东方金账簿货币市场证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2011年第2号）

基金管理人：东方基金管理有限责任公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司

日 期：二〇一二年三月

重要提示

东方金账簿货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2006年6月2日中国证券监督管理委员会《关于同意东方金账簿货币市场证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2006】106号）和《关于东方金账簿货币市场证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2006】146号）的核准，进行募集。本基金基金合同于2006年8月2日正式生效。本基金为货币市场基金。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”、“管理人”或“本公司”）保证《东方金账簿货币市场证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的股票、债券、衍生品等各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行负担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

有关财务数据和净值表现截止日为2011年12月31日（财务数据未经审计），如无其他特别说明，本招募说明书其他所载内容截止日为2012年2月2日。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身既表明其对基金合同的承认和接受，并按《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

一、基金合同生效日期

2006年8月2日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：东方基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
法定代表人：崔伟
总经理：单宇
成立日期：2004年6月11日
注册资本：壹亿元人民币
经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】80号
基金管理公司法人许可证编号：A039
企业法人营业执照注册号：110000007042263
联系人：吕日
电话：010-66295888

股权结构

持股单位	出资金额（人民币）	占总股本比例
东北证券股份有限公司	4600万元	46%
中辉国华实业（集团）有限公司	1800万元	18%
渤海国际信托有限公司	1800万元	18%
河北省国有资产控股运营有限公司	1800万元	18%
合 计	10,000万元	100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。董事会下设合规与风险控制委员会；本公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设总经理办公会、风险控制委员会、投资决策委员会和董事会办公室、综合管理部、人力资源部、监察稽核部、财务部、信息技术部、登记清算部、研究部、基金管理部、交易部、专户管理部、金融工程部、国际业务部、营销策划部、渠道销售部、机构理财部十六个职能部门及上海分公司；本公司设督察长，分管监察稽核部，负责公司的监察稽核工作。

（二）基金管理人主要人员情况

1.董事会成员

崔伟先生，董事长，经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书，中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长，中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员，中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长，中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记，中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人；现任吉林大学商学院教师，东北证券股份有限公司董事。

杨树财先生，董事，硕士研究生，中国注册会计师，高级会计师。吉林省高级职称评委会委员，中国证券业协会财务会计委员会执行委员。历任广西北海吉兴会计师事务所主任会计师，吉林会计师事务所副所长，东北证券有限责任公司财务总监、副总裁兼财务总监，东方基金管理有限责任公司董事长；现任东北证券股份有限公司总裁、副董事长。

齐伟丽女士，董事，会计师。历任中国计算机软件与技术服务总公司工程师，中软总公司多维公司会计师，北京宏世通达商贸集团财务部长，中辉投资有限公司财务总监，新疆中建投资有限责任公司总经理，中天高科特种车辆有限公司副总经理，北京中辉阳光房地产开发有限公司董事；现任北京京发置业有限公司监事，北京宏世通达商贸集团副总经理。

彭铭巧女士，董事，经济学硕士。历任黑龙江证券有限公司深圳营业部交易员、研究员，特区时空杂志社编辑，国泰君安证券公司海口营业部研究员，海航集团有限公司证券业务部研究室经理，海航集团财务有限公司投资银行部理财主管；现任渤海国际信托有限公司投资部总经理。

邱建武先生，董事，高级工程师。历任廊坊市轴瓦厂团支部书记，河北省粮油工业公司总经理、党支部书记，河北省粮油集团公司副总裁、党委常委，河北省粮食局副局长、党组成员，河北省商贸集团公司党委书记、董事长，河北省工贸资产经营有限公司党委书记、董事长、总裁；现任河北省国有资产控股运营有限公司董事长，河北省商贸有限公司董事长，河北省机械工业供销协会名誉理事长，河北省商业会计学会名誉会长。

单宇先生，董事，大学本科。15年以上证券及基金从业经历，历任吉林省信托投资公司证券管理总部证券投资管理部经理，吉林省宝路达投资管理公司总经理，天治基金管理有限公司筹备组成员、副总经理、监事长，东北证券有限责任公司副总裁，东北证券股份有限公司副总裁、合规总监；现任本公司总经理。

