

东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 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。本中期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 2024 年 8 月 30 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 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 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| § 7 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 39 |
| 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 | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 43 |
| 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 | 43 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 43 |
| 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 | 44 |
| 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 | 44 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 44 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 45 |
| 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情况 | 45 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 46 |
| § 10 重大事件揭示 | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 46 |
| 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 | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 47 |
| 10.8 其他重大事件 | 51 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| 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 | 53 |
| § 12 备查文件目录 | 53 |
| 12.1 备查文件目录 | 53 |
| 12.2 存放地点 | 53 |
| 12.3 查阅方式 | 53 |

§ 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 | 东方基金管理股份有限公司 | |
| 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 | 6, 186, 385. 15 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 | 2, 981, 248. 79 份 | 3, 205, 136. 36 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 | 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 | | 东方基金管理股份有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 李景岩 | 郭明 |
| | 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 | | 北京市丰台区金泽路 161 号院 1 | 北京市西城区复兴门内大街 55 |

| | | |
|-------|--------------|--------|
| | 号楼远洋锐中心 26 层 | 号 |
| 邮政编码 | 100073 | 100140 |
| 法定代表人 | 崔伟 | 廖林 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com |
| 基金中期报告备置地点 | 本基金管理人及本基金托管人住所或办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|------------------------------------|
| 注册登记机构 | 东方基金管理股份有限公司 | 北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 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

| 3.1.1 期间数 据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | |
|-------------------|-------------------------------------|--------------|
| | 东方鼎新灵活配置混合 A | 东方鼎新灵活配置混合 C |
| 本期已实现收益 | -282,695.00 | -322,558.10 |
| 本期利润 | -328,488.17 | -364,939.32 |
| 加权平均基金份额 本期利润 | -0.1041 | -0.1054 |
| 本期加权平均净 值利润率 | -7.31% | -7.43% |
| 本期基金份额净 值增长率 | -6.72% | -6.86% |
| 3.1.2 期末数 据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| 期末可供分配利 润 | 1,172,361.89 | 1,240,338.80 |
| 期末可供分配基 金份额利润 | 0.3932 | 0.3870 |
| 期末基金资产净 值 | 4,153,610.68 | 4,445,475.16 |
| 期末基金份额净 值 | 1.3932 | 1.3870 |

| | | |
|--------------|------------------|--------|
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 39.32% | 32.88% |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 | -1.16% | 0.20% | 0.66% | 0.00% | -1.82% | 0.20% |
| 过去三个月 | -1.54% | 0.25% | 1.99% | 0.00% | -3.53% | 0.25% |
| 过去六个月 | -6.72% | 0.45% | 3.98% | 0.00% | -10.70% | 0.45% |
| 过去一年 | -8.24% | 0.35% | 8.01% | 0.00% | -16.25% | 0.35% |
| 过去三年 | -14.62% | 0.36% | 24.01% | 0.00% | -38.63% | 0.36% |
| 自基金合同生效起至今 | 39.32% | 0.57% | 73.57% | 0.00% | -34.25% | 0.57% |

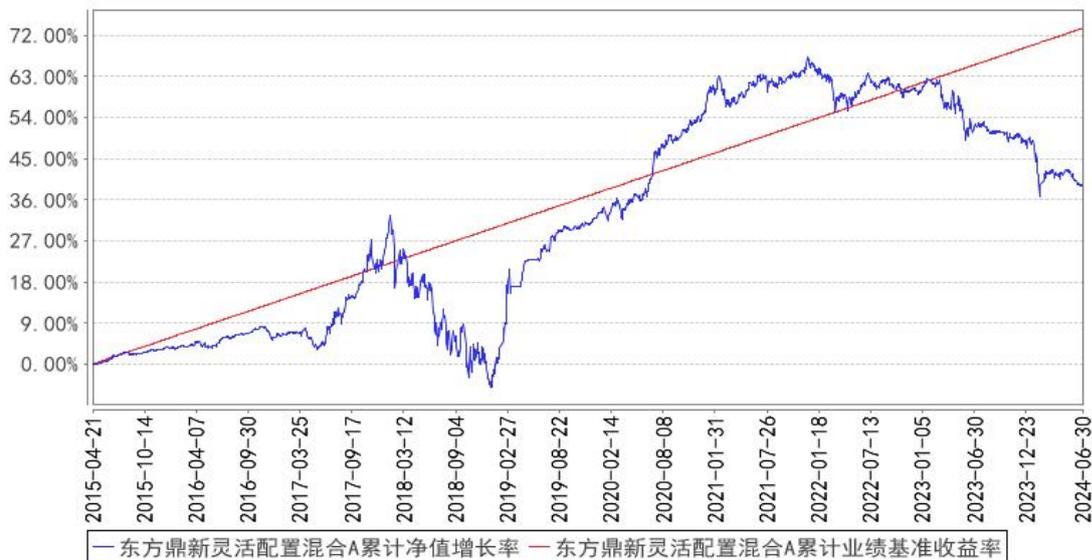
东方鼎新灵活配置混合 C

| 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 | -1.18% | 0.20% | 0.66% | 0.00% | -1.84% | 0.20% |
| 过去三个月 | -1.61% | 0.25% | 1.99% | 0.00% | -3.60% | 0.25% |
| 过去六个月 | -6.86% | 0.45% | 3.98% | 0.00% | -10.84% | 0.45% |
| 过去一年 | -8.52% | 0.35% | 8.01% | 0.00% | -16.53% | 0.35% |
| 过去三年 | -15.39% | 0.36% | 24.01% | 0.00% | -39.40% | 0.36% |

