

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
报告送出日期:二〇一二年三月二十八日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月23日复核了本报告中财务指标、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表示其未来表现,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。

立信会计师事务所 特殊普通合伙 为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告,基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明,请投资者注意阅读。

本报告自2011年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	东方金账簿货币
基金代码	400055
交易代码	400055
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年8月2日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	400,098,253.50份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

2.3基金管理人及基金托管人

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	吕丹	李洁
联系电话	010-66295888	010-58560666
电子邮箱	xqj@orient-fund.com	xing@cmb.com.cn
客户服务电话	010-66578787/400-628-5888	95568
传真	010-66578700	010-58507974
注册地址	北京市西城区德胜门内大街1-1号	北京市西城区复兴门内大街2号

2.4信息披露方式

登载基金年度报告摘要的方式互联网网址: <http://www.orient-fund.com/jmp/ww/405888.com>

基金年度报告备置地点: 本基金管理人及基金托管人住所

§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

3.1.1期间数据和指标	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	13,077,726.95	4,195,763.12	4,430,384.25
本期利润	13,077,726.95	4,195,763.12	4,430,384.25
本期净利润	13,077,726.95	4,195,763.12	4,430,384.25
3.1.2期末资产和负债	2011年末	2010年末	2009年末
期末基金份额净值	400,098,253.50	536,705,957.95	273,042,426.58
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
 ②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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
 ③本基金每日分配收益,按月结转份额。
 3.2基金净值表现
 3.2.1基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去三个月	1.1833%	0.0009%	0.1269%	0.0009%	1.0564%	0.0000%
过去六个月	2.2144%	0.0027%	0.2521%	0.0009%	1.9623%	0.0027%
过去一年	3.9558%	0.0057%	0.4697%	0.0001%	3.4861%	0.0056%
过去三年	7.5832%	0.0096%	1.1897%	0.0002%	6.3935%	0.0094%
过去五年	16.548%	0.0074%	6.1969%	0.0034%	10.3479%	0.0040%
自基金合同生效起至今	17.4650%	0.0071%	6.9398%	0.0033%	10.5252%	0.0038%

3.2.2过去五年基金合同生效以来基金净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方金账簿货币市场证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图
 2006年8月2日至2011年12月31日

3.3过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方金账簿货币市场证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

3.3.2过去三年基金的利润分配情况

项目	本期	上期
一、收入	15,988,500.64	6,299,445.40
1.利息收入	15,336,450.28	5,612,416.60
其中:存款利息收入	2,428,295.14	277,415.20
债券利息收入	6,926,314.22	4,529,638.65
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,983,240.92	805,142.75
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	651,650.36	687,026.80
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	651,650.36	687,026.80
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收益(损失以“-”号填列)	-	-
二、费用	2,910,773.69	2,103,680.28
1.管理人报酬	1,103,414.68	777,432.97
2.托管费	334,428.65	235,585.81
3.销售服务费	836,071.70	588,965.52
4.交易费用	-	-
5.利息支出	304,443.77	172,034.94
其中:卖出回购金融资产支出	304,443.77	172,034.94
6.其他费用	332,214.89	329,662.04
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	13,077,726.95	4,195,763.12
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	13,077,726.95	4,195,763.12

注:报告期内基金净值收益率为13.08%,同期业绩比较基准收益率为1.27%。
 ①本基金净值收益率扣除费用后的净值收益率。
 ②本基金净值收益率标准差为0.0009%。
 ③业绩比较基准收益率为1.27%。
 ④业绩比较基准收益率标准差为0.0001%。
 注:本基金为货币市场基金,其净值收益率与业绩比较基准收益率的对比,主要反映基金净值收益率与业绩比较基准收益率的偏离程度,而非绝对收益水平。

