

## 2015 第三季度报告

11.1 投资组合投资组合情况

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发生有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。

11.1.2 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。

11.1.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	265,338.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,032,827.98
5	应收申购款	7,968.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,296,124.31

11.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券清单

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110300	格力转债	370,327.60	0.06

11.1.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600774	浙江股份	6,534,300.00	1.06	重大资产重组
2	600962	南京高科	3,567,527.26	0.56	重大资产重组
3	603893	君臣药	1,009,406.40	0.16	筹划重大事项

5.6 开放式基金份额变动		单位:份
报告期期初基金份额总额	6,206,061,842.06	
报告期内基金总申购份额	6,109,094.26	
减:报告期内基金总赎回份额	5,832,495,046.02	
报告期内基金净变动份额(份额减少以“-”填列)	-	
报告期末基金份额总额	6,119,359,690.89	

报告期期间买入并持有金额	-
报告期期间卖出/赎回基金份额	-
报告期期末持有的基金份额	8,888,000.00
报告期期末管理人持有的基金份额	-
报告期期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	1.71

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

本基金基金管理人运用固有资金投资本基金基金：

9.3 影响投资决策的其他重要信息

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会资产管理委员会公告[2008]38号)的规定,经与基金托管人协商一致,东方基金管理有限责任公司自 2015 年 7 月 7 日起,对旗下基金所有持有的停牌股票采用“指数收益法”进行估值,基金持有人有权了解相关信息,请查询公司网站及相关媒体公告。

9.9 备查文件目录

一、《东方保本混合型开放式证券投资基金合同》

二、《东方保本混合型开放式证券投资基金托管协议》

三、东方基金管理有限责任公司成立决议、营业执照、公司章程

四、本报告期内公开披露的基金资产负债、基金份额净值及其他公告

9.10 存放地点

上述备查文件存放在基金管理人办公场所。

9.11 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可合理期限内取得上述文件的复印件或复印件。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。

东方基金管理有限责任公司  
2015年10月26日

# 东方多策略灵活配置混合型证券投资基金

三 季 度 报 告			
3.2 期末按行业分类的股权投资组合			
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	800,000.00	0.13
B	采矿业	--	--
C	制造业	54,167,357.89	2.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	1,008,900.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	--	--
J	金融业	--	--
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	56,066,257.89	2.22

代码	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	300428	强力新材	39,011	3,471,887.89	0.50
2	000948	承德露露	300,000	2,512,000.00	0.36
3	002719	麦迪尔	50,000	2,410,000.00	0.35
4	002349	高乐股份	100,000	1,681,000.00	0.23
5	300341	奥翔电气	100,000	1,588,000.00	0.23
6	300286	国瓷材料	500,000	1,260,000.00	0.22
7	002360	德康新材	50,000	1,027,500.00	0.15
8	600694	大商股份	30,000	1,008,000.00	0.15
9	002450	益生股份	50,000	890,000.00	0.13
10	-	-	-	-	-

6.4 报告期末按品种分类的投资组合

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	2,008.00	0.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,102,000.00	5.90
4	央行、政策性金融债	40,102,000.00	5.90
5	企业债券	517,799,529.62	74.89
6	企业短期融资券	88,230,000.00	11.60
7	中期票据	-	-
7	资产支持	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	638,142,539.62	92.28

6.5 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	11190025	11国债承销	500,000	53,235,000.00	7.70
2	011550003	15国飞 SCP003	500,000	50,140,000.00	7.25
3	11190033	11国债承销	450,000	46,930,500.00	6.79

[illegible]

6.11.2

报告期末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。

6.11.3 投资组合构成

序号	名称	金额(元)	
1	存出保证金		163,509.64
2	应收证券清算款		-
3	应收股利		-
4	应收利息	16,601,644.76	-
5	应收申购款		1,988.08
6	其他应收款		-
7	待摊费用		-
8	其他		-
9	合计	16,847,142.27	

6.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有可转换债券

6.11.5 报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明

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	300429	强势力斯	3,471,057.00	0.69	重大资产重组
2	002719	麦趣尔	2,410,000.00	0.36	筹划重大事项
3	002348	高乐股份	1,601,000.00	0.23	筹划重大事项

5.6 开放式基金份额变动

报告期初基金份额总额	2,794,532,326.80
报告期间基金份额申购总额	4,522,900.76
减: 报告期间基金份额赎回总额	2,234,113,961.68

(单位: 份)

报告期间基金资产变动的份额(份数)净变动额(—填列)	
报告期末基金份额总额	664,041,238.97
<b>§7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况</b>	
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	
本报告基金管理人未持有本基金基金份额。	
7.2 基金管理人报告期内投资本基金交易明细	
本报告基金管理人未运用固有资金投资本基金。	
<b>§8 影响投资者决策的其他重要信息</b>	
根据中国证监会于2015年10月26日颁布并实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(证监会公告[2015]13号)的规定,经与基金托管人协商一致,自2015年12月27日起,对旗下各基金的估值和会计核算采用“摊余成本法”进行估值。基金合同持有人除了了解该事项外,请垂青本公司网站相关通知公告。 <b>§9 备查文件目录</b>	
(一) 基金管理人设立及存续证明文件、营业执照复印件、基金管理业务资格批复文件等;(二) 基金托管人设立及存续证明文件、营业执照复印件、基金托管业务资格批复文件等;(三) 基金募集申请核准文件、基金合同、招募说明书、基金产品资料概要、基金销售协议、基金认购、申购、赎回费率、基金定期定额投资业务规则、基金转换业务规则、基金收益分配原则、基金分红实施公告;(四) 投资决策程序;(五) 基金资产存放在基金管理人处的情形;(六) 风险控制制度;(七) 基金投资策略;(八) 基金费用计提标准、支付方式和支付方式;可在合理时间内取得上述文件的复制或印刷件。授权代表在符合法律法规及基金合同约定的前提下有权查阅或复制有关资料。	
www.ebsfunds.com.cn www.ebsfund.com.cn	