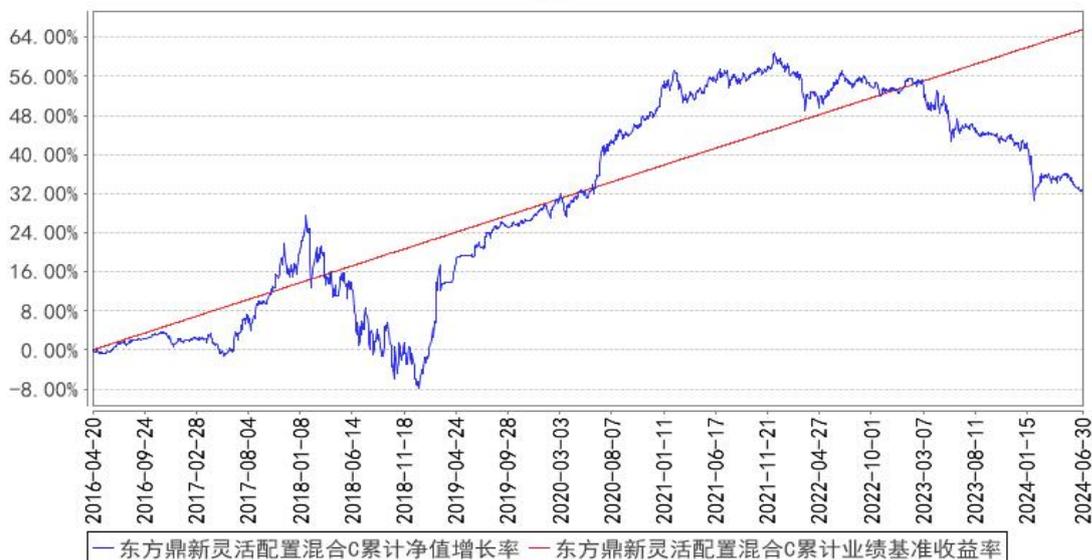
| | | | | | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 自基金合同生效起 至今 | 32.88% | 0.60% | 65.57% | 0.00% | -32.69% | 0.60% |
|----------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|

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股份有限公司（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，于2004年6月11日成立。

截至2024年6月30日，本公司注册资本3.3333亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份19200万股，持股比例57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份8100万股，持股比例24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份2700万股，持股比例8.1%；海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持股比例3.37%；海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止2024年6月30日，本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展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、东方睿鑫热点挖掘灵活配置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、东方稳健回报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、东方新能源汽车主题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、东方新兴成长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、东方永泰纯债1年定期开放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、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有

期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金、东方锦合一年定期开放债券型发起式证券投资基金、东方享悦 90 天滚动持有债券型证券投资基金、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金、东方享誉 30 天滚动持有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 | | |
| 盛泽 | 本基金基金经理、量化投资部总经理、资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员 | 2018 年 9 月 12 日 | - | 9 年 | 量化投资部总经理，资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员。华威大学经济与国际金融经济学硕士，9 年证券从业经历。曾任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018 年 7 月加盟本基金管理人，曾任量化投资部总经理助理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理、东方中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，现任东方量化成长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、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方量化多策略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、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方沪深 300 指数增强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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本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》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》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用基金资产，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。本基金无重大违法、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

回顾 2024 上半年，6 月 PMI 持平 5 月、连续 2 个月位于荣枯线以下，这一数据弱于 3-4 月，但是好于年初 1-2 月，仍处于经济缓慢复苏阶段。细分来看，一方面价格仍在回升通道上，PPI 和 CPI 触底回升趋势基本形成。另一方面库存基本见底，内外库存周期共振有助于迎来量的改善。但由于经济增长中枢下移、居民资产负债表收缩，政策力度的支持复苏尤为关键。中期来看，“新

