

东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十四日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
7.6 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.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
7.8 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贵金属投资明细.....	53
7.9 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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
11.1 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.....	64

§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东方鼎新灵活配置混合	
基金主代码	001196	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 21 日	
基金管理人	东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	218,691,564.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东方鼎新灵活配置混合 A	东方鼎新灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码:	001196	002192
报告期末下属分级基金的份额总额	218,689,977.23 份	1,587.66 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过发掘市场中的新机会进行投资，在有效控制投资风险、动态配置资产及主动管理的基础上，力争为投资人提供绝对回报。
投资策略	本基金通过对宏观经济因素、国家经济政策、市场估值因素、债券市场收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，判断经济周期所处阶段，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机，给出股票、债券和货币市场工具等资产的最佳配置比例并进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：年化收益率 8%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	洪渊
	联系电话	010-66295888	(010) 66105799
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95588

传真	010-66578700	(010) 66105798
注册地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	崔伟	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金半年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	东方鼎新灵活配置混合 A	东方鼎新灵活配置混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-14,206,982.89	23,318.93
本期利润	2,585,312.10	-116,184.10
加权平均基金份额本期利润	0.0056	-0.0306
本期加权平均净值利润率	0.53%	-2.88%
本期基金份额净值增长率	2.06%	1.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	7,580,412.50	52.29
期末可供分配基金份额利润	0.0347	0.0329
期末基金资产净值	236,495,541.04	1,714.00
期末基金份额净值	1.0814	1.0796
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	8.14%	3.43%

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期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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

东方鼎新灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	4.21%	0.48%	0.66%	0.00%	3.55%	0.48%
过去三个月	1.63%	0.40%	1.99%	0.00%	-0.36%	0.40%
过去六个月	2.06%	0.31%	3.97%	0.00%	-1.91%	0.31%
过去一年	2.67%	0.23%	7.99%	0.00%	-5.32%	0.23%

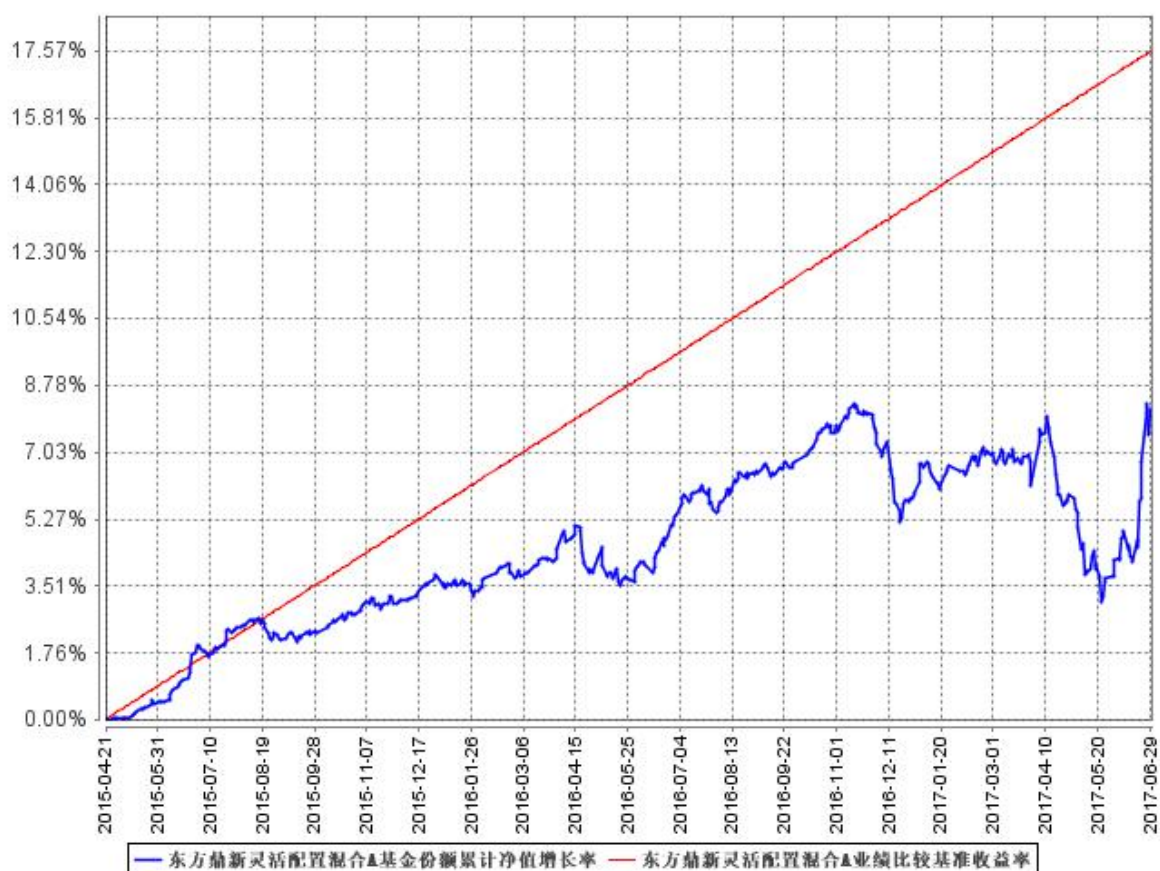
过去三年	8.14%	0.18%	17.57%	0.00%	-9.43%	0.18%
自基金合同生效起至今	8.14%	0.18%	17.57%	0.00%	-9.43%	0.18%

