

东方金账簿货币市场证券投资基金 2015 年 半年度报告

2015 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年八月二十七日

§ 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 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 2015 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
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 债券回购融资情况.....	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.5 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.....	38
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
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.....	39
7.8 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40

8.3 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	41
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	43
10.9 其他重大事件.....	43
§11 备查文件目录.....	47
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方金账簿货币市场证券投资基金	
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	1,804,769,380.75 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	470,454,001.53 份	1,334,315,379.22 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
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100033	100031

法定代表人	崔伟	洪崎
-------	----	----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《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

基金级别	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,534,578.72	31,207,627.74
本期利润	10,534,578.72	31,207,627.74
本期净值收益率	2.2289%	2.3502%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	470,454,001.53	1,334,315,379.22
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	34.4532%	3.3288%

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
过去一个月	0.3836%	0.0143%	0.0288%	0.0000%	0.3548%	0.0143%
过去三个月	1.0331%	0.0090%	0.0873%	0.0000%	0.9458%	0.0090%
过去六个月	2.2289%	0.0075%	0.1736%	0.0000%	2.0553%	0.0075%
过去一年	4.5844%	0.0071%	0.3500%	0.0000%	4.2344%	0.0071%
过去三年	13.6181%	0.0057%	1.0502%	0.0000%	12.5679%	0.0057%
自基金合同 生效起至今	34.4532%	0.0070%	8.2324%	0.0028%	26.2208%	0.0042%

