

# 信息披露 disclosure

## 东方多策略灵活配置混合型证券投资基金

### 2015 半年度报告摘要

交易部：负责提议召开估值委员会会议，并将已达成共识的重估方法所适用的金融产品明细提供风险管理部。

风险管理部：负责制定估值模型、假设及参数，确定参考行业指数并采集行业指数，据其计算估值公允价格；

登记清算部：负责估值事宜的内部外部协调，依据风险管理部提供的公允价格对投资品进行估值，计算基金资产净值及基金份额净值，并按照监管规定，要求做好相关信息披露工作；

监察稽核部：负责对估值政策、估值流程及程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督，及时提醒及督促整改。

除基金经理外，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，公司已与中国工商银行股份有限公司签署了《中债收益率曲线和中债估值服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对本公司旗下持有的银行间固定收益品种估值数据予以验证，并依据其提供的中债收益率估值数据对本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）。

注：截至2015年6月30日，交易所与登记清算部合并为运营部。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配政策的说明：本基金本报告期末未进行利润分配。

根据本基金基金合同相关规定，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 报告期内管理人对于本基金持有人人数或基金资产净值偏离情形的说明

报告期末，本基金不存在连续二十个工作日基金资产净值低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

5 托管人报告

1. 报告期内本基金托管人遵守信托协议声明

本报告期内，本基金托管人在对东方多策略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，完全按照基金管理人指令及合同约定履行了各项职责。

2. 报告期内，东方多策略灵活配置混合型证券投资基金的托管人——东方基金托管人在对东方多策略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、基金费用开支等事项上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各项业务的运作严格按照基金合同的约定进行。报告期内，东方多策略灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本基金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多策略灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告中的财务指标、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：东方多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产：

货币资金 163,264,047.12 28,301,226.69

结算备付金 713,525.28 13,123,006.07

存出保证金 218,618.73 508,104.68

交易性金融资产 1,171,079,734.03 666,860,963.96

其中：股票投资 90,193,887.25 56,480,531.80

基金投资 - - -

债券投资 1,081,786,146.78 600,379,432.16

资产支持证券投资 - - -

金融衍生品投资 - - -

买入返售金融资产 1,342,882,893.43 -

应收款项类投资 1,196.67 -

应收利息 21,024,513.50 20,476,536.14

应收股利 - - -

应收申购款 301,280.56 39,761.44

递延所得税资产 - - -

其他资产 - - -

资产总计 3,490,356,816.32 719,589,595.67

负债和所有者权益：

短期借款 - - -

应付账款 - - -

预收账款 - - -

应付利息 204,886.62 146,102.82

应付股利 91,730,422.78 101,343,686.21

所有者权益：

实收基金 2,694,325,326.80 563,305,487.74

未分配利润 704,030,066.73 54,940,501.82

所有者权益合计 3,398,355,393.53 618,246,989.56

负债和所有者权益总计 3,490,356,816.32 719,589,595.67

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.2162元，基金份额总额2,794,532,326.80份。

6.2 利润表

会计主体：东方多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目 2015年1月1日至2015年6月30日 2014年5月21日至2014年6月30日

一、收入 227,670,670.01 -1,402,068.96

1.利息收入 44,022,029.01 2,844,243.54

其中：存款利息收入 9,142,941.13 15,183.23

债券利息收入 26,608,048.00 2,279,512.44

债券投资收益 - - -

买入返售金融资产收入 9,170,380.86 -

其他利息收入 - - -

2.投资收益（损失以“-”填列） 171,689,264.47 729,906.24

其中：股票投资收益 167,410,196.78 297,422.10

基金投资收益 - - -

债券投资收益 - - -

资产支持证券投资 - - -

金融衍生品投资 - - -

其他投资收益 - - -

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） 19,913,270.41 -5,212,434.20

4.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） 1,141,300.66 137,225.54

5.其他收入（损失以“-”号填列） 26,483,060.29 1,738,366.61

二、费用 17,422,506.44 964,205.54

1.管理人报酬 17,422,506.44 964,205.54

2.托管费 2,903,765.06 159,036.09

3.销售服务费 - - -

4.交易费用 594,884.64 326,920.03

5.利息支出 5,061,742.94 289,589.67

其中：卖出回购金融资产支出 5,061,742.94 289,589.67

6.其他费用 170,076.52 29,291.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） 211,188,739.32 -3,230,414.69

