

东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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	5
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 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内容的真实、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	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48

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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 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	74,024,890.54 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	27,448,697.24 份	46,576,193.30 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 号楼 远洋锐中心 26 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100073	100140
法定代表人		崔伟	陈四清

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

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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 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	5,048,361.33	5,668,899.86	
本期利润	-6,474,491.23	-7,482,582.50	
加权平均基金份额本期利润	-0.0888	-0.0785	
本期加权平均净值利润率	-5.53%	-4.86%	
本期基金份额净值增长率	-1.45%	-1.61%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
	期末可供分配利润	16,664,713.88	28,487,474.79
	期末可供分配基金份额利润	0.6071	0.6116
	期末基金资产净值	44,817,095.73	76,162,601.12
	期末基金份额净值	1.6328	1.6352
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
	基金份额累计净值增长率	63.28%	56.66%

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	2.15%	0.26%	0.66%	0.00%	1.49%	0.26%
过去三个月	3.00%	0.36%	1.99%	0.00%	1.01%	0.36%
过去六个月	-1.45%	0.40%	3.97%	0.00%	-5.42%	0.40%
过去一年	0.06%	0.36%	8.00%	0.00%	-7.94%	0.36%
过去三年	30.40%	0.34%	24.00%	0.00%	6.40%	0.34%
自基金合同生效起至今	63.28%	0.61%	57.56%	0.00%	5.72%	0.61%

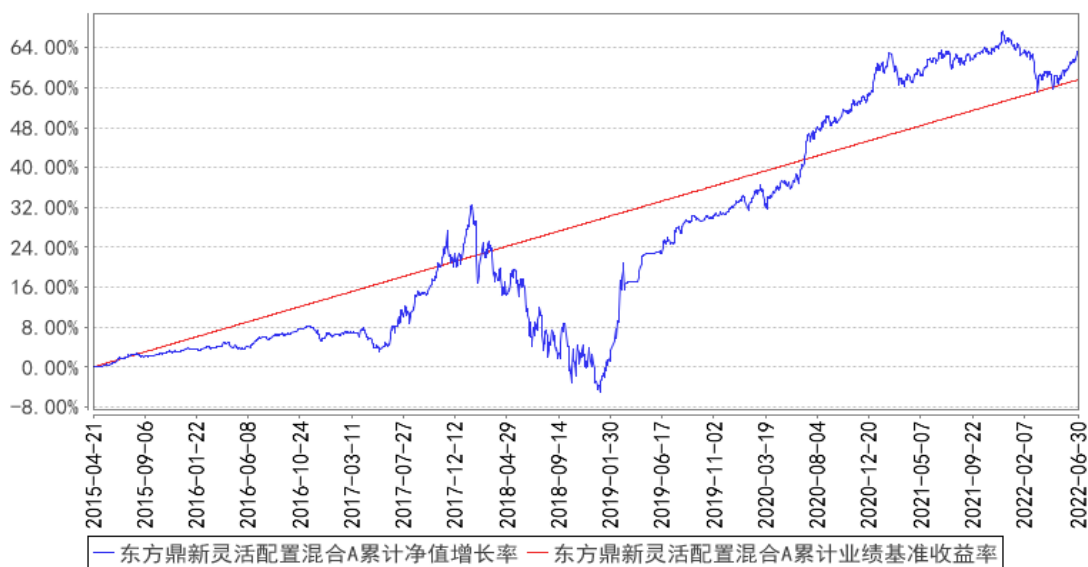
东方鼎新灵活配置混合 C

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	2.12%	0.26%	0.66%	0.00%	1.46%	0.26%
过去三个月	2.92%	0.36%	1.99%	0.00%	0.93%	0.36%
过去六个月	-1.61%	0.40%	3.97%	0.00%	-5.58%	0.40%

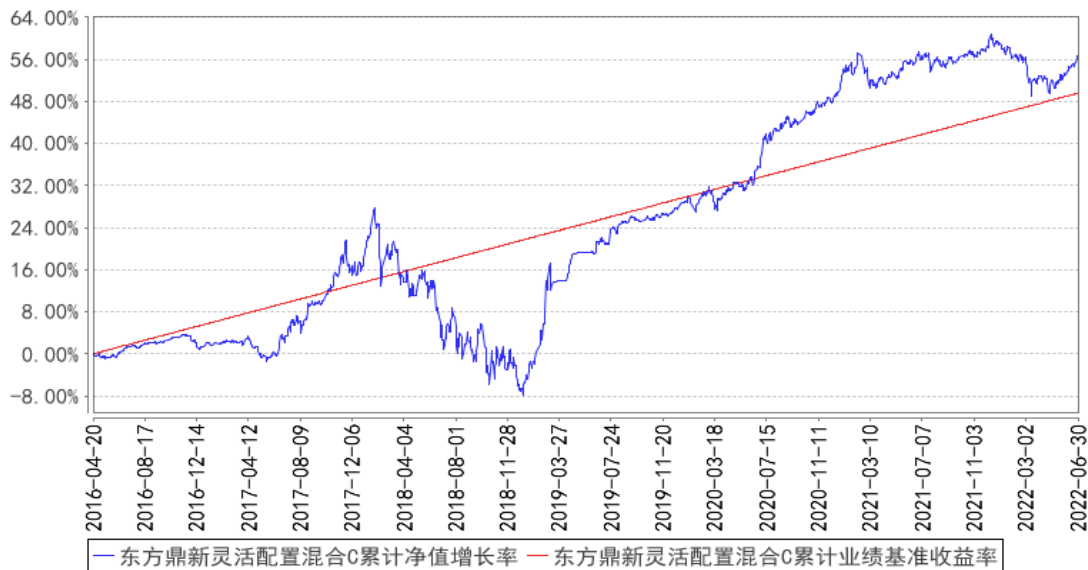
过去一年	-0.25%	0.36%	8.00%	0.00%	-8.25%	0.36%
过去三年	29.15%	0.34%	24.00%	0.00%	5.15%	0.34%
自基金合同生效起至今	56.66%	0.66%	49.56%	0.00%	7.10%	0.66%

