

# 东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：二〇一八年八月二十八日

## § 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 2018 年 8 月 27 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>9</b>
2.1 基金基本情况 .....	9
2.2 基金产品说明 .....	9
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	9
2.4 信息披露方式 .....	10
2.5 其他相关资料 .....	10
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>11</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	11
3.2 基金净值表现 .....	11
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 .....	11
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 .....	13
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	15
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验 .....	15
4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介 .....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	18
4.3.1 公平交易制度的执行情况 .....	18
4.3.2 异常交易行为的专项说明 .....	19
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 .....	19
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析 .....	19
4.4.2 报告期内基金的业绩表现 .....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	20

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	22
<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>23</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	23
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 .....	23
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 .....	23
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....</b>	<b>24</b>
6.1 资产负债表 .....	24
6.2 利润表.....	25
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
6.4 报表附注 .....	27
6.4.1 基金基本情况.....	27
6.4.2 会计报表的编制基础 .....	28
6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明.....	29
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 .....	29
6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 .....	29
6.4.5.1 会计政策变更的说明 .....	29
6.4.5.2 会计估计变更的说明 .....	29
6.4.5.3 差错更正的说明.....	29
6.4.6 税项.....	29
6.4.7 重要财务报表项目的说明.....	30
6.4.7.1 银行存款 .....	30
6.4.7.2 交易性金融资产 .....	30
6.4.7.3 衍生金融资产/负债 .....	31
6.4.7.4 买入返售金融资产 .....	31
6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额 .....	31
6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券.....	31
6.4.7.5 应收利息 .....	31
6.4.7.6 其他资产 .....	32
6.4.7.7 应付交易费用.....	32

6.4.7.8 其他负债 .....	32
6.4.7.9 实收基金 .....	32
6.4.7.10 未分配利润.....	33
6.4.7.11 存款利息收入.....	33
6.4.7.12 股票投资收益.....	34
6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入.....	34
6.4.7.13 债券投资收益.....	34
6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成.....	34
6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入.....	34
6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益.....	35
6.4.7.14 贵金属投资收益 .....	35
6.4.7.15 衍生工具收益.....	35
6.4.7.16 股利收益 .....	35
6.4.7.17 公允价值变动收益 .....	35
6.4.7.18 其他收入 .....	36
6.4.7.19 交易费用 .....	36
6.4.7.20 其他费用 .....	36
.....	37
6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明.....	36
6.4.8.1 或有事项 .....	36
6.4.8.2 资产负债表日后事项 .....	36
6.4.9 关联方关系 .....	37
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 .....	37
6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方.....	37
6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易.....	37
6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易 .....	37
6.4.10.1.1 股票交易.....	37
6.4.10.1.2 债券交易.....	37
6.4.10.1.3 债券回购交易.....	37
6.4.10.1.4 权证交易.....	37

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金.....	37
6.4.10.2 关联方报酬.....	37
6.4.10.2.1 基金管理费.....	37
6.4.10.2.2 基金托管费.....	38
6.4.10.2.3 销售服务费.....	38
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.....	39
6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况.....	39
6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况.....	39
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.....	39
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.....	40
6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况.....	40
.....	41
6.4.11 利润分配情况.....	40
6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券.....	40
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.....	40
6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票.....	40
6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券.....	42
6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购.....	42
6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购.....	42
6.4.13 金融工具风险及管理.....	42
6.4.13.1 风险管理政策和组织架构.....	42
6.4.13.2 信用风险.....	42
6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资.....	42
6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资.....	43
6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资.....	43
6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资.....	43
6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资.....	43
6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资.....	43
6.4.13.3 流动性风险.....	43
6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析.....	44

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析 .....	44
6.4.13.4 市场风险 .....	44
6.4.13.4.1 利率风险.....	44
6.4.13.4.1.1 利率风险敞口 .....	44
6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析.....	46
6.4.13.4.2 外汇风险.....	47
6.4.13.4.3 其他价格风险.....	47
6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口 .....	47
6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析.....	47
6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险.....	48
6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 .....	48
<b>§ 7 投资组合报告 .....</b>	<b>49</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
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 .....	58
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 .....	59
7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	60
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.....	60
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 .....	60
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 .....	61
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.....	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
7.12.1 .....	61

7.12.2	63
7.12.3 期末其他各项资产构成	63
7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细	63
7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明	63
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b>	<b>64</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b>	<b>66</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b>	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
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	67
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	69
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>70</b>
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	70
<b>§ 12 备查文件目录</b>	<b>71</b>
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71



## § 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	219,985,130.33 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	219,898,799.73 份	86,330.60 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。	
	东方鼎新灵活配置混合 A	东方鼎新灵活配置混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,450,267.12	1,852.81
本期利润	-28,349,053.86	-9,946.38
加权平均基金份额本期利润	-0.1289	-0.1482
本期加权平均净值利润率	-10.72%	-12.27%
本期基金份额净值增长率	-10.56%	-9.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	19,700,158.69	8,831.76
期末可供分配基金份额利润	0.0896	0.1023
期末基金资产净值	239,657,254.37	95,162.36
期末基金份额净值	1.0899	1.1023
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	8.99%	5.60%

