

东方启明量化先锋混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 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

送出日期：二〇一七年三月二十七日

§ 1 重要提示

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 2017 年 3 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。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方启明量化先锋混合
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	34,409,481.98 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

2.4 信息披露方式

登载基金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
基金年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年 12 月 3 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,411,310.01	1,962,309.72
本期利润	564,163.55	126,155.53
加权平均基金份额本期利润	0.0626	0.0076
本期基金份额净值增长率	4.49%	1.25%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.5048	0.4401
期末基金资产净值	51,779,123.94	12,940,531.45
期末基金份额净值	1.5048	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。

④本基金基金合同于 2015 年 12 月 3 日生效，上年度为不完整会计年度。

3.2 基金净值表现

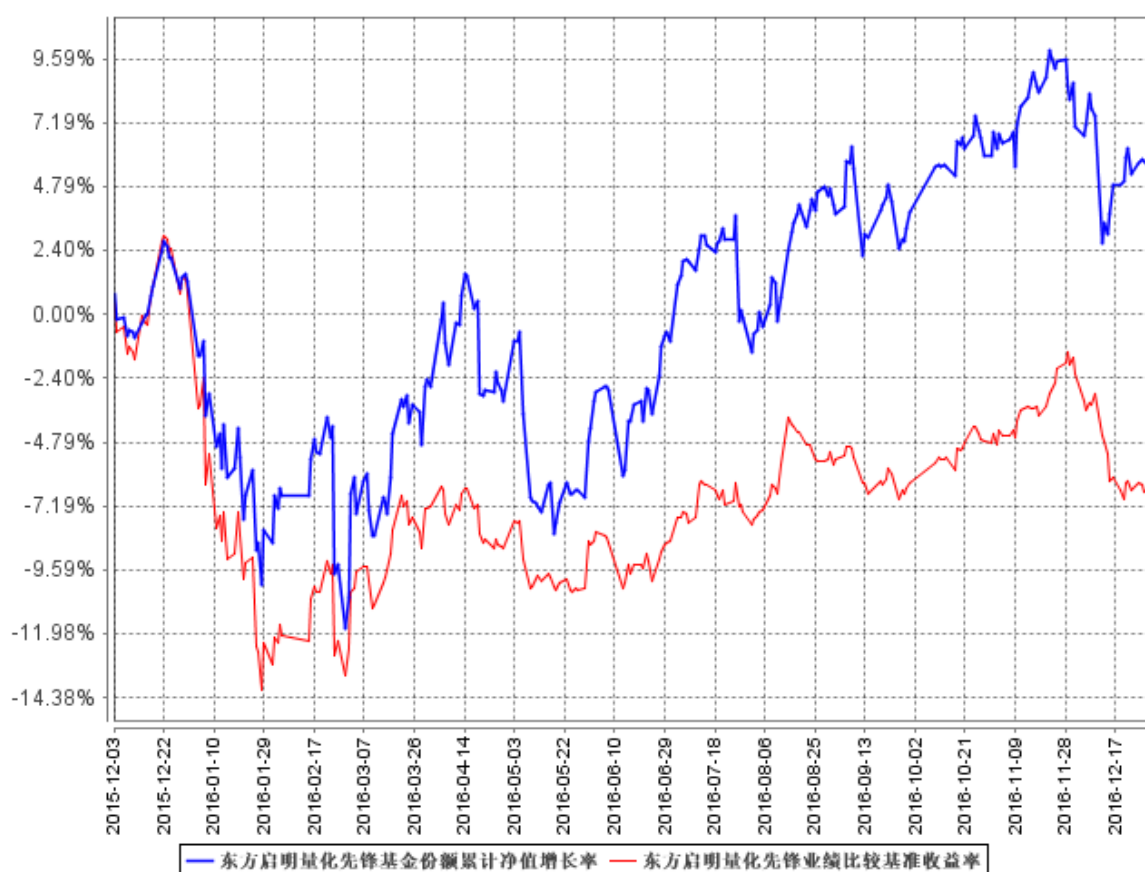
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	1.92%	0.85%	0.03%	0.46%	1.89%	0.39%

过去六个月	6.52%	0.89%	2.46%	0.47%	4.06%	0.42%
过去一年	4.49%	1.19%	-7.07%	0.85%	11.56%	0.34%
过去三年	5.80%	1.16%	-6.32%	0.84%	12.12%	0.32%
过去五年	5.80%	1.16%	-6.32%	0.84%	12.12%	0.32%
自基金合同生效起至今	5.80%	1.16%	-6.32%	0.84%	12.12%	0.32%

