

东方启明量化先锋混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 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

送出日期：二〇一六年八月二十六日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、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，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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 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.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8 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贵金属投资明细.....	43
7.9 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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43

§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
§11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方启明量化先锋混合型证券投资基金
基金简称	东方启明量化先锋
基金主代码	400018
前端交易代码	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
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
报告期末基金份额总额	8,627,195.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	本基金的业绩比较基准为：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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	林葛
	联系电话	010-66295888	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95599
传真		010-66578700	010-68121816
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京复兴门内大街 2 8 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码	100033	100031
法定代表人	崔伟	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金半年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-38,191.05
本期利润	-256,423.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0290
本期加权平均净值利润率	-2.14%
本期基金份额净值增长率	-1.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,560,613.50
期末可供分配基金份额利润	0.4127
期末基金资产净值	12,187,809.24
期末基金份额净值	1.4127
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-0.67%

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期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润

的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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

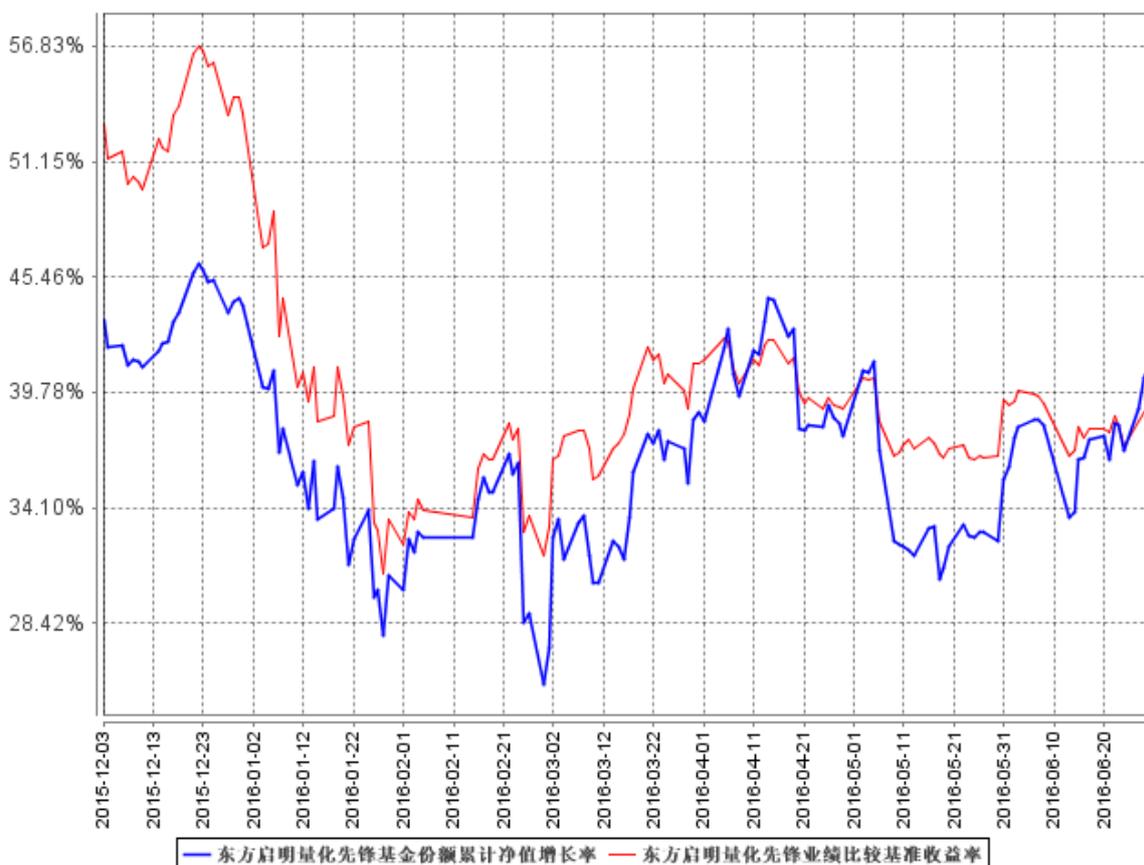
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	4.26%	1.09%	-0.10%	0.60%	4.36%	0.49%
过去三个月	1.79%	1.23%	-1.41%	0.61%	3.20%	0.62%
过去六个月	-1.90%	1.45%	-9.30%	1.11%	7.40%	0.34%
过去一年	-0.67%	1.35%	-8.57%	1.07%	7.90%	0.28%
过去三年	-0.67%	1.35%	-8.57%	1.07%	7.90%	0.28%
自基金合同生效起至今	-0.67%	1.35%	-8.57%	1.07%	7.90%	0.28%

