

## 东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2019年第3期）

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

公告日期：2019年10月25日

### 重要提示

东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2017年11月7日证监许可【2017】2013号文注册募集。本基金合同已于2018年2月8日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和收益及市场前景等作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，投资对象或对手方违约引发的信用风险，投资对象流动性不足产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的管理风险，本基金的特定风险等。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具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），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常

赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金除了投资于 A 股市场优质企业外，还可在法律法规规定的范围内投资港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

本基金可投资科创板上市交易股票，将承担因上市条件、交易规则、退市制度等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险、投资集中风险等。本基金根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板上市交易股票或选择不将基金资产投资于科创板上市交易股票。本基金资产并非必然投资科创板上市交易股票。

本基金可投资中小企业私募债，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开发行的方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经纪商进行场内交易和结算，该种交易结算模式可能存在操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险、无法完成当日估值等风险。

本基金为混合型证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变基金的实质性风险收益特征，但由于风险分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》和《基金产品资料概要》等信息披露文件。基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

投资者应当通过本基金管理人或销售机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元，从而遭受损失的风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。基金的过往业绩及净值高低并不预示其未来的业绩表现。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2019年10月24日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年9月30日（本招募说明书中的财务资料未经审计）。

## 第一部分 基金管理人

### 一、概况

1、名称：东方阿尔法基金管理有限公司

2、住所： 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

3、办公地址： 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 23BC

4、法定代表人：刘明

5、设立时间： 2017 年 7 月 4 日

6、电话：0755-21872900

7、传真：0755-21872902

8、联系人： 曾健

9、注册资本：1 亿元人民币

10、股权结构： 刘明、珠海共同成长股权投资基金合伙企业（有限合伙）、肖冰、雷振锋、曾健分别持有本基金管理人 39.96%、39.56%、13.98%、4.5%和 2%的股权。

### 二、主要人员情况

1、董事会成员

肖冰：董事长，男，工商管理硕士主修金融，曾任联合证券有限责任公司国际业务部总经理助理、鹏华基金管理有限公司市场部总监、泰达宏利基金管理有限公司市场部总监、景顺长城基金管理有限公司营销主管、大成基金管理有限公司市场部总监、综合管理部总监、公司副总经理兼董事会秘书。2015年6月至2017年6月任东方阿尔法基金管理有限公司筹备组副组长。现任东方阿尔法基金管理有限公司董事长。

刘明：董事，男，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。

周瑞堂：独立董事，男，博士。历任广东宝利来投资股份有限公司董事长，深圳市南山区粤海办事处处长（正处级），深圳市南山区投资管理公司总经理，企业党委书记，区国资办主任，深圳市凯虹实业股份有限公司总经理、财务负责人，中国太阳石油公司总经理助理。

杜婷：独立董事，女，博士研究生，副教授。现任深圳大学经济学院副教授。

黄亚平：独立董事，女，学士。现任北京市观韬（深圳）律师事务所律师、合伙人。历任广东金地律师事务所律师、合伙人，广东金融房产律师事务所律师。

## 2、监事成员

陈海玲：监事，女，管理学学士。1992年5月至2008年5月任职于中信银行股份有限公司深圳分行，曾任营业部会计主管、会计部财务经理；2008年5月至2017年6月任职于大成基金管理有限公司计划财务部，曾任财务高级经理。现任东方阿尔法基金管理有限公司综合管理部总监。

## 3、总经理及其他高级管理人员

刘明：总经理，男，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。

曾健：督察长，女，经济学硕士，历任大成基金管理有限公司综合管理部总经理秘书，市场部广东销售团队负责人，人力资源部高级经理、总监助理、副总监、总监，东方阿尔法

基金管理有限公司筹备组成员、副总经理。现任东方阿尔法基金管理有限公司督察长。

王香桂：副总经理，女，金融学研究生，曾任职于美国友邦保险有限公司深圳分公司，历任部门主管、部门总监、公司副总经理；2011年5月至2016年6月任职于大成基金管理有限公司，历任市场部副总经理、营销策划及产品开发部总监、市场营销管理部总监及电子商务部总监，现任东方阿尔法基金管理有限公司副总经理。

曹渊：首席信息官，男，工学学士。2002年9月至2007年6月，任恒生电子股份有限公司华南区维护主管；2007年6月至2016年6月，任大成基金管理有限公司高级系统工程师；2016年6月加入东方阿尔法基金管理有限公司，先后任公司筹备组成员、运作保障部总监。现任东方阿尔法基金管理有限公司首席信息官。