§4基金管理人报告

4.1基金管理人及基金基金经理情况

4.1.1基金管理人及基金基金经理的基本情况

基金管理人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]10号)于2004年6月11日成立,是中华人民共和国证券投资基金业(下称“基金业”)的第一家基金管理公司,本公司注册资本人民币1亿元。本公司股东为东方证券股份有限公司,持有股份46%;中研国华实业(集团)有限公司,持有股份18%;瀚海国际信托有限公司,持有股份18%;河北省国有资产控股运营有限公司,持有股份18%。截至2011年12月31日,本公司管理八只开放式证券投资基金——东方蓝筹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、东方策略股票型开放式证券投资基金、东方稳健回报证券投资基金、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、东方增长中盘混合型开放式证券投资基金。

4.1.2基金基金经理、基金经理小组及基金基金经理简历

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
王丹(女)	本基金基金经理	2010-09-16 -	5年	中国人民大学货币金融学硕士,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、基金经理助理。

注:①此处的任职日期和离任日期均指在法定信息披露媒体正式公告之日。
 ②此处的从业的含义遵从行业协会《证券投资基金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

本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》、《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《东方金账簿货币市场证券投资基金合同》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用基金资产,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。本基金无重大违法违规行为,本基金投资组合符合有关法律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

4.3.2报告期内本基金运作符合公平交易制度,未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的行为。
 4.3.3投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内本公司无其他投资风格相似的投资组合。
 4.3.4异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金运作未发现异常交易行为。
 4.4报告期内基金管理人及基金基金经理的变更情况

2011年,国内政策调控持续收紧,央行在二季度6月上调定存准备金率,使之达到历史最高点,3次加息,严厉的紧缩政策使得CPI增速在四季度降至-0.9%,CPI也位于负值区间后逐步回升,进入4季度,收债危机重新升级,12月初六大央行联手干预,国内的定存准备金率也下降0.5个百分点,货币政策明显松动。
 2011年银行间市场的资金紧张加剧,货币市场利率创下历史新高,资金面整体维持紧张,债券收益率率先抬升,在4季度经济和通胀双下行的驱动下,中长期利率产品和高等级信用产品收益率明显下降。
 报告期内,本基金维持逆回购和存贷款的投资比例,在利率产品收益回落初期增持了含权衍生品,在短债收益率见底后在一级市场积极拓展新发融资,在保持基金现金流流动性的同时,获取了稳健的收益。

4.4.4报告期内基金的投资组合和资产变动情况

2011年1月1日至12月31日,本基金净值收益率为3.9558%,业绩比较基准收益率为4.697%,高于业绩比较基准3.4861%。
 4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年,国内政策调控持续收紧,央行在二季度6月上调定存准备金率,使之达到历史最高点,3次加息,严厉的紧缩政策使得CPI增速在四季度降至-0.9%,CPI也位于负值区间后逐步回升,进入4季度,收债危机重新升级,12月初六大央行联手干预,国内的定存准备金率也下降0.5个百分点,货币政策明显松动。
 2011年银行间市场的资金紧张加剧,货币市场利率创下历史新高,资金面整体维持紧张,债券收益率率先抬升,在4季度经济和通胀双下行的驱动下,中长期利率产品和高等级信用产品收益率明显下降。
 报告期内,本基金维持逆回购和存贷款的投资比例,在利率产品收益回落初期增持了含权衍生品,在短债收益率见底后在一级市场积极拓展新发融资,在保持基金现金流流动性的同时,获取了稳健的收益。

4.4.4.1报告期内基金的投资组合和资产变动情况

2011年1月1日至12月31日,本基金净值收益率为3.9558%,业绩比较基准收益率为4.697%,高于业绩比较基准3.4861%。
 4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年,国内政策调控持续收紧,央行在二季度6月上调定存准备金率,使之达到历史最高点,3次加息,严厉的紧缩政策使得CPI增速在四季度降至-0.9%,CPI也位于负值区间后逐步回升,进入4季度,收债危机重新升级,12月初六大央行联手干预,国内的定存准备金率也下降0.5个百分点,货币政策明显松动。
 2011年银行间市场的资金紧张加剧,货币市场利率创下历史新高,资金面整体维持紧张,债券收益率率先抬升,在4季度经济和通胀双下行的驱动下,中长期利率产品和高等级信用产品收益率明显下降。
 报告期内,本基金维持逆回购和存贷款的投资比例,在利率产品收益回落初期增持了含权衍生品,在短债收益率见底后在一级市场积极拓展新发融资,在保持基金现金流流动性的同时,获取了稳健的收益。