注：本基金基金合同于 2015 年 12 月 3 日生效，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司。东方基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）经中国证监会批准（证监基金字【2004】80号）于2004年6月11日成立，是《中华人民共和国证券投资基金法》施行后成立的第一家基金管理公司。本公司注册资本2亿元人民币。本公司股东为东北证券股份有限公司，持有股份64%；河北省国有资产控股运营有限公司，持有股份27%；渤海国际信托股份有限公司，持有股份9%。截至2016年6月30日，本公司管理35只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长股票型开放式证券投资基金、东方稳健回报债

券型证券投资基金、东方核心动力股票型开放式证券投资基金、东方保本混合型开放式证券投资基金、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方赢家保本混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方稳定增利债券型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方大健康混合型证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方荣家保本混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合证券投资基金、东方合家保本混合型证券投资基金、东方臻馨债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘志刚 (先生)	本基金基金经理、量化投资部总经理、投资决策委员会委员	2015 年 2 月 2 日	-	8 年	吉林大学数量经济学博士，8 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、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。现任量化投资部总经理，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。

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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的同向交易价差、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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金继续采用数量化方法指导大类资产配置、行业配置和股票组合构建，力争在有效控制净值回撤的同时追求稳定的投资收益。在股票组合构建方面，在量化多因子模型基础上采用多策略相结合的方式组合构建和调整，组合业绩显著超越市场指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日，本基金净值增长率为-1.90%，业绩比较基准收益率为-9.30%，高于业绩比较基准 7.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受英国脱欧、地缘政治冲突、美国总统大选等因素的影响，下半年全球经济增长的不确定性继续增加。国内宏观经济和资本市场与全球经济的关联性日趋加深。虽然供给侧改革的力度和深度不断增强，对产能过剩的产业造成了较大的负面冲击，但上半年工业增速已基本企稳，实体经济的下行风险已基本得到控制。2016 年前 6 个月，全国规模以上工业企业实现利润总额同比增长 6.2%，虽然较前 5 个月略有回落，但持续保持了增长势头。围绕供给侧结构性改革的五大任务——“去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板”，上半年经济增长与转型取得较为明显的成效。

证券市场方面，新近出台的改革和监管政策致力于去杠杆、去泡沫、规范市场参与主体。证监会对上市公司再融资审核和并购重组审核更加严格，并加强了对资产管理行业通道类业务的监管力度。银监会对银行理财业务的新规定，将规范理财资金使用，减小理财资金对股票市场的非理性冲击。这些措施将有望降低证券市场的系统性风险，有利于市场向健康稳定的运行模式转变，并逐步投资者的信心。二季度以来，股票市场的波动率显著降低，在此形势下，预计下半年股票市场在震荡中有望走出一波上升行情。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会公告【2008】38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，本基金管理人成立了东方基金管理有限责任公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟

悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称“停牌有价证券”）时，根据估值委员会要求和运营部的估值方案，负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当，对估值方法有失公允性的“停牌有价证券”，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

4. 风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述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，公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的中证债券估值数据对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）。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并将采取适当措施。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东方基金管理有限责任公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，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，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，东方基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东方基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：东方启明量化先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,216,820.58	1,994,293.75
结算备付金		182,576.87	6,390.76
存出保证金		26,319.71	21,798.85
交易性金融资产	6.4.7.2	9,040,907.34	5,130,745.99

其中：股票投资		9,040,907.34	5,130,745.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	6,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	797.40	1,534.66
应收股利		-	-
应收申购款		2,982.12	5,109.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,470,404.02	13,159,873.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		51,884.33	-
应付管理人报酬		9,760.90	20,734.53
应付托管费		2,440.21	5,093.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	169,197.04	146,705.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	49,312.30	46,807.33
负债合计		282,594.78	219,341.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	8,627,195.74	8,985,885.68
未分配利润	6.4.7.10	3,560,613.50	3,954,645.77
所有者权益合计		12,187,809.24	12,940,531.45
负债和所有者权益总计		12,470,404.02	13,159,873.02

注：①报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4127 元，基金份额总额 8,627,195.74 份。

②本基金基金合同于 2015 年 12 月 3 日生效，无上年度可比期间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：东方启明量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		142,408.59
1.利息收入		21,608.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,149.70
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,458.91
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		331,007.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	307,355.74
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	23,652.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-218,232.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	8,024.93
减：二、费用		398,832.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	59,710.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,927.62
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	220,597.29
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	103,597.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-256,423.91
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-256,423.91

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方启明量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、投资限制、收益分配原则、基金的费用以及其他部分条款，并按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金合同进行修订，办理本次基金转型的有关具体事宜。持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 2015 年 12 月 3 日正式实施基金转型，自基金转型实施之日起，《东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金基金合同》失效且《东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金合同》同时生效，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方启明量化先锋混合型证券投资基金》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号—半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一年保持一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 04 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》财税[2015]101 号及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳营业税和企业所得税。
3. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	3,216,820.58
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,216,820.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,703,480.73	9,040,907.34	337,426.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,703,480.73	9,040,907.34	337,426.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	712.80
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	73.98
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.62
合计	797.40