#### 4、基金经理

刘明：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。

#### 5、本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

刘明，投资决策委员会主席，总经理、投资总监；

赵兵，投资决策委员会委员，助理总经理；

竺艺，投资决策委员会委员，研究员。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

## 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2019年6月30日，本集团总资产71,931.81亿元人民币，高级法下资本充足率15.09%，权重法下资本充足率12.60%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工83人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得

到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“多功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖。

## 二、主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991年加入本行；2002年10月至2013年12月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行

长；2013年12月至2016年10月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016年10月至2017年4月任本行业务总监兼北京分行行长；2017年4月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任本行副行长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

### 三、基金托管业务经营情况

截至2019年6月30日，招商银行股份有限公司累计托管479只证券投资基金。

### 四、托管人的内部控制制度

#### 1、 内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

#### 2、 内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

#### 3、 内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位。

(2) 审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营



为出发点，以有效防范各种风险作为内部控制的核心，体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

(4) 有效性原则。内部控制具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

(5) 适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

(6) 防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

(7) 重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8) 制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

#### 4、 内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24

小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

## 五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

(1) 东方阿尔法基金管理有限公司直销柜台

地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 23BC

电话：0755-21872905

传真：0755-21872903

联系人：张珂

(2) 东方阿尔法基金管理有限公司网上直销交易系统

网上交易网址：[www.dfa66.com](http://www.dfa66.com)

移动端站点：请关注“东方阿尔法基金”官方微信

客户服务电话：400-930-6677

投资人可以通过基金管理人网上直销交易系统办理本基金的开户、申购（含定投）及赎回等手续，具体交易细则请参阅基金管理人网站公告。

## 2、代销机构

### （1）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7008 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195050

### （2）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客服电话：95517

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

### （3）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

客服电话：95597

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755—82492962

（4）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95548

联系人：郑慧

电话：010-60838888

传真：010-6083 6029

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（5）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

联系人：刘晓明

电话：0531-89606165

传真：0532-85022605

（6）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客服电话：95548

联系人：刘宏莹

电话：010-60833754

传真：0755-83217421

（7）申万宏源证券有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523

联系人：余敏

电话：021-33388252

传真：021-33388224

网址：www.swhysc.com

（8）申万宏源西部证券有限公司

通讯地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005

室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005

室

法定代表人：韩志谦

客服电话：95523

联系人：王怀春

电话：0991-5801913

传真：0991-5801466

网址：<http://www.swhysc.com>

（9）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

客服电话：95565

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

传真：0755-83734343

（10）广发证券股份有限公司

注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、7、8、17-19、38-44 楼

法人代表：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

（11）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法人代表：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509977

传真：021-64385308

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

（12）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法人代表：祖国明

联系人：韩爱彬

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

（13）上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法人代表：黄欣

联系人：戴珉微

电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

客户服务电话：400-6767-523

网址：[www.zhongzhengfund.com](http://www.zhongzhengfund.com)

(14) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二四西路 1 号 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街 18 号同花顺大楼

法人代表：吴强

联系人：洪泓

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(15) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔楼 1201-1203

法人代表：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(16) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法人代表：王翔

联系人：李关洲

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：400-820-5369

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(17) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A11 层

法人代表：王伟刚

联系人：李瑞真

电话：010-56282139

传真：010-62680827

客户服务电话：400-619-9059

网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

(18) 华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13.14 层

办公地址：上海市浦东区向城路 288 号国华金融大厦 8 楼

法人代表：路昊

联系人：张爽爽

电话：021-68595976

传真：021-68595766

客户服务电话：952303

网址：[www.huaruisales.com](http://www.huaruisales.com)

(19) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法人代表：薛峰

联系人：龚江江

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客户服务电话：4006-788-887

网址：[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com) / [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

(20) 大连网金基金销售有限公司



注册地址：辽宁省大连市沙河口体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

联系人：宋婉婧

电话：0411-39027817

传真：0411-39027835

客户服务电话：4000-899-100

网址：www.yibaijin.com

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》等法律法规和基金合同的约定，选择其他符合要求的机构销售本基金，各销售机构的具体名单见基金管理人网站公示。