§5基金投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

5.1.1报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产比例
权益投资	4,505,371.30	1.346,487.43
固定收益投资	7,700.00	41,428,150.35
金融衍生品投资	-	-
其他资产	470,186,391.20	537,416,143.97

5.1.2报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产比例
银行存款	100,002,764.92	140,001,302.47
结算备付金	-	21,313,909.09
存出保证金	-	-
应收利息	249,770,021.13	140,125,332.33
其他资产	-	-

5.2报告期末基金资产组合情况

5.2.1报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产比例
权益投资	4,505,371.30	1.346,487.43
固定收益投资	7,700.00	41,428,150.35
金融衍生品投资	-	-
其他资产	470,186,391.20	537,416,143.97

5.2.2报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产比例
银行存款	100,002,764.92	140,001,302.47
结算备付金	-	21,313,909.09
存出保证金	-	-
应收利息	249,770,021.13	140,125,332.33
其他资产	-	-

5.3管理人对公允价值估值情况的说明

5.4管理人对报告期内基金估值程序、估值方法等有关事项的合法合规性进行审查和监督,发现问及时要求整改。

5.5管理人对报告期内基金估值程序、估值方法等有关事项的合法合规性进行审查和监督,发现问及时要求整改。

5.6管理人对报告期内基金估值程序、估值方法等有关事项的合法合规性进行审查和监督,发现问及时要求整改。

5.7管理人对报告期内基金估值程序、估值方法等有关事项的合法合规性进行审查和监督,发现问及时要求整改。

5.8管理人对报告期内基金估值程序、估值方法等有关事项的合法合规性进行审查和监督,发现问及时要求整改。

5.9管理人对报告期内基金估值程序、估值方法等有关事项的合法合规性进行审查和监督,发现问及时要求整改。

5.10管理人对报告期内基金估值程序、估值方法等有关事项的合法合规性进行审查和监督,发现问及时要求整改。

§6基金业绩比较基准

6.1基金业绩比较基准

6.2基金业绩比较基准

6.3基金业绩比较基准

6.4基金业绩比较基准

6.5基金业绩比较基准

6.6基金业绩比较基准

6.7基金业绩比较基准

6.8基金业绩比较基准

6.9基金业绩比较基准

6.10基金业绩比较基准

§7基金管理人报告

7.1基金管理人报告

7.2基金管理人报告

7.3基金管理人报告

7.4基金管理人报告

7.5基金管理人报告

7.6基金管理人报告

7.7基金管理人报告

7.8基金管理人报告

7.9基金管理人报告

7.10基金管理人报告

§8基金托管人报告

8.1基金托管人报告

8.2基金托管人报告

8.3基金托管人报告

8.4基金托管人报告

8.5基金托管人报告

8.6基金托管人报告

8.7基金托管人报告

8.8基金托管人报告

8.9基金托管人报告

8.10基金托管人报告

§9基金份额持有人信息

9.1基金份额持有人信息

9.2基金份额持有人信息

9.3基金份额持有人信息

9.4基金份额持有人信息

9.5基金份额持有人信息

9.6基金份额持有人信息

9.7基金份额持有人信息

9.8基金份额持有人信息

9.9基金份额持有人信息

9.10基金份额持有人信息

§10开放式基金资产变动

10.1开放式基金资产变动

10.2开放式基金资产变动

10.3开放式基金资产变动

10.4开放式基金资产变动

10.5开放式基金资产变动

10.6开放式基金资产变动

10.7开放式基金资产变动

10.8开放式基金资产变动