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

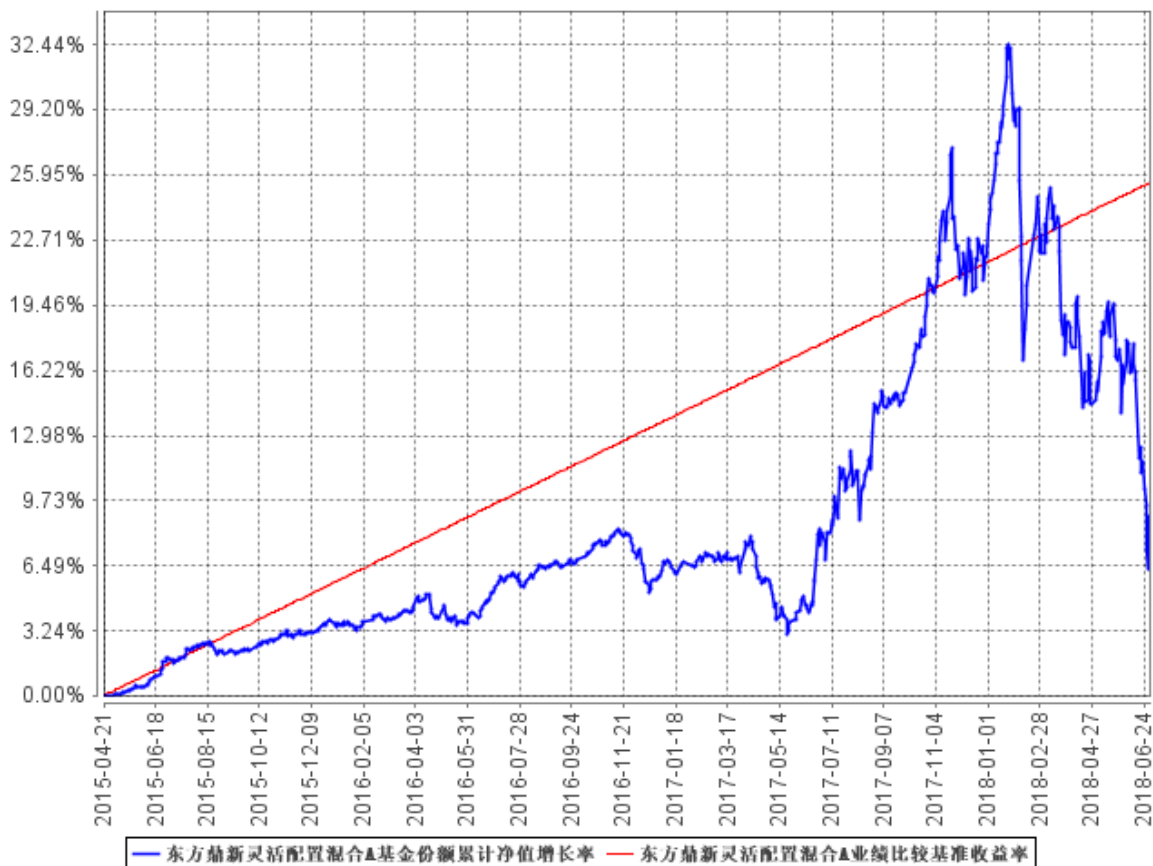
过去一个月	-6.39%	1.23%	0.66%	0.00%	-7.05%	1.23%
过去三个月	-8.15%	1.08%	1.99%	0.00%	-10.14%	1.08%
过去六个月	-10.56%	1.10%	3.97%	0.00%	-14.53%	1.10%
过去一年	0.79%	0.91%	8.00%	0.00%	-7.21%	0.91%
过去三年	6.91%	0.55%	24.01%	0.00%	-17.10%	0.55%
自基金合同生效起至今	8.99%	0.53%	25.56%	0.00%	-16.57%	0.53%

东方鼎新灵活配置混合 C

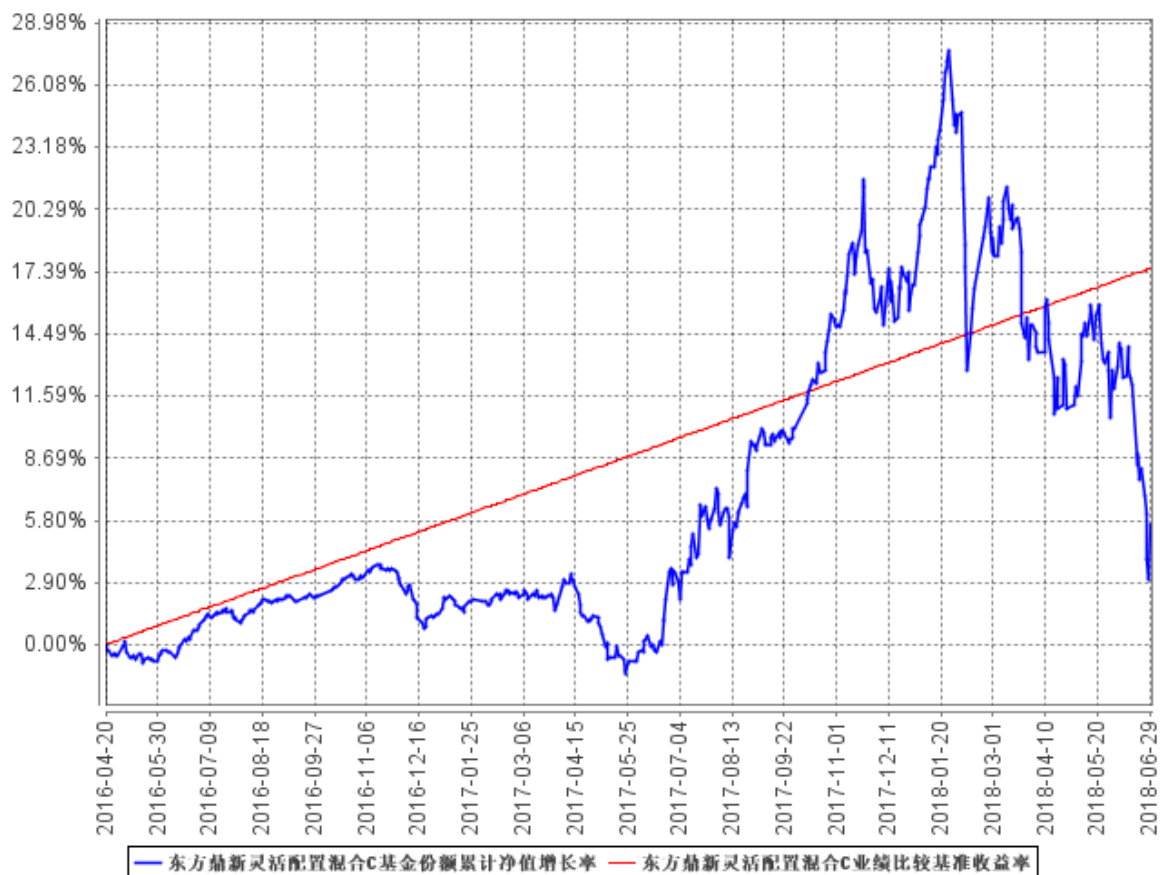
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.36%	1.23%	0.66%	0.00%	-7.02%	1.23%
过去三个月	-8.08%	1.08%	1.99%	0.00%	-10.07%	1.08%
过去六个月	-9.54%	1.10%	3.97%	0.00%	-13.51%	1.10%
过去一年	2.10%	0.91%	8.00%	0.00%	-5.90%	0.91%
过去三年	5.60%	0.64%	17.56%	0.00%	-11.96%	0.64%
自基金合同生效起至今	5.60%	0.64%	17.56%	0.00%	-11.96%	0.64%

### 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2018年6月30日，本公司注册资本3亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币19200万元，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8100万元，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2700万元，占公司注册资本的9%。截至2018年6月30日，本公司管理43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、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、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、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方人工智能主题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、东方合家保本混合型证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
周薇（女士）	本基金基金经理	2015 年 4 月 21 日	2018 年 1 月 24 日	9 年	中国人民银行研究生部金融学博士，9 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、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金（于 2017 年 8 月 23 日起转型为东方永润债券型证券投资基金）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、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理。现任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。
刘志刚（先生）	本基金基金经理、量化投资部总经理、投资决策委员会委员	2017 年 5 月 31 日	-	10 年	量化投资部总经理，投资决策委员会委员，吉林大学数量经济学博士，10 年基金从业经历。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



