

# 东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年三月二十七日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	东方鼎新灵活配置混合	
基金主代码	001196	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 21 日	
基金管理人	东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	523, 519, 285. 56 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	518, 815, 800. 36 份	4, 703, 485. 20 份

### 2.2 基金产品说明

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

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，并自 2016 年 4 月 20 日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。本基金的基金代码为：东方鼎新灵活配置混合 A，001196；东方鼎新灵活配置混合 C，002192。详情可参阅 2016 年 4 月 18 日在东方基金管理有限责任公司网站发布的《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》。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	洪渊
	联系电话	010-66295888	(010) 66105799
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95588
传真		010-66578700	(010) 66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.orient-fund.com">http://www.orient-fund.com</a> 或 <a href="http://www.df5888.com">http://www.df5888.com</a>
基金年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年		2015 年 4 月 21 日 (基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	东方鼎新灵活配置混合 A	东方鼎新灵活配置混合 C	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	24,548,273.71	296,654.25	217,948,646.21	-
本期利润	10,981,863.34	133,953.18	223,536,460.20	-
加权平均基金份额本期利润	0.0165	0.0169	0.0540	-
本期基金份额净值增长率	2.13%	1.48%	3.75%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0596	0.0593	0.0304	-
期末基金资产净值	549,713,906.53	4,982,306.06	1,799,145,495.75	-

期末基金份额净值	1.0596	1.0593	1.0375	-
----------	--------	--------	--------	---

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

④本基金基金合同于 2015 年 4 月 21 日生效，上年度为不完整会计年度。

## 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

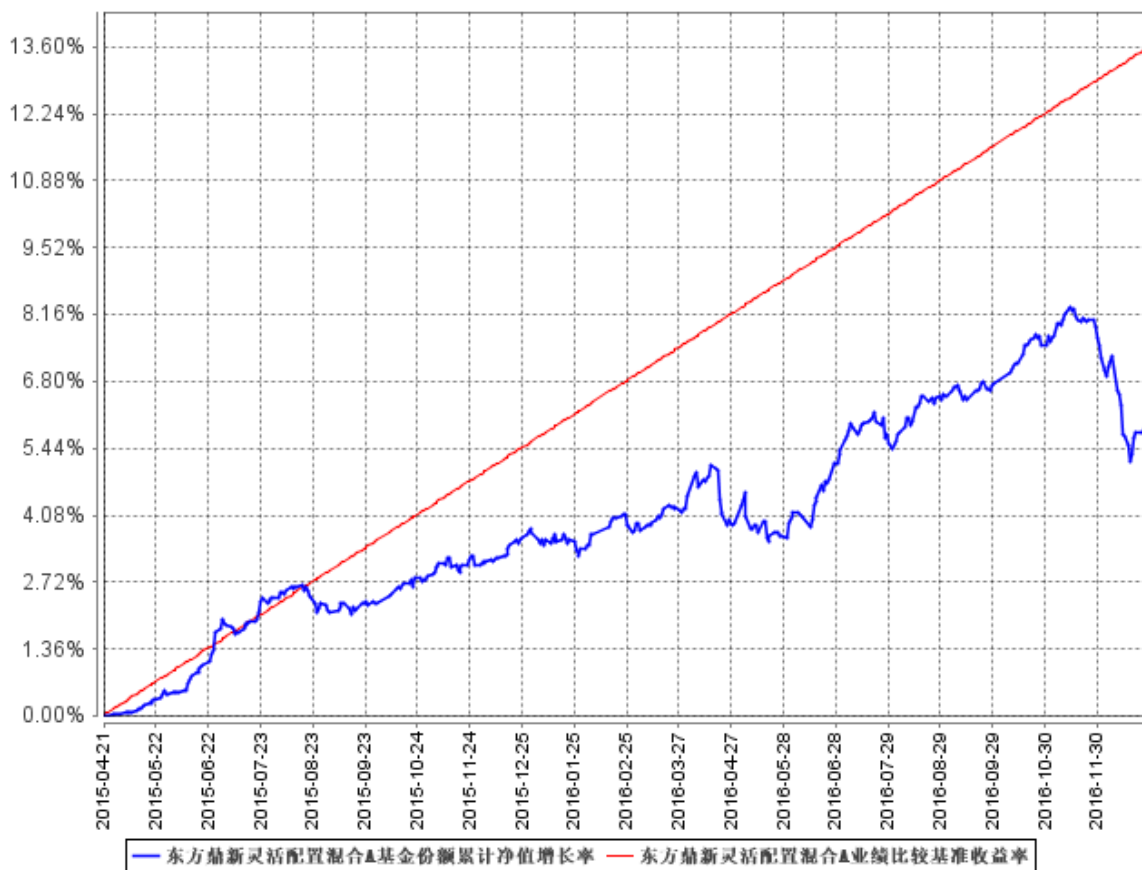
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.75%	0.16%	2.01%	0.00%	-2.76%	0.16%
过去六个月	0.60%	0.14%	4.03%	0.00%	-3.43%	0.14%
过去一年	2.13%	0.14%	8.01%	0.00%	-5.88%	0.14%
过去三年	5.96%	0.11%	13.60%	0.00%	-7.64%	0.11%
过去五年	5.96%	0.11%	13.60%	0.00%	-7.64%	0.11%
自基金合同生效起至今	5.96%	0.11%	13.60%	0.00%	-7.64%	0.11%

