

中国工商银行 (资产托管部上海分部)

东方红-8号双向策略集合资产管理计划季度托管报告

(报告期间: 2015年4月1日—2015年6月30日)

本托管人依据《东方红-8号双向策略集合资产管理合同》(以下简称《管理合同》)、《东方红-8号双向策略集合资产管理计划托管协议》(以下简称《托管协议》),自2011年12月28日起托管东方红-8号双向策略集合资产管理(以下称“计划”或“本计划”)资产。现根据中国证券监督管理委员会《证券公司客户资产管理业务试行办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则(试行)》及其他相关规定,出具2015年第2季度托管报告。

(一)本托管人在报告期间,严格遵守《证券公司客户资产管理业务试行办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则(试行)》和管理合同、托管协议及其他有关法律法规的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在损害计划持有人利益的行为。

1、本托管人履行安全保管计划资产的职责,将计划资产与自有资产以及所托管的其他非本计划的资产严格分开,实行了严格的分账管理,维护计划资产的独立性;对从计划资产中列支的各项费用和计划的应得收益进行了严格复核,确保计划资产的完整。

2、本计划资产的投资对象包括国内依法发行的股票、债券、股指期货、权证、证券投资基金以及法律法规或中国证监会在本合同生效后允许证券公司集合资产管理计划投资的其他金融工具或品种。本托管人根据管理合同、托管协议及其他有关法律法规的规定,对管理人运用计划资产进行投资的行为进行了监督。

3、本托管人严格根据相关法律法规、托管协议的规定,审核、执行计划管理人的划款指令,及时、准确地完成了本计划的各项资金清算交割。



4、本托管人对与本计划资产相关的重大合同原件、因履行托管人职责而生成或收悉的记录计划业务活动的原始凭证、记账凭证、计划账册、交易记录等实施了妥善保管。

(二)本托管人在本报告期间，依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则（试行）》和管理合同、托管协议及其他有关法规对计划管理人——上海东方证券资产管理有限公司（以下称管理人）的投资运作进行了监督。

1、管理人在本计划的会计核算、资产估值、净值计算、计划份额申购赎回价格的计算以及计划费用开支等方面遵守了《证券公司客户资产管理业务试行办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则（试行）》和管理合同、托管协议及其他有关法规的规定，未发现其存在任何损害计划份额持有人利益的行为。

2、本托管人复核了东方红-8号双向策略集合资产管理计划2015年第2季度资产管理报告中的主要财务指标、投资组合报告、计划份额变动情况中的数据，认为其准确无误。

中国工商银行股份有限公司资产托管部上海分部

2015年7月20日