					<p>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、东方岳灵活配置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、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
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	-	9 年	<p>权益投资部副总经理，投资决策委员会委员，对外经济贸易大学经济学硕士，9 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 日转型为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理。</p>

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

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2018 上半年，我国宏观经济总体平稳，稳中向好。初步核算，上半年国内生产总值 418961 亿元，同比增长 6.8%。其中第一产业同比增长 3.2%，第二产业同比增长 6.1%；第三产业同比增长 7.6%。工农业稳定持续增长态势。农业供给侧结构性改革深化，棉花、大豆播种面积增加。畜牧业生产稳定。全国规模以上工业增加值同比增长 6.7%，增速比一季度稍有回落。全国服务型生产指数同比增长 8.0%，保持较快增速。居民收入稳定增长，就业形势稳中向好。由于中美贸易战的持续影响，全国货物进出口顺差收窄，货物进出口总额 141227 亿元，同比增长 7.9%。进出口相抵，顺差 9013 亿元，比上年同期收窄 26.7%。

上半年，中美贸易摩擦主导了整个 A 股市场的下跌，沪指从年初的 3307 点下跌到季末的 2847 点，区间跌幅近 14%。中美贸易摩擦不仅影响到全球的经济，还引发全球金融市场的动荡，特别是国内 A 股市场，投资者在中美贸易摩擦升级下悲观情绪得到进一步释放，使得国内股市一

路下挫。加之资管新规的出台，在一定程度上引发了市场的回落。行业方面，上半年只有休闲服务、医药生物和食品饮料三个板块实现正收益，其余板块均有大幅回落，其中申万一级综合行业下跌超过三成。报告期内，本基金通过自上而下的行业配置与自下而上的个股精选相结合的研究方法进行股票筛选，重点配置估值合理、业绩表现稳健的价值蓝筹以及白马成长股，同时积极参与新股网下申购，获取相对稳定的增强收益，但在市场系统性下跌的形势下未能实现较好的收益。

报告期内，本基金的投资组合满足基金合同的有关约定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-10.56%，业绩比较基准收益率为 3.97%，低于业绩比较基准 14.53%；本基金 C 类净值增长率为-9.54%，业绩比较基准收益率为 3.97%，低于业绩比较基准 13.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 上半年的各项经济数据显示，我国宏观经济运行情况整体保持稳定，无疑是对我国供给侧改革、优化经济结构及金融去杠杆阶段性成果的肯定。下半年，我国政治、经济政策将以“稳”为核心思路，供给侧改革、经济结构调整和金融去杠杆的推进都将以更谨慎的节奏推进。从国际局势来看，中美贸易战无疑是今年最受关注且会被持续关注的事件，需要密切跟踪中美贸易战影响的广度和深度。综合上述信息，我们对我国宏观经济下半年的整体走势持谨慎乐观态度。我们认为，在目前的经济环境下，我国 A 股市场中，业绩稳定增长、企业信用优质、估值合理且具有行业优势的蓝筹股和新兴成长企业的投资价值会愈发凸显。

本基金将继续坚持通过自上而下的行业配置与自下而上的个股精选相结合的研究方法进行股票筛选和市场择时，同时，需要密切关注企业动态，规避“黑天鹅”发生概率高的行业或企业。顺应市场的变化，在严格控制下行风险的情况下，力求获取相对业绩比较基准更加稳定且可观的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及相关会计核算业务细则，本管理人对所管理的基金各项资产进行核算，本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下：

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，本基金本报告期末未进行利润分

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的真实、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多策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,504,936.08	4,586,806.75
结算备付金		-	-
存出保证金		3,208.51	52,348.90
交易性金融资产	6.4.7.2	233,574,434.99	263,374,632.64
其中：股票投资		223,544,434.99	253,293,832.64
基金投资		-	-
债券投资		10,030,000.00	10,080,800.00
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	-	1,000,000.00
应收证券清算款		39,574.15	307,779.59
应收利息	6.4.7.5	174,618.03	253,135.42
应收股利		-	-
应收申购款		2,711.30	3,494.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		240,299,483.06	269,578,197.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	1,000,000.00
应付赎回款		113.24	195.96
应付管理人报酬		144,409.40	158,557.71
应付托管费		51,574.82	56,627.74
应付销售服务费		21.70	12.13
应付交易费用	6.4.7.7	24,908.38	56,755.82



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	326,038.79	530,000.00
负债合计		547,066.33	1,802,149.36
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	219,985,130.33	219,738,467.89
未分配利润	6.4.7.10	19,767,286.40	48,037,580.57
所有者权益合计		239,752,416.73	267,776,048.46
负债和所有者权益总计		240,299,483.06	269,578,197.82

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0899 元，C 类基金份额净值 1.1023 元；基金份额总额 219,985,130.33 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 219,898,799.73 份，C 类基金份额总额 86,330.60 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-26,867,107.73	5,747,222.04
1.利息收入		210,435.43	8,534,608.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,857.73	69,463.09
债券利息收入		187,065.92	7,647,480.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		511.78	817,665.75
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,729,308.92	-19,440,467.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,356,683.98	-8,850,727.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	32,575.76	-11,732,595.61
资产支持证券投资	6.4.7.13.3	-	-
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	2,340,049.18	1,142,856.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-31,811,120.17	16,652,791.96
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	4,268.09	288.18
<b>减：二、费用</b>		1,491,892.51	3,278,094.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	917,482.11	1,717,828.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	327,672.25	613,510.28
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	119.68	5,994.20
4. 交易费用	6.4.7.19	51,014.68	684,465.55
5. 利息支出		-	39,043.28
其中：卖出回购金融资产支出		-	39,043.28
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	195,603.79	217,252.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-28,359,000.24	2,469,128.00
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-28,359,000.24	2,469,128.00

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	219,738,467.89	48,037,580.57	267,776,048.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,359,000.24	-28,359,000.24
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）	246,662.44	88,706.07	335,368.51
其中：1.基金申购款	1,231,215.83	321,406.82	1,552,622.65
2.基金赎回款	-984,553.39	-232,700.75	-1,217,254.14

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	219,985,130.33	19,767,286.40	239,752,416.73
项目	上年度可比期间 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（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	218,691,564.89	17,805,690.15	236,497,255.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          刘鸿鹏          </u>	<u>          刘鸿鹏          </u>	<u>          肖向辉          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 3 月 30 日中国证

监会《关于准予东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]484号）的核准，自2015年4月13日至2015年4月15日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集5,285,260,810.32元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施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《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《财政部、国家税务总局关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税，存款利息收入不

征收增值税。

根据规定，基金产品运营过程中发生的增值税应税行为，以基金产品管理人为增值税纳税人。

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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 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、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、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、现金等对价暂免征收印花税、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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	6,504,936.08
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	6,504,936.08

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	225,422,782.22	223,544,434.99	-1,878,347.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	10,041,700.00	-11,700.00
	合计	10,041,700.00	-11,700.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	235,464,482.22	233,574,434.99	-1,890,047.23