东方鼎新灵活配置混合 C

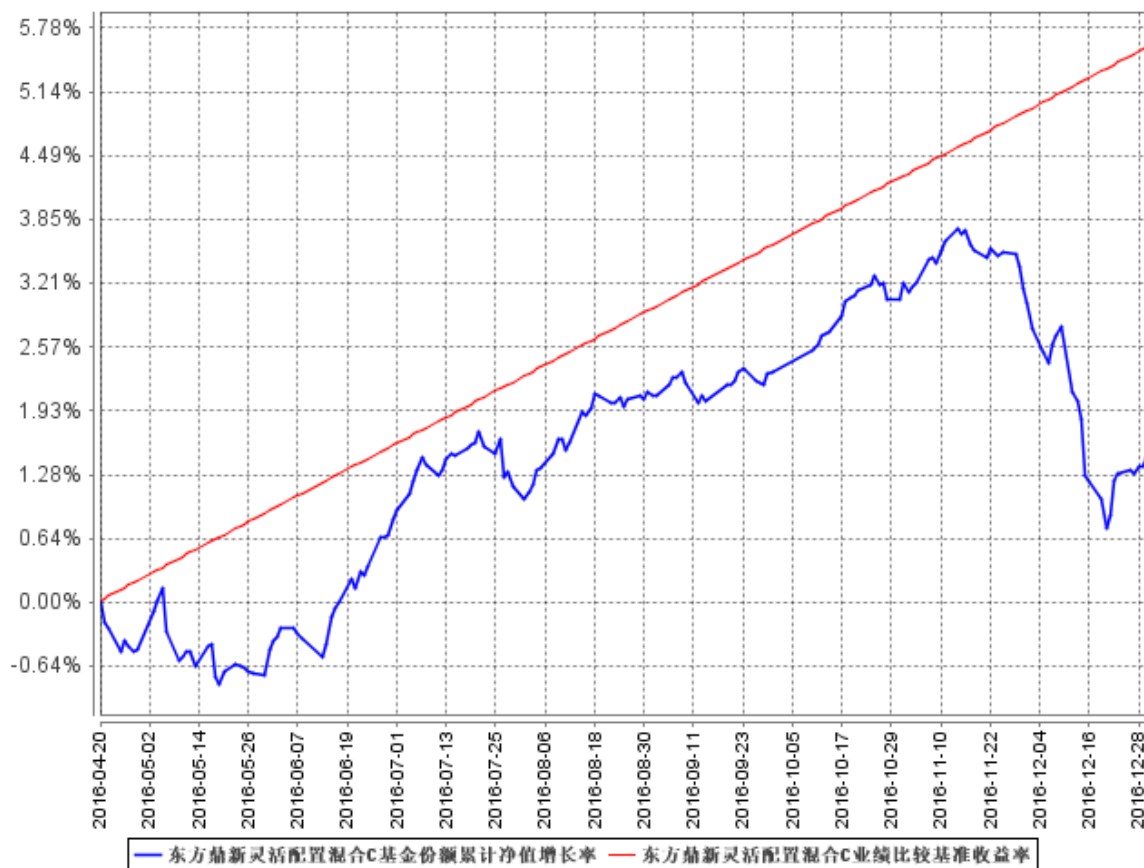
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.81%	0.16%	2.01%	0.00%	-2.82%	0.16%
过去六个月	0.64%	0.14%	4.03%	0.00%	-3.39%	0.14%
过去一年	1.48%	0.14%	5.61%	0.00%	-4.13%	0.14%
过去三年	1.48%	0.14%	5.61%	0.00%	-4.13%	0.14%
过去五年	1.48%	0.14%	5.61%	0.00%	-4.13%	0.14%
自基金合同生效起至今	1.48%	0.14%	5.61%	0.00%	-4.13%	0.14%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

