

东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要

编制日期：2026年04月03日

送出日期：2026年04月07日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	东方阿尔法瑞利混合发起	基金代码	026993
基金简称 C	东方阿尔法瑞利混合发起 C	基金代码 C	026994
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
基金合同生效日	-	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	孙振波	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2019年07月01日

注：本基金的基金类型为混合型（偏股混合型）

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见《东方阿尔法瑞利混合型发起式证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

投资目标	在严格控制投资组合风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的稳健增值。
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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货、国债期货、股票期权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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地

	<p>调整投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：</p> <p>本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 60%-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%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权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。</p> <p>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。</p>
主要投资策略	<p>本基金将采用自上而下的分析方法，通过研究国内外宏观经济、国家政策，判断当下经济周期位置及未来发展趋势，并结合市场估值水平，确定投资范围内各类资产的投资比例，并适时动态调整，以最大限度降低投资组合风险、提高收益。在大类资产配置的基础上，本基金将采用“自下而上”的方式精选个股，结合定性和定量分析对公司投资价值进行评估，在控制风险的基础上创造持续超越业绩比较基准的收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证 800 指数收益率×60%+中证综合债（全价）指数收益率×20%+恒生指数收益率×20%</p>
风险收益特征	<p>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。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。</p>

注：不同的销售机构采用的评价方法不同，本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能存在不一致的风险，投资人在申购本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

暂无。

（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

暂无。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
认购费	-	-	C类份额无认购费
申购费(前收费)	-	-	C类份额无申购费
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	1.00%	
	30天≤N<180天	0.50%	
	N≥180天	0.00%	

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
销售服务费 C 类	0.30%	销售机构
审计费用	-	会计师事务所
信息披露费	-	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、公证费、诉讼费和仲裁费等费用；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货、期权交易费用；基金的银行汇划费用；基金相关的开户费用、账户维护费用；基金投资港股通标的股票的合理费用；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。	

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、本基金审计费用、信息披露费为年金额，由基金整体承担，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

3、对于通过基金管理人认购/申购 C 类基金份额收取的销售服务费，以及通过代销机构认购/申购并持续持有期限超过一年的 C 类基金份额收取的销售服务费采取先收后返模式，基金投资者实际收到的赎回款项或清算款项的金额可能与披露的基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额和清算资金以登记机构确认数据为准。

（三）基金运作综合费用测算

暂无。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金特有风险

（1）本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，股票市场的价格波动可能会导致基金净值发生剧烈波动的风险。

（2）本基金为发起式基金。本基金发起资金认购的本基金份额持有期限自基金合同生效日起满 3 年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有，届时发起资金提供方有可能赎回认购的本基金份额。另外，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合

同自动终止。因此，投资人将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

《基金合同》生效满三年后继续存续的，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当根据基金合同约定进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会。故存在着基金无法继续存续的风险。

(3) 本基金可投资股指期货，可能会出现风险包括基差风险、合约品种差异造成的风险、标的物风险、衍生品模型风险等。

(4) 本基金可投资国债期货，国债期货的风险主要包含市场风险、流动性风险、信用风险、合规性风险以及国债期货实物交割风险等。

(5) 本基金可投资股票期权，股票期权的风险包括市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险和信用风险。

(6) 本基金可投资资产支持证券，资产支持证券的风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等。

(7) 本基金可投资存托凭证，除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险等。

(8) 本基金除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险。

(9) 本基金可投资科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于退市风险、市场风险、流动性风险、投资集中的风险、系统性风险、股价波动风险、政策风险等。

(10) 本基金可投资北交所上市交易股票，将面临因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于上市公司经营风险、股价波动较大的风险、流动性较差的风险、退市风险、投资集中风险、转板风险、监管规则变化的风险等。

(11) 本基金可参与融资业务，融资业务除具有普通证券交易所具有的政策风险、市场风险、违约风险、操作风险等各种风险外，因融资业务的杠杆效应，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

(12) 基金投资者实际收到的赎回款项或清算款项的金额可能与按披露的基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额和清算资金以登记机构确认数据为准。

(13) 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。

2、开放式基金的共有风险：市场风险、管理风险、职业道德风险、流动性风险、合规风险、投资管理风险、实施侧袋机制对投资者的影响、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、基金管理人职责终止风险以及其他风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。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。基金投资者依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应友好协商解决；如经友好协商未能解决的，则任何一方应当按《基金合同》的约定提交仲裁。详情见本基金《基金合同》第二十一部分“争议的处理和适用的法律”。

五、其他资料查询方式

以下资料详见东方阿尔法基金官方网站【www.dfa66.com】【客服电话：400-930-6677】

- （1）基金合同、托管协议、招募说明书
- （2）定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- （3）基金份额净值
- （4）基金销售机构及联系方式
- （5）其他重要资料

六、其他情况说明

无