### 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 2018年6月30日
应收活期存款利息	1,077.04
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	-
应收债券利息	173,539.73
应收资产支持证券利息	-
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	1.26
合计	174,618.03

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	24,733.38
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	24,908.38

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	326,038.79
合计	326,038.79

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	219,705,758.36	219,705,758.36
本期申购	1,001,826.36	1,001,826.36
本期赎回(以“-”号填列)	-808,784.99	-808,784.99
- 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	219,898,799.73	219,898,799.73

金额单位：人民币元

东方鼎新灵活配置混合 C
--------------



项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,709.53	32,709.53
本期申购	229,389.47	229,389.47
本期赎回(以“-”号填列)	-175,768.40	-175,768.40
- 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	86,330.60	86,330.60

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	16,235,907.33	31,794,525.89	48,030,433.22
本期利润	3,450,267.12	-31,799,320.98	-28,349,053.86
本期基金份额交易产生的变动数	13,984.24	63,091.04	77,075.28
其中：基金申购款	77,328.97	187,367.32	264,696.29
基金赎回款	-63,344.73	-124,276.28	-187,621.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,700,158.69	58,295.95	19,758,454.64

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	2,422.79	4,724.56	7,147.35
本期利润	1,852.81	-11,799.19	-9,946.38
本期基金份额交易产生的变动数	4,749.14	6,881.65	11,630.79
其中：基金申购款	19,805.80	36,904.73	56,710.53
基金赎回款	-15,056.66	-30,023.08	-45,079.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,024.74	-192.98	8,831.76

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,553.08
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	261.80
其他	42.85
合计	22,857.73

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	17,628,379.80
减：卖出股票成本总额	15,271,695.82
买卖股票差价收入	2,356,683.98

#### 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 2018年1月1日至2018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	32,575.76
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	32,575.76

##### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,502,867.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	10,109,270.00

成本总额	
减：应收利息总额	361,021.51
买卖债券差价收入	32,575.76

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,340,049.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,340,049.18

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-31,811,120.17
——股票投资	-31,810,890.17
——债券投资	-230.00
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-31,811,120.17

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,189.10
基金转换费收入	78.99
合计	4,268.09

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	50,839.68
银行间市场交易费用	175.00
合计	51,014.68

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	148,765.71
账户维护费用	18,600.00
银行汇划费用	965.00
合计	195,603.79

## 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的管理费	917,482.11	1,717,828.57
其中：支付销售机构的客户维护费	4,706.29	2,192.26

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.7%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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	327,672.25	613,510.28

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	本期
----------	----

各关联方名称	2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	3.00	3.00
合计	-	3.00	3.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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

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固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	6,504,936.08	22,553.08	13,681,668.55	66,716.04

#### 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，本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018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
603693	江苏新能	2018年6月27日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	

##### 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
00245	康得	2018	重大	17.08	-	-	45,800	951,447.77	782,264.-	



0	新	年 6 月 4 日	事项						00
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	重大事项	6.43			121,300	1,066,436.13	779,959.00
002252	上海莱士	2018 年 6 月 29 日	重大事项	19.52			32,200	660,973.00	628,544.00
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大事项	52.04			10,500	614,218.60	546,420.00
601727	上海电气	2018 年 6 月 6 日	重大事项	6.34	2018 年 8 月 7 日	5.71	76,200	527,106.28	483,108.00
300072	三聚环保	2018 年 6 月 19 日	重大事项	23.28	2018 年 7 月 10 日	18.38	18,800	672,944.42	437,664.00
002310	东方园林	2018 年 5 月 25 日	重大事项	15.03			29,100	522,283.40	437,373.00
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大事项	4.18			94,950	408,952.67	396,891.00
601118	海南橡胶	2018 年 5 月 24 日	重大事项	6.62			34,300	192,106.75	227,066.00
002602	世纪华通	2018 年 6 月 12 日	重大事项	32.50			6,100	222,517.90	198,250.00
002411	必康股份	2018 年 6 月 19 日	重大事项	28.34			6,600	186,556.06	187,044.00
000008	神州高铁	2018 年 6 月 8 日	重大事项	4.96	2018 年 8 月 7 日	4.46	36,900	271,681.35	183,024.00
000723	美锦能源	2018 年 3 月 27 日	重大事项	5.43	2018 年 7 月 31 日	4.89	26,900	195,248.00	146,067.00

### 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 2018 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 2018 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.0	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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	0.0	110,800.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	110,800.00

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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 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。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，保持组合必要的流动性和可变现能力，未发生流动性风险。

#### 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 2018 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	6,504,936.08	-	-	-	6,504,936.08
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	3,208.51	-	-	-	3,208.51

交易性金融资产-股票投资	-	-	-	223,544,434.99	223,544,434.99
交易性金融资产-债券投资	10,030,000.00	-	-	-	10,030,000.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	39,574.15	39,574.15
应收利息	-	-	-	174,618.03	174,618.03
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,711.30	2,711.30
资产总计	16,538,144.59	-	-	223,761,338.47	240,299,483.06
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	113.24	113.24
应付管理人报酬	-	-	-	144,409.40	144,409.40
应付托管费	-	-	-	51,574.82	51,574.82
应付交易费用	-	-	-	24,908.38	24,908.38
应付销售服务费	-	-	-	21.70	21.70
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	326,038.79	326,038.79
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	547,066.33	547,066.33
利率敏感度缺口	16,538,144.59	-	-	223,214,272.14	239,752,416.73
上年度末 2017 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	4,586,806.75	-	-	-	4,586,806.75
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	52,348.90	-	-	-	52,348.90
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	253,293,832.64	253,293,832.64
交易性金融资产-债券投资	9,970,000.00	-	110,800.00	-	10,080,800.00

买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	307,779.59	307,779.59
应收利息	-	-	-	253,135.42	253,135.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,494.52	3,494.52
资产总计	15,609,155.65	-	110,800.00	253,858,242.17	269,578,197.82
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	195.96	195.96
应付管理人报酬	-	-	-	158,557.71	158,557.71
应付托管费	-	-	-	56,627.74	56,627.74
应付交易费用	-	-	-	56,755.82	56,755.82
应付销售服务费	-	-	-	12.13	12.13
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	530,000.00	530,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,000,000.00	1,000,000.00
负债总计	-	-	-	1,802,149.36	1,802,149.36
利率敏感度缺口	15,609,155.65	-	110,800.00	252,056,092.81	267,776,048.46

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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	0.00	0.00
	市场利率上调 0.25%	0.00	0.00

#### 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 2018年6月30日		上年度末 2017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	223,544,434.99	93.24	253,293,832.64	94.59
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	10,030,000.00	4.18	10,080,800.00	3.76
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	233,574,434.99	97.42	263,374,632.64	98.36

##### 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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-11,560,254.00	-13,146,393.49