## 二、注册登记人

名称：招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

电话：0755-82943666

传真：0755-82960794

联系人：赵斗斗

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京滴慧律师事务所

住所：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界 A 座 1215

负责人：韩强

电话：010-53118002

传真：010-53118002

经办律师：韩强、姚红光

联系人：韩强

## 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：金诗涛

经办注册会计师：薛竞、金诗涛

#### **第四部分：基金的名称**

东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

#### **第五部分：基金的类型**

混合型证券投资基金

#### **第六部分：基金的投资目标**

在严格控制风险的基础之上，通过灵活、主动的投资管理方式力求实现组合资产的稳健增值。

#### **第七部分：基金的投资范围**

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、证券公司短期融资券、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、权证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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资

融券业务中的融资业务。

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：

本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 **0%—95%**；其中对港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）的投资比例不超过股票资产的 **50%**。本基金在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 **95%**；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 **5%**，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果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。

## 第八部分：基金的投资策略

本基金基于宏观经济研究，确定大类资产配置比例；通过上市公司基本面分析，主要采用优选个股的主动投资策略，获取超额收益。优选个股是指积极、深入、全面地了解上市公司基本面，动态评估公司价值，当股价低于合理价值区域时，买入并持有；在股价恢复到合理价值的过程中，分享股价提升带来的超额收益。

### 1、大类资产配置策略

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。其中，全球主要股市的市盈率比较、GDP 增速、上市公司总体盈利增长速度、债市和股市的预期收益率比较和利率水平是确定大类资产配置比例的主要因素。

### 2、个股优选策略

#### （1）建立初选股票池

本基金通过建立初选股票池，避免投资于具有较大风险的股票。非 ST、非\*ST 股票可进入初选股票池，已公告资产重组或基本面发生重大变化的 ST、\*ST 股票，经过基金管理人投资团队严格评估后合格的，仍可进入本基金初选股票池。

#### （2）建立备选股票池

在初选股票池的基础上，本基金将按照以下 5 个因素，对初选股票池成份股进行筛选，确定备选股票池。

- a. 上市公司是否有易于理解而且稳定的盈利模式；
- b. 财务状况是否良好；
- c. 上市公司的行业地位；
- d. 上市公司对上下游的定价能力；
- e. 是否具有良好的治理结构。

基金管理人将采用定量分析与定性分析相结合的方式对以上 5 项因素进行分析。其中，上市公司的盈利模式主要通过其过去 3 年主营业务收入占营业收入比例、主营业务收入增长率等指标衡量；财务状况主要通过其过去 3 年资产负债比例、毛利率和净资产收益率等指标衡量；行业地位主要通过其过去 3 年在行业中的市场占有率等指标衡量；对上下游的定价能力主要通过其过去 3 年经营性现金流占净利润的比例等指标衡量；治理结构主要通过其股东结构、董事会成员构成、管理层过往表现以及资产管理人投资团队实地调研结果等情况考察。

### （3）实地调研

基金管理人投资团队将通过案头分析、公司实地调研等方式，深入了解备选股票池成份股基本面数据的真实性，确保对上市公司内在价值估计的合理性。研究员将把上市公司的盈利能力与国际、国内同行业的公司作比较，调研与公司有关的供应商、客户、竞争对手等各方的情况，通过行业主管机关、税务部门、海关等机构进行第三方数据核实。

### （4）建立投资组合

本基金以备选股票池成份股的动态性价比作为选择其进入投资组合的重要依据，动态性价比主要根据上市公司未来两年的动态 PE 衡量。未来两年的动态 PE 由基金管理人投资团队根据内外部研究资料并结合实地调研结果，在对备选股票池成份股未来两年业绩预测的基础上，结合当前市场价格计算。

基金管理人投资团队将对备选股票池成份股按行业进行动态性价比排序，同时参考 PEG、PB、现金流估值等指标以及对上市公司的定性分析，选择各行业中动态性价比最优的股票买入，构建股票组合。

### （5）投资组合的调整

基金管理人投资团队在买入个股之后，将动态跟踪上市公司的基本面变化，并根据基本面变化及时调整业绩预测及动态性价比排序；在出现新的动态性价比更优的股票时，将以动

态性价比更优的股票替代现有组合中性价比下降的股票。

### 3、港股投资策略

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注：

(1) A 股稀缺性行业个股，包括优质中资公司（如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等）、A 股缺乏投资标的的行业；