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2022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%；天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持有本公司股份3.37%；天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止2022年6月30日，本公司管理57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、东方成长回报平衡混合型证券投资基金、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、东方金元宝货币市场基金、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、东方区域发展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、东方民丰回报赢安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、东方量化成长灵活配置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、东方臻宝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、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方城镇消费主题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、东方欣利混合型证券投资基金、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。

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、量化投资部副总经理	2018 年 9 月 12 日	-	7 年	量化投资部副总经理，华威大学经济与国际金融经济学硕士，7 年投资从业经历。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，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。
王怀勋	本基金基金经理助理	2021 年 3 月 17 日	2022 年 5 月 17 日	7 年	中国人民大学金融专业硕士，7 年证券从业经历。曾任中国人寿保险股份有限公司研发人员。2015 年加盟本基金管理人，曾任产品开发部产品经理助理、专户投资部产品经理、量化投资部研究员，东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理助理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方量化多策略混合型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。

注：①2022 年 7 月 20 日，公司发布了《东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自 7 月 20 日起盛泽（先生）担任东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理。

②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。

③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合规守信情况的说明

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

2022 年上半年，市场的核心矛盾主要围绕着“全球性通胀、国内疫情反复、以及美联储加息缩表”展开。分阶段来看，第一阶段为年初至四月底，全球市场受成本型通胀抬升以及俄罗斯资源品出口制裁等因素的影响，大宗商品价格大幅波动对国内外市场均造成了不同程度的影响。叠加美联储加息、缩表等操作的影响，外资流动性挤压进一步加快了 A 股市场的估值消化过程。因此，在此期间市场整体下行，且估值较高的成长板块跌幅较大，而低估值板块相对占优，上游原材料板块表现突出。第二阶段为四月底至二季度末，A 股触底反弹，高成长、高景气占优，市场风格也从价值重回成长。背后的原因我们认为有以下三点：其一，国内疫情在一季度呈现多发态势，尤其经济重镇上海受疫情影响较大，此后上海复产复工加速，新能源汽车销量超预期等因素使得市场对高景气成长板块的悲观情绪有所缓解；其二，受市场原材料价格大幅度上涨的影响，需求端增长放缓，全球发达经济体逐渐步入滞胀周期，大宗商品价格受此影响回调较大；其三，国内稳增长政策逐步加码，维稳经济基本面。但是根据社融等数据显示内需复苏依然较弱，货币政策较难突然转向。宏观流动性较为乐观且中性利率较为稳定的背景下，前期估值压缩较大的高景气度板块反弹较为显著。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-1.45%，业绩比较基准收益率为 3.97%，低于业绩比较基准 5.42%；本基金 C 类净值增长率为-1.61%，业绩比较基准收益率为 3.97%，低于业绩比较基准 5.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然今年上半年市场经历了宽幅调整后大幅度反弹，但是反弹主要发生在结构性板块当中，行业方面，汽车、电新、机械反弹幅度最大，仅有地产为负收益，风格和行业上的分化主要是由于高估值、高弹性的股票反弹较多，防御板块反弹力度小所致。今年整体宏观环境依然较为复杂，尤其在“供给冲击、需求收缩、预期减弱”的宏观背景下，经济下行压力较大。在此背景下，风险类资产的波动会有所放大，市场对流动性较为宽松的预期更容易引发概念类板块类的集中交易行情，从而导致板块交易过热。在权益投资方面，我们尽量规避估值抬升过高的板块，而是综合

考量景气度和估值，选取更具性价比的板块，进而从中精选个股。与此同时，海外通胀预期虽然有所缓解，但是对于输入性通胀仍然需要保持警惕。今年上半年，我们发现在外部冲击较大的情况下，市场调整幅度较大，波动加剧。为避免风险类资产在此环境中出现大幅回撤，我们运用风险模型严格控制组合的风险暴露，力争获取稳定的产品超额收益。