10.9开放式基金资产变动

10.10开放式基金资产变动

§11基金估值

11.1基金估值

11.2基金估值

11.3基金估值

11.4基金估值

11.5基金估值

11.6基金估值

11.7基金估值

11.8基金估值

11.9基金估值

11.10基金估值

11.11基金估值

11.12基金估值

§12基金费用

12.1基金费用

12.2基金费用

12.3基金费用

12.4基金费用

12.5基金费用

12.6基金费用

12.7基金费用

12.8基金费用

12.9基金费用

12.10基金费用

§13基金收益分配

13.1基金收益分配

13.2基金收益分配

13.3基金收益分配

13.4基金收益分配

13.5基金收益分配

13.6基金收益分配

13.7基金收益分配

13.8基金收益分配

13.9基金收益分配

13.10基金收益分配

§14基金信息披露

14.1基金信息披露

14.2基金信息披露

14.3基金信息披露

14.4基金信息披露

14.5基金信息披露

14.6基金信息披露

14.7基金信息披露

14.8基金信息披露

14.9基金信息披露

14.10基金信息披露

§15基金其他重要事项

15.1基金其他重要事项

15.2基金其他重要事项

15.3基金其他重要事项

15.4基金其他重要事项

15.5基金其他重要事项

15.6基金其他重要事项

15.7基金其他重要事项

15.8基金其他重要事项

15.9基金其他重要事项

15.10基金其他重要事项

§16基金合同及托管协议摘要

16.1基金合同及托管协议摘要

16.2基金合同及托管协议摘要

16.3基金合同及托管协议摘要

16.4基金合同及托管协议摘要

16.5基金合同及托管协议摘要

16.6基金合同及托管协议摘要

16.7基金合同及托管协议摘要

16.8基金合同及托管协议摘要

16.9基金合同及托管协议摘要

16.10基金合同及托管协议摘要

§17基金合同及托管协议摘要

17.1基金合同及托管协议摘要

17.2基金合同及托管协议摘要

17.3基金合同及托管协议摘要

17.4基金合同及托管协议摘要

17.5基金合同及托管协议摘要

17.6基金合同及托管协议摘要

17.7基金合同及托管协议摘要

17.8基金合同及托管协议摘要

17.9基金合同及托管协议摘要

17.10基金合同及托管协议摘要

§18基金合同及托管协议摘要

18.1基金合同及托管协议摘要

18.2基金合同及托管协议摘要

18.3基金合同及托管协议摘要

18.4基金合同及托管协议摘要

18.5基金合同及托管协议摘要

18.6基金合同及托管协议摘要

18.7基金合同及托管协议摘要

18.8基金合同及托管协议摘要

18.9基金合同及托管协议摘要

18.10基金合同及托管协议摘要

§19基金合同及托管协议摘要

19.1基金合同及托管协议摘要

19.2基金合同及托管协议摘要

19.3基金合同及托管协议摘要

19.4基金合同及托管协议摘要

19.5基金合同及托管协议摘要

19.6基金合同及托管协议摘要

19.7基金合同及托管协议摘要

19.8基金合同及托管协议摘要

19.9基金合同及托管协议摘要

19.10基金合同及托管协议摘要

§20基金合同及托管协议摘要

20.1基金合同及托管协议摘要

20.2基金合同及托管协议摘要

20.3基金合同及托管协议摘要

20.4基金合同及托管协议摘要

20.5基金合同及托管协议摘要

20.6基金合同及托管协议摘要

20.7基金合同及托管协议摘要

20.8基金合同及托管协议摘要

20.9基金合同及托管协议摘要

20.10基金合同及托管协议摘要

§21基金合同及托管协议摘要

21.1基金合同及托管协议摘要

21.2基金合同及托管协议摘要

21.3基金合同及托管协议摘要

21.4基金合同及托管协议摘要

21.5基金合同及托管协议摘要

21.6基金合同及托管协议摘要

21.7基金合同及托管协议摘要

21.8基金合同及托管协议摘要

21.9基金合同及托管协议摘要

21.10基金合同及托管协议摘要

§22基金合同及托管协议摘要

22.1基金合同及托管协议摘要