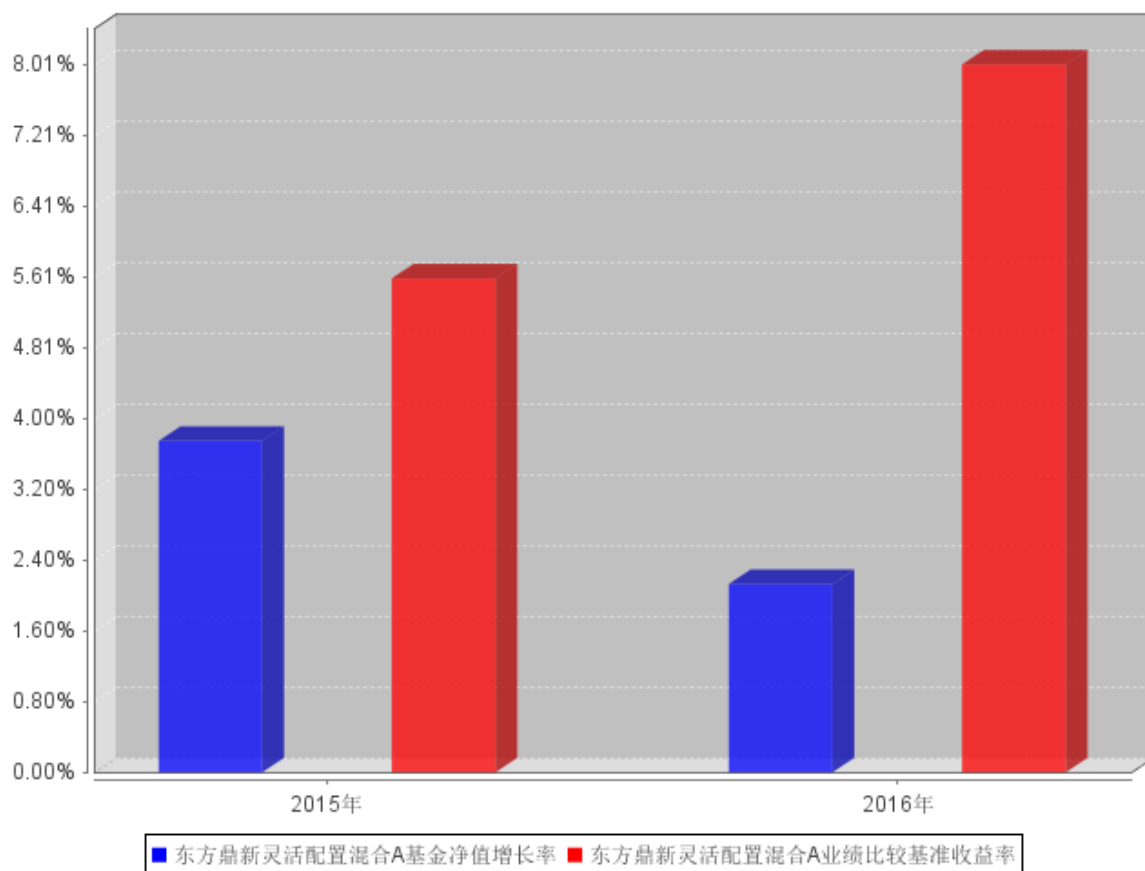


东方鼎新灵活配置混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



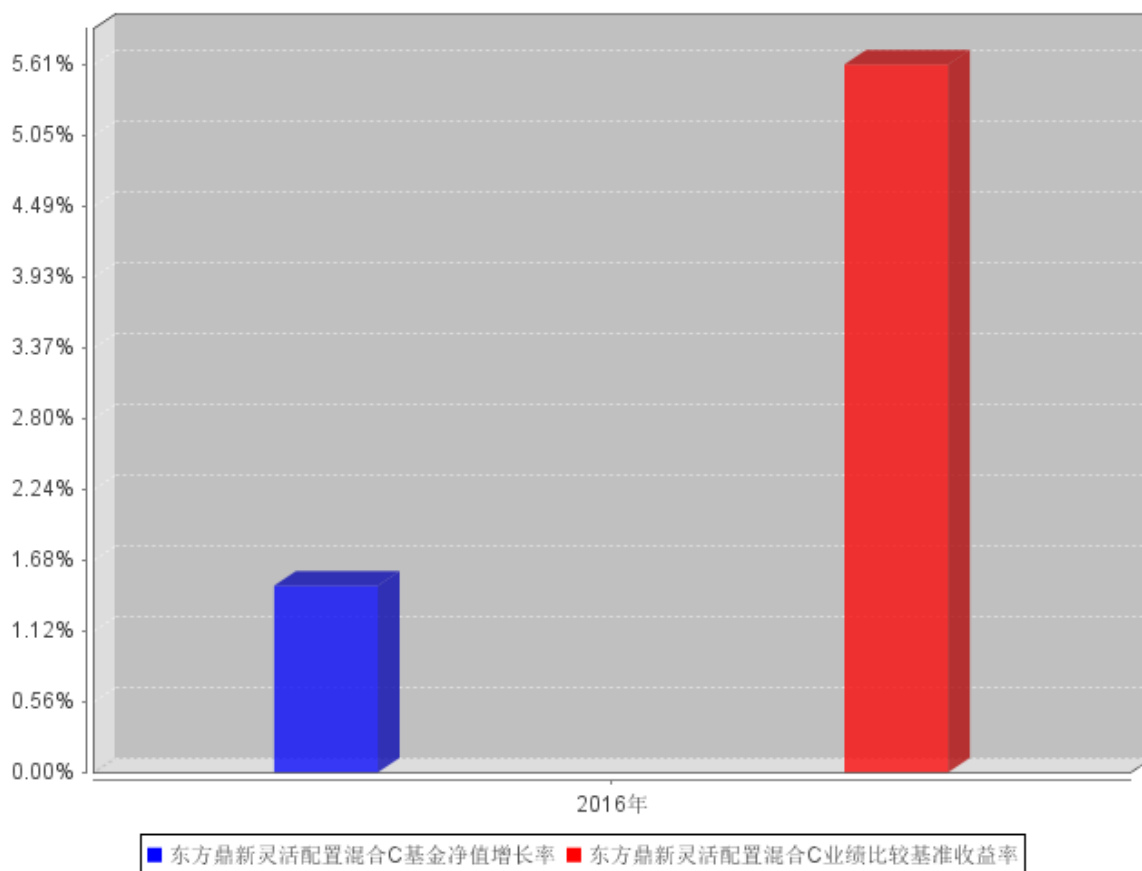
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 东方鼎新灵活配置混合A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图





东方鼎新灵活配置混合C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2015年4月21日）至报告期截止日（2016年12月31日）未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立。截至2016年12月31日，本公司注册资本2亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币12800万元，占公司注册资本的64%；河北省国有资产控股运营有限公司出资人民币5400万元，占公司注册资本27%；渤海

国际信托股份有限公司出资人民币 1800 万元，占公司注册资本的 9%。截止 2016 年 12 月 31 日，本公司管理 40 只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型开放式证券投资基金、东方保本混合型开放式证券投资基金、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方赢家保本混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方稳定增利债券型证券投资基金、东方金元宝货币市场证券投资基金、东方大健康混合型证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方荣家保本混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方合家保本混合型证券投资基金、东方臻馨债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金。

#### 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		
朱晓栋 (先生)	本基金基金经理、权益投资部副总经理、投资决策委员会委员	2015 年 4 月 21 日	-	7 年	对外经济贸易大学经济学硕士，7 年证券从业经历。2009 年 12 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行业、建筑建材行业研究员，东方

				<p>龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 7 月 31 日更名为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理。现任权益投资部副总经理、投资决策委员会委员、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精</p>
--	--	--	--	--

