

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

2022 年 3 月 31 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

报告送出日期：2022 年 4 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	176,841,974.72 份	
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。	
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	
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	90,828,998.45 份	86,012,976.27 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 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
1. 本期已实现收益	3,944,189.41	4,136,345.86
2. 本期利润	-7,626,763.03	-9,572,595.75
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0764	-0.0769
4. 期末基金资产净值	143,983,238.78	136,657,542.40
5. 期末基金份额净值	1.5852	1.5888

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所述基金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	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	-4.33%	0.43%	1.97%	0.00%	-6.30%	0.43%
过去六个月	-2.52%	0.36%	3.99%	0.00%	-6.51%	0.36%
过去一年	0.54%	0.33%	8.00%	0.00%	-7.46%	0.33%
过去三年	35.39%	0.34%	24.00%	0.00%	11.39%	0.34%
过去五年	48.97%	0.72%	40.00%	0.00%	8.97%	0.72%
自基金合同 生效起至今	58.52%	0.62%	55.57%	0.00%	2.95%	0.62%

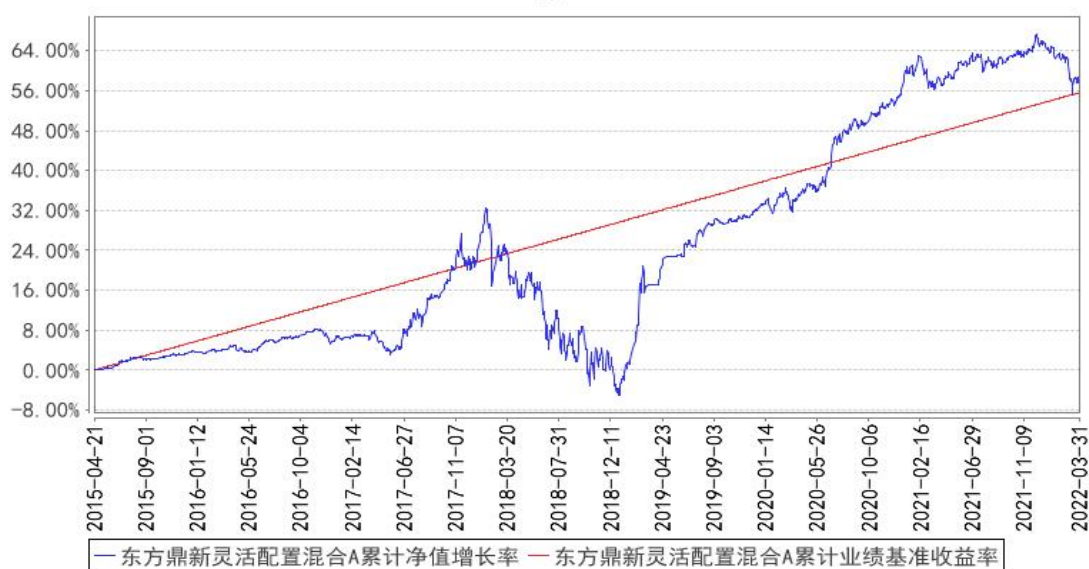
东方鼎新灵活配置混合 C

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	①-③	②-④
----	--------	---------------	----------------	------------------	-----	-----

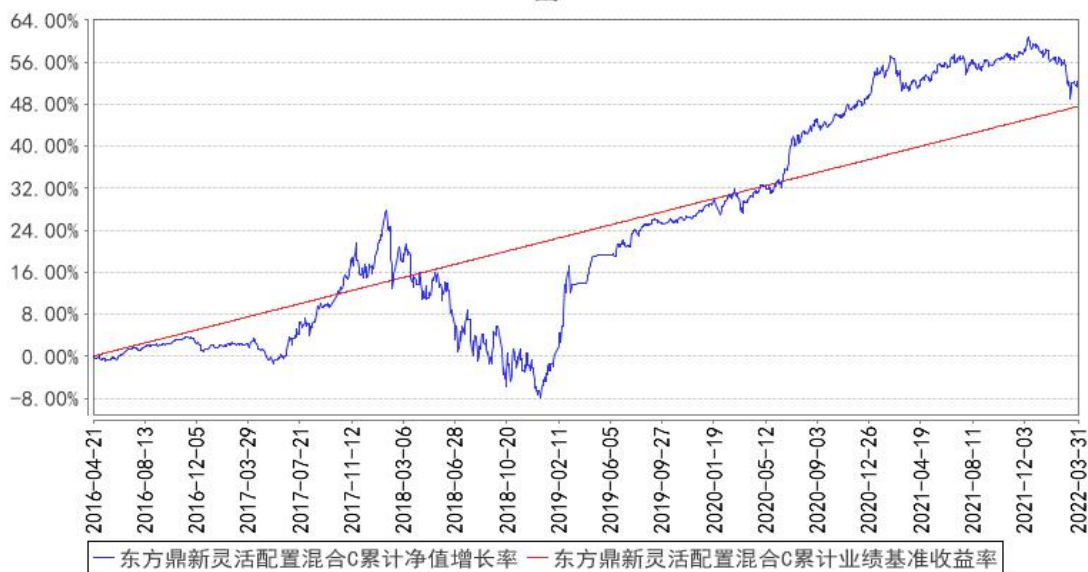
				④		
过去三个月	-4.40%	0.43%	1.97%	0.00%	-6.37%	0.43%
过去六个月	-2.66%	0.36%	3.99%	0.00%	-6.65%	0.36%
过去一年	0.23%	0.33%	8.00%	0.00%	-7.77%	0.33%
过去三年	33.68%	0.34%	24.00%	0.00%	9.68%	0.34%
过去五年	49.46%	0.72%	40.00%	0.00%	9.46%	0.72%
自基金合同生效起至今	52.21%	0.67%	47.57%	0.00%	4.64%	0.67%