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

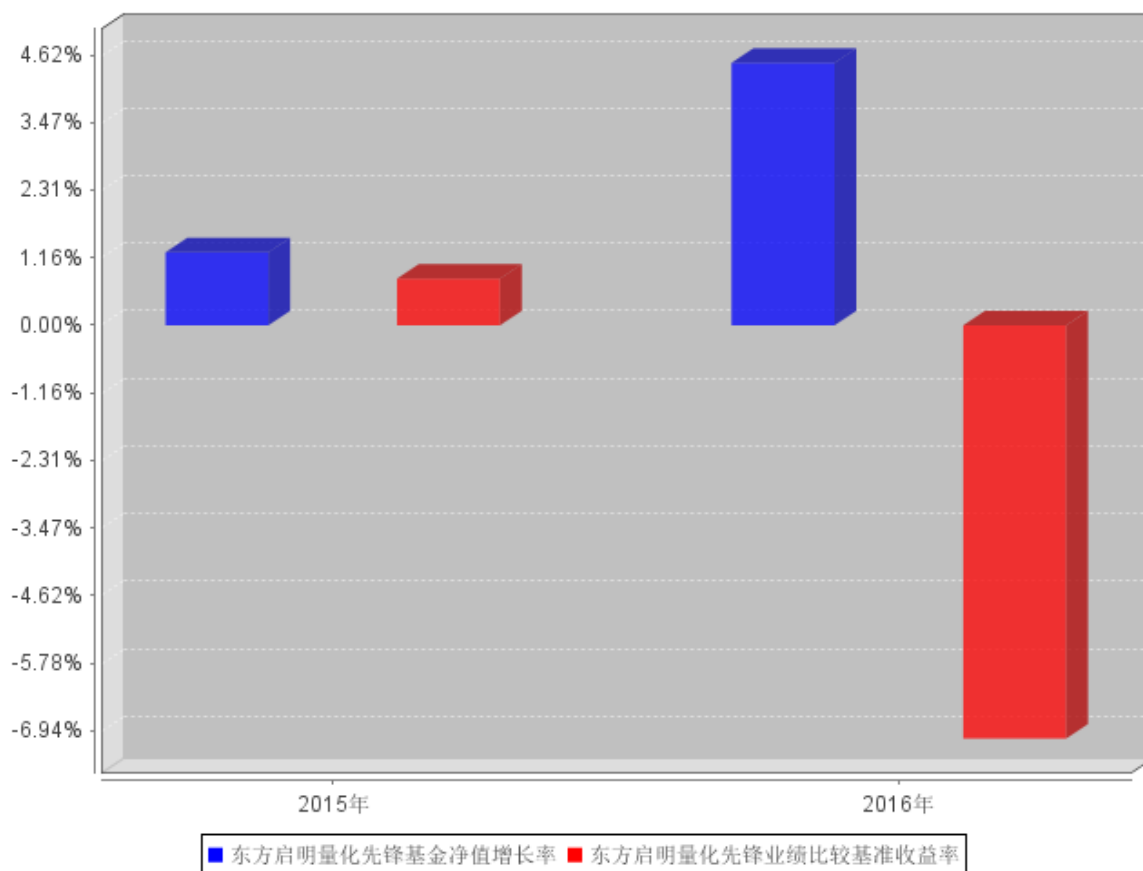
东方启明量化先锋基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方启明量化先锋自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2015年12月3日）至报告期截止日（2016年12月31日）未进行利润分配。

§ 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（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立。截至2016年12月31日，本公司注册资本2亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币12800万元，占公司注册资本的64%；河北省国有资产控股运营有限公司出资人民币5400万元，占公司注册资本27%；渤海国际信托股份有限公司出资人民币1800万元，占公司注册资本的9%。截止2016年12月31日，

本公司管理 40 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、东方策略成长混合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、东方核心动力混合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、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、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证券投资基金、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型证券投资基金、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、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方永熙 18 个月定期开放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、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。
龚晓雨 (先生)	本基金基金经理助理	2016 年 10 月 28 日	-	2 年	吉林大学概率论与数理统计专业硕士，2 年证券从业经历。2014 年加盟东方基金，曾任量化投资部研究员，现任东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理助理。

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、《东方启明量化先锋混合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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及 95%的置信水平下，对同向交易价差进行 T 分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 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。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在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

2016 年年初，中国股票市场经历了罕见的急速下跌，随后主要指数表现出窄幅震荡并稳中趋升的态势。在始于 2015 年下半年的中国股票市场异常波动及去杠杆的大背景下，2016 年中小盘及创业板较大盘蓝筹股票出现较大程度的回调，估值水平逐渐向理性回归。

本基金在四个季度分别实现-3.62%、1.79%、4.52%和 1.92%的收益，分别超越业绩比较基准 4.38%、3.20%、2.10%和 1.89%。2016 年全年本基金主要采用量化技术进行资产配置和股票选择，并利用量化择时模型控制股票仓位以尽可能降低市场风险的冲击。在结构性行情和主题板块切换较快的背景下，本基金通过量化多因子模型和大数据分析技术实时跟踪与分析各种行业和个股的数据变化，从中发掘有价值的信息并转化成策略信号，尽可能多地捕获各种投资机会，以提高基金的选股效果和投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为 4.49%，业绩比较基准收益率为-7.07%，高于业绩比较基准 11.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际上，全球主要经济体货币政策正在经历一个重大的转折，即货币政策开始从超宽松的状态回归正常化，全球流动性正处于由宽松到收紧的拐点。2016 年下半年开始，主要经济体的利率水平出现普遍抬升。美联储已经于 2016 年 12 月再度加息，并且做出对 2017 年加息三次的预判，加息速度略快于市场预期。

