

Bank 中国光大银行

国金创新三原色量化精选 MOM 集合资产管理计划

(二零一六年第二季度) 托管报告

本计划托管人—中国光大银行根据《国金创新三原色量化精选 MOM 集合资产管理计划资产管理合同》和《国金创新三原色量化精选 MOM 集合资产管理计划资产托管协议》，在托管国金创新三原色量化精选 MOM 集合资产管理计划的过程中，严格遵守《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》及各项法规规定，对国金创新三原色量化精选 MOM 集合资产管理计划管理人—国金证券股份有限公司 2016 年 4 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害计划份额持有人利益的行为。

在报告期内，国金证券股份有限公司，遵守了《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》等有关法律法规。

信息披露符合《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《国金创新三原色量化精选 MOM 集合资产管理计划资产管理合同》及其相关法规的规定，计划管理人所编制和披露的《国金创新三原色量化精选 MOM 集合资产管理计划 2016 年第二季度资产管理报告》中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息是真实、准确。

中国光大银行 投资与托管业务部

2016 年 7 月 21 日