东方鼎新灵活配置混合 C

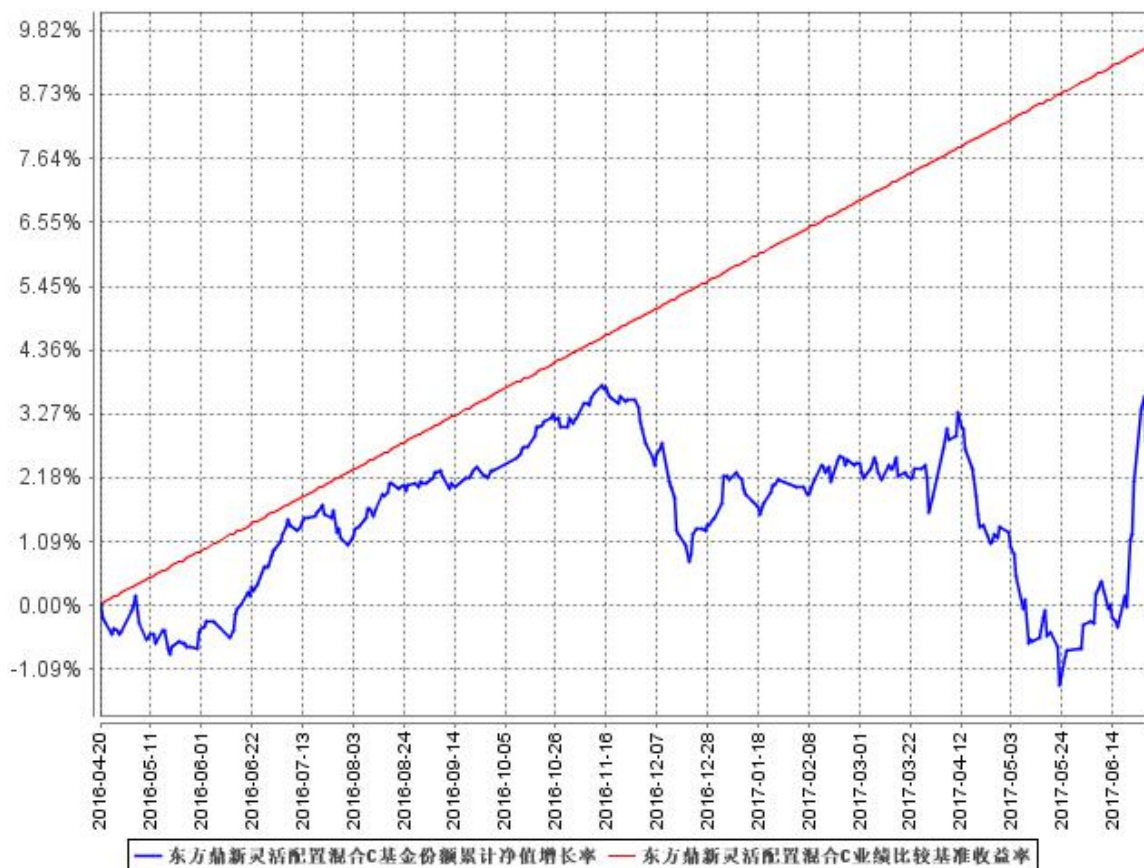
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.19%	0.48%	0.66%	0.00%	3.53%	0.48%
过去三个月	1.56%	0.40%	1.99%	0.00%	-0.43%	0.40%
过去六个月	1.92%	0.31%	3.97%	0.00%	-2.05%	0.31%
过去一年	2.57%	0.24%	7.99%	0.00%	-5.42%	0.24%
过去三年	3.43%	0.22%	9.57%	0.00%	-6.14%	0.22%
自基金合同生效起至今	3.43%	0.22%	9.57%	0.00%	-6.14%	0.22%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

东方鼎新灵活配置混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方鼎新灵活配置混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立。截至2017年6月30日，本公司注册资本2亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币12800万元，占公司注册资本的64%；河北省国有资产控股运营有限公司出资人民币5400万元，占公司注册资本27%；渤海国际信托股份有限公司出资人民币1800万元，占公司注册资本的9%。截至2017年6月30日，本公司管理44只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型开放式证券投资基金、东方成长收益平衡混合型开放式证券投资基金、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方稳定增利债券型证券投资基金、东方金元宝货币市场证券投资基金、东方大健康混合型证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方荣家保本混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方合家保本混合型证券投资基金、东方臻馨债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方臻悦纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘志刚 (先生)	本基金经理、量化投资部总经理、投资决策委员会委员	2015 年 5 月 21 日	-	9 年	吉林大学数量经济学博士，9 年证券从业经历。曾任工银瑞信基金管理有限公司产品开发部产品开发经理、安信基金管理有限责任公司市场部副总经理兼产品开发总监。2013 年 5 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任指数与量化投资部总经理、专户业务部总经理、产品开发部总经理、投资经理、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金（自 2015 年 12 月 3 日起转型为东方启明量化先锋混合型证券投资基金）基金经理。现任量化投资部总经理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员。
周薇(女士)	本基金经理	2015 年 4 月 21 日	-	8 年	中国人民银行研究生部金融学博士，8 年证券从业经历，曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012 年 7 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任固定收益部债券研究员、投资经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理。现任东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资

					基金基金经理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理、东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金。
朱晓栋 (先生)	本基金基金经理、权益投资部副总经理、投资决策委员会委员	2015 年 4 月 21 日	-	8 年	对外经济贸易大学经济学硕士，8 年证券从业经历。2009 年 12 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行业、建筑建材行业研究员，东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 7 月 31 日更名为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理。现任权益投资部副总经理、投资决策委员会委员、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方区域发展混合

					型证券投资基金基金经理、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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作基金资产，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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的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 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债券市场为熊市，整体收益率抬升。市场最主要的主导力量来自于监管机构。农历新年前及之后的 MLF 利率和逆回购利率上调打破了开年来的平静，国开活跃券因此上行了 40bp，冲击过后，市场有所缓和，但 2 月、3 月接连的 SLF、MLF 利率上调再次对市场造成了冲击，自 3 月底开始，银监会密集出台监管文件，金融“强监管”逐步落实，5 月同样延续了 4 月的监管趋严格局，MPA 考核重压时刻盘旋在银行上空，同时，央行整体上依然保持中性偏紧的政策基调，使得整体市场收益率出现了较大幅度上行，其中国开 10 年期从季初的 4.05% 一度冲高至 5 月中旬的 4.385%，并在高位盘亘 1 月之久；进入 6 月中旬，监管机构对 MPA 的自查考核期限推迟，银行提前准备半年末流动性，美联储加息靴子落地，而美债收益率保持在 2.1~2.2% 的区间，汇率保持稳定，中美利差有所脱钩，使得市场小牛氛围回归，10 年期国开债收益率回落至 4.2%。

报告期内，本基金主要操作是卖出，实现了投资风格转型。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 2.06%，业绩比较基准收益率为 3.97%，低于业绩比较基准 1.91%；本基金 C 类净值增长率为 1.92%，业绩比较基准收益率为 3.97%，低于业绩比较基准 2.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，就经济和 CPI 而言，经济或将保持平稳，达到 6.8% 的增速，CPI 则可能略高于上半年；