22.2基金合同及托管协议摘要

22.3基金合同及托管协议摘要

22.4基金合同及托管协议摘要

22.5基金合同及托管协议摘要

22.6基金合同及托管协议摘要

22.7基金合同及托管协议摘要

22.8基金合同及托管协议摘要

22.9基金合同及托管协议摘要

22.10基金合同及托管协议摘要

§23基金合同及托管协议摘要

23.1基金合同及托管协议摘要

23.2基金合同及托管协议摘要

23.3基金合同及托管协议摘要

23.4基金合同及托管协议摘要

23.5基金合同及托管协议摘要

23.6基金合同及托管协议摘要

23.7基金合同及托管协议摘要

23.8基金合同及托管协议摘要

23.9基金合同及托管协议摘要

23.10基金合同及托管协议摘要

§24基金合同及托管协议摘要

24.1基金合同及托管协议摘要

24.2基金合同及托管协议摘要

24.3基金合同及托管协议摘要

24.4基金合同及托管协议摘要

24.5基金合同及托管协议摘要

24.6基金合同及托管协议摘要

24.7基金合同及托管协议摘要

24.8基金合同及托管协议摘要

24.9基金合同及托管协议摘要

24.10基金合同及托管协议摘要

§25基金合同及托管协议摘要

25.1基金合同及托管协议摘要

25.2基金合同及托管协议摘要

25.3基金合同及托管协议摘要

25.4基金合同及托管协议摘要

25.5基金合同及托管协议摘要

25.6基金合同及托管协议摘要

25.7基金合同及托管协议摘要

25.8基金合同及托管协议摘要

25.9基金合同及托管协议摘要

25.10基金合同及托管协议摘要

§26基金合同及托管协议摘要

26.1基金合同及托管协议摘要

26.2基金合同及托管协议摘要

26.3基金合同及托管协议摘要

26.4基金合同及托管协议摘要

26.5基金合同及托管协议摘要

26.6基金合同及托管协议摘要

26.7基金合同及托管协议摘要

26.8基金合同及托管协议摘要

26.9基金合同及托管协议摘要

26.10基金合同及托管协议摘要

§27基金合同及托管协议摘要

27.1基金合同及托管协议摘要

27.2基金合同及托管协议摘要

27.3基金合同及托管协议摘要

27.4基金合同及托管协议摘要

27.5基金合同及托管协议摘要

27.6基金合同及托管协议摘要

27.7基金合同及托管协议摘要

27.8基金合同及托管协议摘要

27.9基金合同及托管协议摘要

27.10基金合同及托管协议摘要

§28基金合同及托管协议摘要

28.1基金合同及托管协议摘要

28.2基金合同及托管协议摘要

28.3基金合同及托管协议摘要

28.4基金合同及托管协议摘要

28.5基金合同及托管协议摘要

28.6基金合同及托管协议摘要

28.7基金合同及托管协议摘要

28.8基金合同及托管协议摘要

28.9基金合同及托管协议摘要

28.10基金合同及托管协议摘要

§29基金合同及托管协议摘要

29.1基金合同及托管协议摘要

29.2基金合同及托管协议摘要

29.3基金合同及托管协议摘要

29.4基金合同及托管协议摘要

29.5基金合同及托管协议摘要

29.6基金合同及托管协议摘要

29.7基金合同及托管协议摘要

29.8基金合同及托管协议摘要

29.9基金合同及托管协议摘要

29.10基金合同及托管协议摘要

§30基金合同及托管协议摘要

30.1基金合同及托管协议摘要

30.2基金合同及托管协议摘要

30.3基金合同及托管协议摘要

30.4基金合同及托管协议摘要

30.5基金合同及托管协议摘要

30.6基金合同及托管协议摘要

30.7基金合同及托管协议摘要

30.8基金合同及托管协议摘要

30.9基金合同及托管协议摘要

30.10基金合同及托管协议摘要

§31基金合同及托管协议摘要

31.1基金合同及托管协议摘要

31.2基金合同及托管协议摘要

31.3基金合同及托管协议摘要

31.4基金合同及托管协议摘要

31.5基金合同及托管协议摘要

31.6基金合同及托管协议摘要

31.7基金合同及托管协议摘要

31.8基金合同及托管协议摘要

31.9基金合同及托管协议摘要

31.10基金合同及托管协议摘要

§32基金合同及托管协议摘要