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

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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年一季度市场波动加剧，行业集中度较高的成长板块估值消化速度加快且历时时间较长，而以周期板块为代表的低估值行业表现占优。我们认为，在市场剧烈震荡的背后可能涵盖了以下

几个因素的原因。首先为通胀预期的抬升，受大宗商品价格上涨的影响，成本型通胀不断抬升，因此海外方面美联储由鸽转鹰，其连续加息、TAPER 和缩表节奏超市场预期，对外资流动性造成了巨大冲击，而我国通胀水平控制相对较好，但市场的一致预期发生了一定转变，对权益类资产形成了一定的估值压制；其次为海外地缘政治引发的经济制裁，其产生的连锁反应再度推升了大宗商品价格及消费服务成本，如天然气、原油、运输物流等，欧洲受高通胀的影响下面临着经济衰退的风险，从而也将影响我国对欧盟国家的出口贸易；其三为国内流动性扩张节奏的停滞，过去两年的结构性牛市主要由新增资金推动风格不断集中所形成，自开年以来增量资金萎缩以及市场下跌造成了净赎回等影响，风格集中背后蕴含的风险开始释放，市场情绪逐渐降温，投资人相对青睐于安全边际较高的低估值资产；最后受上游原材料上涨的影响，中下游行业基本面也随即发生了变化，从而对一致预期的动态估值形成了一定压制，因此成长板块估值消化幅度较大。因此，市场受多种因素的影响而震荡加剧，但是在当前节点上我们对未来权益类资产的投资回报仍然抱有乐观预期。在经历了超过两年的结构性牛市后，风格集中化所带来的估值泡沫已经进入了快速消化通道，不少优质个股的投资性价比已经凸显，因此对于全市场选股的潜在阿尔法机会较往年更多、且纬度更广。往年高成长、高动量的风格极致市场中，选股阿尔法机会相对较少，投资收益绝大部分来自于市场贝塔，而经过一季度的风格切换后，市场结构逐渐趋于平衡，例如低估值价值类板块反弹强劲、股息率等指标重新进入大众视野等。在金稳会、国常会的会议精神指引下，为应对潜在的经济下行压力，未来货币政策及财政政策大概率会较去年更为积极，且在“稳增长”主题的配套政策支持下，基建投资方面已率先发力并初见效果，我们预计国内市场流动性压力依然可控且内外环境将得到不断改善。综上所述，在一季度错综复杂的市场环境下，具备一定性价比的投资机会也在不断浮现，虽然市场调整剧烈，但是未来我们仍将依靠丰富的多样化投资手段力争挖掘潜在的投资机会，为创造长期稳健的超额收益目标而持续努力。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 3 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为-4.33%，业绩比较基准收益率为 1.97%，低于业绩比较基准 6.30%；本基金 C 类净值增长率为-4.40%，业绩比较基准收益率为 1.97%，低于业绩比较基准 6.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	63,233,524.48	22.44
	其中：股票	63,233,524.48	22.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	203,112,472.87	72.08
	其中：债券	203,112,472.87	72.08
	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	10,001,959.44	3.55
	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	5,273,402.88	1.87
8	其他资产	181,620.71	0.06
9	合计	281,802,980.38	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	4,448,606.00	1.59
C	制造业	28,168,710.21	10.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,603,356.05	1.28
F	批发和零售业	871,261.57	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	3,033,943.00	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,520,916.70	0.54
J	金融业	19,653,404.82	7.00
K	房地产业	1,037,214.00	0.37
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	896,112.13	0.32
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	63,233,524.48	22.53
----	---------------	-------

