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

东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金

2017 半年度 报告摘要

2017年6月30日

§1 重要提示

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
下属分级基金场内简称:	-	-
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		010-66578878或400-628-5888	95588
传真		010-66578700	010 66105798

2.4信息披露方式

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

§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

基金规模	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

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

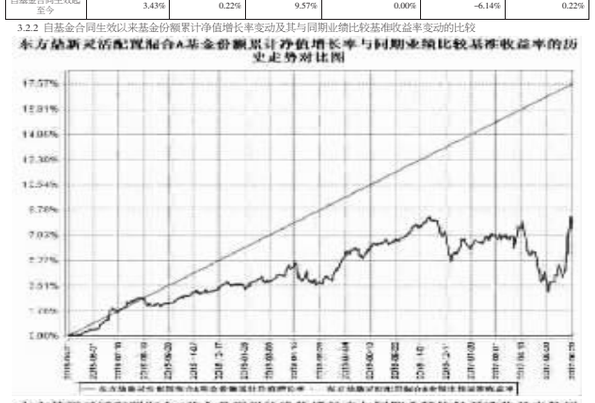
东方鼎新灵活配置混合A

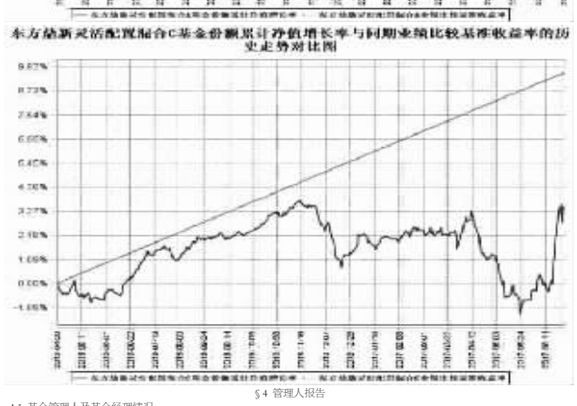
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.21%	0.48%	0.66%	0.00%	3.55%	0.48%
过去三个月	1.63%	0.40%	1.99%	0.00%	-0.36%	0.40%
过去六个月	2.06%	0.31%	3.97%	0.00%	-1.91%	0.31%
过去一年	2.67%	0.23%	7.99%	0.00%	-5.32%	0.23%
过去三年	8.14%	0.18%	17.57%	0.00%	-9.43%	0.18%
自基金合同生效起至今	8.14%	0.18%	17.57%	0.00%	-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





§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、东方永照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(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、东方永照18个月定期开放债券型证券投资基金。
朱晓楠(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(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 管理人对投资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 管理人对投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中的公平交易程序;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的同向交易价差、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,未直接或通过与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,央行控制资本流出入的想法不会改变,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。基金将保持目前的稳短久期,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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	241,753.21	19,240.49
应收利息	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	-	-
资产总计	237,564,294.39	555,636,508.39
负债和所有者权益	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	-	-
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	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	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	218,691,564.89	523,519,285.56
未分配利润	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	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	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	-8,850,727.97	948,675.60
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-11,732,595.61	1,008,694.84
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,142,856.53	109,997.40
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	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)	288.18	1,902,466.31
减:二.费用	3,278,094.04	6,429,781.64
1.管理人报酬	1,717,828.57	4,677,202.07
2.托管费	613,510.28	1,169,300.43
3.销售服务费	5,994.20	0.89
4.交易费用	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	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(本期净利润)	-	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
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	1,734,085,430.78	65,060,064.97	1,799,145,495.75
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	10,038,051.57	10,038,051.57
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)	-1,431,315,814.18	-58,961,487.13	-1,490,277,301.31
其中:1.基金申购款	176,184.39	7,266.34	183,450.73
2.基金赎回款	-1,431,491,998.57	-58,968,753.47	-1,490,460,752.04
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)	302,769,616.60	16,136,629.41	318,906,246.01

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:

刘鸣鹏 刘鸣鹏 肖向辉

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金额为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独立公告。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、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>估值业务及会计报告有关事项的通知》、《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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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