国内方面，2016 年 12 月召开的中央经济工作会议确定了 2017 年“稳中求进”的经济工作总基调。提出要继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，但货币方面提出要保持稳健中性，与 2016 年上半年央行提出的货币政策“稳健略偏宽松”的表述形成了鲜明的对比，显示货币政策出现边际收紧。

在政策求稳，经济增长趋稳和波动降低的背景下，预计证券市场将延续 2016 年下半年窄幅震荡略有上升的格局。结构性行情将较 2016 年更加明显，变换速度可能更快。一带一路、国企改革、区域振兴等主题板块或将继续发酵。本基金将积极利用量化技术选出具有超额收益的股票，在严格控制下行风险的情况下，力争使基金的投资业绩在超越业绩基准的基础上实现更高更稳定的绝对回报目标。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，开展定期和实时监控，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：（1）开展对公司各项业务的日常监察，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强基金投资运作的监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（3）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。（4）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

4.7 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）。

4.8 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，本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

4.10 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，截至报告期末，本基金基金资产净值已超过五千万元。

§ 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 12 月 31 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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2017]第 ZB30037 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	东方启明量化先锋混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的东方启明量化先锋混合型证券投资基金（以下简称“东方启明量化”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、2016 年度的所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是东方启明量化的基金管理人东方基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，东方启明量化的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东方启明量化 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	朱锦梅	赵立卿
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	上海市南京路 61 号新黄浦金融大厦 4 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	24,866,405.50	1,994,293.75
结算备付金	178,924.64	6,390.76
存出保证金	20,201.38	21,798.85
交易性金融资产	15,811,029.25	5,130,745.99
其中：股票投资	15,811,029.25	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	-	-
买入返售金融资产	100,000.00	6,000,000.00
应收证券清算款	12,009,058.25	-
应收利息	1,569.42	1,534.66
应收股利	-	-
应收申购款	5,419,769.70	5,109.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	58,406,958.14	13,159,873.02
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	6,229,635.38	-
应付管理人报酬	14,342.33	20,734.53
应付托管费	3,585.59	5,093.79
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	335,767.24	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	44,503.66	46,807.33
负债合计	6,627,834.20	219,341.57
所有者权益：		
实收基金	34,409,481.98	8,985,885.68
未分配利润	17,369,641.96	3,954,645.77
所有者权益合计	51,779,123.94	12,940,531.45
负债和所有者权益总计	58,406,958.14	13,159,873.02

注：①报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5048 元，基金份额总额 34,409,481.98 份。

②本基金基金合同于 2015 年 12 月 3 日生效，上年度为不完整会计年度，下同。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 3 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	1,441,630.97	288,429.92
1. 利息收入	40,191.49	16,178.66
其中：存款利息收入	26,586.93	2,885.54
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	13,604.56	13,293.12
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,121,063.11	2,009,496.09
其中：股票投资收益	2,080,174.58	2,012,896.39
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	40,888.53	-3,400.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-847,146.46	-1,836,154.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	127,522.83	98,909.36
减：二、费用	877,467.42	162,274.39
1. 管理人报酬	126,761.60	18,937.56
2. 托管费	31,690.27	4,734.40
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	559,478.21	55,336.66
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	159,537.34	83,265.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	564,163.55	126,155.53
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	564,163.55	126,155.53

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,985,885.68	3,954,645.77	12,940,531.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	564,163.55	564,163.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	25,423,596.30	12,850,832.64	38,274,428.94
其中：1. 基金申购款	34,395,132.57	17,075,258.38	51,470,390.95
2. 基金赎回款	-8,971,536.27	-4,224,425.74	-13,195,962.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	34,409,481.98	17,369,641.96	51,779,123.94

项目	上年度可比期间 2015 年 12 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	25,737,619.46	10,065,050.65	35,802,670.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	126,155.53	126,155.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-16,751,733.78	-6,236,560.41	-22,988,294.19
其中：1. 基金申购款	103,162.54	847,965.32	951,127.86
2. 基金赎回款	-16,854,896.32	-7,084,525.73	-23,939,422.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	8,985,885.68	3,954,645.77	12,940,531.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 刘鸿鹏 刘鸿鹏 肖向辉
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方启明量化先锋混合型证券投资基金由东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金转型而来。东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金经 2012 年 10 月 10 日中国证监会证监许可【2012】1344 号文核准募集，基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 19 日生效。2015 年 10 月 22 日至 2015 年 11 月 30 日，东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，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议案》，同意东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金变更基金名称、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）。

7.4.2 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 2 号——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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

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
渤海国际信托股份有限公司	本基金管理人股东
河北省国有资产控股运营有限公司	本基金管理人股东
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人下属子公司

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2015年12月3日(基金合同生效日)至2015年 12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	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	214,355,068.38	57.31%	13,435,548.20	48.28%

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 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12月31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	195,342.74	56.78%	252,929.59	75.33%