(2) 具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头；

(3) 符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；

(4) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。

### 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。

#### (1) 利率预测分析

准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益。当预期利率下调时，适当加大组合中长久期债券的投资比例，为债券组合获取价差收益；当预期利率上升时，减少长久期债券的投资，降低债券组合的久期，以控制利率风险。

#### (2) 收益率曲线变动分析

收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。本基金通过预测收益率曲线形状的变化，调整债券组合内部品种的比例获得投资收益。

#### (3) 债券信用分析

本基金通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行深入、细致的调研，准确评价债券的违约概率，提早预测债券评级的改变，捕捉价格优势或套利机会。

#### (4) 收益率利差分析

本基金将在预测和分析同一市场不同板块之间、不同市场的同一品种之间、不同市场不同板块之间的收益率利差的基础上，采取积极投资策略，选择适当品种，获取投资收益。

### 5、权证投资策略

在控制投资风险的前提下，对权证进行投资，争取获得较高的回报。权证投资策略主要为：采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资的价值基准，并根据权证标的股票基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证趋势投资。

#### 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。

#### 7、融资买入股票策略

本基金将根据融资买入股票成本以及其他投资工具收益率综合评估是否采用融资方式买入股票，本基金在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。

#### 8、国债期货的投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，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，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，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。

#### 9、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券本质上为公司债，只是发行主体扩展到未上市的中小型企业，扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债券发行主体为非上市中小企业，企业管理体制和治理结构弱于普通上市公司，信息披露情况相对滞后，对企业偿债能力的评估难度高于普通上市公司，且定向发行方式限制了合格投资者的数量，会导致一定的流动性风险。因此本基金中小企业私募债券的投资将重点关注信用风险和流动性风险。本基金采取自下而上的方法建立适合中小企业私募债券的信用评级体系，对个券进行信用分析，在信用风险可控的前提下，追求合理回报。本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤，重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素，给予不同因素不同权重，采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估，选择发行主体资质优良，估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。

## 第九部分：基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 40\% + \text{中证综合债券指数收益率} \times 40\% + \text{恒生指数收益率} \times 20\%$

采用该比较基准主要基于如下考虑：

本基金为混合型基金，在综合考虑了基金投资组合的构建、投资标的以及市场上各类指数的编制方法后，本基金选择市场认同度较高并且作为股指期货标的的沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩比较基准。沪深 300 指数成份股选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

恒生指数，由香港恒生银行全资附属的恒生指数服务有限公司编制，是以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅动趋势最有影响的一种股价指数。

债券组合的业绩基准则采用了中证综合债券指数，中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数，该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，具有较强的市场代表性。

如果指数编制单位停止计算编制这些指数或更改指数名称，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后变更本基金业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 第十部分：基金的风险收益特征

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，而低于股票型基金。本基金除了投资于 A 股市场优质企业外，还可在法律法规规定的范围内投资港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

## 第十一部分：基金投资组合报告

以下内容摘自本基金 2019 年第 3 季度报告（未经审计）。

### 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	1,337,709,030.91	93.85
	其中：股票	1,337,709,030.91	93.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	75,813,220.00	5.32
	其中：债券	75,813,220.00	5.32
	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	9,254,106.78	0.65
8	其他资产	2,595,063.70	0.18
9	合计	1,425,371,421.39	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### (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	55,388,118.00	3.90
B	采矿业	-	-
C	制造业	548,622,218.71	38.60
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	122,365,008.50	8.61
G	交通运输、仓储和邮政业	102,716,955.10	7.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	27,264,617.40	1.92



	术服务业		
J	金融业	308,409,756.77	21.70
K	房地产业	72,360,870.40	5.09
L	租赁和商务服务业	76,648,640.83	5.39
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,932,845.20	1.68
S	综合	-	-
	合计	1,337,709,030.91	94.11

### (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股票。

### (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	002867	周大生	5,909,398	122,365,008.50	8.61
2	000001	平安银行	7,779,868	121,288,142.12	8.53
3	601021	春秋航空	2,418,130	102,716,955.10	7.23
4	002142	宁波银行	3,879,366	97,798,816.86	6.88
5	601877	正泰电器	4,310,936	94,107,732.88	6.62
6	002202	金风科技	7,221,201	90,409,436.52	6.36
7	601318	中国平安	1,025,238	89,236,715.52	6.28
8	000858	五粮液	627,000	81,384,600.00	5.73
9	600031	三一重工	5,658,433	80,802,423.24	5.68
10	600519	贵州茅台	69,732	80,191,800.00	5.64