田瑞璋先生，独立董事，大学本科。历任中国北方工业（集团）总公司副总经理，中国兵器工业总公司总经济师、副总经理、党组成员（副部级），中国工商银行党委副书记、副行长，中央金融工委委员（副部级），工商东亚金融控股有限公司全国政协委员、工商东亚董事长；现任中国扶贫开发协会常务副会长（中组部任命、副部级），中国金融学会常务理事、中国城市金融学会副会长、中国宏观经济学会常务理事、渤海银行独立董事、晋商银行独立董事。

金硕先生，独立董事，教授。历任吉林大学总务办公室副主任、副教授、教授，长春税务学院党委书记、院长，长春市政协委员，吉林省政协委员、文教卫生委员会副主任；现任吉林财经大学党委书记。

关雪凌女士，独立董事，经济学博士。历任中国人民大学东欧中亚研究所副所长、所长；现任中国人民大学俄罗斯研究中心主任，国务院发展研究中心欧亚社会发展研究所特约高级研究员、中国俄罗斯东欧中亚学会常务理事。

2.监事会成员

何俊岩先生，监事会主席，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉林省五一劳动奖章获得者。历任东北证券股份有限公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券股份有限公司财务总监，东方基金管理有限责任公司监事会主席；现任东北证券股份有限公司副总裁，吉林省总会计师协会副会长，吉林省证券业协会副会长，东证融通投资管理有限公司董事。

李绍科先生，监事，大专，高级经济师。历任北京新富投资集团有限公司副总经济师，联合置地房地产开发有限公司总经济师，北京莱富建设有限公司总经济师，北京绿城投资有限公司总经济师；现任中辉国华实业（集团）有限公司总经济师。

杨晓燕女士，监事，哲学硕士，金融学研究生，高级经济师。曾任职北京银行等金融机构，17年金融、证券从业经历；现任本公司监察稽核部经理。

3.其他高级管理人员

单宇先生，总经理，简历请参见董事介绍。

王兴宇先生，副总经理，美国宾西法尼亚印第安那大学工商管理硕士、美国依阿华大学法律学硕士；具有6年基金从业经历和5年保险从业经历，曾任中法人寿保险有限责任公司宣传公关及法律部经理、董事会秘书，先后任职于博时基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、益民基金管理有限公司。2009年9月加盟本公司。

仝岩女士，副总经理，管理学硕士；曾任金融街控股有限公司董事会办公室主任、服务中心主任，长城人寿保险公司筹备组副组长，金融街商会副秘书长，北京华融文化投资有限公司总经理。2008年4月加盟本公司，任董事会秘书、总经理助理。

吕日先生，督察长。吉林大学经济学院政治经济学专业博士研究生，高级经济师。曾担任吉林省证券公司长春北国之春营业部副经理、延吉证券营业部副经理、营业机构管理部经理；东北证券股份有限公司总裁助理兼营销交易管理总部总经理。2008年11月加盟本公司。

4.本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
王丹丹（女士）	2010-9-16	中国人民银行研究生部金融学硕士，2006年加盟东方基金管理有限责任公司，曾任债券研究员、债券交易员、本基金基金经理助理。
于鑫（先生）	2006年8月2日至2006年12月19日、2007年8月14日至2010年9月15日担任本基金基金经理	
张晓东（先生）	2006年10月9日至2007年8月14日担任本基金基金经理	

5.投资决策委员会成员

单宇先生：总经理，投资决策委员会主任委员。简历请参见董事介绍。

庞飒先生：总经理助理兼投资总监，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会副主任委员。浙江大学生命科学院理学硕士学历，11年证券从业经验，曾担任申银万国证券研究所行业分析师，富国基金行业分析师，汇添富基金管理有限公司投资决策委员会委员、基金投资部副总监、高级研究员、研究主管、基金经理。2010年5月加盟本公司。

张岗先生：西北大学经济学博士，10年证券从业经历。历任健桥证券股份公司行业公司部经理，天治基金管理公司研究员、天治财富增长混合型证券投资基金基金经理（2006年3月-2007年4月），投资副总监、投资决策委员会委员，建信基金管理公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟本公司，现任东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理，东方保本混合型开放式证券投资基金基金经理，研究部经理，投资决策委员会委员。