就央行而言，汇率政策有所变化，在内外投机和套利盘纷纷止损后，汇率保持升值，与美国有一定程度的脱钩，且将继续保持一段时间，央行控制资本流出的想法不会改变，国内 M2 增速及社融增速均有所回调，但仍然无法完全摆脱美元和美债市场的影响，大概率仍将实行中性偏紧的货币政策；资金利率方面，由于更多的资金投放和回收都通过公开市场操作进行，因此利率大体上取决于央行的政策，目前央行较为中性的政策基调预示着后续资金利率难以出现明显下行，但受制于企业盈利能力改善有限，央行会保持资金利率在一定区间，冲高的风险有限；

就债市供求而言，目前的配置价值依然较高，银行和保险或有一定需求；去杠杆进程依然会

继续，但边际影响在逐渐缩小，但在融资成本趋稳的情况下，下半年的供给或对市场构成一定的压力；

就海外而言，美联储或按照计划缩表和加息，下半年的美债可能会再次上行，美元因政治力量及其他经济体相对较强的经济走势和预期或维持较目前稍微偏弱的格局；

就整体估值而言，目前估值水平较年初有一定幅度上行，具有了一定的保护；就目前的利差而言，利率债期限利差压缩空间非常有限，但短端大幅下行比如说 50bp 的概率依然不大，信用债的期限利差虽较年初有所提高，但仍然处于较低水平；信用利差保护也依然非常窄。

综上，预计 3 季度债市依然保持目前的收益率水平，长端难以出现 30-50bp 的下行，我们对债市保持中性但较上半年稍乐观的看法。基金将保持目前的稍短久期，谨慎介入利率债波段，通过杠杆操作获取利差收入，在市场面临较大事件性和流动性冲击时，置换部分短端利率债仓位。

感谢基金持有人对本基金的信任和支持，我们将本着勤勉尽责的精神，秉承“诚信是基、回报为金”的原则，力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会公告【2008】38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，本基金管理人成立了东方基金管理有限责任公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称“停牌有价证券”）时，

根据估值委员会要求和运营部的估值方案,负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当,对估值方法有失公允性的“停牌有价证券”,建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

4. 风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时,建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末,公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金)。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》,并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值(适用非货币基金)。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定,结合本基金实际运作情况,本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金的管理人——东方基金管理有限公司在东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东方基金管理有限公司编制和披露的东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	13,681,668.55	9,172,956.61
结算备付金		229,768.94	245,129.30
存出保证金		36,913.09	16,528.36
交易性金融资产	6.4.7.2	223,366,811.44	535,727,745.62
其中：股票投资		223,366,811.44	84,429,788.62
基金投资		-	-
债券投资		-	451,297,957.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		241,753.21	19,240.49
应收利息	6.4.7.5	6,379.95	10,454,709.27
应收股利		-	-
应收申购款		999.21	198.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		237,564,294.39	555,636,508.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		113.39	11,000.51
应付管理人报酬		212,461.66	330,590.87
应付托管费		75,879.18	118,068.15
应付销售服务费		0.30	1,412.43
应付交易费用	6.4.7.7	440,147.53	149,223.48

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	338,437.29	330,000.36
负债合计		1,067,039.35	940,295.80
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	218,691,564.89	523,519,285.56
未分配利润	6.4.7.10	17,805,690.15	31,176,927.03
所有者权益合计		236,497,255.04	554,696,212.59
负债和所有者权益总计		237,564,294.39	555,636,508.39

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0814 元，C 类基金份额净值 1.0796 元；基金份额总额 218,691,564.89 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 218,689,977.23 份，C 类基金份额总额 1,587.66 份。

6.2 利润表

会计主体：东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		5,747,222.04	16,467,833.21
1.利息收入		8,534,608.95	14,094,631.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	69,463.09	2,967,595.53
债券利息收入		7,647,480.11	7,395,276.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		817,665.75	3,731,759.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-19,440,467.05	2,067,367.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,850,727.97	948,675.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-11,732,595.61	1,008,694.84
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,142,856.53	109,997.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,652,791.96	-1,596,632.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	288.18	1,902,466.31
减：二、费用		3,278,094.04	6,429,781.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,717,828.57	4,677,202.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	613,510.28	1,169,300.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,994.20	0.89
4. 交易费用	6.4.7.19	684,465.55	186,755.64
5. 利息支出		39,043.28	167,774.17
其中：卖出回购金融资产支出		39,043.28	167,774.17
6. 其他费用	6.4.7.20	217,252.16	228,748.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,469,128.00	10,038,051.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,469,128.00	10,038,051.57

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	523,519,285.56	31,176,927.03	554,696,212.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,469,128.00	2,469,128.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-304,827,720.67	-15,840,364.88	-320,668,085.55
其中：1.基金申购款	58,592.02	3,713.81	62,305.83
2.基金赎回款	-304,886,312.69	-15,844,078.69	-320,730,391.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减	-	-	-

殊普通合伙)“瑞华验字[2015]第 01300032 号”验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,285,314,816.72 份基金单位,其中认购资金利息折合 54,006.40 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金自 2016 年 4 月 20 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额,此前已持有本基金份额的投资人,其基金账户中保留的本基金份额余额为 A 类基金份额。A 类基金份额指在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用,从本类别基金资产中不计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额;C 类基金份额指从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。两级基金份额分别设置基金代码,分别计算基金份额净值并单独公告。详情请见本公司于 2016 年 4 月 18 日发布的《关于东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(含中小企业私募债券)、央行票据、中期票据、短期融资券、债券回购、资产支持证券、银行存款等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相关规定)。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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号—半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84号《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年04月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年09月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》财税[2015]101号及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳营业税和企业所得税。
3. 基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的

个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	13,681,668.55
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	13,681,668.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	214,855,316.93	223,366,811.44	8,511,494.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	214,855,316.93	223,366,811.44	8,511,494.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	6,271.95
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	93.06
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	14.94
合计	6,379.95

注：其他为应收交易保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	425,559.35
银行间市场应付交易费用	14,588.18
合计	440,147.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	338,437.29
合计	338,437.29

