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
送出日期:二〇一五年三月二十八日

东方金账簿货币市场证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2015 年 3 月 20 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。

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。

本报告期自 2014 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	东方金账簿货币	
基金主代码	400005	
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	923,388,657.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B
下属分级基金的交易代码:	400005	400006
报告期末下属分级基金的份额总额	487,107,255.42 份	436,281,401.99 份

2.2 基金产品说明

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。
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。
业绩比较基准	银行税后活期利率
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均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	赵天杰
	联系电话	010-66295888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	zhaotianjie@cmbc.com.cn
客户服务电话		010-66578578或 400-628-5888	95568
传真		010-66578700	010-58560798

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	2014年		2013年		2012年	
	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B
本期已实现收益	70,196,540.23	6,339,438.95	67,062,212.60	-	46,764,574.08	-
本期利润	70,196,540.23	6,339,438.95	67,062,212.60	-	46,764,574.08	-
本期净值收益率	4.7530%	0.9562%	4.1684%	-	4.2939%	-
3.1.2 期末数据和指标	2014年末		2013年末		2012年末	
期末基金资产净值	487,107,255.42	436,281,401.99	1,530,617,293.10	-	978,226,090.30	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	-	1.0000	-

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。

④本基金于 2014 年 10 月 22 日起新增 B 类基金份额类别,详情请查询本公司 2014 年 10 月 16 日发布的《关于东方金账簿货币市场证券投资基金增加基金份额类别的公告》。本报告中东方金账簿货币 B 的数据统计期间为 2014 年 10 月 22 日至 2014 年 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额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 A

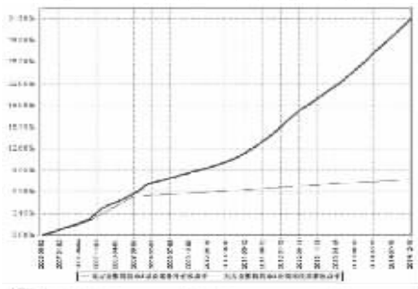
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1472%	0.0052%	0.0882%	0.0000%	1.0590%	0.0052%
过去六个月	2.3041%	0.0067%	0.1764%	0.0000%	2.1277%	0.0067%
过去一年	4.7530%	0.0058%	0.3500%	0.0000%	4.4030%	0.0058%
过去三年	13.4653%	0.0056%	1.1190%	0.0001%	12.3463%	0.0055%
过去五年	20.0522%	0.0062%	1.9487%	0.0002%	18.1035%	0.0060%
自基金合同生效起至今	31.0793%	0.0070%	8.0588%	0.0029%	23.0205%	0.0041%

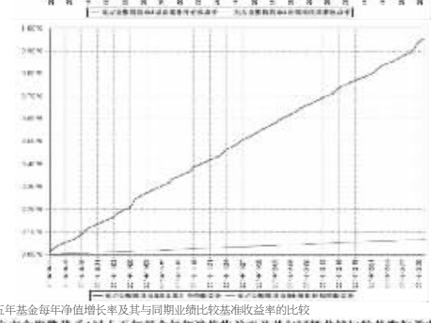
东方金账簿货币 B

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	0.9562%	0.0056%	0.0681%	0.0000%	0.8881%	0.0056%

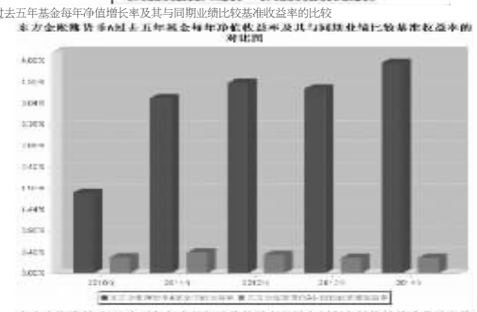
注:本基金每日分配收益,按月结转份额。

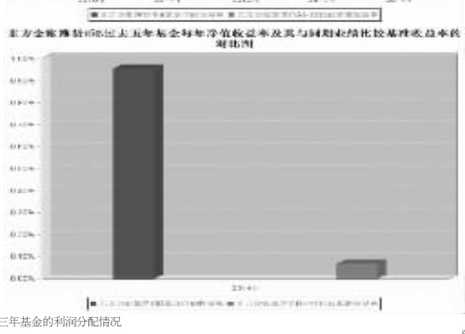
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 过去五年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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