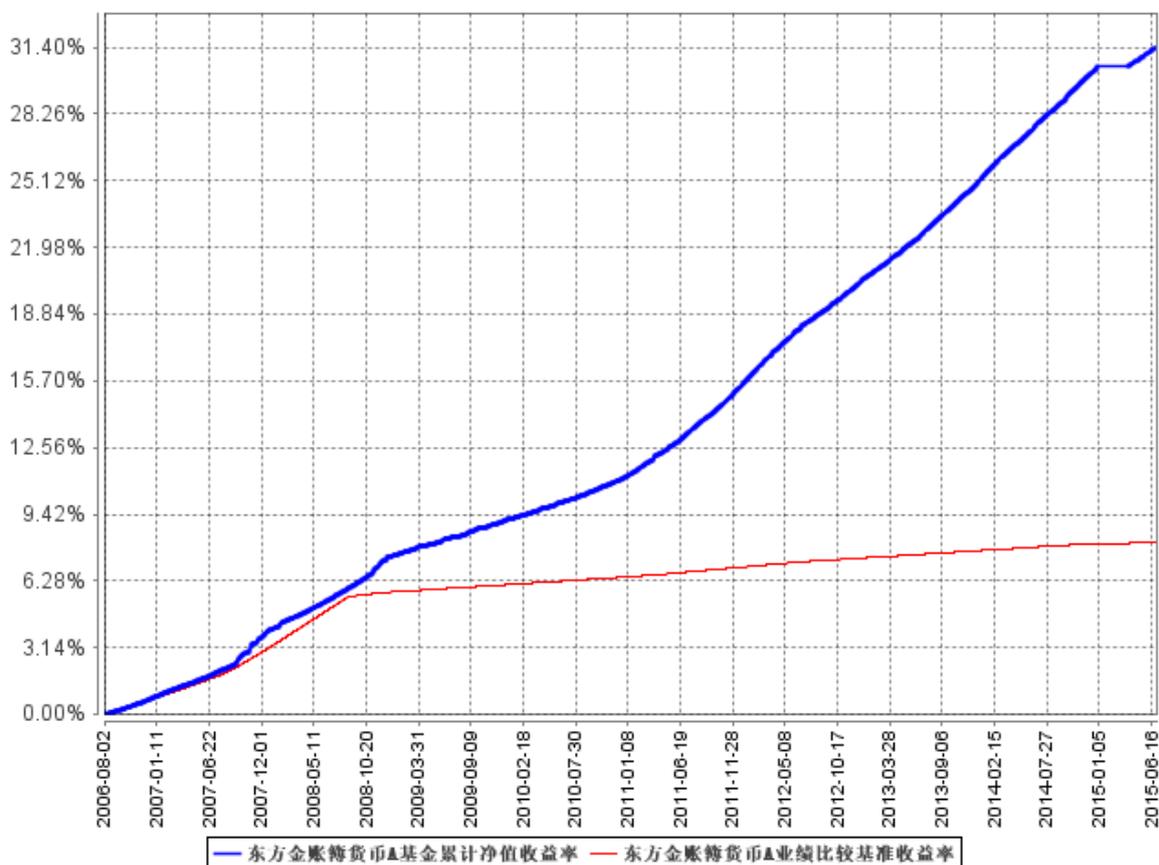
东方金账簿货币 B

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
过去一个月	0.4032%	0.0143%	0.0288%	0.0000%	0.3744%	0.0143%
过去三个月	1.0935%	0.0090%	0.0873%	0.0000%	1.0062%	0.0090%
过去六个月	2.3502%	0.0075%	0.1736%	0.0000%	2.1766%	0.0075%
过去一年	3.3288%	0.0070%	0.2416%	0.0000%	3.0872%	0.0070%
过去三年	3.3288%	0.0070%	0.2416%	0.0000%	3.0872%	0.0070%
自基金合同 生效起至今	3.3288%	0.0070%	0.2416%	0.0000%	3.0872%	0.0070%

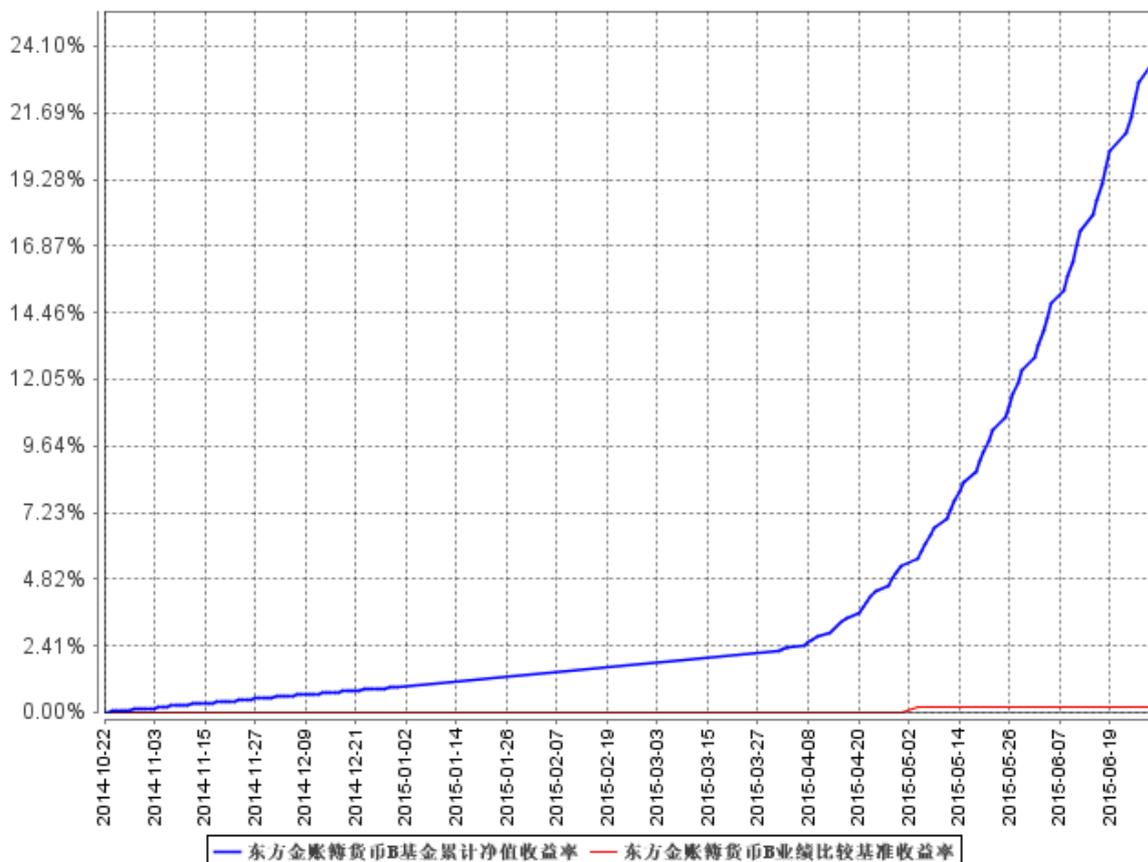
注：本基金每日分配收益，按月结转份额。

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

东方金账簿货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方金账簿货币B基金累计净值收益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%；渤海国际信托有限公司，持有股份9%。截至2015年6月30日，本公司管理24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