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股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营高管、分管投研高管、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益投资部、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）。

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，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。

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 2022 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,144,026.96	21,462,809.56
结算备付金		-	22,728.62
存出保证金		22,438.98	13,073.03
交易性金融资产	6.4.7.2	115,650,180.26	400,884,229.34
其中：股票投资		25,966,369.96	126,615,629.34
基金投资		-	-
债券投资		89,683,810.30	274,268,600.00
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	3,150,258.90	-
债权投资		-	-
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		-	292,203.93
应收股利		-	-
应收申购款		88,499.80	65,857.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	4,398,703.02
资产总计		123,055,404.90	427,139,605.13
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		84.28	-
应付赎回款		1,641,089.22	399,102.00
应付管理人报酬		75,515.87	251,495.44
应付托管费		26,969.94	89,819.81
应付销售服务费		20,246.02	75,379.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,667.04	19,843.78
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	301,135.68	361,475.42
负债合计		2,075,708.05	1,197,115.45
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	74,024,890.54	256,536,640.48
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	46,954,806.31	169,405,849.20
净资产合计		120,979,696.85	425,942,489.68
负债和净资产总计		123,055,404.90	427,139,605.13

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，东方鼎新灵活配置混合 A 基金份额净值 1.6328 元，基金份额总额 27,448,697.24 份；东方鼎新灵活配置混合 C 基金份额净值 1.6352 元，基金份额总额 46,576,193.30 份。东方鼎新灵活配置混合份额总额合计为 74,024,890.54 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-12,306,983.91	26,891,642.05
1. 利息收入		40,526.08	7,407,852.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	24,009.43	29,327.75
债券利息收入		-	6,942,116.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,516.65	436,408.66
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,127,756.00	19,611,549.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,213,391.82	19,629,394.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,572,034.69	-1,268,543.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	342,329.49	1,250,699.41
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）	6.4.7.16	-24,674,334.92	-160,334.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	199,068.93	32,574.69
减：二、营业总支出		1,650,089.82	3,707,262.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	954,637.72	2,130,400.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	340,942.08	760,857.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	231,664.36	438,144.13
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		175.89	1,186.51
其中：卖出回购金融资产支出		175.89	1,186.51
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		10,665.88	18,784.62
8. 其他费用	6.4.7.19	112,003.89	357,890.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,957,073.73	23,184,379.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,957,073.73	23,184,379.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,957,073.73	23,184,379.49

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	256,536,640.48	-	169,405,849.20	425,942,489.68
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	256,536,640.48	-	169,405,849.20	425,942,489.68
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	-182,511,749.94	-	-122,451,042.89	-304,962,792.83
(一)、 综合收 益总额	-	-	-13,957,073.73	-13,957,073.73
(二)、 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)	-182,511,749.94	-	-108,493,969.16	-291,005,719.10
其中:1. 基金申 购款	59,801,151.82	-	38,346,840.10	98,147,991.92
2 .基金 赎回 款	-242,312,901.76	-	-146,840,809.26	-389,153,711.02
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综	-	-	-	-

合收益 结转留 存收益				
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	74,024,890.54	-	46,954,806.31	120,979,696.85
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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(基 金净值)	377,176,512.35	-	216,987,856.04	594,164,368.39
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期 期初净 资产(基 金净值)	377,176,512.35	-	216,987,856.04	594,164,368.39
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-5,422,048.40	-	19,250,753.77	13,828,705.37
(一)、 综合收 益总额	-	-	23,184,379.49	23,184,379.49
(二)、 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)	-5,422,048.40	-	-3,933,625.72	-9,355,674.12

其中:1. 基金申购款	70,090,137.66	-	41,793,813.62	111,883,951.28
2. 基金赎回款	-75,512,186.06	-	-45,727,439.34	-121,239,625.40
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合 收益结转 留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资 产(基金 净值)	371,754,463.95	-	236,238,609.81	607,993,073.76

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：

刘鸿鹏

刘鸿鹏

王丹丹

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者,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颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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》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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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

除下述会计政策说明中涉及的变更外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最

近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或

源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收

入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

（3）公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下简称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会[2020]22 号），公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据

将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息，金额分别为人民币 21,462,809.56 元、人民币 22,728.62 元、人民币 13,073.03 元、人民币 4,398,703.02 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、债权投资、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、债权投资等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。债权投资确认预期信用损失准备人民币 0 元。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、债权投资的金额分别为人民币 21,464,699.22 元、人民币 22,738.82 元、人民币 13,078.93 元、人民币 0 元，应收利息转入交易性金融资产为人民币 4,396,797.26 元。

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对财务报表列报和披露产生重大影响。

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》、[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《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]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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项

列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、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。

4、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。

5、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。

6、基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7、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 2022 年 6 月 30 日