国九条”强调防风险、促进高质量发展，进一步明确退市制度和分红要求；短期来看，行业龙头抗风险能力更强，经济进入弱复苏，行业龙头更有可能率先从复苏中走出来。

风格判断上，当期震荡的宏观基本面与偏高的美债利率依然支持价值风格，且优质资产较为稀缺背景下高股息个股的机构配置比例仍在不断提升，目前来看趋势可能不断加强但尚未结束。在汇率方面短期内仍然需要根据美元指数的水平做出合理应对，因此国内市场的降息预期亦有所降温，但是长期来看对于中性利率的下移判断保持不变。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-6.72%，业绩比较基准收益率为 3.98%，低于业绩比较基准 10.70%；本基金 C 类净值增长率为-6.86%，业绩比较基准收益率为 3.98%，低于业绩比较基准 10.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，“稳汇率”和“宽信用”的力度可能会是影响当前市场风格的重要因素。流动性方面，受外部环境如美国降息预期及大选情况影响较大，稳汇率凸显重要性。其次，外需的持续性也存在不确定性，从而影响出口下半年的高增持续性。此外，红利板块逐渐进入顶部偏左侧阶段、仍具备配置价值，风格内部轮动明显、部分红利品种性价比依然较高；另外随着中报来临，高盈利质量也成为市场从价值向成长切换中尝试的过渡方向。综上所述，风险类资产的风险偏好的修复仍需基本面数据的好转来引导，本基金通过对于基本面的研究做出合理投资判断，力争实现稳定的长期超额收益。

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》、《资产管理产品相关会计处理规定》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股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员包括公司总经理、分管运营高级管理人员、分管投研高级管理人员、督察长以及运营部负责人、投研部门指定负责人、合规法务部负责人、风险管理部负责人及总办会其他指定人员。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

负责召集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，由指定的副主任代理其行使召集职责。

2. 运营部

(1) 自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

(2) 征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

(3) 根据估值委员会会议决定的估值方法及估值模型而最终确认的具体投资品种公允价值与托管行协商一致后，对相应产品进行估值。

(4) 负责编制相应产品持有的投资品种变更估值方法的相关公告，协调相关部门对外发布公告，并根据公告内容协助相关部门做好客户沟通。

(5) 负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

3. 投研部门

根据现行法律法规及各产品相关法律文件，适时评估各产品持有投资品种的现有估值政策及估值方法是否公允、适当；对估值方法有失公允性时，投研部门必要时可向运营部提交估值方法调整说明，由运营部提请估值委员会召集估值会议进行审议。

4. 合规法务部、风险管理部

在日常合规监控及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召集估值会议。

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，公司已与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，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）或影子定价（适用货币基金）。

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，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情形，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——东方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期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股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 759,103.53 | 6,208,114.32 |
| 结算备付金 | | 18,777.33 | 23,054.10 |
| 存出保证金 | | 1,471.65 | 965.24 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 8,010,303.26 | 4,714,793.56 |
| 其中：股票投资 | | 2,410,256.00 | 3,185,650.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 5,600,047.26 | 1,529,143.56 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | 89,359.58 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 10,232.83 | 10,613.77 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 8,799,888.60 | 11,046,900.57 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023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 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 19,462.93 | 21,004.21 |
| 应付管理人报酬 | | 5,010.88 | 6,475.50 |
| 应付托管费 | | 1,431.70 | 1,850.15 |
| 应付销售服务费 | | 1,100.20 | 1,437.40 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.7 | 173,797.05 | 277,497.82 |
| 负债合计 | | 200,802.76 | 308,265.08 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.8 | 6,186,385.15 | 7,201,190.94 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.9 | 2,412,700.69 | 3,537,444.55 |
| 净资产合计 | | 8,599,085.84 | 10,738,635.49 |
| 负债和净资产总计 | | 8,799,888.60 | 11,046,900.57 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，东方鼎新灵活配置混合 A 基金份额净值 1.3932 元，基金份额 2,981,248.79 份；东方鼎新灵活配置混合 C 基金份额净值 1.3870 元，基金份额 3,205,136.36 份。东方鼎新灵活配置混合份额总额合计 6,186,385.15 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -614,225.67 | -266,346.89 |
| 1. 利息收入 | | 5,458.33 | 11,295.03 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.10 | 5,458.33 | 10,679.80 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 615.23 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -531,683.66 | 151,501.76 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.11 | -569,315.94 | 7,578.85 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | -26,620.44 | -53,819.16 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.13 | - | - |
| 收益 | | | |
| 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 | 64,252.72 | 197,742.07 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -88,174.39 | -430,030.95 |
| 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 | 174.05 | 887.27 |
| 减：二、营业总支出 | | 79,201.82 | 220,773.69 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 32,733.64 | 91,799.80 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 9,352.51 | 32,785.63 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 7,331.63 | 26,171.69 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.19 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 3.56 | - |

| | | | |
|---------------------|----------|-------------|-------------|
| 8. 其他费用 | 6.4.7.20 | 29,780.48 | 70,016.57 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -693,427.49 | -487,120.58 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -693,427.49 | -487,120.58 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -693,427.49 | -487,120.58 |