					选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理。
周薇（女士）	本基金基金经理	2015 年 4 月 21 日	-	7 年	北京大学金融学硕士，7 年证券从业经历，曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012 年 7 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任固定收益部债券研究员、投资经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理。现任东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理、东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理、东

					方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
邱义鹏 (先生)	本基金基金经理	2015 年 4 月 21 日	-	8 年	清华大学材料科学与工程专业硕士, 8 年证券从业经历。曾任嘉实基金医药行业研究员助理、长城证券医药行业研究员。2010 年 8 月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任权益投资部医药生物、建筑材料、建筑装饰、食品饮料、农林牧渔行业研究员, 东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理。现任东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金

					经理、东方主题精选混合型证券投资基金基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技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。
--	--	--	--	--	---

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及 95%的置信水平下，对同向交易价差进行 T 分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

#### 4.3.3 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。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在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

基本面方面，2016 年上半年在天量社会融资的推动下，经济基本面较为平稳。但是代价也是显著的，即增量 M2 与增量 GDP 之比回到了 2009 年的高点，加杠杆的主力是居民改善性需求购房和地方政府。9 月之后，经济的复苏在一定程度上得到验证，但市场对库存周期的延续性存在质疑。

政策面上，央行在 16 年 2 月 29 日降准，并于 3 月份降低了 MLF 的利率，但在 4 月份 MLF 操作时回到了 2 月份的利率水平。之后货币政策基本平稳，真正的转向发生在下半年。央行在 10 月底开始微调，后在 12 月确认货币政策的微妙变化，从“适度宽松”转向“中性”。流动性层面，整个四季度都偏紧。