于鑫先生：东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理，东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理，基金管理部经理，投资决策委员会委员。清华大学MBA，CFA；10年证券从业经历，曾任世纪证券有限公司资产管理部投资经理；2005年加盟本公司。

李骥先生：首席策略分析师，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员。北京大学经济学博士，10年证券从业经历，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、长盛基金管理有限公司研究部副总监。2007年9月加盟本公司，曾任研究部经理。

6.上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人概况

1.基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
成立时间：1996年2月7日
基金托管业务批准文号：证监基金字【2004】101号
组织形式：股份有限公司（上市）
注册资本：26,714,732,987元人民币
存续期间：持续经营
电话：010-58560666
联系人：关悦

中国民生银行于1996年1月12日在北京正式成立，是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立十五年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了良好的资产质量。

2000年12月19日，中国民生银行A股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003年3月18日，中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004年11月8日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了58亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005年10月26日，民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，规范行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

中国民生银行在“2006民营上市公司100强”中位列第一名，并在市值、社会贡献两项分榜单中名列第一。

在《福布斯》中文版评选的“2006中国顶尖企业十强榜”上，民生银行位列第七名。

2007年10月，中国民生银行通过了SAI国际组织颁布的SA8000体系认证（即企业社会责任管理体系），成为中国金融界第一家通过该项认证的商业银行。

2007年11月，民生银行获得2007第一财经金融品牌价值榜十佳中资银行称号，同时荣获《21世纪经济报道》等机构评选的“最佳贸易融资银行奖”。

2007年12月，民生银行荣获《福布斯》颁发的第三届“亚太地区最大规模上市企业50强”奖项。

2008年7月，民生银行荣获“2008年中国最具生命力百强企业”第三名

在《2008中国商业银行竞争力评价报告》中民生银行核心竞争力排名第6位，在公司治理和流程银行两个单项评价中位列第一。

2009年6月，民生银行在“2009年中国本土银行网站竞争力评测活动”中获2009年中国本土银行网站“最佳服务质量奖”。

2009年9月，在大连召开的第二届中国中小企业融资论坛上，中国民生银行被评为“2009中国中小企业金融服务十佳机构”。在“第十届中国优秀财经证券网站评选”中，民生银行荣膺“最佳安全性能奖”和“2009年度最佳银行网站”两项大奖。

2009年11月21日，在第四届“21世纪亚洲金融年会”上，民生银行被评为“2009年·亚洲最佳风险管理银行”。

2009年12月1日，中国民生银行获得了“2008年度中国上市公司百强榜第13名”。

2009年12月9日，在由《理财周报》主办的“2009年第二届最受尊敬银行评选暨2009年第三届中国最佳银行理财产品评选”中，民生银行获得了“2009年中国最受尊敬银行”、“最佳服务私人银行”、“2009年最佳零售银行”多个奖项。

2010年2月3日，在“卓越2009年度金融理财排行榜”评选活动中，中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评，荣获卓越2009年度金融理财排行榜“十佳电子银行”奖。

2010年5月20日，在2010年英国《金融时报》中国银行业成就奖颁奖典礼上，中国民生银行从众多竞争者中脱颖而出，荣获“最佳贸易金融银行奖”。

2010年10月，在经济观察报主办的“2009年度中国最佳银行评选”中，民生银行获得评委会奖——“中国银行业十年改革创新奖”。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓著的银行而特别设立的。

2010年12月1日，在《亚洲货币》杂志（Asiamoney）公布的年度最佳公司治理票选结果中，民生银行在中国区组别中获得最高票数，成为年度中国区最佳公司治理企业。

2011年6月22日，在由《理财周报》主办的“2011中国上市公司最佳董事会价值管理论坛”上，民生银行荣获“2011中国主板上市公司最佳董事会10强”。

2011年7月9日，在《华夏时报》、北京大学中国企业法律风险管理研究中心主办的“2011中国上市公司风险管理高峰论坛”上，民生银行荣获“2011金盾奖-中国上市公司最佳信息披露奖”。