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东方鼎新灵活配置混合 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	518,815,800.36	518,815,800.36
本期申购	56,711.96	56,711.96
本期赎回(以“-”号填列)	-300,182,535.09	-300,182,535.09
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	218,689,977.23	218,689,977.23

金额单位：人民币元

东方鼎新灵活配置混合 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,703,485.20	4,703,485.20
本期申购	1,880.06	1,880.06
本期赎回(以“-”号填列)	-4,703,777.60	-4,703,777.60
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,587.66	1,587.66

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东方鼎新灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,646,247.03	-4,748,140.86	30,898,106.17
本期利润	-14,206,982.89	16,792,294.99	2,585,312.10
本期基金份额交易产生的变动数	-13,858,851.64	-1,819,002.82	-15,677,854.46
其中：基金申购款	3,439.14	149.57	3,588.71
基金赎回款	-13,862,290.78	-1,819,152.39	-15,681,443.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,580,412.50	10,225,151.31	17,805,563.81

单位：人民币元

东方鼎新灵活配置混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	321,946.90	-43,126.04	278,820.86
本期利润	23,318.93	-139,503.03	-116,184.10
本期基金份额交易产生的变动数	-345,213.54	182,703.12	-162,510.42
其中：基金申购款	127.66	-2.56	125.10
基金赎回款	-345,341.20	182,705.68	-162,635.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52.29	74.05	126.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	66,716.04
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,503.52
其他	243.53
合计	69,463.09

注：其他包括基金申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	177,918,177.55
减：卖出股票成本总额	186,768,905.52
买卖股票差价收入	-8,850,727.97

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-11,732,595.61
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-11,732,595.61

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	552,321,157.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	545,909,672.33
减：应收利息总额	18,144,080.34
买卖债券差价收入	-11,732,595.61

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,142,856.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,142,856.53

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	16,652,791.96
——股票投资	10,849,576.63
——债券投资	5,803,215.33
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	16,652,791.96

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	248.14
基金转换费收入	0.05
其他	39.99
合计	288.18

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	678,606.55

银行间市场交易费用	5,859.00
合计	684,465.55

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
账户维护费用	18,600.00
银行费用	10,214.87
合计	217,252.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的佣金费用，无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,717,828.57	4,677,202.07
其中：支付销售机构的客户维护费	2,192.26	5,530.71

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.0% 的年费率计算，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	613,510.28	1,169,300.43

注：①计提标准：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，具体计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方鼎新灵活配置混合 A	东方鼎新灵活配置混合 C	合计
东方基金管理有限责任公司	-	5,990.90	5,990.90
合计	-	5,990.90	5,990.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方鼎新灵活配置混合 A	东方鼎新灵活配置混合 C	合计
东方基金管理有限责任公司	-	0.89	0.89
合计	-	0.89	0.89

注：①计提标准：本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	13,681,668.55	66,716.04	6,058,719.02	108,906.58

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603933	睿能科技	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 29 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601727	上海电气	2017 年 6 月 22 日	重大事项	7.57	2017 年 7 月 3 日	7.54	71,800	496,111.00	543,526.00	-
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大事项	10.57	-	-	35,700	377,536.00	377,349.00	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大事项	6.21	-	-	14,200	89,318.00	88,182.00	-
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大事项	22.29	-	-	3,000	59,940.00	66,870.00	-
600795	国电	2017	重	3.60	-	-	18,200	61,698.00	65,520.00	-

	电力	年 6 月 5 日	大事项							
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大事项目	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	5,900	31,624.00	31,565.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和监察稽核部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的股票市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业

市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	0.00	41,911,213.20
AAA 以下	0.00	380,715,039.50
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	422,626,252.70

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.3 流动性风险

所谓流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考

察。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和负债不计息，持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,681,668.55	-	-	-	13,681,668.55
结算备付金	229,768.94	-	-	-	229,768.94
存出保证金	36,913.09	-	-	-	36,913.09
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	223,366,811.44	223,366,811.44
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	241,753.21	241,753.21
应收利息	-	-	-	6,379.95	6,379.95
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	999.21	999.21
资产总计	13,948,350.58	-	-	223,615,943.81	237,564,294.39
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	113.39	113.39
应付管理人报酬	-	-	-	212,461.66	212,461.66
应付托管费	-	-	-	75,879.18	75,879.18
应付交易费用	-	-	-	440,147.53	440,147.53
应付销售服务费	-	-	-	0.30	0.30
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	338,437.29	338,437.29
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	1,067,039.35	1,067,039.35
利率敏感度缺口	13,948,350.58	-	-	-222,548,904.46	236,497,255.04
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,172,956.61	-	-	-	9,172,956.61
结算备付金	245,129.30	-	-	-	245,129.30
存出保证金	16,528.36	-	-	-	16,528.36
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	84,429,788.62	84,429,788.62
交易性金融资产-债券投资	49,079,704.30	350,629,874.40	51,588,378.30	-	451,297,957.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	19,240.49	19,240.49
应收利息	-	-	-	10,454,709.27	10,454,709.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	198.74	198.74
资产总计	58,514,318.57	350,629,874.40	51,588,378.30	94,903,937.12	555,636,508.39
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,000.51	11,000.51
应付管理人报酬	-	-	-	330,590.87	330,590.87
应付托管费	-	-	-	118,068.15	118,068.15
应付交易费用	-	-	-	149,223.48	149,223.48
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	331,412.79	331,412.79
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	940,295.80	940,295.80
利率敏感度缺口	58,514,318.57	350,629,874.40	51,588,378.30	93,963,641.32	554,696,212.59

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

	影响金额（单位：人民币元）	
	本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
市场利率下调 0.25%	0.00	1,808,462.92
市场利率上调 0.25%	0.00	-1,733,312.93

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	223,366,811.44	94.45	84,429,788.62	15.22
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	451,297,957.00	81.36
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	223,366,811.44	94.45	535,727,745.62	96.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动	
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步	
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-11,661,097.54	-3,599,849.79
	沪深 300 指数上涨 5%	11,661,097.54	3,599,849.79