活期存款	4,144,026.96
等于：本金	4,143,146.17
加：应计利息	880.79
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	4,144,026.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	22,314,549.19	-	25,966,369.96	3,651,820.77	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	18,004,143.83	330,805.48	18,362,805.48	27,856.17
	银行间市场	70,195,662.99	868,004.82	71,321,004.82	257,337.01
	合计	88,199,806.82	1,198,810.30	89,683,810.30	285,193.18
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	110,514,356.01	1,198,810.30	115,650,180.26	3,937,013.95	

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

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	3,150,258.90	-
合计	3,150,258.90	-

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	55,338.11
其中：交易所市场	52,725.78
银行间市场	2,612.33
应付利息	-
预提费用	245,780.45
合计	301,135.68

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和债券账户维护费。

6.4.7.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,498,822.02	77,498,822.02
本期申购	47,504,193.59	47,504,193.59
本期赎回（以“-”号填列）	-97,554,318.37	-97,554,318.37
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	27,448,697.24	27,448,697.24

东方鼎新灵活配置混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	179,037,818.46	179,037,818.46
本期申购	12,296,958.23	12,296,958.23
本期赎回（以“-”号填列）	-144,758,583.39	-144,758,583.39
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	46,576,193.30	46,576,193.30

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。

6.4.7.8 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
本期期初	42,122,561.90	8,783,506.19	50,906,068.09
本期利润	5,048,361.33	-11,522,852.56	-6,474,491.23
本期基金份额交易产生的变动数	-30,506,209.35	3,443,030.98	-27,063,178.37
其中：基金申购款	25,938,544.55	4,844,110.64	30,782,655.19
基金赎回款	-56,444,753.90	-1,401,079.66	-57,845,833.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,664,713.88	703,684.61	17,368,398.49

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
本期期初	98,528,129.35	19,971,651.76	118,499,781.11
本期利润	5,668,899.86	-13,151,482.36	-7,482,582.50
本期基金份额交易产生的变动数	-75,709,554.42	-5,721,236.37	-81,430,790.79
其中：基金申购款	7,014,211.37	549,973.54	7,564,184.91
基金赎回款	-82,723,765.79	-6,271,209.91	-88,994,975.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,487,474.79	1,098,933.03	29,586,407.82

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	23,219.33
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	650.70
其他	139.40
合计	24,009.43

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,213,391.82
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	8,213,391.82

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	145,454,152.46
减：卖出股票成本总额	136,880,563.73
减：交易费用	360,196.91
买卖股票差价收入	8,213,391.82

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,300,022.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	272,012.16
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	3,572,034.69

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	267,514,829.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	261,734,393.64

减：应计利息总额	5,504,176.05
减：交易费用	4,247.90
买卖债券差价收入	272,012.16

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	342,329.49
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	342,329.49

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-24,674,334.92
股票投资	-24,565,959.23
债券投资	-108,375.69
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	-24,674,334.92

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	198,392.47

基金转换费收入	676.46
合计	199,068.93

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	6,863.44
账户维护费	18,360.00
合计	112,003.89

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，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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	954,637.72	2,130,400.10
其中：支付销售机构的客户维护费	86,976.11	81,031.20

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70%的年费率计算，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	340,942.08	760,857.20

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

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	132,736.58	132,736.58
合计	-	132,736.58	132,736.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	378,163.21	378,163.21
合计	-	378,163.21	378,163.21

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 5 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	4,144,026.96	23,219.33	755,594.44	28,221.97

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，本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022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	受限期	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
300834	星辉	2022年	6个月	新股流	55.57	30.01	276	15,337.32	8,282.76	-

	环材	1月6日		通受限							
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.44	577	6,577.80	11,793.88		-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股流通受限	50.31	70.30	301	15,143.31	21,160.30		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.58	257	10,344.25	7,859.06		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.50	157	10,060.56	5,887.50		-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.48	232	16,864.08	16,583.36		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.40	193	10,977.84	10,885.20		-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.82	1,303	22,502.81	19,310.46		-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	20.08	20.33	373	7,489.84	7,583.09		-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	10.80	16.16	84,004	907,243.20	1,357,504.64		-

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 2022 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 2022 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、风险管理部、合规法务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。

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 2022年6月30日	上年度末 2021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 2022年6月30日	上年度末 2021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

6.4.13.2.3 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	61,573,035.07	201,808,000.00
AAA 以下	0.00	10,156,000.00
未评级	10,164,358.90	30,296,000.00
合计	71,737,393.97	242,260,000.00

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	9,856,630.03	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	9,856,630.03	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