关联方名称	上年度可比期间 2015年12月3日(基金合同生效日)至2015年12月31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	12,243.83	47.73%	101,983.25	69.52%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年12月3日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付 的管理费	126,761.60	18,937.56
其中：支付销售机构的客 户维护费	62,121.74	5,610.91

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年12月3日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付 的托管费	31,690.27	4,734.40

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 12 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	24,866,405.50	22,708.33	1,994,293.75	2,848.85

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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
600973	宝胜股份	2016年11月28日	重大事项	8.05	2017年2月22日	8.86	16,700	133,600.00	134,435.00	-
600161	天坛生物	2016年12月6日	重大事项	39.40	2017年3月24日	43.34	2,500	101,785.00	98,500.00	-
000710	*ST天仪	2016年12月29日	临时停牌	47.41	2017年1月4日	52.15	2,900	70,607.00	137,489.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 100,000.00 元, 于 2017 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本年度报告报出日, 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	15,811,029.25	27.07
	其中：股票	15,811,029.25	27.07
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	100,000.00	0.17
	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	25,045,330.14	42.88
7	其他各项资产	17,450,598.75	29.88
8	合计	58,406,958.14	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	167,341.71	0.32
B	采矿业	487,068.00	0.94
C	制造业	10,230,461.75	19.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	498,662.05	0.96
E	建筑业	271,259.76	0.52
F	批发和零售业	798,560.18	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	651,149.56	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,179,638.77	2.28
J	金融业	726,687.70	1.40
K	房地产业	306,170.46	0.59
L	租赁和商务服务业	172,550.00	0.33
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	160,259.91	0.31
Q	卫生和社会工作	617.40	0.00

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	160,602.00	0.31
	合计	15,811,029.25	30.54

8.3 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

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	601318	中国平安	5,600	198,408.00	0.38
2	300365	恒华科技	4,600	190,900.00	0.37
3	603311	金海环境	8,100	188,811.00	0.36
4	300113	顺网科技	7,000	188,230.00	0.36
5	601398	工商银行	42,000	185,220.00	0.36
6	000421	南京公用	20,800	184,912.00	0.36
7	300154	瑞凌股份	17,900	184,012.00	0.36
8	002084	海鸥卫浴	17,100	183,825.00	0.36
9	002753	永东股份	5,700	180,519.00	0.35
10	300344	太空板业	11,230	179,006.20	0.35

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601857	中国石油	1,745,874.00	13.49
2	600036	招商银行	1,513,994.00	11.70
3	601988	中国银行	1,252,002.00	9.68
4	601939	建设银行	1,241,238.00	9.59
5	002008	大族激光	1,200,234.00	9.27
6	601800	中国交建	1,137,744.47	8.79

7	601398	工商银行	1,039,239.00	8.03
8	601318	中国平安	1,014,164.42	7.84
9	300065	海兰信	871,067.85	6.73
10	300024	机器人	826,758.40	6.39
11	000735	罗牛山	824,401.00	6.37
12	300017	网宿科技	807,100.00	6.24
13	002171	楚江新材	803,822.00	6.21
14	600188	兖州煤业	652,036.00	5.04
15	000906	浙商中拓	619,328.85	4.79
16	600128	弘业股份	619,190.00	4.78
17	603818	曲美家居	608,864.00	4.71
18	600688	上海石化	605,154.00	4.68
19	600058	五矿发展	601,324.00	4.65
20	600872	中炬高新	585,552.00	4.52
21	600135	乐凯胶片	569,048.00	4.40
22	002597	金禾实业	551,000.00	4.26
23	000031	中粮地产	549,322.00	4.24
24	600449	宁夏建材	543,077.00	4.20
25	600839	四川长虹	540,207.00	4.17
26	600059	古越龙山	532,460.00	4.11
27	000789	万年青	518,591.00	4.01
28	603006	黎明股份	516,003.75	3.99
29	000541	佛山照明	515,606.00	3.98
30	600106	重庆路桥	515,206.00	3.98
31	002726	龙大肉食	510,013.00	3.94
32	000001	平安银行	509,765.00	3.94
33	300131	英唐智控	500,645.00	3.87
34	002093	国脉科技	500,121.00	3.86
35	002607	亚夏汽车	496,961.00	3.84
36	002511	中顺洁柔	489,225.00	3.78
37	000652	泰达股份	487,797.00	3.77
38	300048	合康新能	477,649.00	3.69
39	002128	露天煤业	476,710.00	3.68
40	000698	沈阳化工	473,118.00	3.66
41	000915	山大华特	468,811.00	3.62
42	600830	香溢融通	468,794.00	3.62