减：所得税费用 - - -

四、净利润（净亏损以“-”号填列） 211,188,739.32 -3,230,414.69

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告期间：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目 2015年1月1日至2015年6月30日 所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值） 563,305,487.74 618,246,989.56

二、本期利润分配产生的基金净值变动（本期净收益） 211,188,739.32 211,188,739.32

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） 2,231,226,839.06 337,965,126.89

其中：1.基金申购款 2,610,182,153.06 410,122,512.62

2.基金赎回款 -299,956,314.00 -72,167,887.03

四、本期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） 2,794,532,326.80 604,032,066.73

六、其他综合收益 - - -

七、其他权益变动 - - -

八、其他 - - -

九、其他 - - -

十、其他 - - -

十一、其他 - - -

十二、其他 - - -

十三、其他 - - -

十四、其他 - - -

十五、其他 - - -

十六、其他 - - -

十七、其他 - - -

十八、其他 - - -

十九、其他 - - -

二十、其他 - - -

二十一、其他 - - -

二十二、其他 - - -

二十三、其他 - - -

二十四、其他 - - -

二十五、其他 - - -

二十六、其他 - - -

二十七、其他 - - -

二十八、其他 - - -

二十九、其他 - - -

三十、其他 - - -

三十一、其他 - - -

三十二、其他 - - -

三十三、其他 - - -

三十四、其他 - - -

三十五、其他 - - -

三十六、其他 - - -

三十七、其他 - - -

三十八、其他 - - -

三十九、其他 - - -

四十、其他 - - -

四十一、其他 - - -

四十二、其他 - - -

四十三、其他 - - -

四十四、其他 - - -

四十五、其他 - - -

四十六、其他 - - -

四十七、其他 - - -

四十八、其他 - - -

四十九、其他 - - -

五十、其他 - - -

五十一、其他 - - -

五十二、其他 - - -

五十三、其他 - - -

五十四、其他 - - -

五十五、其他 - - -

五十六、其他 - - -

五十七、其他 - - -

五十八、其他 - - -

五十九、其他 - - -

六十、其他 - - -

六十一、其他 - - -

六十二、其他 - - -

六十三、其他 - - -

六十四、其他 - - -

六十五、其他 - - -

六十六、其他 - - -

六十七、其他 - - -

六十八、其他 - - -

六十九、其他 - - -

七十、其他 - - -

七十一、其他 - - -

七十二、其他 - - -

七十三、其他 - - -

七十四、其他 - - -

七十五、其他 - - -

七十六、其他 - - -

七十七、其他 - - -

七十八、其他 - - -

七十九、其他 - - -

八十、其他 - - -

八十一、其他 - - -

八十二、其他 - - -

八十三、其他 - - -

八十四、其他 - - -

八十五、其他 - - -

八十六、其他 - - -

八十七、其他 - - -

八十八、其他 - - -

八十九、其他 - - -

九十、其他 - - -

九十一、其他 - - -

九十二、其他 - - -

九十三、其他 - - -

九十四、其他 - - -

九十五、其他 - - -

九十六、其他 - - -

九十七、其他 - - -

九十八、其他 - - -

九十九、其他 - - -

一百、其他 - - -

一百零一、其他 - - -

一百零二、其他 - - -

一百零三、其他 - - -

一百零四、其他 - - -

一百零五、其他 - - -

一百零六、其他 - - -

一百零七、其他 - - -

一百零八、其他 - - -

一百零九、其他 - - -

一百一十、其他 - - -

一百一十一、其他 - - -

一百一十二、其他 - - -

一百一十三、其他 - - -

一百一十四、其他 - - -

一百一十五、其他 - - -

一百一十六、其他 - - -

一百一十七、其他 - - -

一百一十八、其他 - - -

一百一十九、其他 - - -

一百二十、其他 - - -

一百二十一、其他 - - -

一百二十二、其他 - - -

一百二十三、其他 - - -

一百二十四、其他 - - -

一百二十五、其他 - - -

一百二十六、其他 - - -

一百二十七、其他 - - -

一百二十八、其他 - - -

一百二十九、其他 - - -

一百三十、其他 - - -

一百三十一、其他 - - -

一百三十二、其他 - - -

一百三十三、其他 - - -

一百三十四、其他 - - -

一百三十五、其他 - - -

一百三十六、其他 - - -

一百三十七、其他 - - -

一百三十八、其他 - - -

一百三十九、其他 - - -

一百四十、其他 - - -

一百四十一、其他 - - -

一百四十二、其他 - - -

一百四十三、其他 - - -

一百四十四、其他 - - -

一百四十五、其他 - - -