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 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 2022 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	4,144,026.96	-	-	-	4,144,026.96
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	22,438.98	-	-	-	22,438.98
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	25,966,369.96	25,966,369.96
交易性金融资产-债券投资	59,133,436.60	30,550,373.70	-	-	89,683,810.30
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,150,258.90	-	-	-	3,150,258.90
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	88,499.80	88,499.80
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	66,450,161.44	30,550,373.70	-	26,054,869.76	123,055,404.90
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	84.28	84.28
应付赎回款	-	-	-	1,641,089.22	1,641,089.22
应付管理人报酬	-	-	-	75,515.87	75,515.87
应付托管费	-	-	-	26,969.94	26,969.94
应付销售服务费	-	-	-	20,246.02	20,246.02
应交税费	-	-	-	10,667.04	10,667.04
其他负债	-	-	-	301,135.68	301,135.68
负债总计	-	-	-	2,075,708.05	2,075,708.05
利率敏感度缺口	66,450,161.44	30,550,373.70	-	23,979,161.71	120,979,696.85
上年度末 2021 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	21,462,809.56	-	-	-	21,462,809.56
结算备付金	22,728.62	-	-	-	22,728.62
存出保证金	13,073.03	-	-	-	13,073.03
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	126,615,629.34	126,615,629.34
交易性金融资产-债券投资	142,972,600.00	121,404,000.00	9,892,000.00	-	274,268,600.00
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	292,203.93	292,203.93
应收利息	-	-	-	4,398,703.02	4,398,703.02
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	65,857.63	65,857.63
资产总计	164,471,211.21	121,404,000.00	9,892,000.00	131,372,393.92	427,139,605.13

负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	399,102.00	399,102.00
应付管理人报酬	-	-	-	251,495.44	251,495.44
应付托管费	-	-	-	89,819.81	89,819.81
应付交易费用	-	-	-	27,417.62	27,417.62
应付销售服务费	-	-	-	75,379.00	75,379.00
应交税费	-	-	-	19,843.78	19,843.78
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	334,057.80	334,057.80
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	1,197,115.45	1,197,115.45
利率敏感度缺口	164,471,211.21	121,404,000.00	9,892,000.00	130,175,278.47	425,942,489.68

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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上调 0.25%	-292,540.38	-1,139,702.25
	市场利率下调 0.25%	149,065.59	674,966.25

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 2022年6月30日	上年度末 2021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	25,966,369.96	21.46	126,615,629.34	29.73
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	89,683,810.30	74.13	274,268,600.00	64.39
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	115,650,180.26	95.59	400,884,229.34	94.12

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		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上涨 5%	1,334,313.53	6,819,137.89
	沪深 300 指数下跌 5%	-1,334,313.53	-6,819,137.89

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	24,499,519.71	122,923,288.74
第二层次	89,683,810.30	274,349,553.93
第三层次	1,466,850.25	3,611,386.67
合计	115,650,180.26	400,884,229.34

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

截止中期报告报出日，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	25,966,369.96	21.10
	其中：股票	25,966,369.96	21.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	89,683,810.30	72.88
	其中：债券	89,683,810.30	72.88
	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	3,150,258.90	2.56

	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	4,144,026.96	3.37
8	其他各项资产	110,938.78	0.09
9	合计	123,055,404.90	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	3,238,921.44	2.68
C	制造业	15,530,404.93	12.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	566,313.00	0.47
E	建筑业	19,750.00	0.02
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,085,167.00	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	979,840.00	0.81
J	金融业	3,702,206.50	3.06
K	房地产业	579,090.00	0.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	264,677.09	0.22
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	25,966,369.96	21.46

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	600519	贵州茅台	900	1,840,500.00	1.52
2	600938	中国海油	84,004	1,357,504.64	1.12
3	600036	招商银行	32,000	1,350,400.00	1.12
4	300750	宁德时代	2,000	1,068,000.00	0.88
5	601166	兴业银行	50,700	1,008,930.00	0.83
6	300122	智飞生物	8,000	888,080.00	0.73

7	000568	泸州老窖	3,500	862,890.00	0.71
8	002142	宁波银行	23,250	832,582.50	0.69
9	002460	赣锋锂业	5,200	773,240.00	0.64
10	600256	广汇能源	69,200	729,368.00	0.60
11	600438	通威股份	12,000	718,320.00	0.59
12	600875	东方电气	43,600	717,220.00	0.59
13	600884	杉杉股份	24,100	716,252.00	0.59
14	601088	中国神华	21,100	702,630.00	0.58
15	300613	富瀚微	8,160	691,968.00	0.57
16	603260	合盛硅业	5,700	672,372.00	0.56
17	600089	特变电工	23,100	632,709.00	0.52
18	603392	万泰生物	4,060	630,518.00	0.52
19	300223	北京君正	5,600	595,000.00	0.49
20	600027	华电国际	144,100	566,313.00	0.47
21	600018	上港集团	92,300	538,109.00	0.44
22	600887	伊利股份	13,200	514,140.00	0.42
23	002092	中泰化学	65,000	504,400.00	0.42
24	300760	迈瑞医疗	1,600	501,120.00	0.41
25	601600	中国铝业	105,100	499,225.00	0.41
26	300390	天华超净	5,400	471,960.00	0.39
27	601699	潞安环能	30,740	449,418.80	0.37
28	000002	万 科 A	21,600	442,800.00	0.37
29	600585	海螺水泥	12,200	430,416.00	0.36
30	000625	长安汽车	23,842	412,943.44	0.34
31	600309	万华化学	4,200	407,358.00	0.34
32	601006	大秦铁路	55,400	365,086.00	0.30
33	002001	新 和 成	14,784	337,223.04	0.28
34	002240	盛新锂能	5,000	301,800.00	0.25
35	600050	中国联通	83,200	287,872.00	0.24
36	600690	海尔智家	9,400	258,124.00	0.21
37	300759	康龙化成	2,700	257,094.00	0.21
38	000001	平安银行	16,300	244,174.00	0.20
39	000425	徐工机械	35,000	188,650.00	0.16
40	000338	潍柴动力	14,900	185,803.00	0.15
41	601598	中国外运	46,900	181,972.00	0.15
42	600104	上汽集团	9,600	170,976.00	0.14
43	601009	南京银行	14,800	154,216.00	0.13
44	000069	华侨城 A	21,000	136,290.00	0.11
45	601881	中国银河	6,600	63,822.00	0.05
46	600066	宇通客车	5,700	49,305.00	0.04
47	601838	成都银行	2,900	48,082.00	0.04
48	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03