16 年上半年债市的调整，利率债调整的触发点是天量信贷投放，信用债调整的触发点是 4 月

铁物资事件，中间伴随着摸底理财、MPA 考核、营业税改增值税、八项规定、基金子公司去杠杆、券商资管新规、交易所调整质押率等各种传闻。五一过后，营改增金融债收税的传闻被证伪，5 月利率债修复。端午节过后，随着对资金面担忧的缓解，信用成交逐渐活跃起来。6 月下旬英国意外退欧，利率债大涨，之后好资质信用债进入抢券模式，信用债已经部分突破 3 月份的高点。下半年债市 7 月-10 月持续上涨，利率债调整的触发点是 11 月 9 日特朗普当选冲击下外围债市的调整；信用债的调整紧跟其后，虽然隐蔽但幅度巨大，其间伴随着理财纳入 MPA 考核、私行资产配置变化、资管税务变化、交易所调整质押率等各种传闻。12 月下旬央行在银行间投入巨量资金，利率债在超调之后开展一轮反弹，之后信用债市场有所恢复，成交逐渐有所改善。

报告期内，在市场调整的二季度加仓，并在四季度的剧烈下跌中适时根据市场变化进行了仓位和久期调整，主要集中在信用风险较小的老城投品种，组合回撤较小。整体而言，本基金组合较为稳定，以享受票息为主，获得了较好的绝对收益。

报告期内，本基金以绝对收益为主要策略，以适度仓位参与市场，取得了一定的正收益，完成了绝对收益的目标。

在选股与行业配置策略上，本基金以行业景气与生命周期为行业配置逻辑，在合理价格积极介入成长性较好、可持续较强的板块和个股。在报告期内，本基金在国企改革、钢铁板块、电力设备投资等板块取得一定的绝对收益。同时，IPO 的持续对本基金业绩也做出正贡献。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为 2.13%，业绩比较基准收益率为 8.01%，低于业绩比较基准 5.88%；本基金 C 类净值增长率为 1.48%，业绩比较基准收益率为 5.61%，低于业绩比较基准 4.13%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一个季度，在经济继续回暖的带动之下，PPI 持续走强，将使得上游周期性板块的盈利预期大幅增加，而随着 PPI 对中下游的传导，预计整体中上涨板块都将引来不错的表现；而与此对应，随着估值和盈利增长风险的充分释放，部分成长型个股的估值进入投资区间，这些个股将迎来较好的布局机会，但市场仍然呈现分化，业绩为王，部分估值过高，没有业绩支撑的个股仍将面临较大下行压力。

展望 2017 年，国内宏观经济或呈现前高后低的态势，宏观弱、微观强，通胀中枢或将上移。房地产方面，在地产政策调控下，房地产投资趋弱或于二季度以后凸显；基建方面，预算内财政对其推动力度较弱，PPP 的发力程度值得观察；汽车产业链方面，购置税减半政策到期后，销售



回落将拖累社零增速、产出下降也将拖累工业增加值；出口方面，人民币贬值、PPI 回升，外向型出口企业或有好转，但美国的贸易保护政策或将带来较大不确定性。

从政策角度来看，2016 年 12 月中央经济工作会议弱化经济增长目标，推动供给侧改革，弱化地产投资属性，防范资产泡沫。财政政策方面，将更加积极有效，预算安排要适应推进供给侧结构性改革、降低企业税费负担。货币政策方面，17 年货币政策被定调为稳健中性，再提“流动性闸门”，央行态度边际收紧。

从资金面角度来看，外汇贬值背景下，基础货币流失较多，目前主要通过 MLF、公开市场操作等短期限工具对冲，银行需要持续抵押利率债，可能会存在可质押券不充足、LCR 指标分子缩水等问题，从而导致银行融出意愿减弱。即使央行不提高基准利率，资金面偏紧的状态可能仍将持续。

17 年上半年的机会在于超跌之后的反弹，Q2 和 Q3 需要密切观察市场的变化，全年债券资产仍可能带来不错的绝对收益。组合拟以短久期城投、短融和存单为底仓，配合利率债的波段操作。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，开展定期和实时监控，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：（1）开展对公司各项业务的日常监察，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强基金投资运作的监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（3）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。（4）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会公告【2008】38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，本基金管理人成立了东方基金管理有限责任公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），

成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

#### 1. 委员会主任

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

#### 2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

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

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

#### 3. 投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称“停牌有价证券”）时，根据估值委员会要求和运营部的估值方案，负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当，对估值方法有失公允性的“停牌有价证券”，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

#### 4. 风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

## 4.8 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。

## 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

## 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东方基金管理有限公司编制和披露的东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2017]第 ZB30045 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“东方鼎新基金”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、2016 年度的所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是东方鼎新基金的基金管理人东方基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，东方鼎新基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东方鼎新基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