2011年9月20日，民生银行凭借在投资者关系管理方面的诸多创新做法和成绩，在第十三届投资者关系全球排名（IR Global Rankings，IRGR）颁奖典礼上，以中国区第二名获得中国投资者关系大奖（香港上市公司）优秀奖。

2.主要人员情况

陈凌：女，高级会计师。资产托管部总经理。曾任职于中国有色金属工业总公司财务部，中国有色财务公司，招商银行北京分行，中国民生银行股份有限公司总行营业部、北京管理部、西安分行、总行年金筹备组；历任中国有色财务公司处长，中国民生银行股份有限公司总行营业部副主任、北京管理部副总经理、西安分行行长、总行年金筹备组组长等职务。具有丰富的大型企业集团、非银行金融机构及商业银行的从业工作经历和管理工作经验。

3.基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工43人，平均年龄35岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员100%都具有基金从业资格。截止到2011年12月31日，本行共托管基金14只，分别为天治品质优选混合型证券投资基金、融通易支付货币市场证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、天治天得利货币市场基金、东方金账簿货币市场基金、长信增利动态策略证券投资基金、华商领先企业混合型证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金。托管基金资产净值为330.51亿元。

（二）基金托管人的内部控制制度

1.内部风险控制目标

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

2.内部风险控制组织结构

中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生银行股份有限公司稽核部、资产托管部内设稽核监督处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内设独立、专职的内部监督稽核处，负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计划，组织、指导、协调、监督各业务处室风险控制工作的实施。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3.内部风险控制原则

（1）全面性原则：风险控制必须覆盖资产托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

（2）独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监督处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

（5）防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

4.内部风险控制制度和措施

（1）制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

（2）建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

（3）风险识别与评估：稽核监督处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

（4）相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

（5）人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

（6）应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

5.资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

（1）坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，中国民生银行股份有限公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（2）实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务处室和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

（3）建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制，横向多处室制的内部组织结构，形成不同处室、不同岗位相互制衡的组织结构。

（4）以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

（5）制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要，制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职稽核监督处，依照有关法律规章，每两个月对业务的运行进行一次稽核检查。总行稽核部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

（6）将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中，技术控制风险比制度控制风险更加可靠，可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、相关服务机构

（一）直销机构：

名称：东方基金管理有限责任公司直销中心
住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
法定代表人：崔伟
联系人：史鹏浩
电话：010-66295921
传真：010-66578690
网址：www.orient-fund.com或www.df5888.com

（二）代销机构：

1.中国民生银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
联系人：董云巍
电话：010-58351666
传真：010-83914283
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

2.中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25 号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
联系人：王琳
电话：010-66275654
传真：010-66275654
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

3.中国工商银行股份有限公司
住所：中国北京复兴门内大街55号
办公地址：中国北京复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
联系人：王佺
电话：010-66107900
传真：010-66108013
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

4.中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1 号中国银行总行办公大楼
法定代表人：肖钢
联系人：宋亚萍
电话：010-66596688
传真：010-66593157
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

5.招商银行股份有限公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：秦晓
联系人：邓炯鹏
电话：0755-83077278
传真：0755-83195109
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

6.中国邮政储蓄银行有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号A座
法定代表人：刘安东
联系人：陈春林
电话：010-68858117
传真：010-66415194
客户服务电话：11185
网址：www.psbc.com

7.北京银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号首层
法定代表人：闫冰竹
联系人：王曦
电话：010-66223584
客户服务电话：95526
网址：www.bankofbeijing.com.cn

8.交通银行股份有限公司
住所：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：林芳
电话：021-58781234
传真：021-58408842
客户服务电话：95559或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.95559.com.cn

9.东北证券股份有限公司
住所：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
联系人：潘锴
电话：0431-85096709
客户服务电话：4006000686
网址：www.nesc.cn

10.中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座
办公地址：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座
法定代表人：顾伟国
联系人：李洋
电话：010-66568888
传真：010-66568536
客户服务电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

11.广发证券股份有限公司
住所：广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址：广州市天河北路183 号大都会广场18、19、36、38、41、42 楼
法定代表人：林治海
联系人：黄岚
电话：020-87555888
传真：020-87555305
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn