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|---------------|---------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 7,201,190.94 | - | 3,537,444.55 | 10,738,635.49 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 7,201,190.94 | - | 3,537,444.55 | 10,738,635.49 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -1,014,805.79 | - | -1,124,743.86 | -2,139,549.65 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -693,427.49 | -693,427.49 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -1,014,805.79 | - | -431,316.37 | -1,446,122.16 |
| 其中：1. 基金申购款 | 756,505.73 | - | 315,258.19 | 1,071,763.92 |
| 2. 基金赎回款 | -1,771,311.52 | - | -746,574.56 | -2,517,886.08 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|----------------|----------------|
| 资产变动（净资产减少以“-”号填列） | | | | |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 6,186,385.15 | - | 2,412,700.69 | 8,599,085.84 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 43,498,534.70 | - | 26,015,892.10 | 69,514,426.80 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 43,498,534.70 | - | 26,015,892.10 | 69,514,426.80 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -28,193,010.22 | - | -18,093,108.24 | -46,286,118.46 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -487,120.58 | -487,120.58 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -28,193,010.22 | - | -17,605,987.66 | -45,798,997.88 |
| 其中：1. 基金申购款 | 8,076,017.80 | - | 4,335,015.92 | 12,411,033.72 |
| 2. 基金赎回款 | -36,269,028.02 | - | -21,941,003.58 | -58,210,031.60 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-----------|---------------|---|--------------|---------------|
| 四、本期期末净资产 | 15,305,524.48 | - | 7,922,783.86 | 23,228,308.34 |
|-----------|---------------|---|--------------|---------------|

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>王丹丹</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股份有限公司，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

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《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[2012]85 号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(2) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地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，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个

人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 759,103.53 |
| 等于：本金 | 759,029.79 |
| 加：应计利息 | 73.74 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 759,103.53 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|----|------------------------|------|--------------|------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 2,502,481.54 | - | 2,410,256.00 | -92,225.54 |

| | | | | |
|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 5,518,130.00 | 86,297.26 | 5,600,047.26 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 5,518,130.00 | 86,297.26 | 5,600,047.26 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 8,020,611.54 | 86,297.26 | 8,010,303.26 | -96,605.54 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

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 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 13,852.57 |
| 其中：交易所市场 | 13,852.57 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 159,944.48 |
| 合计 | 173,797.05 |

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

6.4.7.8 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|--------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,442,527.25 | 3,442,527.25 |
| 本期申购 | 31,535.66 | 31,535.66 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -492,814.12 | -492,814.12 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 2,981,248.79 | 2,981,248.79 |

东方鼎新灵活配置混合 C

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,758,663.69 | 3,758,663.69 |
| 本期申购 | 724,970.07 | 724,970.07 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,278,497.40 | -1,278,497.40 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 3,205,136.36 | 3,205,136.36 |

注：本期申购包含基金转换入、红利再投份额；赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.9 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 | 2,079,341.47 | -380,202.67 | 1,699,138.80 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 2,079,341.47 | -380,202.67 | 1,699,138.80 |
| 本期利润 | -282,695.00 | -45,793.17 | -328,488.17 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -257,655.78 | 59,367.04 | -198,288.74 |
| 其中：基金申购款 | 17,080.06 | -3,629.60 | 13,450.46 |
| 基金赎回款 | -274,735.84 | 62,996.64 | -211,739.20 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |

| | | | |
|-----|--------------|-------------|--------------|
| 本期末 | 1,538,990.69 | -366,628.80 | 1,172,361.89 |
|-----|--------------|-------------|--------------|

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 | 2,261,080.40 | -422,774.65 | 1,838,305.75 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 2,261,080.40 | -422,774.65 | 1,838,305.75 |
| 本期利润 | -322,558.10 | -42,381.22 | -364,939.32 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -297,646.22 | 64,618.59 | -233,027.63 |
| 其中：基金申购款 | 385,048.99 | -83,241.26 | 301,807.73 |
| 基金赎回款 | -682,695.21 | 147,859.85 | -534,835.36 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,640,876.08 | -400,537.28 | 1,240,338.80 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 5,274.71 |
| 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 | 172.96 |
| 其他 | 10.66 |
| 合计 | 5,458.33 |

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -569,315.94 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | -569,315.94 |

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |

| | |
|------------|---------------|
| 卖出股票成交总额 | 12,081,348.74 |
| 减：卖出股票成本总额 | 12,620,369.48 |
| 减：交易费用 | 30,295.20 |
| 买卖股票差价收入 | -569,315.94 |

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 41,642.48 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -68,262.92 |
| 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 | -26,620.44 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 4,423,373.40 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,449,773.65 |
| 减：应计利息总额 | 41,628.89 |
| 减：交易费用 | 233.78 |
| 买卖债券差价收入 | -68,262.92 |

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

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

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

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

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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 |
|---------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 64,252.72 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 64,252.72 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -88,174.39 |
| 股票投资 | -86,494.39 |
| 债券投资 | -1,680.00 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 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 | -88,174.39 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 162.96 |
| 基金转换费收入 | 11.09 |
| 合计 | 174.05 |

