

东方启明量化先锋混合 2015 年第 4 季度 报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年一月二十一日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 1 月 15 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。

本公司于 2015 年 10 月 22 日至 2015 年 11 月 30 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，表决通过了《关于东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金转型有关事项的决议》，自 2015 年 12 月 3 日起实施转型，由东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金正式变更为东方启明量化先锋混合型证券投资基金。详情可参阅本公司于 2015 年 12 月 2 日在《证券时报》和管理人网站上发布的《关于以通讯方式重新召开东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》及其提示性公告、《东方基金管理有限责任公司关于东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

东方启明量化先锋混合型证券投资基金报告期自 2015 年 12 月 3 日起至 2015 年 12 月 31 日止，原东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金报告期自 2015 年 10 月 1 日起至 2015 年 12 月 2 日止。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	东方启明量化先锋
基金主代码	400018
交易代码	400018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 3 日
报告期末基金份额总额	8,985,885.68 份
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过量化选股策略，结合类别资产的配置，力争获

	得基金的长期稳定增值。
投资策略	本基金基金资产的 30%-95%可投资于股票，在符合法律法规的规定和基金合同约定的前提下，本基金通过量化选股策略筛选股票，结合类别资产的配置力争实现分散组合投资风险、提高投资收益的目标。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%。
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	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

转型前：

基金简称	东方央视财经 50 指数
基金主代码	400018
交易代码	400018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 19 日
报告期末基金份额总额	23,835,583.54 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对央视财经 50 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值，分享中国经济的持续、稳定增长的成果。
投资策略	本基金将追求对股票的充分投资，股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于央视财经 50 指数成份股及其备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。本基金采用“指数化被动投资为主、主动性增强投资为辅”的投资策略来构建股票投资组合，指数化投资部分运用被动投资策略，采用全复制的方法，对成份股及备选成份股进行配置。主动性增强部分主要采取定量分析与定性分析相结合的方法，对央视财经 50 指数成份股进行权重优化，适度投资于优选的非成份股上市公司股票。
业绩比较基准	央视财经 50 指数收益率×95%+ 银行活期

	存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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	转型后
	报告期（2015年12月3日—2015年12月31日）
1. 本期已实现收益	1,962,309.72
2. 本期利润	126,155.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0076
4. 期末基金资产净值	12,940,531.45
5. 期末基金份额净值	1.4401

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。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	转型前
	报告期（2015年10月1日—2015年12月2日）
1. 本期已实现收益	-173,786.28
2. 本期利润	2,473,382.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1195
4. 期末基金资产净值	33,900,634.19
5. 期末基金份额净值	1.4223