43	000708	大冶特钢	466,730.00	3.61
44	600973	宝胜股份	463,445.00	3.58
45	600755	厦门国贸	451,938.00	3.49
46	600048	保利地产	450,234.00	3.48
47	600999	招商证券	446,814.00	3.45
48	600705	中航资本	443,617.00	3.43
49	601818	光大银行	441,526.00	3.41
50	600500	中化国际	439,159.00	3.39
51	600757	长江传媒	436,972.00	3.38
52	002001	新 和 成	434,213.00	3.36
53	600626	申达股份	431,703.00	3.34
54	600668	尖峰集团	429,554.00	3.32
55	002041	登海种业	428,381.75	3.31
56	002108	沧州明珠	422,654.00	3.27
57	600792	云煤能源	420,807.50	3.25
58	002577	雷柏科技	414,001.00	3.20
59	002182	云海金属	410,730.00	3.17
60	002026	山东威达	409,352.00	3.16
61	002396	星网锐捷	408,329.00	3.16
62	002086	东方海洋	407,528.00	3.15
63	603167	渤海轮渡	405,752.00	3.14
64	002709	天赐材料	404,355.00	3.12
65	002461	珠江啤酒	403,650.00	3.12
66	600366	宁波韵升	401,812.00	3.11
67	300203	聚光科技	400,403.00	3.09
68	002150	通润装备	400,285.60	3.09
69	600073	上海梅林	399,097.00	3.08
70	603306	华懋科技	398,358.00	3.08
71	600508	上海能源	398,186.00	3.08
72	601328	交通银行	395,952.00	3.06
73	300073	当升科技	394,313.00	3.05
74	002626	金达威	390,608.00	3.02
75	002003	伟星股份	389,629.00	3.01
76	002372	伟星新材	389,395.00	3.01
77	002483	润邦股份	387,756.00	3.00
78	002441	众业达	386,023.00	2.98

79	300147	香雪制药	384,984.00	2.98
80	002269	美邦服饰	383,770.00	2.97
81	600594	益佰制药	380,629.00	2.94
82	300037	新宙邦	380,561.00	2.94
83	600971	恒源煤电	379,991.00	2.94
84	000501	鄂武商 A	375,083.00	2.90
85	601998	中信银行	374,219.00	2.89
86	002271	东方雨虹	371,511.00	2.87
87	300328	宜安科技	370,665.00	2.86
88	601929	吉视传媒	369,308.83	2.85
89	002433	太安堂	368,940.00	2.85
90	603223	恒通股份	368,683.00	2.85
91	600596	新安股份	368,602.00	2.85
92	300246	宝莱特	363,558.00	2.81
93	300041	回天新材	362,925.00	2.80
94	300287	飞利信	362,835.00	2.80
95	600183	生益科技	360,152.00	2.78
96	000150	宜华健康	358,206.00	2.77
97	300409	道氏技术	357,221.00	2.76
98	600298	安琪酵母	354,838.00	2.74
99	300333	兆日科技	352,481.00	2.72
100	601636	旗滨集团	350,302.00	2.71
101	600180	瑞茂通	348,810.00	2.70
102	300121	阳谷华泰	348,109.00	2.69
103	600117	西宁特钢	347,055.00	2.68
104	600966	博汇纸业	343,896.00	2.66
105	600397	安源煤业	342,331.00	2.65
106	002193	山东如意	341,299.00	2.64
107	000890	法尔胜	340,021.00	2.63
108	600586	金晶科技	339,424.00	2.62
109	002132	恒星科技	339,420.00	2.62
110	600487	亨通光电	339,408.00	2.62
111	002615	哈尔斯	339,033.50	2.62
112	000910	大亚圣象	338,465.00	2.62
113	002016	世荣兆业	338,060.00	2.61
114	600606	绿地控股	336,366.00	2.60

115	603002	宏昌电子	336,350.00	2.60
116	000563	陕国投 A	335,561.00	2.59
117	300475	聚隆科技	334,949.00	2.59
118	002172	澳洋科技	334,512.00	2.58
119	600085	同仁堂	332,621.00	2.57
120	600510	黑牡丹	332,119.00	2.57
121	002142	宁波银行	331,642.00	2.56
122	600826	兰生股份	329,880.00	2.55
123	300141	和顺电气	329,860.00	2.55
124	002518	科士达	327,052.00	2.53
125	002734	利民股份	326,381.00	2.52
126	002543	万和电气	325,028.00	2.51
127	601007	金陵饭店	324,568.21	2.51
128	300118	东方日升	323,792.00	2.50
129	300248	新开普	323,204.00	2.50
130	002749	国光股份	321,914.00	2.49
131	600210	紫江企业	321,828.00	2.49
132	300034	钢研高纳	320,183.00	2.47
133	300113	顺网科技	319,132.00	2.47
134	002495	佳隆股份	315,564.00	2.44
135	002732	燕塘乳业	315,069.00	2.43
136	300160	秀强股份	314,200.00	2.43
137	002320	海峡股份	313,830.00	2.43
138	600100	同方股份	313,601.00	2.42
139	000705	浙江震元	312,264.00	2.41
140	600159	大龙地产	311,965.00	2.41
141	000921	海信科龙	311,605.00	2.41
142	603806	福斯特	311,231.00	2.41
143	600730	中国高科	310,215.00	2.40
144	002713	东易日盛	308,727.00	2.39
145	000701	厦门信达	308,496.00	2.38
146	002335	科华恒盛	308,160.00	2.38
147	600736	苏州高新	306,933.00	2.37
148	000561	烽火电子	306,251.00	2.37
149	600969	郴电国际	305,488.00	2.36
150	600783	鲁信创投	305,263.00	2.36