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 9,944.48 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 936.00 |

| | |
|-------|-----------|
| 账户维护费 | 18,900.00 |
| 合计 | 29,780.48 |

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 |
|--------------|--------------------|
| 东方基金管理股份有限公司 | 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，期末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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----|--|---|
| | | |

| | | |
|------------------|-----------|-----------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 32,733.64 | 91,799.80 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 12,076.47 | 22,602.11 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 20,657.17 | 69,197.69 |

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前五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、公休假等，支付日期顺延。

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 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 9,352.51 | 32,785.63 |

注：①计提标准：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。

③本基金于 2023 年 8 月 28 日，将托管费率自 0.25% 调整至 0.20%，详情请见《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2023 年 8 月修订）》。

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 |
|----------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 |
|----------------|--|------------------|-----------|
| 东方基金管理股份有限公司 | - | - | - |
| 合计 | - | - | - |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 |
| 东方基金管理股份有限公司 | - | 12,563.41 | 12,563.41 |
| 合计 | - | 12,563.41 | 12,563.41 |

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 | 759,103.53 | 5,274.71 | 11,714,419.54 | 10,623.28 |

6.4.10.7 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，本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

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 2024 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 2024 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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、风控部门组成的风险管理组织体系，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。本基金投资于具有良好信用等级的证券，并在法律法规规定和本基金基金合同约定的基础上，进一步进行分散化投资管理。

除通过上述措施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。

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 2024年6月30日 | 上年度末 2023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仅包含短期融资券及超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| - | 0.00 | - |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023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 |

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 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

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、央行票据、短期融资券、超短期融资券及同业存单等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 流动性风险

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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人严密监控基金申购赎回情况，预留充足可用现金头寸与之相匹配。本基金所持资产大部分可在证券交易所或银行间同业市场交易，除在本报告（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、计算并预留最优现金头寸；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 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 2024年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|------------|------|------|--------------|--------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 759,103.53 | - | - | - | 759,103.53 |
| 结算备付金 | 18,777.33 | - | - | - | 18,777.33 |
| 存出保证金 | 1,471.65 | - | - | - | 1,471.65 |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | 2,410,256.00 | 2,410,256.00 |

| | | | | | |
|--------------------------|--------------|-------|-------|--------------|--------------|
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 5,600,047.26 | - | - | - | 5,600,047.26 |
| 交易性金融资产-资产支持证券投资 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 10,232.83 | 10,232.83 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 6,379,399.77 | - | - | 2,420,488.83 | 8,799,888.60 |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 19,462.93 | 19,462.93 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 5,010.88 | 5,010.88 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,431.70 | 1,431.70 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,100.20 | 1,100.20 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 173,797.05 | 173,797.05 |
| 负债总计 | - | - | - | 200,802.76 | 200,802.76 |
| 利率敏感度缺口 | 6,379,399.77 | - | - | 2,219,686.07 | 8,599,085.84 |
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 6,208,114.32 | - | - | - | 6,208,114.32 |
| 结算备付金 | 23,054.10 | - | - | - | 23,054.10 |
| 存出保证金 | 965.24 | - | - | - | 965.24 |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | 3,185,650.00 | 3,185,650.00 |
| 交易性金融资产-债券投资 | 1,529,143.56 | - | - | - | 1,529,143.56 |
| 交易性金融资产-资产支持证券投资 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |

| | | | | |
|-----------|--------------|---|--------------|---------------|
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | 89,359.58 | 89,359.58 |
| 应收股利 | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | 10,613.77 | 10,613.77 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产总计 | 7,761,277.22 | - | 3,285,623.35 | 11,046,900.57 |
| 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 | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | 21,004.21 | 21,004.21 |
| 应付管理人报酬 | - | - | 6,475.50 | 6,475.50 |
| 应付托管费 | - | - | 1,850.15 | 1,850.15 |
| 应付销售服务费 | - | - | 1,437.40 | 1,437.40 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | 277,497.82 | 277,497.82 |
| 负债总计 | - | - | 308,265.08 | 308,265.08 |
| 利率敏感度缺口 | 7,761,277.22 | - | 2,977,358.27 | 10,738,635.49 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 市场利率上调 0.25% | -4,543.04 | -157.12 |
| | 市场利率下调 0.25% | 4,543.04 | 157.12 |

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。

本基金按照基金合同的约定和法律法规的规定进行投资，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 2024年6月30日 | | 上年度末 2023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 | 2,410,256.00 | 28.03 | 3,185,650.00 | 29.67 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 5,600,047.26 | 65.12 | 1,529,143.56 | 14.24 |
| 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 | 8,010,303.26 | 93.15 | 4,714,793.56 | 43.90 |