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。

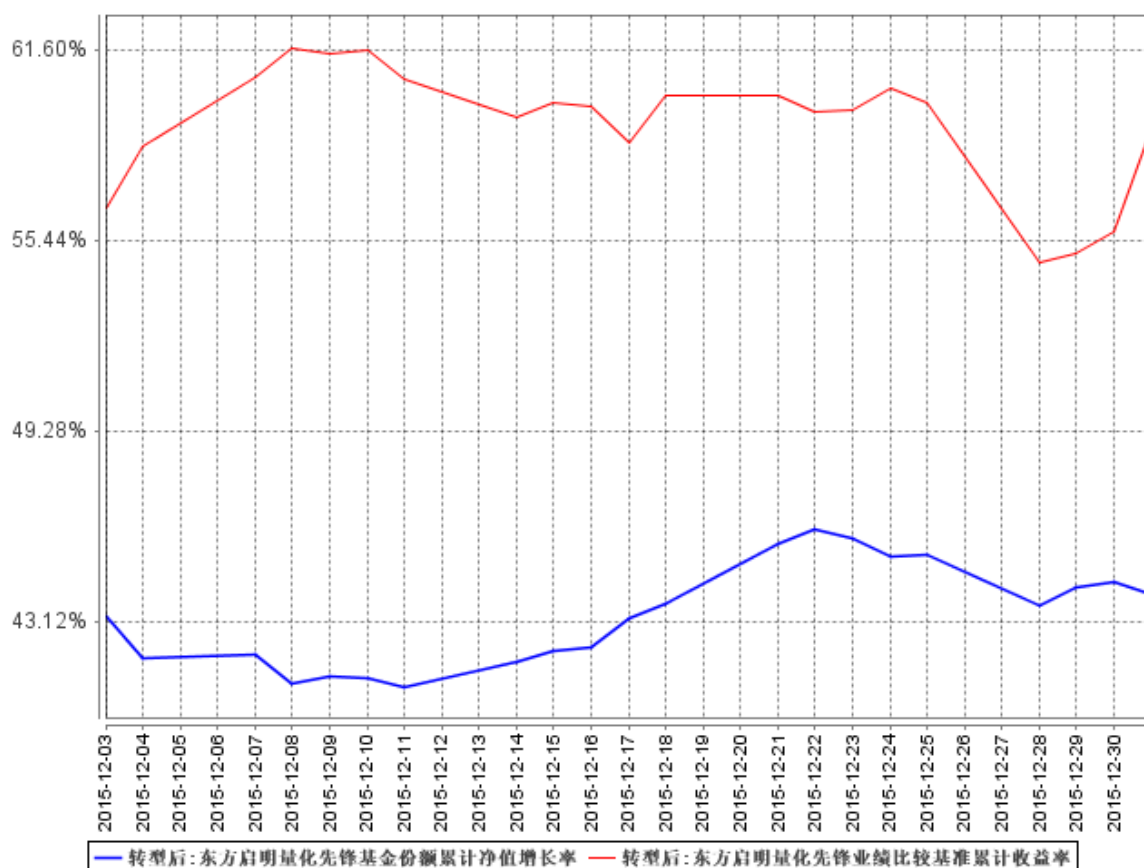
3.2 基金净值表现（转型后）

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	1.25%	0.57%	4.47%	1.20%	-3.22%	-0.63%