注册会计师的姓名	朱锦梅	赵立卿
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	上海市南京路 61 号新黄浦金融大厦 4 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	9,172,956.61	641,522,106.42
结算备付金	245,129.30	509,033.20
存出保证金	16,528.36	302,660.96
交易性金融资产	535,727,745.62	481,423,352.33
其中：股票投资	84,429,788.62	41,620,288.33
基金投资	-	-
债券投资	451,297,957.00	439,803,064.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	696,102,364.15
应收证券清算款	19,240.49	4,803,599.07
应收利息	10,454,709.27	8,787,204.36
应收股利	-	-
应收申购款	198.74	3,197.91
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	555,636,508.39	1,833,453,518.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	32,000,000.00

应付证券清算款	-	-
应付赎回款	11,000.51	9,341.03
应付管理人报酬	330,590.87	1,522,299.95
应付托管费	118,068.15	380,574.98
应付销售服务费	1,412.43	-
应付交易费用	149,223.48	205,985.91
应交税费	-	-
应付利息	-	59,809.32
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	330,000.36	130,011.46
负债合计	940,295.80	34,308,022.65
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	523,519,285.56	1,734,085,430.78
未分配利润	31,176,927.03	65,060,064.97
所有者权益合计	554,696,212.59	1,799,145,495.75
负债和所有者权益总计	555,636,508.39	1,833,453,518.40

注：①报告截止日 2016 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0596 元，C 类基金份额净值 1.0593 元；基金份额总额 523,519,285.56 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 518,815,800.36 份，C 类基金份额总额 4,703,485.20 份。

②本基金基金合同于 2015 年 4 月 21 日生效，上年度为不完整会计年度，下同。

## 7.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 21 日(基金合同 生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	20,842,593.45	261,948,592.64
1.利息收入	24,920,922.39	54,040,169.83
其中：存款利息收入	3,008,511.99	43,826,511.83
债券利息收入	18,031,492.18	4,809,283.52
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,880,918.22	5,404,374.48
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	7,746,700.32	168,350,881.02

其中：股票投资收益	8,214,421.08	168,565,389.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-604,718.42	-542,921.98
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	136,997.66	328,413.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-13,729,111.44	5,587,813.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,904,082.18	33,969,727.80
<b>减：二、费用</b>	<b>9,726,776.93</b>	<b>38,412,132.44</b>
1. 管理人报酬	6,532,851.14	28,671,694.72
2. 托管费	1,788,901.63	7,167,923.68
3. 销售服务费	18,533.20	-
4. 交易费用	357,838.09	1,598,772.70
5. 利息支出	569,163.74	708,908.17
其中：卖出回购金融资产支出	569,163.74	708,908.17
6. 其他费用	459,489.13	264,833.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>11,115,816.52</b>	<b>223,536,460.20</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>11,115,816.52</b>	<b>223,536,460.20</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,734,085,430.78	65,060,064.97	1,799,145,495.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	11,115,816.52	11,115,816.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,210,566,145.22	-44,998,954.46	-1,255,565,099.68

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	535,974,158.18	34,581,503.13	570,555,661.31
2. 基金赎回款	-1,746,540,303.40	-79,580,457.59	-1,826,120,760.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	523,519,285.56	31,176,927.03	554,696,212.59
项目	上年度可比期间 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,285,314,816.72	-	5,285,314,816.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	223,536,460.20	223,536,460.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,551,229,385.94	-158,476,395.23	-3,709,705,781.17
其中：1. 基金申购款	5,312,150,975.55	23,553,583.08	5,335,704,558.63
2. 基金赎回款	-8,863,380,361.49	-182,029,978.31	-9,045,410,339.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,734,085,430.78	65,060,064.97	1,799,145,495.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘鸿鹏

基金管理人负责人

刘鸿鹏

主管会计工作负责人

肖向辉

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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）和《关于东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（机构部函【2015】894号）的核准，自2015年4月13日至2015年4月15日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集5,285,260,810.32元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2015]第01300032号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年4月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为5,285,314,816.72份基金单位，其中认购资金利息折合54,006.40份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自2016年4月20日起，本基金增加C类基金份额并设置对应的基金代码。基金投资人申购时可根据投资需求自主选择A类基金份额（现有份额）或C类基金份额进行申购。由于基金费用收取方式的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。目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。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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

### 7.4.3 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 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。7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

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

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

上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

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

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

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
渤海国际信托股份有限公司	本基金管理人股东
河北省国有资产控股运营有限公司	本基金管理人股东
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人下属子公司

### 7.4.8 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。

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015年4月21日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东北证券股份有限 公司	-	-	703,597,392.78	73.09%

##### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015年4月21日(基金合同生效日)至 2015年12月31日
-------	--	--

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	785,740,884.52	80.64%

### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年4月21日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	830,900,000.00	84.54%

### 7.4.8.1.4 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。

### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年4月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券股份有限公司	640,554.04	72.69%	-	-