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。

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）	本基金基金经理	2013 年 9 月 25 日	-	11 年	中国人民大学工商管理硕士，11 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、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方赢家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	2014 年 8 月 28 日	-	6 年	北京大学金融学硕士，6 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公司，曾任固定收益部债

					券 研 究 员、投 资 经 理、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 鼎 新 灵 活 配 置 混 合 型 证 券 投 资 基 金 基 金 经 理、东 方 惠 新 灵 活 配 置 混 合 型 证 券 投 资 基 金 基 金 经 理、东 方 永 润 18 个 月 定 期 开 放 债 券 型 证 券 投 资 基 金。
--	--	--	--	--	---

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。

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

2015 年上半年，宏观经济维持低位，增长乏力，各项实体经济数据均走低。具体而言，一、二季度 GDP 增速为 7%，工业生产增速季度环比下降，工业企业利润累计同比不断下滑，国内外需求依然疲弱；通胀水平维持低位，工业通缩压力较大；PMI 制造业指数不断下行，已逼近荣枯线，指向制造业景气度偏弱。

在经济低迷的压力下，上半年我国财政政策和货币政策不断加码。财政政策方面，赤字不断

加大，正式出炉地方置换债券，大规模批复新投资项目；货币政策方面，先后三次降准、三次降息，降低公开市场回购利率，并通过 MLF、SLF 续作等宽松操作释放流动性，提振经济。

在央行大幅释放流动性后，上半年资金面总体较为宽松，回购利率推动货币利率的下行。具体而言，1-2 月债市整体延续慢牛行情，中长端利率债收益率创三年来的新低，信用利差降至较低位置；3 月，受地方债务置换政策出台的影响，利率债收益率上行，期限利差有所扩大；4 月，受央行宽松货币政策的影响，收益率有所下行；5 月，受中核 IPO、地方债挤压等因素，收益率再度反弹，期限利差不断变陡；6 月，债券收益率在降息降准的影响下重新回落至低位，中长端利率下行幅度较小，二季度末期限利差有所扩大。

报告期内，本基金规模变动较大，春节前有较大赎回，三四月份以来伴随资金面的宽松申购较多，对收益有所摊薄，但半年末资金季节性紧张叠加新股申购冻结较多资金影响，赎回量较大。整体组合保持较好流动性，均衡配置了回购、存款及债券，并逐步增加了对新发短融的配置力度，伴随债市短端收益率的下行组合一直保持较高偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 2.2175%，业绩比较基准收益率为 0.1597%，高于业绩比较基准 2.0600%；2015 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金 B 类净值增长率为 2.3382%，业绩比较基准收益率为 0.1725%，高于业绩比较基准 2.1700%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济下行压力较大，仍需政策托底。具体而言，制造业产能过剩、出口增长有限等因素制约经济上行；股票交易萎缩、IPO 暂停等因素制约金融业对 GDP 的拉动；7 月中采 PMI 跌至临界点，新订单指数持续回落至 2012 年 9 月以来的最低值，工业经济仍未企稳。对于经济面临的困难，7 月 30 日的中央政治局会议表示将会保持宏观政策的连续性和稳定性，加大定向调控力度。2015 年下半年宏观政策仍将维持较为宽松的基调，坚持积极的财政政策和稳健的货币政策，不断推动地方政府债务的置换，并有望于下半年通过降准及定向操作工具释放流动性。

对于下半年债券市场而言，从需求角度来看，受海外机构进入银行间市场、新股 IPO 暂停、两融配资受限的影响，高收益优先级产品规模缩小，打新基金重新配置，债券需求回归，具备投资优势；从供给角度来看，截至 7 月 30 日各地已发行一般及专项地方债券 1.41 万亿元，中标利率均落在招标利率下限，其对下半年债券市场的挤出扰动效应有望缩小；从宏观角度来看，货币政策有望保持定向宽松的基调，从而进一步推动中长端利率水平的下行，经济走低将催生信用债分化，仍需警惕违约事件的发生。因此本基金将在保证流动性的前提下适度拉长久期，择机配置

短融、浮息债，力求获得阶段性资本利得收益，同时通过配置短久期存款及逆回购，提高组合静态收益。

“诚信是基，回报为金”，我们珍惜持有人的每一份利益，用我们的专业知识、勤恳态度，谋求长期、稳定的回报。

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）。

注：截至 2015 年 6 月 30 日，交易部与登记清算部合并为运营部。

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 41,742,206.46 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 人或基金资产净值低于 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”）。