### (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	75,813,220.00	5.33
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	75,813,220.00	5.33

**(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	019611	19国债01	628,000	62,793,720.00	4.42
2	019556	17国债02	130,000	13,019,500.00	0.92

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

**(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。

**(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。

**(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。

**(9) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**a. 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投资股指期货。

**b. 本基金投资股指期货的投资策略**

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。

**(10) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**a. 本期国债期货投资政策**

基金管理人将按照相关法律法规的规定，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，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，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。

**b. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**c. 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**(11) 投资组合报告附注**

**a.** 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。

**b.** 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。

**C. 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	1,275,011.65
5	应收申购款	1,320,052.05
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,595,063.70

d.其他资产构成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。

e.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	002867	周大生	30,870,000.00	2.17	大宗交易流通受限
2	601021	春秋航空	24,572,093.00	1.73	大宗交易流通受限

f.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，分项之和与合计可能有尾差。

## 十一、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。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。

### 东方阿尔法精选混合 A

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
2018.2.8-2018.12.31	-17.89%	1.13%	-10.95%	0.75%	-6.94%	0.38%
2019.1.1-2019.6.30	24.82%	1.62%	13.54%	0.76%	11.28%	0.86%
2019.7.1-2019.9.30	1.81%	0.92%	-1.25%	0.52%	3.06%	0.40%

### 东方阿尔法精选混合 C

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
2018.2.8-2018.12.31	-18.25%	1.13%	-10.95%	0.75%	-7.3%	0.38%
2019.1.1-2019.6.30	24.50%	1.61%	13.54%	0.76%	10.96%	0.85%
2019.7.1-2019.9.30	1.69%	0.92%	-1.25%	0.52%	2.94%	0.40%

## 第十三部分：费用概览

## 一、与基金运作有关的费用

### 1、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、证券账户的开户费、账户维护费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、基金投资港股通标的股票的合理费用；
- 12、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### 3、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (1) 基金管理人的管理费

基金管理费按基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### (2) 基金托管人的托管费

基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### （3）销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.5%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金份额销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4—12 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 4、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

## 5、基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 二、与基金销售有关的费用

### 1、申购费率

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金 C 类基金份额在申购时不收取申购费用。

(1) 本基金对申购设置级差费率。投资者如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

申购金额	A 类基金份额申购费率	C 类基金份额的申购费
M<50 万	1.50%	0%
50 万≤M<100 万	1.00%	0%
M≥100 万	1000 元/笔	0

(2) 本基金的申购费用由申购基金份额的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

## 2、赎回费率

持有 基金时间 (T)	A 类基金份额赎回费率	C 类基金份额的赎回费率
T < 7 天	1.50%	1.5%
7 天 ≤ T < 30 天	0.75%	0.50%
30 天 ≤ T < 2 年	0.50%	0%
2 年 ≤ T	0%	0%

(注：赎回份额持有时间的计算，从该份额初始登记日开始计算；1 年指 365 天)

### (1) A 类基金份额

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期等于或长于 7 日但少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期等于或长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期等于或长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人收取的赎回费总额的 25% 计入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要

的手续费。以上每个月按照 30 日计算。未计入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

## （2）C 类基金份额

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期等于或长于 7 日但少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和基金销售服务费率。

5、当本基金各类份额发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

## 第十四部分：对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，对“重要提示”进行了更新；
- 2、在“绪言”部分，对“绪言”进行了更新；
- 3、在“释义”部分，新增了“基金产品资料概要”的释义，对“《信息披露办法》”和“指定媒介”的释义进行了更新；
- 4、在“基金管理人”部分，对“基金管理人的职责”、“基金管理人的内部控制制度”等相关信息进行了更新；
- 5、在“基金托管人”部分，对“基金托管人概况”进行了更新；
- 6、在“相关服务机构”部分，对“基金份额发售机构”进行了更新；
- 7、在“基金的投资”部分，对“基金投资组合报告”、“基金业绩”等信息进行了更新；
- 8、在“其他应披露事项”部分，对“其他应披露事项”进行了更新；



9、根据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，同时根据《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同（2019 年 10 月修订）》和《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议（2019 年 10 月修订）》对招募说明书的部分表述进行了更新。

东方阿尔法基金管理有限公司

2019 年 10 月 25 日