151	600284	浦东建设	302,356.00	2.34
152	002079	苏州固锔	301,477.00	2.33
153	000926	福星股份	301,373.00	2.33
154	002091	江苏国泰	301,000.00	2.33
155	002458	益生股份	300,843.00	2.32
156	300365	恒华科技	300,579.00	2.32
157	002042	华孚色纺	298,590.00	2.31
158	000552	靖远煤电	298,570.00	2.31
159	002594	比亚迪	298,346.00	2.31
160	002144	宏达高科	297,709.00	2.30
161	600119	长江投资	296,439.00	2.29
162	000823	超声电子	295,465.00	2.28
163	601717	郑煤机	295,056.00	2.28
164	300240	飞力达	293,274.00	2.27
165	002232	启明信息	292,812.00	2.26
166	300020	银江股份	290,161.00	2.24
167	000417	合肥百货	289,958.00	2.24
168	000985	大庆华科	289,293.00	2.24
169	000900	现代投资	289,052.00	2.23
170	600028	中国石化	288,818.00	2.23
171	300008	天海防务	287,105.00	2.22
172	300205	天喻信息	284,931.00	2.20
173	600297	广汇汽车	283,571.00	2.19
174	300321	同大股份	283,340.00	2.19
175	002064	华峰氨纶	283,237.00	2.19
176	002115	三维通信	282,855.00	2.19
177	600197	伊力特	282,654.00	2.18
178	002580	圣阳股份	282,008.00	2.18
179	000993	闽东电力	281,537.00	2.18
180	601515	东风股份	281,253.00	2.17
181	603898	好莱客	280,536.34	2.17
182	601058	赛轮金宇	279,581.00	2.16
183	002056	横店东磁	279,296.00	2.16
184	300355	蒙草生态	278,656.00	2.15
185	600900	长江电力	278,576.00	2.15
186	600456	宝钛股份	276,942.00	2.14

187	002264	新华都	276,430.00	2.14
188	002177	御银股份	276,155.00	2.13
189	600260	凯乐科技	275,779.00	2.13
190	300074	华平股份	274,750.37	2.12
191	300443	金雷风电	274,256.00	2.12
192	601101	昊华能源	274,233.00	2.12
193	600429	三元股份	273,502.44	2.11
194	300018	中元股份	272,990.00	2.11
195	300415	伊之密	272,730.00	2.11
196	300363	博腾股份	272,424.00	2.11
197	601555	东吴证券	272,082.00	2.10
198	300335	迪森股份	271,385.00	2.10
199	300387	富邦股份	270,337.02	2.09
200	002536	西泵股份	269,499.00	2.08
201	002087	新野纺织	269,385.00	2.08
202	002460	赣锋锂业	269,367.00	2.08
203	000429	粤高速 A	268,738.00	2.08
204	600287	江苏舜天	267,866.00	2.07
205	002233	塔牌集团	267,650.00	2.07
206	002088	鲁阳节能	266,691.00	2.06
207	603026	石大胜华	266,512.00	2.06
208	600543	莫高股份	265,794.00	2.05
209	601233	桐昆股份	265,582.56	2.05
210	600267	海正药业	265,574.00	2.05
211	002768	国恩股份	264,801.00	2.05
212	600078	澄星股份	264,266.00	2.04
213	601333	广深铁路	264,183.00	2.04
214	300094	国联水产	264,080.00	2.04
215	002705	新宝股份	263,857.39	2.04
216	002403	爱仕达	262,088.00	2.03
217	002119	康强电子	261,734.00	2.02
218	002148	北纬通信	260,544.00	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。

8.4.2 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	601857	中国石油	1,705,599.00	13.18
2	601988	中国银行	1,367,527.50	10.57
3	600036	招商银行	1,322,532.00	10.22
4	002008	大族激光	1,317,082.82	10.18
5	601939	建设银行	1,200,220.44	9.27
6	601800	中国交建	1,097,805.20	8.48
7	601318	中国平安	1,006,039.08	7.77
8	601398	工商银行	997,006.81	7.70
9	300017	网宿科技	979,392.60	7.57
10	300024	机器人	860,072.00	6.65
11	300065	海兰信	852,924.00	6.59
12	000735	罗牛山	772,419.00	5.97
13	002171	楚江新材	699,588.63	5.41
14	600128	弘业股份	679,537.00	5.25
15	000906	浙商中拓	616,635.00	4.77
16	600688	上海石化	603,396.00	4.66
17	600872	中炬高新	573,109.00	4.43
18	600449	宁夏建材	569,589.00	4.40
19	600058	五矿发展	558,128.00	4.31
20	000031	中粮地产	550,570.00	4.25
21	600839	四川长虹	548,174.00	4.24
22	600059	古越龙山	534,237.00	4.13
23	603006	黎明股份	527,070.00	4.07
24	002093	国脉科技	510,961.00	3.95
25	000001	平安银行	504,866.70	3.90
26	000541	佛山照明	502,050.00	3.88
27	000652	泰达股份	496,733.00	3.84
28	000698	沈阳化工	489,390.00	3.78
29	002511	中顺洁柔	488,953.00	3.78
30	600188	兖州煤业	487,303.00	3.77
31	600048	保利地产	475,845.00	3.68
32	600830	香溢融通	473,207.64	3.66
33	000708	大冶特钢	471,802.00	3.65
34	601818	光大银行	455,466.00	3.52