本半年度，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

本半年度，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关损害基金份额持有人利益的行为。本半年度，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。

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

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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	400,438,889.28	268,442,795.22
结算备付金		535,000.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,145,446,175.87	599,524,524.56
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,145,446,175.87	599,524,524.56
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	497,001,505.50	209,801,034.70
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	13,189,833.13	16,410,593.61
应收股利		-	-
应收申购款		20,802,103.43	8,200.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,077,413,507.21	1,094,187,148.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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		264,829,547.58	167,160,729.25
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		537,048.59	53,897.51
应付管理人报酬		677,203.23	317,116.43
应付托管费		205,213.10	96,095.89
应付销售服务费		118,393.25	119,429.03
应付交易费用	6.4.7.7	49,285.44	28,188.97
应交税费		-	-
应付利息		10,247.51	21,956.91

应付利润		6,061,617.90	2,911,629.14
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	155,569.86	89,447.55
负债合计		272,644,126.46	170,798,490.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,804,769,380.75	923,388,657.41
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,804,769,380.75	923,388,657.41
负债和所有者权益总计		2,077,413,507.21	1,094,187,148.09

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 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 1,804,769,380.75 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 470,454,001.53 份，B 类基金份额总额 1,334,315,379.22 份。

6.2 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		47,769,713.62	50,388,441.08
1.利息收入		43,997,490.26	44,598,904.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,274,031.43	15,204,736.42
债券利息收入		19,098,524.79	17,011,662.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,624,934.04	12,382,505.75
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,772,223.36	5,789,536.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13.1	3,772,223.36	5,789,536.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		6,027,507.16	7,614,156.93

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,186,049.42	3,022,130.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	965,469.49	915,797.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	672,153.54	2,289,492.82
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		1,008,498.86	1,191,205.59
其中：卖出回购金融资产支出		1,008,498.86	1,191,205.59
6. 其他费用	6.4.7.20	195,335.85	195,530.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		41,742,206.46	42,774,284.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41,742,206.46	42,774,284.15

6.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	923,388,657.41	-	923,388,657.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,742,206.46	41,742,206.46
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）	881,380,723.34	-	881,380,723.34
其中：1. 基金申购款	10,683,211,043.78	-	10,683,211,043.78
2. 基金赎回款	-9,801,830,320.44	-	-9,801,830,320.44
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）	-	-41,742,206.46	-41,742,206.46
五、期末所有者权益（基金净值）	1,804,769,380.75	-	1,804,769,380.75
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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(本期利润)	-	42,774,284.15	42,774,284.15
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)	-219,933,447.41	-	-219,933,447.41
其中：1. 基金申购款	3,880,178,437.45	-	3,880,178,437.45
2. 基金赎回款	-4,100,111,884.86	-	-4,100,111,884.86
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)	-	-42,774,284.15	-42,774,284.15
五、期末所有者权益(基金净值)	1,310,683,845.69	-	1,310,683,845.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

孙晔伟
基金管理人负责人

秦熠群
主管会计工作负责人

张蓉梅
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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 6 日中国证监会《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，由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》自 2006 年 7 月 3 日至 2006 年 7 月 28 日公开募集设立。本基金为货币市场基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 489,924,256.22 元人民币，业经天华会计师事务所“天华验字（2006）第 58-06 号”及“天华验字（2006）第 58-07 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》于 2006 年 8 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 489,989,508.84 份基金单位，其中认购资金利息折

合 65,252.62 份基金单位。本基金的基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于：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。

本基金于 2014 年 10 月 22 日实施分级，新增 B 类基金份额类别，基金份额分类后，在基金存续期内的任何一个开放日，若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额，并于升级次一工作日适用 B 类基金份额的相关费率，若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额，并于降级次一工作日适用 A 类基金份额的相关费率。两级基金份额分设不同的基金代码，分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

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”）及应用指南、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 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、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

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【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》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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- (3) 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，暂不缴纳营业税和企业所得税。

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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	438,889.28
定期存款	400,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	150,000,000.00
存款期限 1 个月内	250,000,000.00
其他存款	-