12.国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路618 号
办公地址：上海市浦东新区商城路618号
法定代表人：万建华
联系人：吴倩
电话：021-38676767
传真：021-38670767
客户服务电话：4008888666
网址：www.gtja.com

13.东方证券股份有限公司
住所：上海市中山南路318号2号楼22-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼22-29层
法定代表人：王益民
联系人：吴宇
电话：021-63325888
传真：021-63326173
客户服务电话：021-962506或40088-88506
网址：www.dfzq.com.cn

14.海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市黄浦区广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
电话：021-23219275
传真：021-23219100
客户服务电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.htsec.com

15.中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐
电话：010-85130588
传真：010-65182261
网站：www.csc108.com

16.山西证券股份有限公司
住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
客户服务电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

17.光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼
法定代表人：王明权
联系人：刘晨
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客户服务电话：10108998
网址：www.ebscn.com

18.国信证券有限责任公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

19.中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市面上深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址：北京朝阳区亮马桥路48号
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-60838888
传真：010-60833799
客户服务电话：各地营业部咨询电话
网址：www.ecitic.com

20.申银万国证券股份有限公司
住所：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：李清怡
电话：021-54033888
传真：021-54035333
客户服务电话：021-962505
网址：www.sw2000.com.cn

21.东海证券有限责任公司
住所：江苏省常州市延陵西路59号投资广场18楼
办公地址：上海市浦东新区东坊路989号中达广场13楼
法定代表人：朱科敏
联系人：霍小菲
电话：021-50586660
传真：021-50585607
客户服务电话：400-888-8588
网址：www.longone.com.cn

22.中信金通证券有限责任公司
住所：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：刘军
联系人：丁思聪
电话：0571-85112510
传真：0571-85783771
客户服务电话：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn

23.国元证券股份有限公司
住所：安徽省合肥市寿春路178号
办公地址：安徽省合肥市寿春路178号
法定代表人：凤良志
联系人：祝丽萍
电话：0551-2257012
传真：0551-2272100
客户服务电话：95578
网址：www.gyzq.com.cn

24.安信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305
传真：0755-82558355
客户服务电话：4008001001
网址：www.essence.com.cn

25.中信万通证券有限责任公司
住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层（266061）
法定代表人：张智河
联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客户服务电话：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

26.长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务电话：95579或4008-888-999
网址：www.95579.com

27.招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
联系人：黄健
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
客户服务电话：95565、4008888111
网址：www.newone.com.cn

28.齐鲁证券有限公司
住所：济南市经七路86号
办公地址：济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

29.江海证券有限公司
住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张宇宏
电话：0451-82336863
传真：0451-82287211
客户服务电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

30.宏源证券股份有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：010-88085858
传真：010-88085195
客户服务电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

31.华福证券有限责任公司
住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-87383623
传真：0591-87383610
客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）
网址：www.hfzq.com.cn

32.五矿证券有限公司
住所：深圳市福田区金田路4028号经贸中心48楼
办公地址：深圳市福田区金田路4028号经贸中心48楼
法定代表人：高竹
联系人：高克南
电话：0755- 82545707
传真：0755-82545500
客户服务电话：40018-40028
网址：www.wkzq.com.cn

33.恒泰长财证券有限公司
住所：长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段
办公地址：长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段
法定代表人：赵培武
联系人：曲志诚
电话：0431-82945299
传真：0431-82946531
网址：www.cczq.net

34.东莞证券有限责任公司
住所：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：张运勇
联系人：苏卓仁
电话：0769-22112062
客户服务电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号0769）
网址：www.dgzq.com.cn

（三）注册登记机构

名称：东方基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
法定代表人：崔伟
联系人：王广辉
电话：010-66295872
传真：010-66578680
网址：www.orient-fund.com或www.df5888.com

（四）律师事务所和经办律师

名称：北京市德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层
办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层
负责人：王丽
联系人：徐建军
电话：010-66575888
传真：010-65232181
经办律师：徐建军 李晓明

（五）会计师事务所和经办注册会计师

名称：立信会计师事务所有限公司
住所：上海市南京东路61号新黄浦金融大厦4层
办公地址：北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层
法定代表人：朱建弟
联系人：朱锦梅
电话：010-68286868
传真：010-88210608
经办注册会计师：朱锦梅、魏星