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

务。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,532,851.14	28,671,694.72
其中：支付销售机构的客户维护费	8,791.76	19,495.39

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.7% 的年费率计算，具体计算方法如下：

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

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

③本基金管理人自 2016 年 8 月 16 日起对本基金实施调整后的基金管理费率，由原来的“年费率 1.0%”调整为“年费率 0.7%”。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,788,901.63	7,167,923.68

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。

### 7.4.8.2.3 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方鼎新灵活配置混合 A	东方鼎新灵活配置混合 C	合计
东方基金管理有限责任公司	-	18,472.58	18,472.58
合计	-	18,472.58	18,472.58

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。

### 7.4.8.3 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，未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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	9,172,956.61	137,261.79	11,522,106.42	6,455,052.95

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间,未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.9 期末(2016 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 22 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002567	唐人神	2016 年 12 月 22 日	重大事项	12.64	2017 年 1 月 3 日	12.75	349,910	4,453,411.70	4,422,862.40	-
603986	兆易创新	2016 年 9 月 19 日	重大事项	177.97	2017 年 3 月 13 日	195.77	982	22,841.32	174,766.54	-
300537	广信材	2016 年	重大	48.79	2017 年	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-

	料	10月12日	事项		1月13日				
--	---	--------	----	--	-------	--	--	--	--

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	84,429,788.62	15.20
	其中：股票	84,429,788.62	15.20
2	固定收益投资	451,297,957.00	81.22
	其中：债券	451,297,957.00	81.22
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,418,085.91	1.70
7	其他各项资产	10,490,676.86	1.89
8	合计	555,636,508.39	100.00



## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,675,093.21	8.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,305,592.23	0.96
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	16,199,553.18	2.92
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	18,249,550.00	3.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	84,429,788.62	15.22

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600754	锦江股份	549,883	16,199,553.18	2.92
2	000959	首钢股份	1,999,960	13,239,735.20	2.39
3	600919	江苏银行	905,000	8,715,150.00	1.57
4	600579	天华院	600,000	8,604,000.00	1.55
5	002481	双塔食品	700,000	6,349,000.00	1.14
6	002375	亚厦股份	500,000	5,290,000.00	0.95
7	601126	四方股份	500,000	4,865,000.00	0.88
8	601988	中国银行	1,388,000	4,774,720.00	0.86
9	601818	光大银行	1,190,000	4,652,900.00	0.84
10	002567	唐人神	349,910	4,422,862.40	0.80

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600754	锦江股份	17,625,536.45	0.98
2	000959	首钢股份	11,463,921.40	0.64
3	600919	江苏银行	10,093,508.17	0.56
4	002375	亚厦股份	5,748,000.00	0.32
5	600268	国电南自	5,689,536.00	0.32
6	601126	四方股份	5,649,982.00	0.31
7	600579	天华院	5,589,584.27	0.31
8	002481	双塔食品	5,524,015.00	0.31
9	000905	厦门港务	5,460,254.00	0.30
10	600439	瑞贝卡	5,442,568.90	0.30
11	600395	盘江股份	5,388,164.00	0.30
12	000972	中基健康	5,380,207.00	0.30
13	601988	中国银行	5,062,320.00	0.28
14	601818	光大银行	5,042,500.00	0.28
15	002260	德奥通航	4,782,206.70	0.27
16	002303	美盈森	4,627,190.11	0.26

17	002567	唐人神	4,453,411.70	0.25
18	300050	世纪鼎利	4,448,088.00	0.25
19	603558	健盛集团	4,075,582.80	0.23
20	300285	国瓷材料	3,550,614.00	0.20

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。

#### 8.4.2 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	600395	盘江股份	6,482,050.00	0.36
2	600268	国电南自	6,416,479.00	0.36
3	603558	健盛集团	6,254,680.20	0.35
4	000905	厦门港务	5,591,638.98	0.31
5	600439	瑞贝卡	5,375,083.00	0.30
6	002336	*ST 人乐	5,137,543.54	0.29
7	000890	法尔胜	5,113,319.18	0.28
8	002260	德奥通航	4,746,033.12	0.26
9	300050	世纪鼎利	4,368,627.41	0.24
10	600549	厦门钨业	4,250,325.78	0.24
11	000972	中基健康	4,093,129.00	0.23
12	300429	强力新材	3,936,137.88	0.22
13	300285	国瓷材料	3,724,439.00	0.21
14	002458	益生股份	3,635,884.00	0.20
15	002365	永安药业	3,497,439.00	0.19
16	600050	中国联通	2,220,000.00	0.12
17	000540	中天城投	2,096,769.12	0.12
18	002428	云南锗业	1,859,293.00	0.10
19	300322	硕贝德	1,594,578.00	0.09
20	002234	民和股份	1,589,483.00	0.09