合计:	400,438,889.28
-----	----------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2015年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,145,446,175.87	1,149,179,620.00	3,733,444.13	0.2069%
	合计	1,145,446,175.87	1,149,179,620.00	3,733,444.13	0.2069%

注: ①偏离金额=影子定价-摊余成本

②偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金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

单位: 人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	497,001,505.50	-
合计	497,001,505.50	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金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 2015年6月30日
应收活期存款利息	194.02

应收定期存款利息	507,222.26
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	216.72
应收债券利息	12,054,890.93
应收买入返售证券利息	609,687.88
应收申购款利息	17,621.32
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	13,189,833.13

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	49,285.44
合计	49,285.44

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,721.14
预提费用	147,848.72
合计	155,569.86

注：预提费用包括按日计提的审计费、信息披露费和债券账户维护费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东方金账簿货币 A		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	487,107,255.42	487,107,255.42
本期申购	1,412,331,810.66	1,412,331,810.66
本期赎回(以“-”号填列)	-1,428,985,064.55	-1,428,985,064.55

本期末	470,454,001.53	470,454,001.53
-----	----------------	----------------

金额单位：人民币元

东方金账簿货币 B		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	436,281,401.99	436,281,401.99
本期申购	9,270,879,233.12	9,270,879,233.12
本期赎回(以“-”号填列)	-8,372,845,255.89	-8,372,845,255.89
本期末	1,334,315,379.22	1,334,315,379.22

注：本期申购包含红利再投资、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

东方金账簿货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	10,534,578.72	-	10,534,578.72
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-10,534,578.72	-	-10,534,578.72
本期末	-	-	-

单位：人民币元

东方金账簿货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	31,207,627.74	-	31,207,627.74
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-31,207,627.74	-	-31,207,627.74
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	11,707.22
定期存款利息收入	15,940,851.70
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	94,900.97
其他	226,571.54
合计	16,274,031.43

注：其他为基金申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

根据本基金基金合同规定，本基金不投资股票。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,654,185,892.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,615,610,384.27
减：应收利息总额	34,803,285.06
买卖债券差价收入	3,772,223.36

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

根据本基金基金合同规定，本基金不投资资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

根据本基金基金合同规定，本基金不投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

根据本基金基金合同规定，本基金不投资权证。

6.4.7.16 股利收益

根据本基金基金合同规定，本基金不投资股票。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本报告期本基金无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本报告期本基金无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本报告期本基金无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	99,177.14
债券账户维护费	18,000.00
其他	200.00
银行汇划费用	38,287.13
合计	195,335.85

注：其他为上清所 CFCA 证书使用费。

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

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要披露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、代销机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、基金直销机构
中国民生银行股份有限公司	本基金托管人、代销机构

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东北证券股份有限公司	107,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

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 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,186,049.42	3,022,130.58
其中：支付销售机构的客户维护费	418,975.96	296,444.62

注：①计提标准：基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：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上月基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次日起 2 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、休息日等，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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	965,469.49	915,797.10

注：①计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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计提方式与支付方式：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上月基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B	合计
东方基金管理有限责任公司	17,141.26	62,004.86	79,146.12
中国民生银行股份有限公司	3,578.41	1,294.55	4,872.96
东北证券股份有限公司	537.60	-	537.60
合计	21,257.27	63,299.41	84,556.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B	合计
东方基金管理有限责任公	1,562,143.77	-	1,562,143.77

司			
中国民生银行股份有限公司	72,470.45	-	72,470.45
东北证券股份有限公司	530.16	-	530.16
合计	1,635,144.38	-	1,635,144.38

注：①计提标准：A 类基金份额和 B 类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，A 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.25%年费率计提，B 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.01%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为各级基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费率

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计算，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上月基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次日起 2 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、休息日，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

③本基金于 2014 年 10 月 22 日起新增 B 类基金份额类别，所以东方金账簿货币 B 上年度可比期间无销售服务费。

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

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	-	81,274,174.27	-	-	-	-

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

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人均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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	100,438,889.28	3,674,808.29	651,811.60	2,216,292.29

注：本期期末余额中包含 100,000,000.00 元定期存款。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内，本基金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

金额单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
7,655,299.36	3,038,390.75	1,655,808.91	12,349,499.02	-

东方金账簿货币B

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	本期利润分配合计	备注
20,917,654.63	3,668,331.68	4,806,721.13	29,392,707.44	-