	沪深 300 指数上涨 5%	11,560,254.00	13,146,393.49
--	----------------	---------------	---------------

#### 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 4,598,298.40 元，占基金资产净值比例为 1.92%；上年度末本基金风险价值为 3,005,994.77 元，占基金资产净值比例为 1.12%。

#### 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	223,544,434.99	93.03
	其中：股票	223,544,434.99	93.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,030,000.00	4.17
	其中：债券	10,030,000.00	4.17
	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	6,504,936.08	2.71
8	其他各项资产	220,111.99	0.09
9	合计	240,299,483.06	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	560,516.00	0.23
B	采矿业	6,985,872.00	2.91
C	制造业	95,333,824.24	39.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,933,252.00	2.47
E	建筑业	7,620,099.00	3.18
F	批发和零售业	4,357,718.00	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	7,047,293.00	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,345,122.00	3.48
J	金融业	70,524,312.00	29.42
K	房地产业	9,860,093.00	4.11

L	租赁和商务服务业	3,135,753.40	1.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	887,734.14	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,226,586.21	0.51
R	文化、体育和娱乐业	1,726,260.00	0.72
S	综合	-	-
	合计	223,544,434.99	93.24

### 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	226,100	13,244,938.00	5.52
2	600519	贵州茅台	10,800	7,899,768.00	3.29
3	600036	招商银行	215,300	5,692,532.00	2.37
4	000333	美的集团	98,500	5,143,670.00	2.15
5	000651	格力电器	100,400	4,733,860.00	1.97
6	601166	兴业银行	260,100	3,745,440.00	1.56
7	600887	伊利股份	126,800	3,537,720.00	1.48
8	600276	恒瑞医药	46,100	3,492,536.00	1.46
9	600016	民生银行	493,200	3,452,400.00	1.44
10	601939	建设银行	518,000	3,392,900.00	1.42
11	601328	交通银行	573,400	3,291,316.00	1.37
12	000858	五粮液	40,500	3,078,000.00	1.28
13	002415	海康威视	77,000	2,859,010.00	1.19
14	601288	农业银行	797,800	2,744,432.00	1.14
15	600030	中信证券	164,300	2,722,451.00	1.14
16	600104	上汽集团	73,100	2,557,769.00	1.07
17	000002	万科A	101,500	2,496,900.00	1.04
18	601668	中国建筑	438,200	2,392,572.00	1.00
19	600000	浦发银行	245,100	2,343,156.00	0.98
20	600900	长江电力	137,800	2,224,092.00	0.93
21	601601	中国太保	65,600	2,089,360.00	0.87
22	601169	北京银行	308,900	1,862,667.00	0.78
23	600048	保利地产	148,500	1,811,700.00	0.76
24	000725	京东方A	494,400	1,750,176.00	0.73

25	002304	洋河股份	12,600	1,658,160.00	0.69
26	000001	平安银行	179,100	1,628,019.00	0.68
27	600837	海通证券	168,900	1,599,483.00	0.67
28	601988	中国银行	439,700	1,587,317.00	0.66
29	600309	万华化学	34,240	1,555,180.80	0.65
30	600690	青岛海尔	76,400	1,471,464.00	0.61
31	002027	分众传媒	153,120	1,465,358.40	0.61
32	600019	宝钢股份	185,800	1,447,382.00	0.60
33	600518	康美药业	62,300	1,425,424.00	0.59
34	600028	中国石化	219,400	1,423,906.00	0.59
35	600585	海螺水泥	41,700	1,396,116.00	0.58
36	601888	中国国旅	20,400	1,313,964.00	0.55
37	601229	上海银行	81,400	1,282,864.00	0.54
38	600029	南方航空	148,000	1,250,600.00	0.52
39	603288	海天味业	16,900	1,244,516.00	0.52
40	601818	光大银行	332,400	1,216,584.00	0.51
41	601766	中国中车	152,300	1,172,710.00	0.49
42	000538	云南白药	10,900	1,165,864.00	0.49
43	601211	国泰君安	78,400	1,155,616.00	0.48
44	600009	上海机场	20,100	1,115,148.00	0.47
45	002024	苏宁易购	77,700	1,094,016.00	0.46
46	601857	中国石油	135,100	1,041,621.00	0.43
47	601688	华泰证券	68,200	1,020,954.00	0.43
48	601006	大秦铁路	124,200	1,019,682.00	0.43
49	600015	华夏银行	133,700	996,065.00	0.42
50	300059	东方财富	75,500	995,090.00	0.42
51	600703	三安光电	51,100	982,142.00	0.41
52	002230	科大讯飞	30,400	974,928.00	0.41
53	601009	南京银行	123,800	956,974.00	0.40
54	600050	中国联通	194,200	955,464.00	0.40
55	002008	大族激光	17,800	946,782.00	0.39
56	001979	招商蛇口	49,400	941,070.00	0.39
57	000568	泸州老窖	15,300	931,158.00	0.39
58	600919	江苏银行	144,400	925,604.00	0.39
59	002594	比亚迪	18,900	901,152.00	0.38
60	002475	立讯精密	39,650	893,711.00	0.37
61	000338	潍柴动力	101,200	885,500.00	0.37
62	600196	复星医药	21,000	869,190.00	0.36
63	600031	三一重工	96,500	865,605.00	0.36

64	002142	宁波银行	52,900	861,741.00	0.36
65	601186	中国铁建	96,100	828,382.00	0.35
66	601088	中国神华	41,400	825,516.00	0.34
67	000776	广发证券	61,700	818,759.00	0.34
68	002236	大华股份	36,300	818,565.00	0.34
69	300003	乐普医疗	22,300	817,964.00	0.34
70	601628	中国人寿	34,800	783,696.00	0.33
71	601899	紫金矿业	216,700	782,287.00	0.33
72	002450	康得新	45,800	782,264.00	0.33
73	600741	华域汽车	32,900	780,388.00	0.33
74	601390	中国中铁	121,300	779,959.00	0.33
75	601989	中国重工	190,800	770,832.00	0.32
76	600660	福耀玻璃	29,200	750,732.00	0.31
77	601336	新华保险	17,400	746,112.00	0.31
78	000963	华东医药	15,300	738,225.00	0.31
79	603799	华友钴业	7,400	721,278.00	0.30
80	600867	通化东宝	30,000	719,100.00	0.30
81	300124	汇川技术	21,800	715,476.00	0.30
82	002466	天齐锂业	14,400	714,096.00	0.30
83	601225	陕西煤业	86,700	712,674.00	0.30
84	600436	片仔癀	6,300	705,159.00	0.29
85	600958	东方证券	74,700	682,011.00	0.28
86	601012	隆基股份	40,800	680,952.00	0.28
87	000063	中兴通讯	51,600	672,348.00	0.28
88	000100	TCL 集团	226,300	656,270.00	0.27
89	600999	招商证券	47,800	653,904.00	0.27
90	600352	浙江龙盛	54,400	650,080.00	0.27
91	600705	中航资本	139,200	650,064.00	0.27
92	600795	国电电力	246,100	644,782.00	0.27
93	002456	欧菲科技	39,600	638,748.00	0.27
94	002460	赣锋锂业	16,500	636,570.00	0.27
95	600340	华夏幸福	24,700	636,025.00	0.27
96	300015	爱尔眼科	19,649	634,466.21	0.26
97	002252	上海莱士	32,200	628,544.00	0.26
98	600886	国投电力	85,100	618,677.00	0.26
99	000166	申万宏源	140,900	615,733.00	0.26
100	600487	亨通光电	27,860	614,313.00	0.26
101	600271	航天信息	24,300	614,061.00	0.26
102	601933	永辉超市	79,800	609,672.00	0.25