35	603818	曲美家居	451,822.00	3.49
36	002128	露天煤业	451,175.00	3.49
37	600705	中航资本	445,703.00	3.44
38	600999	招商证券	444,716.00	3.44
39	600519	贵州茅台	442,174.81	3.42
40	600757	长江传媒	439,574.00	3.40
41	002150	通润装备	433,605.00	3.35
42	600668	尖峰集团	431,722.00	3.34
43	002041	登海种业	427,627.00	3.30
44	600135	乐凯胶片	421,994.00	3.26
45	002726	龙大肉食	421,565.00	3.26
46	002001	新 和 成	421,350.00	3.26
47	603167	渤海轮渡	419,351.00	3.24
48	600626	申达股份	418,592.00	3.23
49	002086	东方海洋	415,993.00	3.21
50	600500	中化国际	409,303.00	3.16
51	600792	云煤能源	405,924.00	3.14
52	300203	聚光科技	400,055.00	3.09
53	601328	交通银行	398,036.00	3.08
54	600073	上海梅林	396,611.00	3.06
55	600366	宁波韵升	393,020.00	3.04
56	002597	金禾实业	390,745.00	3.02
57	601998	中信银行	388,408.00	3.00
58	002626	金达威	387,766.00	3.00
59	002396	星网锐捷	387,575.00	3.00
60	000150	宜华健康	385,071.40	2.98
61	600971	恒源煤电	384,600.00	2.97
62	002269	美邦服饰	381,669.00	2.95
63	002271	东方雨虹	380,219.00	2.94
64	600594	益佰制药	380,022.00	2.94
65	002577	雷柏科技	378,171.00	2.92
66	002607	亚夏汽车	375,975.00	2.91
67	300131	英唐智控	374,461.00	2.89
68	300037	新宙邦	373,021.00	2.88
69	300246	宝莱特	371,284.00	2.87
70	601929	吉视传媒	370,794.00	2.87
71	002132	恒星科技	369,637.00	2.86
72	000501	鄂武商 A	368,556.00	2.85

73	002433	太安堂	365,959.00	2.83
74	300328	宜安科技	365,504.00	2.82
75	600596	新安股份	362,200.00	2.80
76	601727	上海电气	361,337.34	2.79
77	300121	阳谷华泰	359,830.00	2.78
78	300287	飞利信	359,104.00	2.78
79	600606	绿地控股	355,822.00	2.75
80	000002	万科A	351,722.00	2.72
81	600180	瑞茂通	351,532.00	2.72
82	300333	兆日科技	348,149.00	2.69
83	000890	法尔胜	348,031.00	2.69
84	002193	山东如意	346,067.00	2.67
85	601007	金陵饭店	346,055.00	2.67
86	600826	兰生股份	345,692.00	2.67
87	600966	博汇纸业	344,639.00	2.66
88	300048	合康新能	344,454.00	2.66
89	000789	万年青	343,160.00	2.65
90	600487	亨通光电	341,854.00	2.64
91	601636	旗滨集团	339,348.00	2.62
92	000910	大亚圣象	339,017.12	2.62
93	603002	宏昌电子	337,445.00	2.61
94	002734	利民股份	337,049.00	2.60
95	300475	聚隆科技	336,997.00	2.60
96	600510	黑牡丹	335,927.00	2.60
97	000563	陕国投A	335,316.50	2.59
98	600973	宝胜股份	334,807.00	2.59
99	002320	海峡股份	334,280.00	2.58
100	600106	重庆路桥	334,208.00	2.58
101	300141	和顺电气	333,620.76	2.58
102	600397	安源煤业	332,040.00	2.57
103	600119	长江投资	331,992.00	2.57
104	002142	宁波银行	331,522.00	2.56
105	600117	西宁特钢	331,298.00	2.56
106	002543	万和电气	330,830.00	2.56
107	002495	佳隆股份	330,298.00	2.55
108	000705	浙江震元	329,038.00	2.54
109	002732	燕塘乳业	328,537.00	2.54
110	002518	科士达	325,897.00	2.52