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 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

| | 动 | 本期末 (2024 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2023 年 12 月 31 日) |
|--|-------------------|-----------------------|-------------------------|
| | 沪深 300 指数上涨 5% | 103,683.11 | 135,537.98 |
| | 沪深 300 指数下跌 5% | -103,683.11 | -135,537.98 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 2,410,256.00 | 3,185,650.00 |
| 第二层次 | 5,600,047.26 | 1,529,143.56 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 8,010,303.26 | 4,714,793.56 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至中期报告报出日，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 | 2,410,256.00 | 27.39 |
| | 其中：股票 | 2,410,256.00 | 27.39 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 5,600,047.26 | 63.64 |
| | 其中：债券 | 5,600,047.26 | 63.64 |
| | 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 | 777,880.86 | 8.84 |
| 8 | 其他各项资产 | 11,704.48 | 0.13 |
| 9 | 合计 | 8,799,888.60 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 | - | - |
| B | 采矿业 | 316,218.00 | 3.68 |
| C | 制造业 | 1,254,301.00 | 14.59 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 27,280.00 | 0.32 |
| E | 建筑业 | 78,073.00 | 0.91 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 123,846.00 | 1.44 |

| | | | |
|---|-----------------|--------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 28,320.00 | 0.33 |
| J | 金融业 | 486,163.00 | 5.65 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 96,055.00 | 1.12 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,410,256.00 | 28.03 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|-------|------------|--------------|
| 1 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,600 | 124,540.00 | 1.45 |
| 2 | 600066 | 宇通客车 | 4,800 | 123,840.00 | 1.44 |
| 3 | 000338 | 潍柴动力 | 7,600 | 123,424.00 | 1.44 |
| 4 | 601633 | 长城汽车 | 4,500 | 113,850.00 | 1.32 |
| 5 | 002128 | 电投能源 | 5,000 | 105,500.00 | 1.23 |
| 6 | 000975 | 山金国际 | 6,400 | 104,256.00 | 1.21 |
| 7 | 601058 | 赛轮轮胎 | 7,200 | 100,800.00 | 1.17 |
| 8 | 688578 | 艾力斯 | 1,000 | 63,740.00 | 0.74 |
| 9 | 601919 | 中远海控 | 4,000 | 61,960.00 | 0.72 |
| 10 | 603658 | 安图生物 | 1,300 | 59,891.00 | 0.70 |
| 11 | 002048 | 宁波华翔 | 3,600 | 46,584.00 | 0.54 |
| 12 | 600273 | 嘉化能源 | 5,300 | 37,842.00 | 0.44 |
| 13 | 300679 | 电连技术 | 900 | 36,207.00 | 0.42 |
| 14 | 000429 | 粤高速 A | 3,400 | 35,394.00 | 0.41 |
| 15 | 601963 | 重庆银行 | 4,500 | 34,875.00 | 0.41 |
| 16 | 600153 | 建发股份 | 3,800 | 33,934.00 | 0.39 |
| 17 | 600039 | 四川路桥 | 4,200 | 33,138.00 | 0.39 |
| 18 | 002027 | 分众传媒 | 5,400 | 32,724.00 | 0.38 |
| 19 | 002557 | 洽洽食品 | 1,100 | 31,009.00 | 0.36 |
| 20 | 601225 | 陕西煤业 | 1,200 | 30,924.00 | 0.36 |
| 21 | 002032 | 苏泊尔 | 600 | 30,060.00 | 0.35 |
| 22 | 600755 | 厦门国贸 | 4,100 | 29,397.00 | 0.34 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|-----------|------|
| 23 | 600285 | 羚锐制药 | 1,200 | 29,052.00 | 0.34 |
| 24 | 601318 | 中国平安 | 700 | 28,952.00 | 0.34 |
| 24 | 603337 | 杰克股份 | 1,100 | 28,952.00 | 0.34 |
| 25 | 002139 | 拓邦股份 | 2,700 | 28,674.00 | 0.33 |
| 26 | 300857 | 协创数据 | 500 | 28,500.00 | 0.33 |
| 27 | 300253 | 卫宁健康 | 4,800 | 28,320.00 | 0.33 |
| 28 | 601166 | 兴业银行 | 1,600 | 28,192.00 | 0.33 |
| 29 | 688408 | 中信博 | 300 | 27,624.00 | 0.32 |
| 30 | 000651 | 格力电器 | 700 | 27,454.00 | 0.32 |
| 31 | 605368 | 蓝天燃气 | 2,000 | 27,280.00 | 0.32 |