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 1,265,841.36 元，占基金资产净值比例为 0.54%；上年度末本基金风险价值为 1,289,160.86 元，占基金资产净值比例为 0.23%。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止本半年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	223,366,811.44	94.02
	其中：股票	223,366,811.44	94.02
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,911,437.49	5.86
7	其他各项资产	286,045.46	0.12
8	合计	237,564,294.39	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	557,978.00	0.24
B	采矿业	6,582,702.00	2.78
C	制造业	79,670,419.19	33.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,413,522.00	2.29
E	建筑业	10,838,657.90	4.58
F	批发和零售业	5,006,230.00	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	5,846,115.00	2.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,020,902.50	3.81
J	金融业	80,473,658.55	34.03
K	房地产业	12,439,781.30	5.26
L	租赁和商务服务业	1,764,984.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,931,179.00	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	459,000.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	2,679,720.00	1.13
S	综合	681,962.00	0.29
	合计	223,366,811.44	94.45

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	243,900	12,099,879.00	5.12
2	600036	招商银行	230,800	5,518,428.00	2.33
3	600519	贵州茅台	11,200	5,284,720.00	2.23
4	601166	兴业银行	280,600	4,730,916.00	2.00
5	000651	格力电器	107,600	4,429,892.00	1.87
6	000333	美的集团	101,800	4,381,472.00	1.85
7	600016	民生银行	529,200	4,350,024.00	1.84
8	000002	万科A	153,200	3,825,404.00	1.62
9	601328	交通银行	618,600	3,810,576.00	1.61
10	601939	建设银行	541,200	3,328,380.00	1.41
11	601668	中国建筑	337,600	3,267,968.00	1.38
12	600000	浦发银行	251,520	3,181,728.00	1.35
13	601288	农业银行	860,900	3,030,368.00	1.28
14	600030	中信证券	176,000	2,995,520.00	1.27
15	600887	伊利股份	136,000	2,936,240.00	1.24
16	600837	海通证券	182,100	2,704,185.00	1.14
17	002415	海康威视	82,600	2,667,980.00	1.13
18	601169	北京银行	273,900	2,511,663.00	1.06
19	600104	上汽集团	78,900	2,449,845.00	1.04
20	601601	中国太保	70,700	2,394,609.00	1.01
21	000858	五粮液	42,400	2,359,984.00	1.00
22	600900	长江电力	147,600	2,270,088.00	0.96
23	601766	中国中车	219,100	2,217,292.00	0.94
24	000725	京东方A	531,900	2,212,704.00	0.94
25	601211	国泰君安	101,500	2,081,765.00	0.88
26	600276	恒瑞医药	37,720	1,908,254.80	0.81
27	000001	平安银行	192,200	1,804,758.00	0.76
28	601988	中国银行	471,800	1,745,660.00	0.74

29	600048	保利地产	159,100	1,586,227.00	0.67
30	601390	中国中铁	167,800	1,454,826.00	0.62
31	601818	光大银行	358,600	1,452,330.00	0.61
32	600518	康美药业	66,400	1,443,536.00	0.61
33	600028	中国石化	235,400	1,395,922.00	0.59
34	600019	宝钢股份	197,800	1,327,238.00	0.56
35	600015	华夏银行	143,400	1,322,148.00	0.56
36	601688	华泰证券	73,500	1,315,650.00	0.56
37	000063	中兴通讯	53,200	1,262,968.00	0.53
38	601186	中国铁建	103,600	1,246,308.00	0.53
39	002450	康得新	55,200	1,243,104.00	0.53
40	002304	洋河股份	13,500	1,171,935.00	0.50
41	000776	广发证券	66,100	1,140,225.00	0.48
42	001979	招商蛇口	53,000	1,132,080.00	0.48
43	601006	大秦铁路	133,800	1,122,582.00	0.47
44	600029	南方航空	127,300	1,107,510.00	0.47
45	000538	云南白药	11,600	1,088,660.00	0.46
46	600703	三安光电	54,700	1,077,590.00	0.46
47	600690	青岛海尔	68,200	1,026,410.00	0.43
48	600585	海螺水泥	44,800	1,018,304.00	0.43
49	601628	中国人寿	37,500	1,011,750.00	0.43
50	600958	东方证券	69,600	968,136.00	0.41
51	601336	新华保险	18,700	961,180.00	0.41
52	002024	苏宁云商	83,300	937,125.00	0.40
53	601555	东吴证券	82,000	920,860.00	0.39
54	601009	南京银行	81,800	916,978.00	0.39
55	601901	方正证券	92,200	915,546.00	0.39
56	600340	华夏幸福	26,500	889,870.00	0.38
57	600999	招商证券	51,200	881,664.00	0.37
58	600309	万华化学	30,540	874,665.60	0.37
59	002230	科大讯飞	21,700	865,830.00	0.37
60	600089	特变电工	83,800	865,654.00	0.37
61	600741	华域汽车	35,200	853,248.00	0.36
62	002142	宁波银行	43,600	841,480.00	0.36
63	601857	中国石油	109,400	841,286.00	0.36
64	000423	东阿阿胶	11,700	841,113.00	0.36
65	600705	中航资本	147,787	834,996.55	0.35
66	601669	中国电建	103,400	818,928.00	0.35
67	601985	中国核电	104,500	816,145.00	0.35

68	600660	福耀玻璃	31,300	815,052.00	0.34
69	600009	上海机场	21,600	805,896.00	0.34
70	601899	紫金矿业	232,000	795,760.00	0.34
71	000568	泸州老窖	15,700	794,106.00	0.34
72	002241	歌尔股份	41,000	790,480.00	0.33
73	300070	碧水源	42,300	788,895.00	0.33
74	601377	兴业证券	105,400	783,122.00	0.33
75	002456	欧菲光	42,350	769,499.50	0.33
76	000166	申万宏源	134,600	753,760.00	0.32
77	601607	上海医药	25,900	747,992.00	0.32
78	300072	三聚环保	20,000	741,000.00	0.31
79	002236	大华股份	32,400	739,044.00	0.31
80	000069	华侨城 A	73,400	738,404.00	0.31
81	002736	国信证券	55,000	728,750.00	0.31
82	002466	天齐锂业	13,300	722,855.00	0.31
83	000338	潍柴动力	54,100	714,120.00	0.30
84	000783	长江证券	74,300	703,621.00	0.30
85	600031	三一重工	85,600	695,928.00	0.29
86	600068	葛洲坝	61,800	694,632.00	0.29
87	600196	复星医药	22,400	694,176.00	0.29
88	600886	国投电力	87,600	692,040.00	0.29
89	300059	东方财富	57,500	691,150.00	0.29
90	601600	中国铝业	148,300	670,316.00	0.28
91	600010	包钢股份	305,640	669,351.60	0.28
92	002008	大族激光	19,100	661,624.00	0.28
93	601888	中国国旅	21,800	657,052.00	0.28
94	601788	光大证券	43,900	655,427.00	0.28
95	600066	宇通客车	29,600	650,312.00	0.27
96	600637	东方明珠	29,600	641,432.00	0.27
97	600606	绿地控股	81,595	638,072.90	0.27
98	000625	长安汽车	43,600	628,712.00	0.27
99	601099	太平洋	153,700	617,874.00	0.26
100	000839	中信国安	61,300	612,387.00	0.26
101	601933	永辉超市	85,600	606,048.00	0.26
102	601618	中国中冶	120,600	604,206.00	0.26
103	600535	天士力	14,500	602,330.00	0.25
104	002594	比亚迪	12,040	601,398.00	0.25
105	600893	航发动力	21,700	592,410.00	0.25