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东方金账簿货币市场证券投资基金
（二）本基金类型：货币市场基金
（三）基金运作方式：契约型开放式

六、基金的投资目标和投资方向

（一）基金的投资目标

在强调本金安全性、资产充分流动性的前提下，追求稳定的当期收益。

（二）基金的投资方向

本基金主要投资于金融工具，包括：现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单、剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券、期限在一年以内（含一年）的债券回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，以及经中国证监会、中国人民银行认可的并允许货币市场基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

七、基金的投资策略

（一）投资原则

1.合规性原则

本基金将严格按照《暂行规定》和基金合同的有关规定，选择监管当局批准的、适合投资的货币市场金融工具构建投资组合。同时对投资组合中不同投资产品与金融工具的投资比例进行严格控制，平均剩余期限不得超过180天（含）。

2.流动性侧重原则

根据对可投资金融品种期限结构的分析和投资货币市场基金投资者不同的流动性偏好，通过对不同投资产品未来现金流的预测，在构建组合时应侧重流动性的需求，实现本基金流动性高的特征，最大限度地保证投资者的流动性需求。

3.安全性原则

本基金主要投资于中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性和高信用级别的货币市场工具。

4.目标剩余期限原则

根据对宏观经济、市场环境和未来利率变动趋势的判断，深入分析收益率曲线与资金供求状况，确定并控制投资组合平均剩余期限，把握买卖时机。基金的平均剩余期限控制在180天以内（含）。如果预测利率将上升，可以适当降低投资组合的目标剩余期限；如果预测利率将下降，则可以适当增加投资组合的目标剩余期限。

5.稳健配置原则

根据各品种的交易活跃程度、相对收益、信用等级和剩余期限等重要指标来确定相应的配置比例，基金的资产配置比例严格按照基金合同和国家相关法律、法规规定的限制执行。在相对稳定的市场环境下，基金的资产配置比例将保持相对稳定，尽量不做过多的战术性调整。

（二）投资策略

本基金以价值分析为基础，以主动式的科学投资管理为手段，把握宏观经济走向与微观经济脉搏，通过以剩余期限为核心的资产配置，充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，追求基金资产稳定的当期收益。

1.剩余期限目标控制

根据对宏观经济指标、财政与货币政策、金融监管政策、市场结构变化、市场资金供求等因素的研究与分析，并结合本公司开发的债券超额回报率预测模型，对未来一段时期的短期市场利率的走势进行判断，由投资决策委员会决定或调整投资组合的剩余期限。

2.类属配置策略

类属配置指组合在央行票据、债券回购、短期债券以及现金等投资品种之间的配置比例。通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例，寻找具有投资价值的投资品种，增持相对低估、价格将上升的，能给组合带来相对较高回报的类属；减持相对高估、价格将下降的，给组合带来相对较低回报的类属，借以取得较高的总回报。并通过控制存款的比例、保留充足的可变现资产和平均安排回购到期期限，保证组合的充分流动性。

3.收益率曲线策略

收益曲线策略即在不同期限投资品种之间进行的配置，通过考察收益率曲线的动态变化及预期变化，通过积极使用买入并持有、骑乘收益率曲线等交易策略，寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。在期限配置方面，将在剩余期限决策的基础上，在不增加总体利率风险的情况下，集中于决定期限利差变化的因素，从不同期限的债券的相对价值变化中实现超额收益。

4.个券选择策略

在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，并找出这些债券价格偏离的原因，同时，基于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，选择投资于定价低估的短期债券品种。

5.无风险套利操作策略

由于市场环境差异以及市场参与成员的不同，市场中常常存在无风险套利机会。随着市场有效性的提高，无风险套利的机会与收益会不断减少，但在较长一段时间内市场中仍然会存在无风险套利机会。基金管理人将贯彻谨慎的原则，充分把握市场无风险套利机会，为基金份额持有人带来更大收益。