49	002056	横店东磁	1,200	31,944.00	0.03
50	301122	采纳股份	301	21,160.30	0.02
51	601186	中国铁建	2,500	19,750.00	0.02
52	301217	铜冠铜箔	1,303	19,310.46	0.02
53	301201	诚达药业	232	16,583.36	0.01
54	301116	益客食品	577	11,793.88	0.01
55	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
56	301207	华兰疫苗	193	10,885.20	0.01
57	300834	星辉环材	276	8,282.76	0.01
58	301181	标榜股份	257	7,859.06	0.01
59	301228	实朴检测	373	7,583.09	0.01
60	301196	唯科科技	157	5,887.50	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601919	中远海控	2,676,551.00	0.63
2	601390	中国中铁	2,205,250.00	0.52
3	601988	中国银行	2,185,366.00	0.51
4	600028	中国石化	2,129,762.00	0.50
5	000776	广发证券	2,129,277.00	0.50
6	601688	华泰证券	2,030,659.00	0.48
7	601600	中国铝业	2,024,553.00	0.48
8	601668	中国建筑	1,903,819.00	0.45
9	600089	特变电工	1,871,725.38	0.44
10	300613	富瀚微	1,864,760.00	0.44
11	000039	中集集团	1,864,570.00	0.44
12	000877	天山股份	1,857,864.00	0.44
13	300821	东岳硅材	1,852,212.00	0.43
14	600884	杉杉股份	1,830,802.00	0.43
15	300223	北京君正	1,829,996.00	0.43
16	600352	浙江龙盛	1,795,635.00	0.42
17	300782	卓胜微	1,778,429.00	0.42
18	001979	招商蛇口	1,750,972.00	0.41
19	600426	华鲁恒升	1,743,746.00	0.41
20	603392	万泰生物	1,354,048.00	0.32

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	600036	招商银行	7,813,812.72	1.83
2	600905	三峡能源	6,172,788.40	1.45
3	600519	贵州茅台	5,659,306.00	1.33
4	300750	宁德时代	3,849,074.33	0.90
5	000333	美的集团	3,674,814.00	0.86
6	300059	东方财富	3,230,348.06	0.76
7	601166	兴业银行	2,985,096.68	0.70
8	000858	五粮液	2,938,760.00	0.69
9	002594	比亚迪	2,737,330.00	0.64
10	601919	中远海控	2,338,987.00	0.55
11	002415	海康威视	2,330,016.00	0.55
12	600030	中信证券	2,326,588.30	0.55
13	601012	隆基绿能	2,326,003.12	0.55
14	601390	中国中铁	2,246,142.00	0.53
15	300782	卓胜微	2,240,068.00	0.53
16	601988	中国银行	2,229,718.00	0.52
17	603259	药明康德	2,213,872.72	0.52
18	600887	伊利股份	2,168,776.00	0.51
19	600028	中国石化	2,161,876.00	0.51
20	000776	广发证券	2,045,466.00	0.48

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	60,797,263.58
卖出股票收入（成交）总额	145,454,152.46

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	8,089,786.30	6.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	10,273,019.18	8.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	61,464,374.79	50.81
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,856,630.03	8.15
9	其他	-	-
10	合计	89,683,810.30	74.13

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	101762054	17 浙国贸 MTN002	100,000	10,542,778.08	8.71
2	101901366	19 中化工 MTN005	100,000	10,308,543.01	8.52
3	143263	17 平租 04	100,000	10,273,019.18	8.49
4	102100432	21 首开 MTN001	100,000	10,257,211.51	8.48
5	102101045	21 招金 MTN001	100,000	10,164,358.90	8.40

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

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

本基金所持有的招商银行(600036.SH)于2022-03-21被中国银行保险监督管理委员会公开处罚。主要违法事实:招商银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为:一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差;二、漏报贷款核销业务 EAST 数据;三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据等十三项。招商银行(600036.SH)于2021-11-18被中国银行保险监督管理委员会上海监管局公开处罚,责令改正。主要违法事实:未按照保险公司提供的销售合同条款全面、