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	169,197.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	169,197.04

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	58.50
预提费用	49,253.80
合计	49,312.30

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和银行间债券账户维护费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,985,885.68	8,985,885.68
本期申购	1,663,177.94	1,663,177.94
本期赎回(以“-”号填列)	-2,021,867.88	-2,021,867.88
本期末	8,627,195.74	8,627,195.74

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,869,895.79	-1,915,250.02	3,954,645.77
本期利润	-38,191.05	-218,232.86	-256,423.91
本期基金份额交易产生的变动数	-229,573.32	91,964.96	-137,608.36
其中：基金申购款	1,032,705.30	-435,648.43	597,056.87
基金赎回款	-1,262,278.62	527,613.39	-734,665.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,602,131.42	-2,041,517.92	3,560,613.50

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,940.27
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,898.50
其他	310.93
合计	17,149.70

注：其他包括基金申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	71,673,800.88
减：卖出股票成本总额	71,366,445.14

买卖股票差价收入	307,355.74
----------	------------

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	23,652.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,652.17

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-218,232.86
——股票投资	-218,232.86
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-218,232.86

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	7,209.86
基金转换费收入	815.07
合计	8,024.93

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	220,597.29
银行间市场交易费用	-
合计	220,597.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	24,863.02
账户维护费	9,380.00
指数使用费	47,692.67
银行汇划费用	1,770.57
合计	103,597.04

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东北证券股份有限公司	76,695,888.13	52.03%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券股份有限 公司	69,893.10	51.49%	127,479.95	75.34%

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	59,710.55
其中：支付销售机构的客户维护费	29,529.79

注：①本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,927.62

注：①本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	3,216,820.58	14,940.27

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2015年12月18日	重大事项	18.20	2016年7月4日	21.99	12,010	162,402.53	218,582.00	-
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项	19.22	-	-	9,636	176,116.20	185,203.92	-
600321	国栋建设	2016年5月6日	重大事项	4.02	-	-	19,000	73,161.00	76,380.00	-

		日								
300246	宝莱特	2016年 6月27 日	重大 事项	30.31	2016年 7月1 日	32.20	2,200	69,322.00	66,682.00	-
000710	天兴 仪表	2016年 6月15 日	重大 事项	22.12	-	-	2,900	70,607.00	64,148.00	-
600796	钱江 生化	2016年 5月31 日	重大 事项	9.80	-	-	5,500	49,775.00	53,900.00	-
600545	新疆 城建	2016年 5月31 日	重大 事项	6.91	-	-	7,400	54,553.05	51,134.00	-
300044	赛为 智能	2016年 5月12 日	重大 事项	12.97	-	-	3,900	51,590.00	50,583.00	-
002447	壹桥 海参	2016年 3月9 日	重大 事项	7.19	-	-	6,800	41,816.76	48,892.00	-
300080	易成 新能	2016年 5月19 日	重大 事项	7.76	-	-	5,700	44,408.00	44,232.00	-
002101	广东 鸿图	2016年 4月29 日	重大 事项	21.62	-	-	900	20,428.62	19,458.00	-
000950	*ST建 峰	2016年 3月18 日	重大 事项	7.45	-	-	2,300	13,778.31	17,135.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和监察稽核部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的股票市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	-	-

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.3 流动性风险

所谓流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金

投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和负债不计息，持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,216,820.58	-	-	-	3,216,820.58
结算备付金	182,576.87	-	-	-	182,576.87
存出保证金	26,319.71	-	-	-	26,319.71
交易性金融资产- 股票投资	-	-	-	9,040,907.34	9,040,907.34
交易性金融资产- 债券投资	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	797.40	797.40
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,982.12	2,982.12
资产总计	3,425,717.16	-	-	9,044,686.86	12,470,404.02
负债					
卖出回购金融资产 款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	51,884.33	51,884.33
应付管理人报酬	-	-	-	9,760.90	9,760.90
应付托管费	-	-	-	2,440.21	2,440.21
应付交易费用	-	-	-	169,197.04	169,197.04
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	49,312.30	49,312.30
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	282,594.78	282,594.78
利率敏感度缺口	3,425,717.16	-	-	8,762,092.08	12,187,809.24
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,994,293.75	-	-	-	1,994,293.75
结算备付金	6,390.76	-	-	-	6,390.76
存出保证金	21,798.85	-	-	-	21,798.85
交易性金融资产	-	-	-	5,130,745.99	5,130,745.99