106	000413	东旭光电	52,400	587,928.00	0.25
107	600522	中天科技	48,000	578,400.00	0.24
108	600383	金地集团	50,400	578,088.00	0.24
109	600406	国电南瑞	32,600	575,390.00	0.24
110	000768	中航飞机	31,000	571,640.00	0.24
111	300124	汇川技术	22,300	569,542.00	0.24
112	002673	西部证券	39,200	557,424.00	0.24
113	600109	国金证券	47,300	554,356.00	0.23
114	600816	安信信托	40,700	553,113.00	0.23
115	002475	立讯精密	18,900	552,636.00	0.23
116	600111	北方稀土	48,600	550,638.00	0.23
117	601800	中国交建	34,400	546,616.00	0.23
118	002202	金风科技	35,200	544,544.00	0.23
119	601727	上海电气	71,800	543,526.00	0.23
120	000963	华东医药	10,800	536,760.00	0.23
121	002739	万达电影	10,500	535,185.00	0.23
122	000895	双汇发展	22,100	524,875.00	0.22
123	600271	航天信息	25,000	516,000.00	0.22
124	600570	恒生电子	11,000	513,480.00	0.22
125	601018	宁波港	89,100	503,415.00	0.21
126	600023	浙能电力	92,000	502,320.00	0.21
127	600739	辽宁成大	27,300	492,219.00	0.21
128	600352	浙江龙盛	51,000	486,030.00	0.21
129	600177	雅戈尔	47,920	484,950.40	0.21
130	000728	国元证券	39,600	483,912.00	0.20
131	601992	金隅股份	74,700	483,309.00	0.20
132	600674	川投能源	49,200	483,144.00	0.20
133	600547	山东黄金	16,600	480,238.00	0.20
134	601225	陕西煤业	67,400	476,518.00	0.20
135	300024	机器人	24,400	475,800.00	0.20
136	000623	吉林敖东	20,720	474,280.80	0.20
137	002508	老板电器	10,600	460,888.00	0.19
138	600018	上港集团	72,600	460,284.00	0.19
139	002044	美年健康	27,000	459,000.00	0.19
140	002065	东华软件	21,000	457,590.00	0.19
141	000793	华闻传媒	45,100	456,412.00	0.19
142	600115	东方航空	65,900	448,120.00	0.19

143	600415	小商品城	61,000	441,640.00	0.19
144	000157	中联重科	98,300	441,367.00	0.19
145	603993	洛阳钼业	87,100	440,726.00	0.19
146	000540	中天金融	63,100	438,545.00	0.19
147	002007	华兰生物	12,000	438,000.00	0.19
148	601111	中国国航	44,800	436,800.00	0.18
149	600208	新湖中宝	96,100	432,450.00	0.18
150	600804	鹏博士	24,300	431,325.00	0.18
151	601998	中信银行	68,500	430,865.00	0.18
152	601198	东兴证券	24,800	427,552.00	0.18
153	600085	同仁堂	12,200	426,512.00	0.18
154	600820	隧道股份	42,100	425,210.00	0.18
155	002465	海格通信	38,300	411,342.00	0.17
156	600436	片仔癀	6,700	408,968.00	0.17
157	600153	建发股份	31,600	408,588.00	0.17
158	000826	启迪桑德	11,500	403,880.00	0.17
159	000630	铜陵有色	141,500	401,860.00	0.17
160	002310	东方园林	23,900	399,608.00	0.17
161	600157	永泰能源	111,300	397,341.00	0.17
162	000709	河钢股份	94,800	397,212.00	0.17
163	600362	江西铜业	23,200	391,152.00	0.17
164	000009	中国宝安	48,200	389,938.00	0.16
165	300017	网宿科技	32,300	389,861.00	0.16
166	002081	金螳螂	35,400	388,692.00	0.16
167	000060	中金岭南	34,700	388,640.00	0.16
168	600663	陆家嘴	16,400	387,696.00	0.16
169	000876	新希望	47,100	387,162.00	0.16
170	600489	中金黄金	38,500	386,155.00	0.16
171	600061	国投安信	24,800	385,640.00	0.16
172	002146	荣盛发展	38,900	383,943.00	0.16
173	600170	上海建工	99,545	380,261.90	0.16
174	002027	分众传媒	27,600	379,776.00	0.16
175	601229	上海银行	14,800	377,992.00	0.16
176	600959	江苏有线	35,700	377,349.00	0.16
177	601155	新城控股	20,300	376,362.00	0.16
178	601216	君正集团	76,200	372,618.00	0.16
179	002074	国轩高科	11,700	369,135.00	0.16
180	600118	中国卫星	13,200	367,488.00	0.16