客观揭示所代销保险产品风险。招商银行(600036.SH)于近一年内公告了招商银行股份有限公司广州分行等多个分支机构被中国人民银行广州分行等监管机构分别处以处罚,主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。招商银行(600036.SH)于近一年内公告了周园斌等多位公司高管被中国银行保险监督管理委员会上海监管局等监管机构分别处以处罚,违法事实涉及:2020年7月至9月,周园斌对招商银行上海分行部分个人贷款变相用于购房负直接管理责任等。

本基金所持有的兴业银行(601166.SH)于2022-03-21被中国银行保险监督管理委员会公开处罚。主要违法事实:兴业银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为:一、漏报贸易融资业务 EAST 数据;二、漏报贷款核销业务 EAST 数据;三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据等十四项。兴业银行(601166.SH)于2022-02-25被中国银行保险监督管理委员会公开处罚。主要违法事实:2019年至2020年3月底,兴业银行信用卡中心在代理中美联泰大都会人寿保险有限公司的保险销售外呼业务中,存在夸大保险责任等销售误导行为,涉及业务8笔,保费2.48万元。兴业银行(601166.SH)于2021-08-13被中国人民银行公开处罚。主要违法事实:违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定。兴业银行(601166.SH)于近一年内公告了兴业银行股份有限公司呼和浩特分行等多个分支机构被中国人民银行呼和浩特市中心支行等监管机构分别处以处罚,主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。兴业银行(601166.SH)于近一年内公告了刘小威等多位分支行高管被中国银行保险监督管理委员会宿迁监管分局等监管机构分别处以处罚,违法事实涉及:对兴业银行股份有限公司宿迁分行房地产开发贷款贷后管理不尽职责主要责任等。

本基金所持有的宁波银行(002142.SZ)于2022-05-27被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局公开处罚。主要违法事实:非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位等。宁波银行(002142.SZ)于2022-04-21被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局公开处罚。主要违法事实:薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位等。宁波银行(002142.SZ)于2022-04-11被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局公开处罚。主要违法事实:代理保险销售不规范。宁波银行(002142.SZ)于2022-04-11被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局公开处罚。主要违法事实:信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位。宁波银行(002142.SZ)于2021-12-29被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局公开处罚。主要违法事实:信用卡业务管理不到位。宁波银行(002142.SZ)于2021-07-30被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局公开处罚。主要违法事实:贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储;开发贷款支用审核不严;房地产贷款放款和支用环节审核不严等。宁波银行(002142.SZ)于2021-07-14被中国人民银行宁波市中心支

行公开处罚,公开批评。主要违法事实:1. 违规为存款人多头开立银行结算账户; 2. 超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料; 3. 占压财政存款等 6 项。宁波银行(002142.SZ)于近一年内公告了宁波银行温州分行等多个分支机构被中国银行保险监督管理委员会温州监管分局等监管机构分别处以处罚,主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。宁波银行(002142.SZ)于近一年内公告了陈良等多位公司高管被中国银行保险监督管理委员会江苏监管局等监管机构分别处以处罚,违法事实涉及:对宁波银行股份有限公司南京中山北路支行流动资金贷款贷后管理不到位负管理责任等。

本基金所持有的赣锋锂业(002460.SZ)于 2022-06-08 被深圳证券交易所监管关注。主要违法事实:公司于 2022 年 5 月 17 日披露的《关于深圳证券交易所对公司 2021 年年度报告问询函回函的公告》显示,2022 年 2 月,公司与上海聚锦归企业管理合伙企业(有限合伙)共同投资设立新余赣锋矿业有限公司(以下简称“赣锋矿业”),公司出资 10.85 亿元,持有赣锋矿业 62%的股权,占 2020 年经审计净资产的 10.13%,公司未及时对上述投资事项履行信息披露义务。公司于 2021 年 3 月 9 日披露的《关于收购伊犁鸿大 100%财产份额涉及矿业权投资的公告》显示,公司拟以 14.70 亿元收购伊犁鸿大基业股权投资合伙企业(有限合伙)100%财产份额,公司于 2022 年 3 月 31 日披露的《2021 年年度报告》显示,上述收购事项已于 2021 年 12 月 3 日完成,公司未及时披露有关交付或者过户事宜。

以上事项不会对各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) 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告或者量化投资策略,为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议,讨论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范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金投资计划,主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,监察稽核部、合规法务部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资上述公司主要基于以下原因:该基金基于基本面进行选股,选择盈利增速较高、基本面向好、估值较低等符合选股标准的股票进行分散投资。

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 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	22,438.98
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	88,499.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	110,938.78

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600938	中国海油	1,357,504.64	1.12	新股锁定限售

§ 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	5,286	5,192.72	18,857,746.02	68.70	8,590,951.22	31.30
东方鼎新	12,415	3,751.61	27,459,709.49	58.96	19,116,483.81	41.04

灵活配置混合 C						
合计	17,701	4,181.96	46,317,455.51	62.57	27,707,435.03	37.43

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	64,641.51	0.24
	东方鼎新灵活配置混合 C	1,833.23	0.00
	合计	66,474.74	0.09

