司鹭江营业部总经理、厦门产权交易中心副总经理、香港时富金融服务集团投资经理、大成基金管理有限公司基金经理、投资部副总监、投资部总监、首席投资官、公司助理总经理、股票投资决策委员会主席、公司副总经理,并兼任社保组合基金经理。2015年5月至2017年6月任东方阿尔法基金管理有限公司筹备组组长。现任东方阿尔法基金管理有限公司总经理、投资总监、基金经理,同时兼任私募资产管理计划投资经理。
周谧	基金经理	2023-03-03	-	12年	周谧先生,中国人民大学应用数学硕士。2008年9月起历任中再资产管理股份有限公司金融工程分析师、平安证券有限责任公司高级量化分析师、国金创新投资有限公司投资经理、深圳铸成投资有限公司投资部副总监、财富证券有限责任公司投资经理、金信基金管理有限公司基金经理。2022年10月加入东方阿尔法基金管理有限公司,现任东方阿尔法优选混合型发起式证券投资

					资基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------

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。

4.1.1 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
刘明	公募基金	3	1,038,840,739.39	2018-02-08
	私募资产管理计划	1	256,891,284.11	2020-05-25
	其他组合	-	-	-
	合计	4	1,295,732,023.50	-

注："任职时间"为兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理在东方阿尔法基金管理有限公司首次开始管理本类产品的时间。兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理在行业内首次开始管理公募基金的任职时间为2004年10月22日，首次开始管理私募资产管理计划的任职时间为2014年9月29日。

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》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。

4.3.2 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非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

二季度相比一季度，无论是宏观环境还是市场环境都出现了一些新的变化。随着一季度居民报复性消费以及复工赶工的阶段结束，二季度经济走势恢复平稳状态。海外经济修复的不确定性，大家对经济修复的力度和速度从乐观回复到了中性。政府不断发布各项政策，大家目前对于经济增速保5%是很有信心的，但也在调整对于刺激政策的预期，短期内或许不太会有大幅刺激政策。

二季度，股票市场的走势从风格上来看，与顺周期相关的行业调整更多，而与AI相关的TMT行业表现更好。这主要因为AI是一个比较长远的产业趋势，目前还处于AI大模型产业的初期，短期无法验证业绩也无法确定哪些公司能够最终胜出。

本基金一季度配置了较大比例的新能源行业，从目前看来，新能源行业已经景气了近3年，今年虽能再超预期，但未来行业增速将逐步下降。而其它有些行业处于景气度前中段甚至早期，其预期收益优于新能源行业。在进行行业比较之后，本基金将更加关注国产替代相关科技领域和先进制造行业的投资机会。

当前我们国家最紧迫需要发展的是哪个行业，我们能否发展起来？无疑目前最紧迫需要发展的就是半导体行业。中美两国的博弈是未来十到二十年的全球事件，美国作为竞争对手在哪些行业对我们“重点关照”越多，就越说明这个行业是迫切需要发展的行业，半导体当之无愧。那大家又要问“我们能否发展起来呢？”答案是肯定的！大家不要只看这十年，实际人类历史上这样的技术封锁一直就有。从我国古代对瓷器、养蚕、火药的封锁，英国对蒸汽机技术的封锁，以及之后核能技术等等的封锁都失败了。当一边因为技术封锁带来了技术和人员的过剩，而另一边因为有强烈需求带来对技术和人员的渴求，人的逐利性和技术的天生扩散性必然会让这个技术封锁之墙慢慢被渗透并且最终趋于无效。与其问我们在高科技领域受限之下能否发展起来，还不如问“我们是否对高科技的需求更为迫切，我们是否愿意为了高科技进行投入和追求”，只要这个答案是肯定的，那么我们必将能够突破封锁。这一点大家要有信心。

本基金坚持以科技和大消费的投资为主，但是站在当前时点，考虑到中国经济发展亟须在科技行业和先进制造领域取得突破，我们将紧密跟踪这些产业的变化，为大家把握中国科技突破的新机会。此外，我们也会密切跟踪其它行业在景气度和政策方面的变化情况，如果出现了景气和估值相匹配的机会，我们也会进行适当参与，使组合具有更优的风险收益比，为广大投资人创造价值。

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0.8548元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.43%，同期业绩比较基准收益率为-4.71%；截至报告期末东方阿尔法优选混合C基金份额净值为0.8387元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.54%，同期业绩比较基准收益率为-4.71%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万的情形。

§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	110,985,238.45	91.96
	其中：股票	110,985,238.45	91.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,309,292.50	5.23
	其中：债券	6,309,292.50	5.23
	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	3,354,579.39	2.78
8	其他资产	34,616.07	0.03
9	合计	120,683,726.41	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为2,146,203.48元，占资产净值比例1.78%。

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	93,158,429.93	77.39
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	5,034.15	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,196.70	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,509,386.19	12.05
J	金融业	788,760.00	0.66
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	364,228.00	0.30
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	108,839,034.97	90.41

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 (%)
医疗保健	387,618.83	0.32
信息技术	1,758,584.65	1.46
合计	2,146,203.48	1.78

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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例 (%)
1	300604	长川科技	189,000	8,975,610.00	7.46
2	688012	中微公司	53,802	8,417,322.90	6.99
3	688072	拓荆科技	20,252	8,237,244.44	6.84
4	002371	北方华创	23,400	7,433,010.00	6.17
5	688120	华海清科	28,807	7,260,804.35	6.03
6	688409	富创精密	61,196	6,670,364.00	5.54
7	688262	国芯科技	162,326	6,605,044.94	5.49
8	688037	芯源微	38,542	6,588,754.90	5.47
9	300567	精测电子	57,700	5,490,155.00	4.56
10	688596	正帆科技	83,066	3,596,757.80	2.99

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	6,168,274.88	5.12
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）	141,017.62	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,309,292.50	5.24

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	019688	22国债23	61,000	6,168,274.88	5.12
2	118035	国力转债	1,410	141,017.62	0.12

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

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

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	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,616.07
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	34,616.07

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	688072	拓荆科技	3,870,200.00	3.21	非公开发行锁定

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	96,704,249.66	45,995,172.21
报告期期间基金总申购份额	1,828,873.54	8,323,945.46
减：报告期期间基金总赎回份额	2,537,835.03	8,619,160.44
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	95,995,288.17	45,699,957.23

§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

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

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

本基金成立后有10,001,800.18份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2019年9月12日至2022年9月12日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0.00份。

§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	20230401-20230630	39,814,757.79	-	-	39,814,757.79	28.10%

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》（含更新）
- 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

2023年07月15日