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600036	招商银行	77,400	3,622,320.00	1.29
2	300750	宁德时代	6,200	3,176,260.00	1.13
3	601166	兴业银行	126,300	2,610,621.00	0.93
4	600519	贵州茅台	1,500	2,578,500.00	0.92
5	300059	东方财富	86,348	2,188,058.32	0.78
6	600030	中信证券	94,130	1,967,317.00	0.70
7	600887	伊利股份	53,200	1,962,548.00	0.70
8	601688	华泰证券	115,900	1,724,592.00	0.61
9	601988	中国银行	521,200	1,704,324.00	0.61
10	601211	国泰君安	108,300	1,701,393.00	0.61

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	17,381,517.26	6.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,612,487.12	11.26
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,418,443.84	7.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	133,700,024.65	47.64
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	203,112,472.87	72.37

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101762054	17 浙国贸 MTN002	200,000	20,936,180.82	7.46
2	102001239	20 汇金 MTN008A	200,000	20,508,080.00	7.31
3	102101430	21 杭州国资 MTN001（权益出资）	200,000	20,454,410.96	7.29
4	101901366	19 中化工 MTN005	200,000	20,442,693.70	7.28
5	143263	17 平租 04	200,000	20,418,443.84	7.28

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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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数据等十三项问题。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2021-05-17被中国银行保险监督管理委员会公开处罚。主要违法事实:一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺,部分未按规定计提风险加权资产;二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品;三、理财产品之间风险隔离不到位等二十七项问题。招商银行(600036.SH)于近一年内公告了招商银行深圳分行等多个分支机构被中国银行保险监督管理委员会深圳监管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。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 数据等十四项问题。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深圳分行等多个分支机构被中国银行保险监督管理委员会深圳监管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。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负主要责任等。

本基金所持有的中国银行 (601988. 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:中国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、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差; 三、漏报贷款核销业务 EAST 数据等十八项问题。中国银行 (601988. SH) 于 2021-11-15 被中国银行保险监督管理委员会四川监管局公开处罚, 主要违法事实:房地产开发贷款项目资本金来源审核和贷款用途管控不尽职, 以经营性物业抵押贷款形式违规向房地产开发企业融资, 违规向不符合条件个人发放“年龄接力”住房按揭贷款, 严重违反审慎经营规则。中国银行 (601988. SH) 于 2021-05-17 被中国银行保险监督管理委员会公开处罚。主要违法事实:一、向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款; 二、违规向关系人发放信用贷款; 三、向无资金缺口企业发放流动资金贷款等三十六项。中国银行 (601988. SH) 于近一年内公告了中国银行股份有限公司二连浩特市分行等多个分支机构被中国银行保险监督管理委员会锡林郭勒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。中国银行 (601988. SH) 于近一年内公告了吴雪峰等多位分支行高管被中国银行保险监督管理委员会新疆监管局等监管机构分别处以处罚, 违法事实涉及:担任中国银行乌鲁木齐市分行副行长期间, 对该行未有效监督贷款资金用途, 信贷资金未按约定用途使用负领导责任等。

本基金所持有的国泰君安 (601211. SH) 于 2021-04-30 公告, 其公司高管陈国钢于 2021-04-30 被上海证券交易所监管关注。主要违法事实:国泰君安证券股份有限公司 (以下简称国泰君安或公司) 于 2021 年 2 月 27 日披露公告, 公司时任独立董事陈国钢于 2020 年 8 月 19 日通过集中竞价交易方式增持公司 A 股股份合计 100,000 股, 占公司总股本的 0.00112253%, 增持总金额为

1,967,731 元，并于 2020 年 8 月 28 日通过集中竞价交易方式将上述 100,000 股股份全部减持，减持总金额为 1,932,000 元。本次增减持公司股份行为未产生收益。陈国钢作为公司独立董事，在六个月内买入又卖出公司 100,000 股股票的行为构成短线交易，其在股票卖出前也未按规定提前 15 个交易日披露减持计划。陈国钢于 2020 年 8 月 19 日买入公司股票前，未持有公司股票，上述卖出 100,000 股公司股份的行为，还违反了上市公司董事任职期间每年转让股份不超过本人所持有公司股份 25% 的规定。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	14,865.50
2	应收证券清算款	7,696.63
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	159,058.58

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	181,620.71

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 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
报告期期初基金份额总额	77,498,822.02	179,037,818.46
报告期期间基金总申购份额	46,474,644.69	8,483,695.82
减:报告期期间基金总赎回份额	33,144,468.26	101,508,538.01
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	90,828,998.45	86,012,976.27

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

截止 2022 年 3 月 31 日, 本基金持有上交所科创板流通受限股票。其中: 禾迈股份(688032), 公允价值占基金资产净值比例为 0.09%; 嘉和美康(688246), 公允价值占基金资产净值比例为 0.06%; 汇宇制药(688553), 公允价值占基金资产净值比例为 0.06%; 南模生物(688265), 公允价值占基金资产净值比例为 0.03%。

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

9.3 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 4 月 21 日