买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,534.66	1,534.66
应收申购款	5,109.01	-	-	-	5,109.01
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,027,592.37	-	-	5,132,280.65	13,159,873.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	20,734.53	20,734.53
应付托管费	-	-	-	5,093.79	5,093.79
应付交易费用	-	-	-	146,705.92	146,705.92
其他负债	-	-	-	46,807.33	46,807.33
负债总计	-	-	-	219,341.57	219,341.57
利率敏感度缺口	8,027,592.37	-	-	4,912,939.08	12,940,531.45

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	0.00	0.00
	市场利率上调 0.25%	0.00	0.00

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 6 月 30 日		2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	9,040,907.34	74.18	5,130,745.99	39.65
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,040,907.34	74.18	5,130,745.99	39.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-757,505.89	-220,842.17
	沪深 300 指数上涨 5%	757,505.89	220,842.17

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。			
假设	1. 置信区间 0.95		
	2. 观察期 过去 100 个交易日		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）

	合计	289,894.65	-
--	----	------------	---

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本半年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,040,907.34	72.50
	其中：股票	9,040,907.34	72.50
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	3,399,397.45	27.26
7	其他各项资产	30,099.23	0.24
8	合计	12,470,404.02	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	233,306.00	1.91
B	采矿业	237,120.00	1.95
C	制造业	5,550,709.01	45.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,840.33	0.43
E	建筑业	60,825.56	0.50
F	批发和零售业	795,951.00	6.53
G	交通运输、仓储和邮政业	299,200.68	2.45

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	878,086.40	7.20
J	金融业	122,882.00	1.01
K	房地产业	675,794.36	5.54
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,142.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	49,584.00	0.41
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	19,040.00	0.16
S	综合	54,426.00	0.45
	合计	9,040,907.34	74.18

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	12,010	218,582.00	1.79
2	000651	格力电器	9,636	185,203.92	1.52
3	000150	宜华健康	5,700	177,726.00	1.46
4	600366	宁波韵升	4,800	114,576.00	0.94
5	600826	兰生股份	4,200	109,956.00	0.90
6	002036	联创电子	4,500	105,345.00	0.86
7	300339	润和软件	2,900	103,936.00	0.85
8	002401	中海科技	5,600	102,704.00	0.84
9	002597	金禾实业	7,500	101,025.00	0.83
10	300097	智云股份	2,000	100,100.00	0.82
11	002579	中京电子	6,100	95,648.00	0.78
12	300115	长盈精密	4,500	92,700.00	0.76
13	300245	天玑科技	4,100	91,020.00	0.75
14	600589	广东榕泰	8,800	89,320.00	0.73
15	300074	华平股份	7,400	88,800.00	0.73
16	002119	康强电子	4,200	85,932.00	0.71
17	000785	武汉中商	7,200	80,280.00	0.66

18	000026	飞亚达 A	7,000	80,010.00	0.66
19	300343	联创互联	3,600	78,156.00	0.64
20	000762	西藏矿业	3,100	76,632.00	0.63
21	600321	国栋建设	19,000	76,380.00	0.63
22	300321	同大股份	2,300	76,337.00	0.63
23	002606	大连电瓷	3,900	76,011.00	0.62
24	603227	雪峰科技	3,900	74,880.00	0.61
25	000701	厦门信达	4,200	74,046.00	0.61
26	002382	蓝帆医疗	6,500	73,060.00	0.60
27	300289	利德曼	4,800	71,808.00	0.59
28	300379	东方通	900	71,532.00	0.59
29	002270	华明装备	4,400	71,456.00	0.59
30	600119	长江投资	4,700	71,393.00	0.59
31	600889	南京化纤	6,600	71,148.00	0.58
32	002243	通产丽星	5,500	70,125.00	0.58
33	000561	烽火电子	6,300	70,056.00	0.57
34	300023	宝德股份	2,700	69,849.00	0.57
35	002679	福建金森	3,100	69,347.00	0.57
36	000529	广弘控股	8,400	68,712.00	0.56
37	000523	广州浪奇	6,300	68,481.00	0.56
38	002259	升达林业	8,700	67,251.00	0.55
39	300443	金雷风电	1,000	66,710.00	0.55
40	300246	宝莱特	2,200	66,682.00	0.55
41	300022	吉峰农机	8,100	66,339.00	0.54
42	000969	安泰科技	4,700	65,941.00	0.54
43	600560	金白天正	4,000	65,880.00	0.54
44	002749	国光股份	800	65,616.00	0.54
45	600128	弘业股份	5,100	65,433.00	0.54
46	600684	珠江实业	8,700	65,337.00	0.54
47	600818	中路股份	2,100	65,331.00	0.54
48	600626	申达股份	6,300	65,016.00	0.53
49	002757	南兴装备	1,600	64,960.00	0.53
50	002501	利源精制	6,000	64,800.00	0.53
51	000710	天兴仪表	2,900	64,148.00	0.53
52	600000	浦发银行	4,100	63,837.00	0.52
53	300272	开能环保	4,100	63,263.00	0.52
54	002378	章源钨业	5,900	61,655.00	0.51
55	600279	重庆港九	8,600	61,318.00	0.50
56	600784	鲁银投资	6,900	60,789.00	0.50