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

东方启明量化先锋基金份额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



注:本基金于 2015 年 12 月 3 日基金转型，截至报告期末，转型后基金合同生效不满六个月，仍处于建仓期。

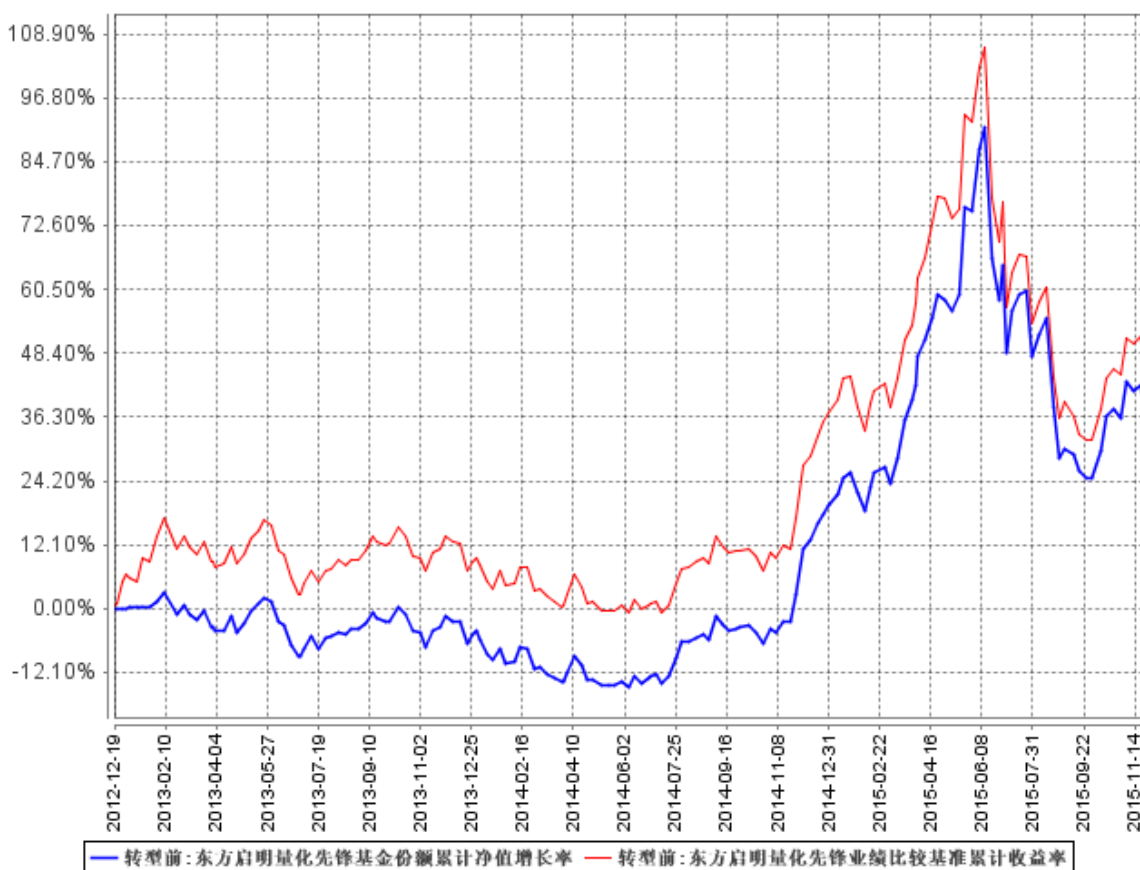
3.2 基金净值表现（转型前）

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	14.10%	1.67%	15.41%	1.56%	-1.31%	0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

东方启明量化先锋基金份额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（转型前）

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		

<p>刘志刚（先生）</p>	<p>本基金基金经理、量化投资部总经理、投资决策委员会委员</p>	<p>2015 年 2 月 2 日</p>	<p>-</p>	<p>7 年</p>	<p>吉林大学数量经济学博士，7 年证券从业经历。曾任工银瑞信基金管理有限公司产品开发部产品开发经理、安信基金管理有限责任公司市场部副总经理兼产品开发总监。2013 年 5 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任指数与量化投资部总经理、专户业务部总经理、产品开发部总经理、投资经理。现任量化投资部总经理，东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金（自 2015 年 12 月 3 日起转型为东方启明量化先锋混合型证券投资基金）基金经理，投资决策委员会委员。</p>
----------------	-----------------------------------	-----------------------	----------	------------	---

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
<p>刘志刚（先生）</p>	<p>本基金基金经理、量化投资部总经理、投资决策委员会委员</p>	<p>2015 年 2 月 2 日</p>	<p>-</p>	<p>7 年</p>	<p>吉林大学数量经济学博士，7 年证券从业经历。曾任工银瑞信基金管理有限公司产品开发部产品开发经理、安信基金管理有限责任公司市场部副</p>

					经理兼产品开发总监。2013 年 5 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任指数与量化投资部总经理、专户业务部总经理、产品开发部总经理、投资经理。现任量化投资部总经理，东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员。
--	--	--	--	--	---

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金基金合同》、《东方启明量化先锋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《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

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内的公平交易程序；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，未直接或通过与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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年 12 月，本基金由东方央视财经 50 指数增强型基金转型为东方启明量化先锋混合型基金。转型后的基金具有更加灵活的股票仓位调整空间。

报告期内，投资组合满足基金合同的规定。在转型之前本基金为指数增强型基金，在投资管理过程中，运用量化增强策略，在严格控制负向偏离的基础上，追求超越业绩比较基准的增强回报。在转型之后，本基金根据对市场形势的判断，按照新的基金合同约定灵活调整股票仓位，尽可能降低对系统性风险的暴露。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年 10 月 1 日起至 2015 年 12 月 2 日，转型前基金(东方央视财经 50 指数增强

型证券投资基金)净值增长率为 14.10%，业绩比较基准收益率为 15.41%，低于业绩比较基准 1.31%。2015 年 12 月 3 日起至 2015 年 12 月 31 日，转型后基金(东方启明量化先锋混合型证券投资基金)净值增长率为 1.25%，业绩比较基准收益率为 4.47%，低于业绩比较基准 3.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年是“十三五”开局之年，中央经济工作会议强调要着力推进供给侧结构性改革，推动经济持续健康发展。预计在改革过程中，将围绕去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板“五大重点任务”，改革带来的阵痛是不可避免的。此外，全球经济增长在地缘政治和局部战争等威胁下面临较大的风险。在新的国内和国际形势下，中国经济在结构调整过程中将继续面临较大的下行压力，但改革的目标和希望是明确的。2016 年中国证券市场的改革和制度建设也将进一步推进，由于宏观经济的不确定性，证券市场的系统性风险仍然很难预测。本基金转型后，将积极利用调整后的股票仓位空间，严格控制下行风险，力争实现超越业绩基准的投资回报。

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，受本基金份额持有人赎回等影响，本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

§5 投资组合报告

转型后：

5.1.1 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	5,130,745.99	38.99
	其中：股票	5,130,745.99	38.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	6,000,000.00	45.59
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	2,000,684.51	15.20
7	其他资产	28,442.52	0.22
8	合计	13,159,873.02	100.00