| 32 | 601939 | 建设银行 | 3,600 | 26,640.00 | 0.31 |
| 33 | 601088 | 中国神华 | 600 | 26,622.00 | 0.31 |
| 34 | 688303 | 大全能源 | 1,300 | 26,507.00 | 0.31 |
| 35 | 601006 | 大秦铁路 | 3,700 | 26,492.00 | 0.31 |
| 36 | 601825 | 沪农商行 | 3,900 | 26,208.00 | 0.30 |
| 37 | 600177 | 雅戈尔 | 3,600 | 25,632.00 | 0.30 |
| 38 | 601665 | 齐鲁银行 | 5,200 | 25,532.00 | 0.30 |
| 39 | 601328 | 交通银行 | 3,400 | 25,398.00 | 0.30 |
| 40 | 601818 | 光大银行 | 8,000 | 25,360.00 | 0.29 |
| 41 | 601169 | 北京银行 | 4,300 | 25,112.00 | 0.29 |
| 42 | 605333 | 沪光股份 | 900 | 25,065.00 | 0.29 |
| 43 | 601988 | 中国银行 | 5,400 | 24,948.00 | 0.29 |
| 44 | 600348 | 华阳股份 | 2,500 | 24,900.00 | 0.29 |
| 45 | 600016 | 民生银行 | 6,500 | 24,635.00 | 0.29 |
| 46 | 601077 | 渝农商行 | 4,900 | 24,598.00 | 0.29 |
| 47 | 601838 | 成都银行 | 1,600 | 24,304.00 | 0.28 |
| 48 | 600873 | 梅花生物 | 2,400 | 24,048.00 | 0.28 |
| 49 | 600028 | 中国石化 | 3,800 | 24,016.00 | 0.28 |
| 50 | 600737 | 中粮糖业 | 2,500 | 23,975.00 | 0.28 |
| 51 | 601229 | 上海银行 | 3,300 | 23,958.00 | 0.28 |
| 52 | 600036 | 招商银行 | 700 | 23,933.00 | 0.28 |
| 53 | 600015 | 华夏银行 | 3,700 | 23,680.00 | 0.28 |
| 54 | 601916 | 浙商银行 | 8,500 | 23,460.00 | 0.27 |
| 55 | 600170 | 上海建工 | 10,900 | 23,435.00 | 0.27 |
| 56 | 000001 | 平安银行 | 2,300 | 23,345.00 | 0.27 |
| 57 | 603599 | 广信股份 | 1,900 | 23,047.00 | 0.27 |
| 58 | 600919 | 江苏银行 | 3,100 | 23,033.00 | 0.27 |
| 59 | 000672 | 上峰水泥 | 3,600 | 22,032.00 | 0.26 |
| 60 | 600997 | 开滦股份 | 3,200 | 21,952.00 | 0.26 |
| 61 | 600502 | 安徽建工 | 5,000 | 21,500.00 | 0.25 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 168,065.00 | 1.57 |
| 2 | 300253 | 卫宁健康 | 165,051.00 | 1.54 |
| 3 | 605500 | 森林包装 | 157,793.00 | 1.47 |
| 4 | 002991 | 甘源食品 | 157,311.00 | 1.46 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 156,448.00 | 1.46 |
| 6 | 301127 | 天源环保 | 155,312.00 | 1.45 |
| 7 | 600023 | 浙能电力 | 154,933.00 | 1.44 |
| 8 | 000883 | 湖北能源 | 154,746.00 | 1.44 |
| 9 | 688571 | 杭华股份 | 154,114.00 | 1.44 |
| 10 | 603511 | 爱慕股份 | 153,917.00 | 1.43 |
| 11 | 600637 | 东方明珠 | 153,237.00 | 1.43 |
| 12 | 603989 | 艾华集团 | 151,493.00 | 1.41 |
| 13 | 603859 | 能科科技 | 150,969.00 | 1.41 |
| 14 | 688100 | 威胜信息 | 150,581.03 | 1.40 |
| 15 | 601919 | 中远海控 | 141,664.00 | 1.32 |
| 16 | 601339 | 百隆东方 | 135,631.00 | 1.26 |
| 17 | 601169 | 北京银行 | 132,147.00 | 1.23 |
| 18 | 002818 | 富森美 | 129,018.00 | 1.20 |
| 19 | 000338 | 潍柴动力 | 128,286.00 | 1.19 |
| 20 | 600066 | 宇通客车 | 124,537.00 | 1.16 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 333,984.00 | 3.11 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 188,992.00 | 1.76 |
| 3 | 600023 | 浙能电力 | 156,376.00 | 1.46 |
| 4 | 000883 | 湖北能源 | 154,201.00 | 1.44 |
| 5 | 688616 | 西力科技 | 150,948.22 | 1.41 |
| 6 | 002991 | 甘源食品 | 145,564.00 | 1.36 |
| 7 | 601339 | 百隆东方 | 145,367.00 | 1.35 |
| 8 | 688100 | 威胜信息 | 138,107.95 | 1.29 |
| 9 | 002818 | 富森美 | 137,297.00 | 1.28 |
| 10 | 603989 | 艾华集团 | 134,416.00 | 1.25 |
| 11 | 600637 | 东方明珠 | 133,151.00 | 1.24 |
| 12 | 603511 | 爱慕股份 | 133,130.00 | 1.24 |
| 13 | 301127 | 天源环保 | 132,882.00 | 1.24 |
| 14 | 603859 | 能科科技 | 132,589.00 | 1.23 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 15 | 301043 | 绿岛风 | 131,270.00 | 1.22 |
| 16 | 605500 | 森林包装 | 128,805.00 | 1.20 |
| 17 | 688571 | 杭华股份 | 125,834.73 | 1.17 |
| 18 | 601166 | 兴业银行 | 123,172.00 | 1.15 |
| 19 | 300253 | 卫宁健康 | 122,008.00 | 1.14 |
| 20 | 000937 | 冀中能源 | 114,915.00 | 1.07 |