57	002320	海峡股份	3,900	60,723.00	0.50
58	002661	克明面业	3,700	60,717.00	0.50
59	600747	大连控股	13,800	60,306.00	0.49
60	002760	凤形股份	1,600	60,304.00	0.49
61	002269	美邦服饰	13,700	60,280.00	0.49
62	002460	赣锋锂业	1,800	60,210.00	0.49
63	300094	国联水产	4,100	59,942.00	0.49
64	002296	辉煌科技	3,300	59,895.00	0.49
65	600765	中航重机	4,100	59,778.00	0.49
66	000021	深科技	5,400	59,454.00	0.49
67	002602	世纪华通	3,200	59,296.00	0.49
68	002098	浔兴股份	5,100	59,262.00	0.49
69	603108	润达医疗	2,100	59,199.00	0.49
70	600816	安信信托	3,500	59,045.00	0.48
71	300442	普丽盛	1,300	58,968.00	0.48
72	002105	信隆健康	6,000	58,680.00	0.48
73	601177	杭齿前进	5,951	58,676.86	0.48
74	300376	易事特	2,100	57,309.00	0.47
75	600395	盘江股份	6,800	56,168.00	0.46
76	600517	置信电气	5,900	56,109.00	0.46
77	603309	维力医疗	2,100	55,650.00	0.46
78	002086	东方海洋	6,300	55,125.00	0.45
79	300264	佳创视讯	4,200	55,062.00	0.45
80	300342	天银机电	1,800	54,828.00	0.45
81	002554	惠博普	7,600	54,720.00	0.45
82	600082	海泰发展	9,400	54,426.00	0.45
83	600117	西宁特钢	10,800	54,324.00	0.45
84	300103	达刚路机	2,900	54,230.00	0.44
85	300240	飞力达	5,076	54,211.68	0.44
86	600796	钱江生化	5,500	53,900.00	0.44
87	002363	隆基机械	4,100	53,382.00	0.44
88	002487	大金重工	6,000	53,100.00	0.44
89	300383	光环新网	1,400	53,060.00	0.44
90	000678	襄阳轴承	6,700	52,930.00	0.43
91	600874	创业环保	6,800	52,836.00	0.43
92	600272	开开实业	3,000	52,770.00	0.43
93	600055	华润万东	3,000	52,680.00	0.43
94	000708	大冶特钢	4,700	52,640.00	0.43
95	600186	莲花健康	9,900	52,569.00	0.43

96	002205	国统股份	2,200	52,448.00	0.43
97	600093	禾嘉股份	4,200	52,122.00	0.43
98	600053	九鼎投资	1,500	51,945.00	0.43
99	600735	新华锦	3,700	51,911.00	0.43
100	300205	天喻信息	3,500	51,765.00	0.42
101	600798	宁波海运	10,500	51,555.00	0.42
102	600533	栖霞建设	10,200	51,408.00	0.42
103	600545	新疆城建	7,400	51,134.00	0.42
104	600861	北京城乡	3,800	50,882.00	0.42
105	600865	百大集团	4,300	50,783.00	0.42
106	300044	赛为智能	3,900	50,583.00	0.42
107	000897	津滨发展	13,000	50,310.00	0.41
108	600338	西藏珠峰	1,700	49,963.00	0.41
109	000758	中色股份	6,400	49,600.00	0.41
110	600593	大连圣亚	1,600	49,584.00	0.41
111	600623	华谊集团	2,500	49,525.00	0.41
112	300050	世纪鼎利	3,400	48,926.00	0.40
113	002447	壹桥海参	6,800	48,892.00	0.40
114	600980	北矿科技	1,600	46,240.00	0.38
115	300250	初灵信息	1,497	44,296.23	0.36
116	300080	易成新能	5,700	44,232.00	0.36
117	600487	亨通光电	3,200	40,256.00	0.33
118	600355	精伦电子	5,200	39,156.00	0.32
119	002115	三维通信	2,800	32,172.00	0.26
120	002281	光迅科技	500	32,100.00	0.26
121	002104	恒宝股份	1,900	31,236.00	0.26
122	600183	生益科技	2,700	25,029.00	0.21
123	300333	兆日科技	1,000	23,800.00	0.20
124	002153	石基信息	900	23,742.00	0.19
125	300209	天泽信息	900	22,725.00	0.19
126	300231	银信科技	1,200	22,128.00	0.18
127	300130	新国都	700	21,630.00	0.18
128	300229	拓尔思	1,000	21,380.00	0.18
129	002449	国星光电	1,600	21,232.00	0.17
130	300369	绿盟科技	500	21,155.00	0.17
131	002189	利达光电	700	19,782.00	0.16
132	600618	氯碱化工	1,500	19,695.00	0.16
133	002101	广东鸿图	900	19,458.00	0.16
134	002139	拓邦股份	1,300	18,798.00	0.15