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	77,498,822.02	179,037,818.46
本报告期基金总申购份额	47,504,193.59	12,296,958.23
减：本报告期基金总赎回份额	97,554,318.37	144,758,583.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	27,448,697.24	46,576,193.30

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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2022 年 2 月 12 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，自 2022 年 2 月 11 日起，聘任许文波先生为公司副总经理。上述人员的变更已报北京监管局及中国证券投资基金业协会备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

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例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东兴证券股份有限公司	1	70,768,560.17	35.12	65,906.72	35.12	-

天风证券股份有限公司	2	53,744,903.74	26.67	50,052.63	26.67	-
广发证券股份有限公司	1	46,531,223.47	23.09	43,334.79	23.09	-
华泰证券股份有限公司	1	16,320,797.69	8.10	15,199.90	8.10	-
华安证券股份有限公司	2	11,250,276.37	5.58	10,477.24	5.58	-
恒泰证券股份有限公司	2	2,870,250.47	1.42	2,673.15	1.42	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
首创证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
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，本基金新增恒泰证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、首创证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长江证券股份有限公司上海、深圳交易席位各一个。

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	25,199,671.39	53.29	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	15,075,864.39	31.88	1,000,000.00	100.00	-	-
恒泰证券股份有限	7,011,900.00	14.83	-	-	-	-

公司						
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
首创证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司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	2022 年 01 月 04 日
2	东方基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022 年 01 月 05 日
3	关于增加浙商银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠的公告	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	2022 年 01 月 07 日
4	关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 01 月 07 日
5	关于增加通华财富(上海)基金销售有限公司等 3 家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并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	2022 年 01 月 11 日
6	关于增加京东肯特瑞基金销售有限公司等 2 家代销机构为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 01 月 12 日
7	关于增加北京创金启富基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并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	2022 年 01 月 13 日
8	关于增加上海长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 01 月 13 日
9	东方基金管理股份有限公司关于开展直销电子交易系统基金申购费率优惠	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券	2022 年 01 月 20 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	
10	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2021 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	2022 年 01 月 21 日
11	东方基金管理股份有限公司高级管理人员变更公告	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	2022 年 02 月 12 日
12	关于增加北京中植基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并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	2022 年 02 月 18 日
13	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金恢复 500 万元以上申购、转换转入、定期定额投资公告	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	2022 年 03 月 03 日
14	关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 03 月 10 日
15	关于增加宁波银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 03 月 10 日
16	关于增加天津市润泽基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 03 月 23 日
17	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2021 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	2022 年 03 月 25 日
18	关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司等两家机构申购费率优惠的公告	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	2022 年 03 月 26 日
19	关于增加招商银行股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券	2022 年 03 月 30 日

	通定投及转换业务的公告	报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
20	关于旗下部分基金参与东方财富证券股份有限公司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	2022 年 04 月 11 日
21	关于旗下部分基金参与京东肯特瑞基金销售有限公司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	2022 年 04 月 11 日
22	关于增加青岛银行为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并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	2022 年 04 月 13 日
23	关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为旗下部分基金销售机构的公告	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	2022 年 04 月 13 日
24	关于增加和讯信息科技有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并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	2022 年 04 月 18 日
25	关于增加华夏银行为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 04 月 19 日
26	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2022 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	2022 年 04 月 21 日
27	关于增加珠海盈米基金销售有限公司等 2 家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 05 月 05 日
28	关于增加西部证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 05 月 10 日

		中国证监会基金电子披露网站	
29	东方基金管理股份有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售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	2022 年 05 月 11 日
30	关于增加宁波银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 05 月 18 日
31	关于东方基金在直销中心（含网上交易）开展部分基金赎回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	2022 年 05 月 24 日
32	关于增加中信百信银行股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并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	2022 年 05 月 26 日
33	关于增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并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	2022 年 05 月 27 日
34	关于增加大连网金基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠的公告	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	2022 年 05 月 30 日
35	关于增加安信证券股份有限公司等三家机构为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠的公告	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	2022 年 06 月 01 日
36	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2022 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	2022 年 06 月 02 日
37	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	2022 年 06 月 02 日
38	关于在国信证券股份有限公司等两家	证券时报、证券日报、	2022 年 06 月 07 日

	机构开通旗下部分基金定投及转换业务并参加申购费率优惠的公告	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	
39	关于增加东莞银行为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 06 月 16 日
40	关于增加上海中正达广基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 06 月 20 日
41	东方基金直销中心办公地址及联系方式变更公告	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	2022 年 06 月 22 日
42	关于增加阳光人寿保险股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	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	2022 年 06 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220607 - 20220630	15,781,582.89	15,765,569.09	15,781,582.89	15,765,569.09	21.30
产品	1	20220616 - 20220630	15,266,010.22	-	-	15,266,010.22	20.62
产品特有风险							
基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。 (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。							

(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。

§ 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

2022 年 8 月 31 日