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 | 11,931,469.87 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 12,081,348.74 |

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 | 5,600,047.26 | 65.12 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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 | 5,600,047.26 | 65.12 |

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 | 019727 | 23 国债 24 | 55,000 | 5,600,047.26 | 65.12 |

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定的备选股票库。

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 | 1,471.65 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 10,232.83 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,704.48 |

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处于转股期的可转换债券。

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中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 | 766 | 3,891.97 | 0.00 | 0.00 | 2,981,248.79 | 100.00 |
| 东方鼎新灵活配置混合 C | 1,621 | 1,977.26 | 0.00 | 0.00 | 3,205,136.36 | 100.00 |
| 合计 | 2,387 | 2,591.70 | 0.00 | 0.00 | 6,186,385.15 | 100.00 |

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 | 1,206.85 | 0.04 |
| | 东方鼎新灵活配置混合 C | 0.00 | 0.00 |
| | 合计 | 1,206.85 | 0.02 |

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 | 3,442,527.25 | 3,758,663.69 |
| 本报告期基金总申购份额 | 31,535.66 | 724,970.07 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 492,814.12 | 1,278,497.40 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,981,248.79 | 3,205,136.36 |

注：基金总申购份额包含红利再投资、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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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

本基金于 2024 年 1 月 1 日将为基金提供审计服务的会计师事务所由立信会计师事务所(特殊普通合伙)变更为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)，该变更事项已经履行了必要的程序。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%) | |
| 天风证券股份有限公司 | 2 | 14,511,840.56 | 60.43 | 13,726.91 | 60.44 | - |
| 信达证券股份有限公司 | 2 | 6,302,582.05 | 26.25 | 5,960.73 | 26.24 | - |
| 华安证券股份有限公司 | 2 | 3,198,396.00 | 13.32 | 3,025.30 | 13.32 | - |
| 国投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 公司 | | | | | | |
| 广发证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 首创证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 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 资质雄厚，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。最近一年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚，或处罚未对其研究服务业务产生重大影响；④ 合规风控能力较强，具备健全的风险管理机制、合规管理机制和信息管理机制；⑤ 具备为公募基金提供

交易服务所需的业务资格，能够提供高效、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具备为公募基金提供研究服务所需的业务资格，建立完善的研究报告质量控制和合规保障机制，具备独立客观的研究观点，能够提供各类研究服务支持，形式包括但不限于线上/线下路演、线上/线下会议、沟通交流、调研活动、数据支持、专题研讨、委托课题、金股推介等；⑦证监系统白名单券商优先纳入合作对象；⑧证监会券商分类标准原则上 CCC 级以下不纳入合作对象；⑨收取的佣金率满足各项法律法规、监管政策的相关规定。

券商选择程序：每年定期根据已租用交易单元的券商提供的资质说明，经交易佣金管理小组审议通过后，建立公司内部券商白名单。如有新增券商，在履行上述程序通过后，可不定期加入公司内部白名单。

(3) 本报告期内本基金交易单元未发生变化。

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 (%) |
| 天风证券股份有限公司 | 11,371,161.55 | 100.00 | - | - | - | - |
| 信达证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 有限公司 | | | | | | |
| 东北证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 司 | | | | | | |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

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 | 东方基金管理股份有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 1 月 2 日 |
| 2 | 东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 1 月 20 日 |
| 3 | 关于增加上海大智慧基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时参与申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 2 月 5 日 |
| 4 | 关于提醒投资者防范不法分子仿冒我司名义从事诈骗活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 2 月 23 日 |
| 5 | 东方基金管理股份有限公司关于终止和合期货有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 2 月 23 日 |
| 6 | 关于旗下部分基金参与深圳前海微众银行股份有限公司申购费率优惠活动 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券 | 2024 年 2 月 29 日 |

| | | | |
|----|---|---|-----------------|
| | 的公告 | 报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 7 | 关于增加江苏银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构并参加申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 14 日 |
| 8 | 关于旗下部分基金参与玄元保险代理有限公司申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 15 日 |
| 9 | 关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司等两家机构申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 27 日 |
| 10 | 东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 30 日 |
| 11 | 东方基金管理股份有限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 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 4 月 2 日 |
| 12 | 东方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资北交所股票及相关风险提示的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 4 月 10 日 |
| 13 | 东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 14 | 东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号） | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 6 月 4 日 |
| 15 | 东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 6 月 4 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 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、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、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。

12.3 查阅方式

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。

东方基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 31 日