135	000977	浪潮信息	800	18,760.00	0.15
136	600136	当代明诚	800	18,520.00	0.15
137	000938	紫光股份	300	18,264.00	0.15
138	600100	同方股份	1,200	17,952.00	0.15
139	000970	中科三环	1,200	17,412.00	0.14
140	002005	德豪润达	2,900	17,139.00	0.14
141	000950	*ST 建峰	2,300	17,135.00	0.14
142	600525	长园集团	1,200	16,620.00	0.14
143	000413	东旭光电	1,900	16,321.00	0.13
144	002008	大族激光	700	15,988.00	0.13
145	300188	美亚柏科	600	15,984.00	0.13
146	002279	久其软件	700	15,526.00	0.13
147	600409	三友化工	2,300	15,502.00	0.13
148	002360	同德化工	1,300	15,405.00	0.13
149	002577	雷柏科技	300	15,315.00	0.13
150	002636	金安国纪	900	14,760.00	0.12
151	002411	必康股份	800	14,280.00	0.12
152	600288	大恒科技	1,100	14,234.00	0.12
153	000681	视觉中国	600	14,190.00	0.12
154	600063	皖维高新	3,100	13,733.00	0.11
155	002197	证通电子	700	13,454.00	0.11
156	000662	天夏智慧	600	12,900.00	0.11
157	300192	科斯伍德	1,000	12,730.00	0.10
158	300469	信息发展	100	12,672.00	0.10
159	002539	新都化工	800	12,232.00	0.10
160	002464	金利科技	200	12,220.00	0.10
161	002538	司尔特	1,300	12,155.00	0.10
162	002556	辉隆股份	800	12,088.00	0.10
163	600756	浪潮软件	400	12,040.00	0.10
164	600135	乐凯胶片	700	11,914.00	0.10
165	002236	大华股份	900	11,790.00	0.10
166	002733	雄韬股份	400	11,780.00	0.10
167	002241	歌尔股份	400	11,472.00	0.09
168	000733	振华科技	500	11,250.00	0.09
169	600105	永鼎股份	1,200	11,244.00	0.09
170	300012	华测检测	900	11,142.00	0.09
171	000823	超声电子	1,100	11,000.00	0.09
172	600078	澄星股份	1,700	10,999.00	0.09
173	600229	城市传媒	900	10,980.00	0.09

174	002268	卫士通	300	10,722.00	0.09
175	300131	英唐智控	900	10,629.00	0.09
176	002562	兄弟科技	400	10,624.00	0.09
177	300380	安硕信息	200	10,300.00	0.08
178	300155	安居宝	700	10,276.00	0.08
179	002391	长青股份	700	10,010.00	0.08
180	002504	弘高创意	400	9,680.00	0.08
181	000420	吉林化纤	1,300	8,684.00	0.07
182	000049	德赛电池	200	8,388.00	0.07
183	600249	两面针	1,200	8,376.00	0.07
184	002442	龙星化工	600	8,202.00	0.07
185	600803	新奥股份	700	8,176.00	0.07
186	002584	西陇科学	600	7,986.00	0.07
187	603599	广信股份	400	7,508.00	0.06
188	002585	双星新材	700	7,434.00	0.06
189	600226	升华拜克	700	6,552.00	0.05
190	002343	慈文传媒	100	4,850.00	0.04
191	002238	天威视讯	20	289.40	0.00
192	600621	华鑫股份	18	180.36	0.00
193	601789	宁波建工	2	11.56	0.00
194	000301	东方市场	1	4.33	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	1,342,200.00	10.37
2	002008	大族激光	1,200,234.00	9.27
3	601800	中国交建	1,002,948.47	7.75
4	300024	机器人	826,758.40	6.39
5	000735	罗牛山	824,401.00	6.37
6	300017	网宿科技	807,100.00	6.24
7	601857	中国石油	782,990.00	6.05
8	300065	海兰信	662,872.85	5.12
9	601318	中国平安	647,153.00	5.00

