

# 东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 第一季度报告

基金管理人:东方基金管理有限责任公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

1.1 重要提示  
基金管理人东方基金管理有限责任公司不存在虚假记载、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责任。  
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合信息内容,保证基金资产净值公允,并符合中国证券监督管理委员会相关披露要求。  
基金管理人东方基金管理有限责任公司承诺,本报告不存在虚假记载、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责任。  
基金托管人中国银行股份有限公司承诺,本报告不存在虚假记载、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责任。  
本报告所载数据截至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况	
基金名称	东方鼎新灵活配置混合
基金代码	001186
交易代码	001186
基金运作方式	契约式
基金合同生效日	2015年4月21日
报告期末基金份额总额	473,460,169.08
投资目标	通过长期投资,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上的方法,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+中证500指数收益率×30%。
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型基金,低于股票型基金。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属基金管理基金简称	东方鼎新灵活配置混合C
下属基金管理基金代码	001186
报告期末下属基金管理基金的份额总额	469,754,390.01

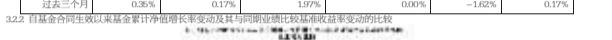
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
主要财务指标	报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)
1.本期已实现收益	3,424,268.02
2.本期利润	2,704,406.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0029
4.期末基金净值增长率	53.76%
5.期末基金份额净值	1.0303

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公允价值变动收益。  
②期末基金净值增长率指基金本期净值增长率,即期末基金份额净值减去上期基金份额净值,再除以报告期基金份额净值。

3.2.1 本报告期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

阶段	净值增长率①	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	0.42%	0.17%	1.07%	0.00%	-1.05%	0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:①本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

②本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

③本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

④本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑤本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑥本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑦本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑧本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑨本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑩本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑪本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑫本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑬本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑭本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑮本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑯本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑰本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑱本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑲本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

⑳本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉑本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉒本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉓本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉔本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉕本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉖本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉗本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉘本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉙本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉚本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉛本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉜本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉝本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉞本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㉟本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊱本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊲本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊳本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊴本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊵本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊶本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊷本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊸本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊹本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊺本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊻本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊼本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊽本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊾本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

㊿本基金合同生效以来基金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,是指基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较。

### § 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	123,019,677.08	24.38
2	其中:股票	123,019,677.08	24.38
3	债券投资	340,326,320.20	69.42
4	其中:国债	340,326,320.20	69.42

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	制造业	62,432,403.69	12.59
C	建筑业	-	-
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	5,568,463.04	1.11
E	金融业	-	-
F	房地产业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	127,823.04	0.03
H	信息传输、软件和信息技术服务业	12,762,977.94	2.59
I	住宿和餐饮业	3,016,310.49	0.61
J	金融业	19,076,000.00	3.79
K	房地产业	8,276,265.83	1.68
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,004,000.00	1.85
N	水利、环境和公共设施管理业	467,748.02	0.09
O	建筑业	-	-
P	教育、文化和体育业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	123,019,677.08	24.42

5.3 报告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

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	000069	招商股份	1,969,900	14,269,714.80	2.93
2	600764	银江股份	441,043	12,762,977.94	2.59
3	300041	花园生物	381,172	11,884,943.96	2.36
4	002421	沃格光电	1,369,964	11,297,644.92	2.24
5	300044	博晖医药	300,000	9,804,000.00	1.96
6	600039	四川路桥	865,200	9,060,000.00	1.80
7	600626	长海股份	917,500	7,829,750.00	1.55
8	002275	宜通世纪	499,962	5,584,463.04	1.11
9	401088	中国银行	1,388,000	5,136,000.00	1.02
10	600079	华宇软件	320,000	4,940,800.00	0.98

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	28,671,796.00	5.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债券	246,123,500.00	49.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	46,396,000.00	9.21
7	可转债(可交换债)	24,136,042.60	4.79
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	340,326,320.20	69.54

5.5 报告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

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140009	140009	140,000.00	0.03
2	120030	120030	500,000.00	0.10
3	110032	110032	250,000.00	0.05
4	120032	120032	400,000.00	0.08
5	130021	130021	300,000.00	0.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商股份	1,969,900	14,269,714.80	2.93
2	银江股份	441,043	12,762,977.94	2.59
3	花园生物	381,172	11,884,943.96	2.36
4	沃格光电	1,369,964	11,297,644.92	2.24
5	博晖医药	300,000	9,804,000.00	1.96
6	四川路桥	865,200	9,060,000.00	1.80
7	长海股份	917,500	7,829,750.00	1.55
8	宜通世纪	499,962	5,584,463.04	1.11
9	中国银行	1,388,000	5,136,000.00	1.02
10	华宇软件	320,000	4,940,800.00	0.98

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商股份	1,969,900	14,269,714.80	2.93
2	银江股份	441,043	12,762,977.94	2.59
3	花园生物	381,172	11,884,943.96	2.36
4	沃格光电	1,369,964	11,297,644.92	2.24
5	博晖医药	300,000	9,804,000.00	1.96
6	四川路桥	865,200	9,060,000.00	1.80
7	长海股份	917,500	7,829,750.00	1.55
8	宜通世纪	499,962	5,584,463.04	1.11
9	中国银行	1,388,000	5,136,000.00	1.02
10	华宇软件	320,000	4,940,800.00	0.98

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	招商股份	1,969,900	14,269,714.80	2.93
2	银江股份	441,043	12,762,977.94	2.59
3	花园生物	381,172	11,884,943.96	2.36
4	沃格光电	1,369,964	11,297,644.92	2.24
5	博晖医药	300,000	9,804,000.00	1.96
6	四川路桥	865,200	9,060,000.00	1.80
7	长海股份	917,500	7,829,750.00	1.55
8	宜通世纪	499,962	5,584,463.04	1.11
9	中国银行	1,388,000	5,136,000.00	1.02
10	华宇软件	320,000	4,940,800.00	0.98

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细