181	601633	长城汽车	27,600	366,804.00	0.16
182	600332	白云山	12,500	363,000.00	0.15
183	000750	国海证券	65,800	361,900.00	0.15
184	600297	广汇汽车	48,050	361,816.50	0.15
185	002500	山西证券	37,700	361,166.00	0.15
186	600369	西南证券	63,200	354,552.00	0.15
187	300315	掌趣科技	43,400	354,144.00	0.15
188	000425	徐工机械	94,300	353,625.00	0.15
189	600008	首创股份	53,700	353,346.00	0.15
190	600150	中国船舶	15,400	352,198.00	0.15
191	600682	南京新百	9,400	346,860.00	0.15
192	601333	广深铁路	76,500	345,780.00	0.15
193	300144	宋城演艺	16,200	338,094.00	0.14
194	000559	万向钱潮	30,700	326,034.00	0.14
195	000792	盐湖股份	31,150	325,517.50	0.14
196	600688	上海石化	48,900	323,229.00	0.14
197	002195	二三四五	44,100	315,315.00	0.13
198	000402	金融街	26,800	314,096.00	0.13
199	601117	中国化学	44,300	309,657.00	0.13
200	000983	西山煤电	35,300	309,581.00	0.13
201	600583	海油工程	49,500	308,880.00	0.13
202	300027	华谊兄弟	37,500	303,375.00	0.13
203	600718	东软集团	19,400	301,670.00	0.13
204	600649	城投控股	28,500	299,535.00	0.13
205	300033	同花顺	4,800	298,608.00	0.13
206	002411	必康股份	10,300	297,876.00	0.13
207	600498	烽火通信	11,700	296,595.00	0.13
208	600895	张江高科	17,300	292,024.00	0.12
209	600256	广汇能源	70,200	290,628.00	0.12
210	600827	百联股份	17,800	289,250.00	0.12
211	600373	中文传媒	12,300	289,173.00	0.12
212	002385	大北农	45,700	287,453.00	0.12
213	002183	怡亚通	33,200	286,516.00	0.12
214	000917	电广传媒	25,300	285,890.00	0.12
215	600704	物产中大	38,350	279,571.50	0.12
216	600074	保千里	21,800	279,258.00	0.12
217	600588	用友网络	16,300	279,056.00	0.12
218	000008	神州高铁	37,600	273,728.00	0.12
219	600060	海信电器	17,500	265,475.00	0.11

220	002470	金正大	35,100	264,303.00	0.11
221	600376	首开股份	23,000	263,120.00	0.11
222	600919	江苏银行	28,300	262,907.00	0.11
223	601718	际华集团	29,500	259,305.00	0.11
224	601866	中远海发	71,400	257,040.00	0.11
225	002558	巨人网络	5,400	249,588.00	0.11
226	000959	首钢股份	35,400	247,446.00	0.10
227	002602	世纪华通	6,800	246,568.00	0.10
228	002174	游族网络	7,700	244,552.00	0.10
229	002352	顺丰控股	4,600	244,536.00	0.10
230	600909	华安证券	24,200	244,178.00	0.10
231	601997	贵阳银行	15,400	243,474.00	0.10
232	600038	中直股份	5,200	238,004.00	0.10
233	002555	三七互娱	9,300	237,801.00	0.10
234	600977	中国电影	12,500	234,000.00	0.10
235	600021	上海电力	19,100	230,919.00	0.10
236	000977	浪潮信息	13,300	230,356.00	0.10
237	000627	天茂集团	28,500	230,280.00	0.10
238	600037	歌华有线	15,500	225,680.00	0.10
239	002152	广电运通	27,000	224,370.00	0.09
240	600737	中粮糖业	22,800	215,232.00	0.09
241	002714	牧原股份	7,800	212,316.00	0.09
242	000671	阳光城	36,100	210,102.00	0.09
243	600549	厦门钨业	9,600	206,304.00	0.09
244	002131	利欧股份	62,450	205,460.50	0.09
245	600372	中航电子	11,700	203,229.00	0.09
246	601118	海南橡胶	35,200	199,936.00	0.08
247	600685	中船防务	7,300	199,874.00	0.08
248	000738	航发控制	10,200	199,614.00	0.08
249	000718	苏宁环球	34,000	199,240.00	0.08
250	600482	中国动力	7,800	197,262.00	0.08
251	002292	奥飞娱乐	11,600	196,040.00	0.08
252	000938	紫光股份	3,200	195,584.00	0.08
253	600446	金证股份	11,100	195,138.00	0.08
254	601877	正泰电器	9,500	190,855.00	0.08
255	000156	华数传媒	12,700	189,357.00	0.08
256	601375	中原证券	17,800	179,068.00	0.08

257	601021	春秋航空	5,300	178,239.00	0.08
258	002424	贵州百灵	9,400	177,284.00	0.07
259	300133	华策影视	15,500	173,600.00	0.07
260	601881	中国银河	14,400	170,784.00	0.07
261	002153	石基信息	7,200	163,656.00	0.07
262	000961	中南建设	24,800	161,696.00	0.07
263	300251	光线传媒	19,600	160,524.00	0.07
264	601958	金铂股份	21,500	154,155.00	0.07
265	600233	圆通速递	7,600	148,884.00	0.06
266	002299	圣农发展	9,800	145,726.00	0.06
267	601163	三角轮胎	5,400	142,020.00	0.06
268	601611	中国核建	11,700	140,049.00	0.06
269	600871	石化油服	40,300	134,602.00	0.06
270	600926	杭州银行	8,900	132,165.00	0.06
271	601966	玲珑轮胎	5,400	121,122.00	0.05
272	603858	步长制药	1,600	114,624.00	0.05
273	000555	神州信息	6,500	108,550.00	0.05
274	600188	兖州煤业	8,500	104,040.00	0.04
275	603160	汇顶科技	1,000	100,300.00	0.04
276	601989	中国重工	14,200	88,182.00	0.04
277	002797	第一创业	8,600	79,206.00	0.03
278	601127	小康股份	3,900	77,805.00	0.03
279	002839	张家港行	4,400	69,168.00	0.03
280	002831	裕同科技	900	67,500.00	0.03
281	601088	中国神华	3,000	66,870.00	0.03
282	002841	视源股份	900	66,798.00	0.03
283	600795	国电电力	18,200	65,520.00	0.03
284	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
285	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
286	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
287	601919	中远海控	5,900	31,565.00	0.01
288	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
289	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
290	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
291	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
292	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
293	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300401	花园生物	12,890,550.88	2.32
2	002481	双塔食品	11,847,795.07	2.14
3	601318	中国平安	11,637,555.95	2.10
4	300404	博济医药	10,142,712.48	1.83
5	601939	建设银行	7,345,382.00	1.32
6	600525	长园集团	7,282,757.80	1.31
7	000959	首钢股份	7,108,977.66	1.28
8	600519	贵州茅台	5,610,881.00	1.01
9	002375	亚厦股份	5,489,031.80	0.99
10	600048	保利地产	5,431,701.60	0.98
11	600036	招商银行	5,158,893.00	0.93
12	002371	北方华创	4,735,953.58	0.85
13	601166	兴业银行	4,531,626.00	0.82
14	600016	民生银行	4,523,534.00	0.82
15	000971	高升控股	4,523,247.91	0.82
16	600266	北京城建	4,478,785.00	0.81
17	600268	国电南自	4,202,754.74	0.76
18	000651	格力电器	4,187,742.00	0.75
19	000333	美的集团	4,101,542.00	0.74
20	601328	交通银行	3,819,520.00	0.69