103	000423	东阿阿胶	11,300	608,053.00	0.25
104	600406	国电南瑞	38,200	603,560.00	0.25
105	002044	美年健康	26,200	592,120.00	0.25
106	601155	新城控股	18,900	585,333.00	0.24
107	601607	上海医药	24,100	575,990.00	0.24
108	601901	方正证券	85,800	574,002.00	0.24
109	600011	华能国际	87,500	556,500.00	0.23
110	601111	中国国航	62,300	553,847.00	0.23
111	601985	中国核电	97,400	550,310.00	0.23
112	000895	双汇发展	20,700	546,687.00	0.23
113	002739	万达电影	10,500	546,420.00	0.23
114	600516	方大炭素	22,400	546,112.00	0.23
115	300070	碧水源	39,200	546,056.00	0.23
116	600570	恒生电子	10,300	545,385.00	0.23
117	600115	东方航空	81,900	542,178.00	0.23
118	600089	特变电工	77,600	537,768.00	0.22
119	002202	金风科技	42,400	535,936.00	0.22
120	600066	宇通客车	27,700	531,563.00	0.22
121	601600	中国铝业	137,400	527,616.00	0.22
122	600111	北方稀土	45,500	517,790.00	0.22
123	601669	中国电建	95,800	513,488.00	0.21
124	300408	三环集团	21,800	512,300.00	0.21
125	601377	兴业证券	97,000	511,190.00	0.21
126	300136	信维通信	16,400	503,972.00	0.21
127	600606	绿地控股	76,100	497,694.00	0.21
128	000069	华侨城 A	68,500	495,255.00	0.21
129	600535	天士力	18,900	487,998.00	0.20
130	600588	用友网络	19,800	485,298.00	0.20
131	000413	东旭光电	79,900	484,194.00	0.20
132	601727	上海电气	76,200	483,108.00	0.20
133	600383	金地集团	47,100	479,949.00	0.20
134	600398	海澜之家	37,500	477,750.00	0.20
135	000503	国新健康	15,000	476,700.00	0.20
136	002736	国信证券	51,400	467,740.00	0.20
137	300122	智飞生物	10,000	457,400.00	0.19
138	000768	中航飞机	28,900	451,996.00	0.19
139	600522	中天科技	51,200	451,072.00	0.19
140	600176	中国巨石	43,900	449,097.00	0.19
141	601788	光大证券	40,700	446,886.00	0.19

142	600332	白云山	11,700	445,185.00	0.19
143	600010	包钢股份	285,500	442,525.00	0.18
144	000783	长江证券	80,800	438,744.00	0.18
145	300072	三聚环保	18,800	437,664.00	0.18
146	002310	东方园林	29,100	437,373.00	0.18
147	002572	索菲亚	13,500	434,430.00	0.18
148	600893	航发动力	18,800	419,616.00	0.18
149	600068	葛洲坝	57,700	416,017.00	0.17
150	600637	东方明珠	27,600	415,656.00	0.17
151	002241	歌尔股份	40,500	412,695.00	0.17
152	600085	同仁堂	11,400	402,192.00	0.17
153	600674	川投能源	45,900	400,248.00	0.17
154	601877	正泰电器	17,900	399,528.00	0.17
155	600023	浙能电力	85,300	397,498.00	0.17
156	000540	中天金融	94,950	396,891.00	0.17
157	300024	机器人	22,800	396,720.00	0.17
158	601998	中信银行	63,800	396,198.00	0.17
159	000157	中联重科	95,400	392,094.00	0.16
160	601919	中远海控	79,600	391,632.00	0.16
161	600739	辽宁成大	25,600	388,608.00	0.16
162	601198	东兴证券	28,800	375,552.00	0.16
163	600018	上港集团	62,800	374,288.00	0.16
164	002007	华兰生物	11,600	373,056.00	0.16
165	601618	中国中冶	111,900	372,627.00	0.16
166	000425	徐工机械	87,700	371,848.00	0.16
167	600547	山东黄金	15,500	370,760.00	0.15
168	002493	荣盛石化	35,700	368,424.00	0.15
169	000625	长安汽车	40,700	366,300.00	0.15
170	601800	中国交建	32,000	364,480.00	0.15
171	600804	鹏博士	29,800	357,600.00	0.15
172	300144	宋城演艺	15,200	357,200.00	0.15
173	601997	贵阳银行	28,700	354,732.00	0.15
174	000623	吉林敖东	19,400	348,812.00	0.15
175	601018	宁波港	82,500	347,325.00	0.14
176	000786	北新建材	18,700	346,511.00	0.14
177	600208	新潮中宝	89,800	343,036.00	0.14
178	600362	江西铜业	21,600	342,360.00	0.14
179	601555	东吴证券	49,900	340,817.00	0.14
180	600926	杭州银行	30,700	340,463.00	0.14

181	600809	山西汾酒	5,400	339,606.00	0.14
182	002065	东华软件	39,400	338,840.00	0.14
183	300017	网宿科技	31,500	337,365.00	0.14
184	002081	金螳螂	33,100	334,310.00	0.14
185	002050	三花智控	17,700	333,645.00	0.14
186	002714	牧原股份	7,500	333,450.00	0.14
187	601099	太平洋	142,400	333,216.00	0.14
188	600816	安信信托	45,800	331,592.00	0.14
189	603833	欧派家居	2,600	331,578.00	0.14
190	600100	同方股份	37,000	324,860.00	0.14
191	002294	信立泰	8,700	323,379.00	0.13
192	002146	荣盛发展	36,400	317,772.00	0.13
193	600482	中国动力	18,100	315,845.00	0.13
194	000792	盐湖股份	29,100	314,862.00	0.13
195	600219	南山铝业	115,900	314,089.00	0.13
196	600109	国金证券	44,100	313,551.00	0.13
197	000728	国元证券	42,200	312,280.00	0.13
198	000630	铜陵有色	137,700	304,317.00	0.13
199	603858	步长制药	7,100	303,809.00	0.13
200	002508	老板电器	9,900	303,138.00	0.13
201	002558	巨人网络	12,700	302,006.00	0.13
202	603993	洛阳钼业	48,000	301,920.00	0.13
203	601333	广深铁路	70,900	301,325.00	0.13
204	600297	广汇汽车	50,900	298,274.00	0.12
205	600498	烽火通信	12,000	298,200.00	0.12
206	002797	第一创业	44,000	297,880.00	0.12
207	002673	西部证券	38,200	288,410.00	0.12
208	600170	上海建工	92,600	281,504.00	0.12
209	600438	通威股份	40,600	280,140.00	0.12
210	000876	新希望	44,100	279,594.00	0.12
211	601117	中国化学	41,300	277,949.00	0.12
212	000839	中信国安	57,400	271,502.00	0.11
213	002624	完美世界	8,600	266,686.00	0.11
214	600153	建发股份	29,600	266,104.00	0.11
215	000709	河钢股份	88,600	261,370.00	0.11
216	000826	启迪桑德	14,900	260,452.00	0.11
217	600977	中国电影	16,200	259,848.00	0.11
218	000983	西山煤电	34,300	257,593.00	0.11
219	002085	万丰奥威	27,300	256,620.00	0.11