同时，随着市场的发展、新的货币投资工具的推出，会产生新的无风险套利机会。本基金将加强对市场前沿的研究，及时发现市场中新的无风险套利机会，扩大基金投资收益。

6.回购策略

根据对市场走势的判断，合理选择恰当的回购策略，以实现资产的增值。通过回购可以进行放大，在市场上升的时候增加获取收益的能力，并利用买入——回购融资——再投资的机制提高资金使用效率，博取更大的差价收益。在市场下跌时，则可使用买断式回购策略以规避风险。

（三）投资决策依据和决策程序

1.投资分析

根据基金管理人投研团队对宏观经济指标、财政与货币政策、金融监管政策、市场结构变化、市场资金供求等因素的研究与分析，建立相关研究模型，并据此作出对短期未来市场利率的预测报告，作为投资决策依据之一。

基金管理人的研究和投资部门定期或不定期举行投资研究联席会议，讨论宏观经济环境、利率走势、短期融资券发行人信用级别变化等相关问题，作为投资决策的重要依据之一。

如果基金经理认为影响利率的因素产生了重大变化，还可以临时提出变更投资决策，并报投资决策委员会审批。

2.投资决策

投资决策委员会根据基金合同、相关法律法规、本基金管理人有关规章制度确定基金的投资原则以及基金的资产配置比例范围，审批总体投资方案和重大投资事项。

基金经理根据投资决策委员会确定的投资对象、类属配置、期限配置等总体投资方案，并结合研究人员提供的投资建议、自己的研究与分析判断、基金申购赎回情况和市场整体情况，构建并优化投资组合。对于超出权限范围的投资，按照公司权限审批流程，提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

3.投资执行

中央交易室接受基金经理下达的交易指令。中央交易室接到指令后，首先应对指令予以审核，然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的，中央交易室可以暂不执行指令，并立即通知基金经理或相关人员。

中央交易室应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议，以便基金经理及时调整交易策略。

4.组合监控与调整

基金管理人的风险管理部门将密切关注宏观经济和市场变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量情况，每日对组合的风险和流动性进行监控，确保基金的各项风险控制指标维持在合理水平，确保组合的流动性能够满足基金份额持有人的赎回要求。

当组合中货币市场工具价格波动引起组合投资比例不能符合控制标准时，或当组合中货币市场工具信用评级调整导致信用等级不符合要求时，基金管理人应采取有效的措施，在合理的时间内调整组合。

风险管理部门定期对基金绩效进行评估。基金经理定期向投资决策委员会回顾前期投资运作情况，并提出下期的操作思路，作为投资决策委员会决策的参考。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资决策程序作出调整。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际对上述投资决策程序做出调整。

八、基金的业绩比较基准

本基金以货币市场工具为投资对象，每日的平均剩余期限控制在180 天内，本基金的业绩比较基准为银行税后活期利率。

在合理的市场化利率基准推出的情况下，本基金管理人可根据投资目标和投资策略，确定变更业绩比较基准，并及时公告。

当法律法规变化或市场有更加合理的业绩比较基准时，本基金管理人有权对此业绩比较基准进行调整，并予以公告。

九、基金的风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率低于股票基金、混合型基金和债券型基金。

十、基金的投资组合报告

本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。

基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至2011年12月31日（财务数据未经审计）。

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	249,770,021.13	53.12
	其中：债券	249,770,021.13	53.12
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	115,900,533.85	24.65
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	100,002,764.92	21.27
4	其他各项资产	4,513,071.30	0.96
5	合计	470,186,391.20	100.00

2.债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额		3.22
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	68,309,697.53	17.07
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3.基金投资组合平均剩余期限

（1）投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	134
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	79

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

（2）期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	38.89	17.07
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.42	-
2	30天（含）—60天	10.00	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.00	-
3	60天（含）—90天	14.96	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.46	-
4	90天（含）—180天	22.50	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）—397天（含）	30.04	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	116.39	17.07

4.期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,537,484.38	17.38
	其中：政策性金融债	69,537,484.38	17.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	180,232,536.75	45.05
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	249,770,021.13	62.43
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	59,506,958.99	14.87