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000959	首钢股份	23,828,459.20	4.30
2	600754	锦江股份	14,999,906.83	2.70
3	002481	双塔食品	14,242,064.15	2.57

4	300401	花园生物	12,147,421.43	2.19
5	002375	亚厦股份	9,579,753.80	1.73
6	600579	天华院	8,829,372.00	1.59
7	600919	江苏银行	8,426,452.00	1.52
8	600525	长园集团	7,172,001.00	1.29
9	300404	博济医药	6,522,513.00	1.18
10	601126	四方股份	5,297,227.40	0.95
11	601988	中国银行	5,201,177.00	0.94
12	601818	光大银行	4,717,000.00	0.85
13	600266	北京城建	4,415,000.00	0.80
14	601939	建设银行	4,173,965.00	0.75
15	002567	唐人神	4,046,043.17	0.73
16	600048	保利地产	3,899,948.51	0.70
17	002371	北方华创	3,845,085.00	0.69
18	002303	美盈森	3,612,457.25	0.65
19	000971	高升控股	3,308,876.20	0.60
20	600268	国电南自	3,154,933.94	0.57

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	314,856,351.71
卖出股票收入（成交）总额	177,918,177.55

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.2 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,913.09
2	应收证券清算款	241,753.21
3	应收股利	-
4	应收利息	6,379.95
5	应收申购款	999.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	286,045.46

7.12.3 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债券。

7.12.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东方鼎新灵活配置混合 A	396	552,247.42	216,673,555.65	99.08%	2,016,421.58	0.92%
东方鼎新灵活配置混合 C	8	198.46	-	-	1,587.66	100.00%
合计	404	541,315.75	216,673,555.65	99.08%	2,018,009.24	0.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方鼎新灵活配置混合 A	9.64	0.0000%
	东方鼎新灵活配置混合 C	0.00	-
	合计	9.64	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方鼎新灵活配置混合 A	0
	东方鼎新灵活配置混合 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	东方鼎新灵活配置混合 A	0
	东方鼎新灵活配置混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方鼎新灵活配置混合 A	东方鼎新灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 4 月 21 日）基金份额总额	5,285,314,816.72	-
本报告期期初基金份额总额	518,815,800.36	4,703,485.20
本报告期基金总申购份额	56,711.96	1,880.06
减：本报告期基金总赎回份额	300,182,535.09	4,703,777.60
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	218,689,977.23	1,587.66

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期末，本基金提高了对大盘蓝筹股的配置。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券股	1	271,846,214.04	55.41%	253,170.40	55.41%	-

份有限公司						
中信证券股 份有限公司	2	216,312,390.48	44.09%	201,452.52	44.09%	-
广发证券股 份有限公司	1	2,492,987.00	0.51%	2,321.72	0.51%	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

（3）本报告期内本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	21,613,230.02	44.33%	51,900,000.00	95.23%	-	-
中信证券股份有限公司	27,143,290.54	55.67%	2,600,000.00	4.77%	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金年度最后一日净值公告	指定报刊、网站	2017年1月3日
2	东方基金管理有限责任公司关于设立成都分公司的公告	指定报刊、网站	2017年1月7日
3	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2017年1月13日
4	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有	指定报刊、网站	2017年1月17日

	的停牌股票估值方法的提示性公告		
5	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定报刊、网站	2017 年 1 月 20 日
6	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	指定报刊、网站	2017 年 1 月 21 日
7	关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构及开通定投和转换业务并参与其申（认）购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2017 年 2 月 13 日
8	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2017 年 3 月 8 日
9	东方基金管理有限责任公司关于基金经理暂停履行职务的公告	指定报刊、网站	2017 年 3 月 9 日
10	关于开展东方鼎新灵活配置混合、东方惠新灵活配置混合、东方新价值混合型证券投资基金直销中心赎回费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2017 年 3 月 11 日
11	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2017 年 3 月 17 日
12	关于增加济安财富为旗下基金销售渠道的公告	指定报刊、网站	2017 年 3 月 21 日
13	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度报告摘要	指定报刊、网站	2017 年 3 月 27 日
14	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度报告	网站	2017 年 3 月 27 日
15	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2017 年 3 月 31 日
16	关于开通武汉伯嘉销售定投业务的公告	指定报刊、网站	2017 年 4 月 11 日
17	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有	指定报刊、网站	2017 年 4 月 12 日

	的停牌股票估值方法的提示性公告		
18	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2017 年 4 月 21 日
19	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2017 年 4 月 25 日
20	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2017 年 5 月 5 日
21	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2017 年 5 月 11 日
22	东方基金关于旗下部分基金参加武汉伯嘉基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2017 年 5 月 16 日
23	关于增加金惠家为旗下基金销售渠道及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2017 年 5 月 20 日
24	关于提高东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额净值精度的公告	指定报刊、网站	2017 年 5 月 26 日
25	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定报刊、网站	2017 年 6 月 1 日
26	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017 年第 1 号）	指定报刊、网站	2017 年 6 月 2 日
27	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）	网站	2017 年 6 月 2 日
28	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2017 年 6 月 2 日
29	东方基金管理有限责任公司关于调整停牌股票(600643)估值方法的公告	指定报刊、网站	2017 年 6 月 23 日

30	关于调整停牌股票(300152)估值方法的公告	指定报刊、网站	2017 年 6 月 27 日
31	东方基金管理有限责任公司直销中心交易流程调整提示公告	网站	2017 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2017-1-1 至 2017-6-30	516,673,555.65	-	300,000,000.00	216,673,555.65	99.08%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.orient-fund.com）查阅。

12.3 查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

东方基金管理有限责任公司

2017 年 8 月 24 日