10	000031	中粮地产	549,322.00	4.24
11	601988	中国银行	538,466.00	4.16
12	000652	泰达股份	487,797.00	3.77
13	600048	保利地产	450,234.00	3.48
14	600999	招商证券	446,814.00	3.45
15	600705	中航资本	443,617.00	3.43
16	600500	中化国际	439,159.00	3.39
17	600128	弘业股份	426,325.00	3.29
18	600792	云煤能源	420,807.50	3.25
19	002396	星网锐捷	408,329.00	3.16
20	600626	申达股份	402,443.00	3.11
21	601939	建设银行	386,669.00	2.99
22	000001	平安银行	386,240.00	2.98
23	300147	香雪制药	384,984.00	2.98
24	601998	中信银行	374,219.00	2.89
25	000906	物产中拓	370,568.85	2.86
26	600668	尖峰集团	357,856.00	2.77
27	601818	光大银行	345,895.00	2.67
28	600397	安源煤业	342,331.00	2.65
29	600085	同仁堂	332,621.00	2.57
30	002142	宁波银行	331,642.00	2.56
31	601007	金陵饭店	324,568.21	2.51
32	600210	紫江企业	321,828.00	2.49
33	600058	五矿发展	321,200.00	2.48
34	002495	佳隆股份	315,564.00	2.44
35	002732	燕塘乳业	315,069.00	2.43
36	600159	大龙地产	311,965.00	2.41
37	002144	宏达高科	297,709.00	2.30
38	002064	华峰氨纶	283,237.00	2.19
39	601515	东风股份	281,253.00	2.17
40	600260	凯乐科技	275,779.00	2.13
41	601101	昊华能源	274,233.00	2.12
42	601555	东吴证券	272,082.00	2.10
43	300443	金雷风电	267,568.00	2.07
44	600119	长江投资	267,540.00	2.07
45	000708	大冶特钢	260,741.00	2.01

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	1,322,532.00	10.22
2	002008	大族激光	1,300,394.82	10.05
3	300017	网宿科技	979,392.60	7.57
4	601800	中国交建	968,299.20	7.48
5	300024	机器人	860,072.00	6.65
6	601318	中国平安	833,283.08	6.44
7	000735	罗牛山	772,419.00	5.97
8	601857	中国石油	727,598.00	5.62
9	300065	海兰信	648,348.00	5.01
10	601988	中国银行	641,112.50	4.95
11	000031	中粮地产	550,570.00	4.25
12	601939	建设银行	502,204.44	3.88
13	000652	泰达股份	496,733.00	3.84
14	600048	保利地产	475,845.00	3.68
15	600705	中航资本	445,703.00	3.44
16	600999	招商证券	444,716.00	3.44
17	600500	中化国际	409,303.00	3.16
18	600128	弘业股份	406,020.00	3.14
19	600792	云煤能源	405,924.00	3.14
20	601998	中信银行	388,408.00	3.00
21	002396	星网锐捷	387,575.00	3.00
22	000001	平安银行	379,992.70	2.94
23	000906	物产中拓	363,527.00	2.81
24	601727	上海电气	361,337.34	2.79
25	600668	尖峰集团	359,998.00	2.78
26	601818	光大银行	358,077.00	2.77
27	601007	金陵饭店	346,055.00	2.67
28	600397	安源煤业	332,040.00	2.57
29	002142	宁波银行	331,522.00	2.56
30	002495	佳隆股份	330,298.00	2.55

31	002732	燕塘乳业	328,537.00	2.54
32	600210	紫江企业	325,868.00	2.52
33	300147	香雪制药	323,343.00	2.50
34	601398	工商银行	316,603.81	2.45
35	600626	申达股份	316,505.00	2.45
36	600159	大龙地产	316,102.00	2.44
37	601555	东吴证券	309,400.00	2.39
38	600260	凯乐科技	301,834.00	2.33
39	002144	宏达高科	300,865.00	2.32
40	600085	同仁堂	297,654.00	2.30
41	601628	中国人寿	296,668.66	2.29
42	600016	民生银行	280,675.20	2.17
43	600058	五矿发展	271,850.00	2.10
44	002064	华峰氨纶	271,466.00	2.10
45	601515	东风股份	270,646.00	2.09
46	600866	*ST 星湖	263,052.00	2.03

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	75,607,277.35
卖出股票收入（成交）总额	71,673,800.88

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情况。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	26,319.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	797.40
5	应收申购款	2,982.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,099.23

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	000002	万科A	218,582.00	1.79	重大事项
2	000651	格力电器	185,203.92	1.52	重大事项

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
749	11,518.29	49,519.51	0.57%	8,577,676.23	99.43%

8.2 期末上市基金前十名持有人

无

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	8,710.48	0.10%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 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）基金份额总额	25,737,619.46
本报告期期初基金份额总额	8,985,885.68
本报告期基金总申购份额	1,663,177.94
减：本报告期基金总赎回份额	2,021,867.88
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	8,627,195.74