111	600210	紫江企业	325,868.00	2.52
112	300248	新开普	324,028.00	2.50
113	000561	烽火电子	323,678.00	2.50
114	300147	香雪制药	323,343.00	2.50
115	002749	国光股份	322,006.00	2.49
116	300160	秀强股份	321,396.00	2.48
117	600100	同方股份	321,349.00	2.48
118	600730	中国高科	321,177.00	2.48
119	000915	山大华特	320,480.00	2.48
120	000701	厦门信达	319,240.00	2.47
121	002335	科华恒盛	318,962.00	2.46
122	002264	新华都	316,760.00	2.45
123	600159	大龙地产	316,102.00	2.44
124	300118	东方日升	315,541.00	2.44
125	002713	东易日盛	315,182.00	2.44
126	300034	钢研高纳	313,104.00	2.42
127	603806	福斯特	312,395.00	2.41
128	002091	江苏国泰	311,716.00	2.41
129	000921	海信科龙	309,949.00	2.40
130	601555	东吴证券	309,400.00	2.39
131	002458	益生股份	308,692.00	2.39
132	600969	郴电国际	308,139.00	2.38
133	601717	郑煤机	306,919.00	2.37
134	002594	比亚迪	303,226.00	2.34
135	000823	超声电子	303,036.00	2.34
136	002232	启明信息	302,751.00	2.34
137	000993	闽东电力	302,221.00	2.34
138	600028	中国石化	302,112.60	2.33
139	600260	凯乐科技	301,834.00	2.33
140	600284	浦东建设	301,042.00	2.33
141	002144	宏达高科	300,865.00	2.32
142	600736	苏州高新	299,373.00	2.31
143	000900	现代投资	298,155.00	2.30
144	002115	三维通信	298,053.00	2.30
145	000417	合肥百货	297,998.00	2.30
146	600085	同仁堂	297,654.00	2.30
147	002580	圣阳股份	296,934.00	2.29
148	601628	中国人寿	296,668.66	2.29

149	002042	华孚色纺	296,450.00	2.29
150	002182	云海金属	296,332.00	2.29
151	300321	同大股份	295,216.00	2.28
152	600197	伊力特	294,737.00	2.28
153	300018	中元股份	289,497.00	2.24
154	300205	天喻信息	288,541.00	2.23
155	300240	飞力达	287,920.50	2.22
156	600543	莫高股份	286,922.00	2.22
157	300074	华平股份	286,887.58	2.22
158	002177	御银股份	284,096.00	2.20
159	300443	金雷风电	282,624.00	2.18
160	600755	厦门国贸	281,974.96	2.18
161	000552	靖远煤电	280,983.00	2.17
162	600016	民生银行	280,675.20	2.17
163	002087	新野纺织	279,824.00	2.16
164	600297	广汇汽车	279,358.00	2.16
165	601058	赛轮金宇	277,481.00	2.14
166	002365	永安药业	274,813.00	2.12
167	601233	桐昆股份	274,781.00	2.12
168	600900	长江电力	274,770.00	2.12
169	600267	海正药业	274,032.00	2.12
170	300008	天海防务	273,184.80	2.11
171	002460	赣锋锂业	273,049.00	2.11
172	002064	华峰氨纶	271,466.00	2.10
173	600287	江苏舜天	270,718.00	2.09
174	601515	东风股份	270,646.00	2.09
175	603026	石大胜华	270,396.00	2.09
176	601333	广深铁路	270,116.00	2.09
177	600456	宝钛股份	269,791.00	2.08
178	000338	潍柴动力	267,341.80	2.07
179	002028	思源电气	266,980.00	2.06
180	300094	国联水产	266,215.00	2.06
181	002233	塔牌集团	265,575.00	2.05
182	002119	康强电子	263,936.50	2.04
183	600866	*ST 星湖	263,052.00	2.03
184	002403	爱仕达	262,054.00	2.03
185	600277	亿利洁能	261,652.00	2.02
186	300073	当升科技	261,571.00	2.02

187	600078	澄星股份	260,504.00	2.01
188	300363	博腾股份	260,122.00	2.01
189	002548	金新农	259,054.00	2.00

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。

8.4.3 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	191,723,913.05
卖出股票收入（成交）总额	182,276,657.91

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	20,201.38
2	应收证券清算款	12,009,058.25
3	应收股利	-
4	应收利息	1,569.42
5	应收申购款	5,419,769.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,450,598.75

8.12.4 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。

8.12.5 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的情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
828	41,557.35	49,519.51	0.14%	34,359,962.47	99.86%

9.3 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	69,457.33	0.20%

9.4 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、基金投资和研 究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

§ 10 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	34,395,132.57
减:本报告期基金总赎回份额	8,971,536.27
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	34,409,481.98

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

经本基金管理人第四届董事会第二十一临时会议及第五届董事会第一次会议决议，于 2016 年 8 月 19 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》，孙晔伟先生不再担任公司总经理，崔伟先生代任公司总经理职务。

经本基金管理人第五届董事会第三次临时会议决议，于 2016 年 10 月 29 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》，刘鸿鹏先生担任公司总经理职务，崔伟先生不再代任总经理职务。

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。

11.3 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与公司之间的民事诉讼案件做出终审判决，判决公司支付原告部分劳动报酬并驳回原告的其他诉讼请求，该案已审理终结。

公司没有其他诉讼和仲裁情况。

本报告期，无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 40,000.00 元；截至 2016 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 2 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	214,355,068.38	57.31%	195,342.74	56.78%	-
方正证券股份有限公司	1	159,645,502.58	42.69%	148,679.26	43.22%	-
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 实力雄厚，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。

11.7.2 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	-	-	49,100,000.00	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	-	-	-	-	-	-

东方基金管理有限责任公司
2017年3月27日