5.1.2 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	采矿业	81,122.43	0.63
C	制造业	2,832,714.30	21.89
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	22,540.00	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	506,084.31	3.91
J	金融业	1,156,790.37	8.94
K	房地产业	293,404.30	2.27
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	151,594.28	1.17
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	28,260.00	0.22
S	综合	58,236.00	0.45
	合计	5,130,745.99	39.65

5.1.3 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	600016	民生银行	33,216	320,202.24	2.47
2	000002	万科A	12,010	293,404.30	2.27
3	601318	中国平安	7,986	287,496.00	2.22
4	600887	伊利股份	16,922	278,028.46	2.15
5	000651	格力电器	9,636	215,364.60	1.66
6	600690	青岛海尔	18,092	211,133.64	1.63

7	600519	贵州茅台	967	210,989.73	1.63
8	002415	海康威视	5,366	184,536.74	1.43
9	300017	网宿科技	2,979	178,710.21	1.38
10	601398	工商银行	33,681	154,258.98	1.19

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.1.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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、处罚的情形。

5.1.11.2

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。

5.1.12 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	21,798.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,534.66
5	应收申购款	5,109.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,442.52

5.1.13 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债券。

5.1.14 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（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000002	万科A	293,404.30	2.27	重大事项
2	600690	青岛海尔	211,133.64	1.63	重大事项

转型前：

5.1.15 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	31,558,696.91	92.40
	其中：股票	31,558,696.91	92.40
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,636,396.57	4.79

7	其他资产	958,120.53	2.81
8	合计	34,153,214.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	采矿业	566,100.99	1.67
C	制造业	16,718,285.61	49.32
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,360,935.27	9.91
J	金融业	7,108,354.44	20.97
K	房地产业	1,497,686.40	4.42
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	711,559.20	2.10
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	28,260.00	0.08
S	综合	408,965.00	1.21
	合计	30,400,146.91	89.67

5.2.2 报告期末积极投资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	采矿业	-	-
C	制造业	233,040.00	0.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	147,200.00	0.43
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	661,410.00	1.95
J	金融业	116,900.00	0.34
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	1,158,550.00	3.42

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600016	民生银行	226,516	2,025,053.04	5.97
2	601318	中国平安	54,210	1,952,102.10	5.76
3	600887	伊利股份	117,122	1,802,507.58	5.32
4	000002	万科A	82,110	1,497,686.40	4.42
5	600519	贵州茅台	6,667	1,477,273.86	4.36
6	000651	格力电器	64,036	1,344,756.00	3.97
7	002415	海康威视	36,907	1,283,256.39	3.79
8	300017	网宿科技	20,179	1,208,923.89	3.57
9	601398	工商银行	229,881	1,085,038.32	3.20
10	600406	国电南瑞	57,700	907,044.00	2.68

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600570	恒生电子	8,000	514,800	1.52
2	601800	中国交建	10,000	147,200	0.43
3	300104	乐视网	3,000	146,610	0.43
4	002594	比亚迪	2,000	126,240	0.37
5	601211	国泰君安	5,000	116,900	0.34

5.3.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.3.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.3.5 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.3.8 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。

5.3.9 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。

5.3.10 投资组合报告附注

5.3.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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、处罚的情形。

5.3.10.2

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。

5.3.11 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	21,798.85
2	应收证券清算款	861,893.35
3	应收股利	-
4	应收利息	3,409.63
5	应收申购款	7,571.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	63,446.86
8	其他	-
9	合计	958,120.53

5.3.12 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债券。

5.3.13 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

基金合同生效日（2015年12月3日）	25,737,619.46
基金份额总额	
报告期期初基金份额总额	-
报告期期间基金总申购份额	103,162.54
减：报告期期间基金总赎回份额	16,854,896.32
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	8,985,885.68

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

7.1.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§7 基金管理人运用自有资金投资本基金情况（转型前）

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

7.1.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 一、中国证监会批准东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 二、中国证监会核准东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金转型的文件；
- 三、《东方基金管理有限责任公司关于东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》
- 四、《东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 五、《东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 六、《东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 七、《东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- 八、《东方启明量化先锋混合型证券投资基金托管协议》；
- 九、《东方启明量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》；
- 十、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 十一、报告期内东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

8.3 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。

东方基金管理有限责任公司
2016 年 1 月 21 日