注：基金总申购份额包含基金转换转入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经本基金管理人第四届董事会第十六次临时会议决议，于2016年3月16日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，陈振宇先生不再担任公司副总经理。

本基金管理人已通过证监会指定报刊及本基金管理人网站对上述高级管理人员变更情况履行了信息披露义务，并在本基金及本基金管理人管理的其他基金的招募说明书-基金管理人部分及时更新了上述高级管理人员变更情况。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，北京市第二中级人民法院对一起原公司员工（原告）与公司（被告）之间的民事诉讼案件做出终审判决，该案已审理终结。

公司没有其他诉讼和仲裁情况。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券股份有限公司	1	76,695,888.13	52.03%	69,893.10	51.49%	-
方正证券股份有限公司	1	70,697,628.10	47.97%	65,841.61	48.51%	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根

据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

(3) 本基金本报告期内租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	37,000,000.00	100.00%	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方启明量化先锋混合型证券投资基金年度最后一日净值公告	指定报刊、网站	2016年1月4日
2	东方基金管理有限责任公司关于临时调整旗下基金开放时间的公告	指定报刊、网站	2016年1月4日
3	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016年1月5日
4	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016年1月7日

5	东方基金管理有限责任公司关于临时调整旗下基金开放时间的公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 7 日
6	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 8 日
7	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 12 日
8	东方基金关于变更公司股东名称及经营范围的公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 14 日
9	关于增加中金公司为旗下基金销售渠道及开通转换业务并参与其申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 20 日
10	东方启明量化先锋混合 2015 年第 4 季度报告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 21 日
11	关于增加中正达广为旗下基金销售渠道及开通定投及转换业务并参与其认申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 27 日
12	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 28 日
13	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 30 日
14	东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2015 年第 2 号）	网站	2016 年 2 月 1 日

15	东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2015 年第 2 号）	指定报刊、网站	2016 年 2 月 1 日
16	关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 2 月 1 日
17	关于增加平安证券为旗下基金销售渠道及开通定投与转换业务并参与其申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 2 月 17 日
18	关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 2 月 17 日
19	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 2 月 18 日
20	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 2 月 27 日
21	东方基金管理有限责任公司 关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 1 日
22	东方基金管理有限责任公司 关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 5 日
23	东方基金管理有限责任公司 关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 8 日
24	东方基金管理有限责任公司关于	指定报刊、网站	2016 年 3 月 14 日

	参与上海利得费率优惠活动的公告		
25	东方基金管理有限责任公司关于参与同花顺费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 14 日
26	东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 16 日
27	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 19 日
28	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 22 日
29	东方启明量化先锋混合型证券投资基金（原东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金转型） 2015 年年度报告摘要	指定报刊、网站	2016 年 3 月 29 日
30	东方启明量化先锋混合型证券投资基金（原东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金转型） 2015 年年度报告	网站	2016 年 3 月 29 日
31	关于在银河证券开通东方基金旗下基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 29 日
32	关于增加奕丰金融为旗下基金销售渠道 及开通定投及转换业务的公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 30 日
33	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 4 月 6 日
34	东方基金管理有限责任公司关于	指定报刊、网站	2016 年 4 月 7 日

	直销系统维护暂停直销电子交易的公告		
35	东方基金管理有限责任公司关于直销系统维护暂停直销电子交易的公告	指定报刊、网站	2016 年 4 月 13 日
36	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 4 月 15 日
37	东方启明量化先锋混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2016 年 4 月 21 日
38	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 4 月 22 日
39	关于继续参加中正达广基金认购、申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 4 月 27 日
40	关于增加大泰金石管理有限公司为旗下基金销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 4 月 27 日
41	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 5 月 4 日
42	关于增加东兴证券为旗下基金销售渠道及开通转换业务的公告	指定报刊、网站	2016 年 5 月 10 日
43	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 5 月 10 日
44	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股	指定报刊、网站	2016 年 5 月 11 日

	票估值方法的提示性公告		
45	关于增加国金证券为旗下基金销售渠道及开通转换业务的公告	指定报刊、网站	2016 年 5 月 13 日
46	关于增加海银基金销售有限公司为旗下基金销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 5 月 27 日
47	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 6 月 1 日
48	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 6 月 3 日
49	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 6 月 16 日
50	东方基金管理有限责任公司关于在京东旗舰店开展申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 6 月 28 日
51	东方基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范金融诈骗的通告	指定报刊、网站	2016 年 6 月 28 日
52	关于增加前海凯恩斯为旗下基金销售渠道及开通定投及转换业务的公告	指定报刊、网站	2016 年 6 月 28 日
53	东方基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、网站	2016 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 一、《东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方启明量化先锋混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

11.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，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。

11.3 查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

东方基金管理有限责任公司
2016年8月26日