东方金账簿货币 A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	57,505,862.58	9,726,523.61	2,964,154.04	70,196,540.23	
2013年	57,815,312.73	7,518,986.45	1,727,913.42	67,062,212.60	
2012年	35,598,536.52	7,885,638.95	3,280,398.61	46,764,574.08	
合计	150,919,711.83	25,131,149.01	7,972,466.07	184,023,326.91	
东方金账簿货币 B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	4,174,842.29	2,011,208.96	153,387.70	6,339,438.95	
2013年	-	-	-	-	
2012年	-	-	-	-	
合计	4,174,842.29	2,011,208.96	153,387.70	6,339,438.95	

注:本基金“每日分配收益,按月结转份额”。本基金收益根据每日基金收益公告,以每万份基金份额净收益为基准,每日为基金份额持有人计算当日收益并分配,每月集中支付收益。

§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%;渤海国际信托有限公司,持有股份 9%。截止 2014 年 12 月 31 日,本公司管理十六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、东方双倍添利债券型证券投资基金、东方添益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		
姚航(女士)	本基金经理	2013年9月25日	-	10年	中国人民大学工商管理硕士,10 年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司运营部,2010 年 10 月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任债券交易员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理,现任东方金账簿货币市场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、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
周薇(女士)	本基金经理	2014年8月28日	-	5年	北京大学金融学硕士,5 年证券从业经历,曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012 年 7 月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任固定收益部债券研究员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理。现任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理。
王丹丹(女士)	本基金经理、固定收益部副总经理、投资决策委员会委员	2010年9月16日	2014年3月7日	8年	中国人民银行研究生部金融学硕士,8 年基金从业经历。2006 年 6 月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、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。现任固定收益部副总经理、投资决策委员会委员、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。
周薇(女士)	本基金基金经理助理	2014年4月17日	2014年8月27日	5年	北京大学金融学硕士,5 年证券从业经历,曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012 年 7 月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任固定收益部债券研究员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理。现任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理。

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

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》、《证券投资基金管理公司管理办法》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中的公平交易程序;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,未直接或通过与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

从资金面来看,在 2014 年底至 2015 年初来看,11 月初是这期间最为宽松的时点。之后影响资金面的因素主要有:10 月底以来发改委持续审批新项目带来的信用投放,12 月为 2014 年内最密集 IPO 造成的资金冻结,9 月未央行投放 MLF 的到期、对同业存款是否缴纳存款准备金的预期变化、A 股持续上涨。以上这些因素都对资金面都造成相当压力。我们充分利用 IPO 及银行间资金紧张时点进行操作,力争创造平稳并且较好的收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年 1 月 1 日至 12 月 31 日,本基金 A 类净值增长率为 4.7530%,业绩比较基准收益率为 0.3500%,高于业绩比较基准 4.4030%;2014 年 10 月 22 日至 12 月 31 日,本基金 B 类净值增长率为 0.9562%,业绩比较基准收益率为 0.0681%,高于业绩比较基准 0.8881%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着 2014 年末债券收益率的上行,2015 年有望获得较好的票息收益。从中期趋势来看,经济仍在继续探底的过程中,在债券收益率的高点仍然可能创造一定资本利得。从国内货币政策、国内通胀形势、美元走势等角度看,上半年存在较好的配置时间窗口。

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”),成员由总经理、督察长、投资总监、基金经理和风险管理部、交易部、登记清算部、监察稽核部负责人组成,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:

总经理、督察长、投资总监:参与估值小组的日常工作,负责对基金投资组合中“长期停牌”等没有市价的股票所属行业和重估方法形成最后决议;

基金经理:参与估值小组的日常工作,对采纳的估值方法和估值模型等发表意见和建议,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权;

交易部:负责提议召开估值委员会会议,并将已形成决议的重估方法所适用的金融产品明细提供风险管理部;

风险管理部:负责制定估值模型、假设及参数、确定参考行业指数并采集行业指数,据其计算估值公允价格;

登记清算部:负责估值事宜的内外部协调,依据风险管理部提供的公允价格对投资品种进行估值,计算基金资产净值及基金份额净值,并按照监管部门要求作好相关信息披露工作;

监察稽核部:对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督,发现问题及时要求整改。

除基金经理外,参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截止本报告期期末,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)。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况,本基金应分配且已分配利润 76,535,979.18 元;本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

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,本基金不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产规模低于 5000 万元的情形。

§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

中国民生银行根据《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》和《东方金账簿货币市场证券投资基金托管协议》,托管东方金账簿货币市场证券投资基金(以下简称“东方金账簿基金”)。

本年度,中国民生银行在东方金账簿基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,依法安全保管了基金财产,按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本年度,按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人——东方基金管理有限责任公司在东方金账簿基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金利润分配等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。本年度,基金管理人——东方基金管理有限责任公司严格遵守《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 A 类应分配且已分配利润 70,196,540.23 元,B 类应分配且已分配利润 6,339,438.95 元。

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

由东方金账簿基金管理人——东方基金管理有限责任公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、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真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金本年度财务会计报告已经审计,立信会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:东方金账簿货币市场证券投资基金

报告截止日:2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	268,442,795.22	450,196,851.51
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	599,524,524.56	624,578,122.36
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		599,524,524.56	624,578,122.36
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	209,801,034.70	380,001,490.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	16,410,593.61	11,059,450.76
应收股利		-	-
应收申购款		8,200.00	225,733,323.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,094,187,148.09	1,691,569,238.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		167,160,729.25	155,184,602.41
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		53,897.51	-
应付管理人报酬		317,116.43	364,164.87
应付托管费		96,095.89	110,352.98
应付销售服务费		119,429.03	275,882.45
应付交易费用	7.4.7.7	28,188.97	34,860.70
应交税费		-	-
应付利息		21,956.91	13,548.96
应付利润		2,911,629.14	4,879,532.69
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	89,447.55	89,000.00
负债合计		170,798,490.68	160,951,945.06
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	923,388,657.41	1,530,617,293.10
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		923,388,657.41	1,530,617,293.10
负债和所有者权益总计		1,094,187,148.09	1,691,569,238.16

注:①报告截止日 2014 年 12 月 31 日,A 类基金份额净值 1.0000 元,B 类基金份额净值 1.0000 元;基金份额总额 923,388,657.41 份,下属分级基金的份额总额分别为:A 类基金份额总额 487,107,255.42 份,B 类基金份额总额 436,281,401.99 份。

②本基金于 2014 年 10 月 22 日起新增 B 类基金份额类别,详情请查询本公司 2014 年 10 月 16 日发布的《关于东方金账簿货币市场证券投资基金增加基金份额类别的公告》。

7.2 利润表

会计主体:东方金账簿货币市场证券投资基金

本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一.收入		91,056,087.85	82,715,512.54
1.利息收入		81,346,343.39	78,397,632.03
其中:存款利息收入	7.4.7.11	26,570,098.24	19,527,988.96
债券利息收入		34,251,633.11	30,409,655.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,524,612.04	28,459,987.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		9,709,744.46	4,317,630.51
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	9,709,744.46	4,317,630.51
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-	250.00
减:二、费用		14,520,108.67	15,633,299.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,531,902.14	5,400,670.11
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,676,333.96	1,636,566.73
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,879,808.35	4,091,416.81
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		3,039,100.46	4,143,404.27
其中:卖出回购金融资产支出		3,039,100.46	4,143,404.27
6. 其他费用	7.4.7.20	392,963.76	381,242.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		76,535,979.18	67,062,212.60
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		76,535,979.18	67,062,212.60