5.期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1181301	11昆自CP01	300,000	30,109,693.58	7.53
2	041160008	11津建材CP001	300,000	29,992,357.65	7.50
3	110206	11国开06	200,000	19,999,930.19	5.00
4	1181292	11友阿CP01	200,000	19,982,849.90	4.99
5	110402	11农发02	200,000	19,848,358.70	4.96
6	041164007	11营口港CP001	100,000	10,043,912.32	2.51
7	041158010	11巨化CP001	100,000	10,041,537.84	2.51
8	070219	07国开19	100,000	10,030,525.39	2.51
9	1181160	11华晨CP01	100,000	10,022,469.67	2.51
10	041153004	11皖山鹰CP002	100,000	10,019,536.36	2.50

6.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1880%
报告期内偏离度的最低值	-0.2278%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1165%

7.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

（2）本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券，但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

（3）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。

（4）期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,505,371.30
4	应收申购款	7,700.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,513,071.30

十一、基金的业绩

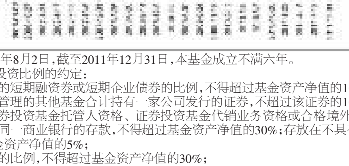
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）基金净值表现

历史各时间段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	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差？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
2006.08.02-2006.12.31	0.7896%	0.0019%	0.7429%	0.0001%	0.0467%	0.0018%
2007.01.01-2007.12.31	3.1856%	0.0072%	2.4441%	0.0017%	0.7415%	0.0055%
2008.01.01-2008.12.31	3.2897%	0.0084%	2.5631%	0.0039%	0.7266%	0.0045%
2009.01.01-2009.12.31	1.6419%	0.0078%	0.3600%	0.0000%	1.2819%	0.0078%
2010.01.01-2010.12.31	1.8175%	0.0053%	0.3600%	0.0000%	1.4575%	0.0053%
2011.01.01-2011.06.30	1.7027%	0.0075%	0.2176%	0.0002%	1.4851%	0.0073%
2011.07.01-2011.9.30	1.0180%	0.0019%	0.1260%	0.0000%	0.8920%	0.0019%
2011.10.01-2011.12.31	1.1853%	0.0030%	0.1260%	0.0000%	1.0593%	0.0030%

（二）自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1.本基金成立于2006年8月2日，截至2011年12月31日，本基金成立不满六年。

2.基金合同中关于基金投资比例的约定：

①投资于同一公司发行的短期融资券或短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

②与本基金基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

③存款银行应当具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管人资格。存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的5%；

④基金投资于定期存款的比例，不得超过基金资产净值的30%；

⑤除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的，基金管理人应在5 个交易日内进行调整；

⑥投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过180天；

⑦持有的剩余期限不超过397 天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%；

⑧通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过397天；

⑨法律法规或中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。由于证券市场波动或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。

因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述约定的规定，基金管理人应在合理期限内进行调整，以符合有关限制规定。

本基金在本报告期内遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

十二、费用概览

（一）管理费率：

基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提

（二）托管费率：

基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提

（三）销售费用：

基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提

十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理方法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新，主要内容如下：

（一）在“重要提示”部分，更新了“招募说明书有关财务数据的截止日期”及“其他内容的截止日期”。

（二）在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关内容。

（三）在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关内容。

（四）在“五、相关服务机构”部分，更新了直销机构、注册登记机构、会计师事务所的信息。

（五）在“七、基金份额的申购与赎回”部分，更新了“申购与赎回办理的场所”、“定期定额投资计划”等内容，并说明了开通定期定额投资的代销机构和日期。

（六）在“八、基金的投资”部分，更新了“基金投资组合报告”的内容，基金投资组合报告截止日期更新为2011年12月31日，该部分内容均按有关规定编制，并经本基金托管人复核，但未经审计。

（七）在“九、基金的业绩”部分，更新了“基金净值表现”和“本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，该部分内容均按照有关规定编制，并经本基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。

（八）在“十九、基金的托管协议内容摘要”部分，更新了基金管理人、基金托管人的相关信息。

（九）在“二十、对基金份额持有人的服务”部分，更新相关服务信息。

（十）在“二十一、其他应披露事项”部分，更新了（四）从上次《招募说明书（更新）》截止日2011年8月2日至本次《招募说明书（更新）》截止日2012年2月2日之间的信息披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容，可登录东方基金管理有限责任公司网站www.orient-fund.com。

东方基金管理有限责任公司
2012年3月16日