220	600415	小商品城	59,300	255,583.00	0.11
221	000060	中金岭南	52,000	252,720.00	0.11
222	002500	山西证券	37,000	249,380.00	0.10
223	600038	中直股份	6,200	247,938.00	0.10
224	002352	顺丰控股	5,500	247,500.00	0.10
225	601633	长城汽车	25,100	246,482.00	0.10
226	600489	中金黄金	36,100	246,202.00	0.10
227	601360	三六零	8,500	245,650.00	0.10
228	000961	中南建设	38,800	244,828.00	0.10
229	600583	海油工程	46,200	243,012.00	0.10
230	600820	隧道股份	41,000	242,310.00	0.10
231	600663	陆家嘴	15,300	241,587.00	0.10
232	601992	金隅集团	72,800	238,784.00	0.10
233	600369	西南证券	61,700	237,545.00	0.10
234	601216	君正集团	70,100	236,237.00	0.10
235	600118	中国卫星	12,300	234,930.00	0.10
236	600346	恒力股份	15,800	231,628.00	0.10
237	300433	蓝思科技	11,000	230,780.00	0.10
238	600157	永泰能源	129,200	229,976.00	0.10
239	601118	海南橡胶	34,300	227,066.00	0.09
240	002470	金正大	32,900	226,352.00	0.09
241	000627	天茂集团	32,200	226,044.00	0.09
242	601228	广州港	38,700	224,847.00	0.09
243	000898	鞍钢股份	40,200	223,914.00	0.09
244	600008	首创股份	52,400	221,128.00	0.09
245	002555	三七互娱	18,000	218,700.00	0.09
246	601881	中国银河	26,800	217,884.00	0.09
247	600909	华安证券	37,900	216,788.00	0.09
248	300027	华谊兄弟	34,600	213,136.00	0.09
249	000671	阳光城	35,300	210,741.00	0.09
250	000402	金融街	26,000	209,300.00	0.09
251	002074	国轩高科	14,800	208,088.00	0.09
252	000559	万向钱潮	30,000	204,000.00	0.09
253	002153	石基信息	7,000	203,000.00	0.08
254	601021	春秋航空	5,700	199,671.00	0.08
255	002602	世纪华通	6,100	198,250.00	0.08
256	600376	首开股份	28,000	196,840.00	0.08
257	600704	物产中大	37,500	196,125.00	0.08
258	300251	光线传媒	19,200	195,456.00	0.08



259	000938	紫光股份	3,100	194,060.00	0.08
260	601898	中煤能源	39,800	192,234.00	0.08
261	600682	南京新百	11,600	190,704.00	0.08
262	600549	厦门钨业	12,350	187,473.00	0.08
263	002411	必康股份	6,600	187,044.00	0.08
264	002385	大北农	44,900	185,437.00	0.08
265	000008	神州高铁	36,900	183,024.00	0.08
266	600688	上海石化	31,800	180,942.00	0.08
267	300033	同花顺	4,600	178,802.00	0.07
268	601866	中远海发	69,500	173,055.00	0.07
269	600959	江苏有线	33,900	172,890.00	0.07
270	002601	龙麟佰利	13,300	171,969.00	0.07
271	600061	国投资本	18,400	170,752.00	0.07
272	601991	大唐发电	51,900	157,257.00	0.07
273	600373	中文传媒	12,000	154,200.00	0.06
274	600372	中航电子	11,500	150,190.00	0.06
275	601238	广汽集团	13,300	148,162.00	0.06
276	601718	际华集团	36,600	147,132.00	0.06
277	000723	美锦能源	26,900	146,067.00	0.06
278	000959	首钢股份	34,700	142,617.00	0.06
279	601611	中国核建	17,000	134,300.00	0.06
280	601958	金钼股份	21,300	133,551.00	0.06
281	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.05
282	603160	汇顶科技	1,900	123,291.00	0.05
283	601808	中海油服	12,200	116,388.00	0.05
284	002468	申通快递	6,700	114,905.00	0.05
285	600025	华能水电	37,600	114,304.00	0.05
286	600188	兖州煤业	8,300	108,232.00	0.05
287	603260	合盛硅业	1,500	105,855.00	0.04
288	002925	盈趣科技	1,900	105,222.00	0.04
289	002625	光启技术	8,900	104,219.00	0.04
290	601828	美凯龙	6,600	100,848.00	0.04
291	600233	圆通速递	7,400	97,680.00	0.04
292	601108	财通证券	8,300	93,624.00	0.04
293	001965	招商公路	11,500	93,610.00	0.04
294	600390	五矿资本	11,000	85,250.00	0.04
295	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.03
296	601838	成都银行	8,400	73,500.00	0.03
297	601212	白银有色	16,700	68,303.00	0.03

298	601878	浙商证券	8,000	67,200.00	0.03
299	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.02
300	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.02

## 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	603288	海天味业	1,285,423.00	0.48
2	002027	分众传媒	1,249,826.00	0.47
3	601229	上海银行	1,000,038.00	0.37
4	600867	通化东宝	752,099.00	0.28
5	600487	亨通光电	675,193.00	0.25
6	600516	方大炭素	598,543.79	0.22
7	300408	三环集团	538,153.15	0.20
8	600176	中国巨石	523,735.00	0.20
9	600398	海澜之家	502,478.00	0.19
10	000786	北新建材	406,419.00	0.15
11	002493	荣盛石化	367,140.00	0.14
12	600809	山西汾酒	340,576.67	0.13
13	002050	三花智控	323,763.00	0.12
14	601360	三六零	305,502.00	0.11
15	002085	万丰奥威	299,107.00	0.11
16	600438	通威股份	297,197.00	0.11
17	603858	步长制药	274,395.00	0.10
18	300433	蓝思科技	272,579.00	0.10
19	002926	华西证券	265,381.38	0.10
20	600926	杭州银行	259,820.00	0.10