注:①本基金于 2014 年 10 月 22 日起新增 B 类基金份额类别,详情请查询本公司 2014 年 10 月 16 日发布的《关于东方金账簿货币市场证券投资基金增加基金份额类别的公告》。

②本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方金账簿货币市场证券投资基金

本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 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)	1,530,617,293.10	-	1,530,617,293.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	76,535,979.18	76,535,979.18
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)	-607,228,635.69	-	-607,228,635.69
其中:1.基金申购款	10,010,955,381.84	-	10,010,955,381.84
2.基金赎回款	-10,618,184,017.53	-	-10,618,184,017.53
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)	-	-76,535,979.18	-76,535,979.18
五、期末所有者权益(基金净值)	923,388,657.41	-	923,388,657.41

注:①报告期末所有者权益(基金净值)为零。

②上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日,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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止本年度报告报出日,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	固定收益投资	599,524,524.56	54.79
	其中:债券	599,524,524.56	54.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	209,801,034.70	19.17
	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	268,442,795.22	24.53
4	其他各项资产	16,418,793.61	1.50
5	合计	1,094,187,148.09	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.24	
	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	167,160,729.25	18.10
	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个交易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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2014年9月18日	20.31	基金赎回,被动超比例	2天,2014 年 9 月 22 日恢复
2	2014年9月19日	21.53	基金赎回,被动超比例	1天,2014 年 9 月 22 日恢复

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

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。

8.3.2 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	59.38	18.10
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60 天	4.33	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90 天	14.09	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180 天	19.52	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397 天(含)	19.40	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		116.72	18.10

8.4 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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	154,855,214.44	16.77
	其中:政策性金融债	154,855,214.44	16.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	444,669,310.12	48.16
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	599,524,524.56	64.93
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	占基金资产净值比例(%)
1	110402	11农发 02	500,000	49,968,734.75	5.41
2	041464059	14汇机床 CP001	400,000	40,050,788.15	4.34
3	041452034	14渝南 CP001	300,000	30,075,738.48	3.26
4	041458049	14中铝业 CP003	300,000	30,055,556.92	3.25
5	140317	14进出 17	300,000	29,994,860.89	3.25
6	041459052	14中冶 CP002	300,000	29,896,366.65	3.24
7	100236	10国开 36	300,000	29,888,858.45	3.24
8	041459010	14云南物流 CP001	200,000	20,106,191.80	2.18
9	041451043	14大族 CP001	200,000	20,056,507.16	2.17
10	041456007	14奇瑞 CP001	200,000	20,045,346.30	2.17

8.6 “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	66
报告期内偏离度的最高值	0.4747%
报告期内偏离度的最低值	-0.2385%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2140%

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

根据本基金基金合同规定,本基金不投资资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1

本基金采用摊余成本法计价。

8.8.2

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。

8.8.3

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。

8.8.4 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	16,410,593.61
4	应收申购款	8,200.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	16,418,793.61

§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

份额级别	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
东方金账簿货币 A	33,907	14,365.98	11,851,906.42	2.43%	475,255,349.00	97.57%
东方金账簿货币 B	16	27,267,587.62	384,608,349.22	88.16%	51,673,052.77	11.84%
合计	33,923	27,220.14	396,460,255.64	42.94%	526,928,401.77	57.06%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	东方金账簿货币 A	2,818,285.66	0.58%
	东方金账簿货币 B	0.00	0.00%
	合计	2,818,285.66	0.31%

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	份额级别	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	东方金账簿货币 A	>100