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。

### 8.4.3 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	138,369,489.20
卖出股票收入（成交）总额	98,266,627.25

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。

### 8.5 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	8,677,704.30	1.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,994,000.00	3.60
	其中：政策性金融债	19,994,000.00	3.60
4	企业债券	354,523,000.00	63.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	46,555,000.00	8.39
7	可转债（可交换债）	21,548,252.70	3.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	451,297,957.00	81.36

### 8.6 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	1480386	14 冀渤海债	300,000	31,263,000.00	5.64
2	1280398	12 营口沿海债	500,000	30,995,000.00	5.59
3	1180132	11 厦门象屿债	250,000	26,040,000.00	4.69
4	1280182	12 津南债	400,000	24,924,000.00	4.49
5	1380228	13 东丽债	300,000	24,663,000.00	4.45

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 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	16,528.36
2	应收证券清算款	19,240.49
3	应收股利	-
4	应收利息	10,454,709.27
5	应收申购款	198.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,490,676.86

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113009	广汽转债	5,675,945.60	1.02
2	110032	三一转债	4,484,901.60	0.81
3	110033	国贸转债	2,602,566.00	0.47
4	110035	白云转债	2,237,097.60	0.40
5	110034	九州转债	1,480,473.00	0.27
6	127003	海印转债	860,026.80	0.16
7	113010	江南转债	762,660.00	0.14
8	123001	蓝标转债	708,789.20	0.13
9	128010	顺昌转债	475,305.30	0.09

### 8.12.5 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	002567	唐人神	4,422,862.40	0.80	重大事项

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		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	492	1,054,503.66	516,673,555.65	99.59%	2,142,244.71	0.41%
东方鼎新灵活配置混合 C	8	587,935.65	4,701,899.56	99.97%	1,585.64	0.03%
合计	500	1,047,038.57	521,375,455.21	99.59%	2,143,830.35	0.41%

### 9.3 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	61.06	0.0000%
	东方鼎新灵活配置混合 C	1.90	0.0000%
	合计	62.96	0.0000%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 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	1,734,085,430.78	-
本报告期基金总申购份额	516,966,673.12	19,007,485.06
减:本报告期基金总赎回份额	1,732,236,303.54	14,303,999.86
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	518,815,800.36	4,703,485.20

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议《关于调整东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金管理费率并修改基金合同的议案》以及《关于调整东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金赎回费率的议案》，本次会议于 2016 年 8 月 16 日完成计票，表决通过上述议案，自 2016 年 8 月 16 日起，本基金实施新的管理费率以及赎回费率。关于本次会议的召集及决议情况，本基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上披露了以下公告：

1、2016 年 7 月 14 日披露了《关于以通讯方式召开东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》

2、2016 年 7 月 15 日披露了《关于以通讯方式召开东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》

3、2016 年 7 月 16 日披露了《关于以通讯方式召开东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》

4、2016 年 8 月 17 日披露了《东方基金管理有限责任公司关于东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》



## 11.2 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

经本基金管理人第四届董事会第十六次临时会议决议，于 2016 年 3 月 16 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，陈振宇先生不再担任公司副总经理。

经本基金管理人第四届董事会第二十一临时会议及第五届董事会第一次会议决议，于 2016 年 8 月 19 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，孙晔伟先生不再担任公司总经理，崔伟先生代任公司总经理职务。

经本基金管理人第五届董事会第三次临时会议决议，于 2016 年 10 月 29 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，刘鸿鹏先生担任公司总经理职务，崔伟先生不再代任总经理职务。

本基金管理人已通过证监会指定报刊及本基金管理人网站对上述高级管理人员变更情况履行了信息披露义务，并在本基金及本基金管理人管理的其他基金的招募说明书-基金管理人部分及时更新了上述高级管理人员变更情况。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，北京市第二中级人民法院对一起原公司员工与公司之间的民事诉讼案件做出终审判决，判决公司支付原告部分劳动报酬并驳回原告的其他诉讼请求，该案已审理终结。

公司没有其他诉讼和仲裁情况。

本报告期，无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任立信会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 80,000.00 元；截至 2016 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 2 年的审计服务。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
中信证券股份有限公司	2	122,062,771.74	52.09%	113,676.55	52.09%	-
东方证券股份有限公司	2	112,257,939.54	47.91%	104,545.03	47.91%	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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

#### （2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证

券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

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

(3) 本报告期内本基金新增租用 1 个交易单元。

### 11.7.2 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
中信证券股份有限公司	3,174,661.61	26.73%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	8,700,308.10	73.27%	180,300,000.00	100.00%	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

东方基金管理有限责任公司  
2017年3月27日