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	601318	中国平安	665,859.00	0.25
2	603259	药明康德	597,281.60	0.22
3	600177	雅戈尔	522,146.00	0.19
4	002926	华西证券	451,549.22	0.17
5	002465	海格通信	309,581.00	0.12
6	600036	招商银行	281,506.00	0.11
7	600150	*ST 船舶	262,199.00	0.10
8	600901	江苏租赁	261,817.50	0.10
9	000750	国海证券	247,418.00	0.09
10	300750	宁德时代	225,164.00	0.08
11	603156	养元饮品	221,368.52	0.08
12	300315	掌趣科技	220,819.00	0.08
13	002925	盈趣科技	220,232.32	0.08
14	600895	张江高科	219,256.00	0.08
15	601066	中信建投	217,941.40	0.08
16	601555	东吴证券	214,560.00	0.08
17	002920	赛德西威	203,640.29	0.08
18	600827	百联股份	197,279.02	0.07
19	601838	成都银行	194,458.81	0.07
20	600649	城投控股	188,409.00	0.07

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	17,333,188.34
卖出股票收入（成交）总额	17,628,379.80

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,030,000.00	4.18
	其中：政策性金融债	10,030,000.00	4.18
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	10,030,000.00	4.18

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180201	18 国开 01	100,000	10,030,000.00	4.18
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 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

本基金所持有格力电器（000651.SZ）于 2017 年 7 月 26 日公告：公司近日收到中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称“广东证监局”）对公司董事徐自发先生下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发采取出具警示函措施的决定》（〔2017〕39 号，以下简称“《决定书》”），《决定书》的主要内容为：“徐自发，经查，你于 2015 年 6 月起至今任格力电器董事。2016 年 11 月 24 日，你通过交易所集中竞价交易的方式买入格力电器股票 575,300 股，成交均价为 26.39 元/股，成交金额 1518.22 万元。2017 年 5 月 22 日，你再次通过交易所集中竞价交易的方式，卖出格力电器股票 400,825 股，成交均价为 33.45 元/股，成交金额 1340.76 万元。你作为格力电器的董事，将持有的格力电器股票在买入后不足 6 个月卖出，违反了《证券法》第四十七条的规定，现对你采取出具警示函的监管措施。你应该认真吸取教训，加强证券法律法规学习，严格规范买卖上市公司股票行为，采取切实有效措施杜绝此类违规行为再次发生。”公司同时给出相关说明：“徐自发先生于 2017 年 5 月 22 日通过深圳证券交易所集中竞价交易系统减持了本公司部分股份。减持过程中，因其委托某券商营业部客户经理对短线交易相关法律法规理解偏差，出现本次短线交易。公司已于 2017 年 5 月 27 日对相关情况进行了公告（公告编号：2017-020），徐自发先生因本次短线交易产生的收益 2,829,824.5 元已经收归公司所有。”

格力电器于 2017 年 10 月 19 日公告：公司董事徐自发先生于 2017 年 10 月 18 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（编号：粤证调查通字 170202

号)，该通知书内容为“因涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你立案调查，请予以配合。”

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

(1) 研究：本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台，采用自上而下和自下而上相结合的方式。在全面深入研究的基础上，提出大类资产配置建议、目标久期建议、类属资产配置建议等。

(2) 资产配置决策：投资决策委员会依据上述研究报告，对基金的资产配置比例、目标久期设定等提出指导性意见。基金经理基于投研部门的投资建议，根据自己对未来一段时期内宏观经济走势的基本判断，对基金资产的投资，制定月度资产配置和久期设置计划，并报投资决策委员会审批，审批通过，方可按计划执行。

(3) 组合构建：大类资产配置比例范围及目标久期设定范围确定后，基金经理参考研究员的投资建议，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。

(4) 交易执行：交易管理部负责具体的交易执行，依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

(5) 风险监控：本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控，定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况，责令投资不规范的基金经理进行检讨，并及时调整。

(6) 风险绩效评估：风险管理部定期和不定期对基金的投资进行风险绩效评估，并提供相关报告，使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略，并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整和优化投资组合。

(7) 组合调整：基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，以及组合风险与绩效的评估结果，结合基金申购和赎回的现金流量情况，对投资组合进行动态调整，使之不断得到优化。

本基金投资格力电器主要基于以下原因：

珠海格力电器股份有限公司是目前全球最大的集研发、生产、销售、服务于一体的国有控股专业化空调企业。公司是唯一成为“世界名牌”的中国空调业品牌，公司产品产销量连续多年全球领先。2005 年至今，格力家用空调产销量连续 13 年领跑全球，2006 年荣获“世界名牌”称号。

格力电器作为空调行业龙头,2017 年全年,公司实现营业收入 1482.86 亿元,同比增长 36.92%; 归母净利润 224.01 亿元,同比增长 44.87%。其中,第四季度营业收入 374.12 亿元,同比增长 44.59%; 归母净利润 69.4 亿元,同比增长 63.91%。2018 年一季度延续良好表现,实现营业收入 395.6 亿元,同比增长 33.29%; 归母净利润 5.58 亿元,同比增长 39.04%。

公司业绩长期稳定增长,具有较高的营收成长性。估值方面,公司上市以来平均估值 18.34 倍,近 10 年平均估值 11.99 倍,近 3 年平均估值仅为 11.16 倍,明显被低估,有充足回升空间。综合看来,具有较高投资价值。

除上述情况外,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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	3,208.51
2	应收证券清算款	39,574.15
3	应收股利	-
4	应收利息	174,618.03
5	应收申购款	2,711.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	220,111.99

### 7.12.4 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可转换债券。

### 7.12.5 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	488	450,612.29	216,673,555.65	98.53%	3,225,244.08	1.47%
东方鼎新灵活配置混合 C	18	4,796.14	-	-	86,330.60	100.00%
合计	506	434,753.22	216,673,555.65	98.49%	3,311,574.68	1.51%

### 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	0.0000%
	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、基金投资和研发部门负责人持	东方鼎新灵活配置混合 A	0



有本开放式基金	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	219,705,758.36	32,709.53
本报告期基金总申购份额	1,001,826.36	229,389.47
减：本报告期基金总赎回份额	808,784.99	175,768.40
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	219,898,799.73	86,330.60

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，基金管理人、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

截至报告期末，公司不存在诉讼情况。

本报告期内无涉及本基金基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
东兴证券股份有限公司	1	17,961,210.62	55.17%	16,727.31	55.17%	-
南京证券股份有限公司	2	14,593,373.09	44.83%	13,590.99	44.83%	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	141,867.27	100.00%	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## § 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	2018-1-1 至 2018-6-30	216,673,555.65	-	-	216,673,555.65	98.49%
个人	1	-	-	-	-	-	-
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](http://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

2018年8月28日