

东方阿尔法基金管理有限公司关于修改旗下公募基金基金合同及托管协议的公告

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》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》和《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规和各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，同时为确保相关基金估值的合理性和公允性，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，并向中国证监会备案，东方阿尔法基金管理有限公司（以下简称“我司”）对旗下3只公募基金的基金合同和托管协议进行了修订。根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，本次修改无需召开基金份额持有人大会审议。修订将自2020年12月29日起正式生效。现将基金合同的具体修订内容公告如下：

一、本次修订涉及投资范围中新增存托凭证、新增侧袋机制条款的具体基金名称及修订内容如下：

序号 基金名称

- 1 东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
- 2 东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金
- 3 东方阿尔法优势产业混合型发起式证券投资基金

修订的内容：

1、新增存托凭证的相关内容：

补充投资存托凭证的风险揭示；在投资范围中增加存托凭证；在投资策略中增加存托凭证投资策略；在投资限制中增加存托凭证投资比例限制；在估值方法中增加存托凭证估值核算方法。同时，在基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。

2、新增侧袋机制的相关内容：

增加了侧袋机制相关释义、实施侧袋机制期间基金的申购与赎回安排、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定、侧袋机制的实施和投资运作安排、实施侧袋机制期间的基金资产估值核算方法、实施侧袋机制期间的基金费用处理、实施侧袋机制期间的收益分配和实施侧袋机制期间的信息披露。

（具体请查看东方阿尔法基金公司官网刊登的基金合同及托管协议修改对照表）

二、本次修订涉及估值方法中“汇率”计算方法调整的具体基金名称及修订内容如下：

序号 基金名称

- 1 东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
- 2 东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金

原合同表述 修订后表述

本基金外币资产价值计算中，涉及外币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准，先根据外币行情价格折算成保留两位小数的人民币估值价，再根据持仓量计算出市值。

如本基金投资股票市场交易互联互通机制允许买卖的境外证券

市场上市的股票，涉及相关货币对人民币汇率的，届时根据相关法律法规及监管机构的要求确定汇率来源，如法律法规及监管机构无相关规定，基金管理人与基金托管人协商一致后确定本基金的估值汇率来源。

三、本次修订涉及估值方法中“在发行时明确一定期限限售期的股票”计算方法调整的具体基金名称及修订内容如下：

序号 基金名称

1 东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

原合同表述 修订后表述

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

四、本次修订涉及“风险收益特征”表述调整的具体基金名称及修订内容如下：

序号 基金名称

1 东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

原合同表述 修订后表述

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，属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

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。

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。

五、更新基金管理人与基金托管人的基本信息。

上述具体请见东方阿尔法基金公司官网刊登的《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及托管协议修改对照表》、《东方阿尔法优选混合型发起式证券投资基金基金合同及托管协议修改对照表》和《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及托管协议修改对照表》。

本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法

律法规的规定，修订自 2020 年 12 月 29 日起生效。

投资者可通过我司网站 www.dfa66.com 查阅更新后的基金合同、托管协议等法律文件，或拨打客服热线 400-930-6677 咨询有关详情。

风险提示：基金管理人承诺依照诚实信用、勤勉尽职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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资者投资本基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，了解拟投资基金的风险收益特征，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者风险承受能力匹配。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

特此公告。

东方阿尔法基金管理有限公司

2020 年 12 月 29 日