注：①本基金每日分配收益，按月结转份额。即本基金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。

②本表列示的本期利润分配金额与前述数据的差异是由于基金份额升降级造成。

6.4.12 期末（2015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

根据本基金基金合同规定，本基金不投资股票。

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 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 264,829,547.58 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011524003	15 中冶 SCP003	2015 年 7 月 1 日	100.16	500,000	50,080,000.00
041459052	14 中冶 CP002	2015 年 7 月 1 日	101.04	170,000	17,176,800.00
011599365	15 建发集 SCP001	2015 年 7 月 1 日	99.96	1,000,000	99,960,000.00
011599187	15 徐工 SCP001	2015 年 7 月 1 日	100.41	1,000,000	100,410,000.00
合计				2,670,000	267,626,800.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	903,274,120.00	434,681,672.34
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	903,274,120.00	434,681,672.34

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

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券。

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（2015 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。

6.4.13.4 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

利率风险是债券投资的首要风险，更多的指市场利率上升致使债券价格下跌，持债市值缩水的风险。计量利率风险的工具为组合久期，对货币基金来说，即组合的剩余期限不得超过 180 天，这有效地防范了利率风险。基金管理人根据对市场利率走势的判断，决定拉长或缩短组合的剩余期限。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	400,438,889.28	-	-	-	-	400,438,889.28
结算备付金	535,000.00	-	-	-	-	535,000.00
存出保证金	0.00	-	-	-	-	0.00
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融资产-债券投资	752,967,690.00	396,211,930.00	-	0.00	-	1,149,179,620.00
买入返售金融资产	497,001,505.50	-	-	-	-	497,001,505.50
应收证券清算款	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	13,189,833.13	13,189,833.13
应收股利	-	-	-	-	-	0.00
应收申购款	20,802,103.43	-	-	-	-	20,802,103.43
资产总计	1,671,745,188.21	396,211,930.00	-	0.00	13,189,833.13	2,081,146,951.34
负债						
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	264,829,547.58	264,829,547.58
应付赎回款	-	-	-	-	537,048.59	537,048.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	677,203.23	677,203.23
应付托管费	-	-	-	-	205,213.10	205,213.10
应付交易费用	-	-	-	-	49,285.44	49,285.44
应付销售服务费	-	-	-	-	118,393.25	118,393.25
应付利息	-	-	-	-	10,247.51	10,247.51
应付利润	-	-	-	-	6,061,617.90	6,061,617.90
其他负债	-	-	-	-	155,569.86	155,569.86
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00	0.00

负债总计	-	-	-	-	-	272,644,126.46	272,644,126.46
利率敏感度缺口	1,671,745,188.21	396,211,930.00	-	-	-	-259,454,293.33	1,808,502,824.88
上年度末 2014 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息		合计
资产							
银行存款	268,442,795.22	-	-	-	-	-	268,442,795.22
交易性金融资产-债券 投资	420,376,372.68	179,148,151.88	-	-	-	-	599,524,524.56
买入返售金融资产	209,801,034.70	-	-	-	-	-	209,801,034.70
应收利息	-	-	-	-	-	16,410,593.61	16,410,593.61
应收申购款	8,200.00	-	-	-	-	-	8,200.00
资产总计	898,628,402.60	179,148,151.88	-	-	-	16,410,593.61	1,094,187,148.09
负债							
卖出回购金融资产款	167,160,729.25	-	-	-	-	-	167,160,729.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	53,897.51	53,897.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	317,116.43	317,116.43
应付托管费	-	-	-	-	-	96,095.89	96,095.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	119,429.03	119,429.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	28,188.97	28,188.97
应付利息	-	-	-	-	-	21,956.91	21,956.91
应付利润	-	-	-	-	-	2,911,629.14	2,911,629.14
其他负债	-	-	-	-	-	89,447.55	89,447.55
负债总计	167,160,729.25	-	-	-	-	3,637,761.43	170,798,490.68
利率敏感度缺口	731,467,673.35	179,148,151.88	-	-	-	12,772,832.18	923,388,657.41

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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	市场利率下调 0.25%	1,494,694.20	754,523.12
	市场利率上调 0.25%	-1,492,282.00	-753,293.48

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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,149,179,620.00	63.67	-	-
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	1,149,179,620.00	63.67	-	-

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。本期末本基金风险价值为 4,795,339.00 元，占基金资产净值比例为 0.27%。

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	固定收益投资	1,145,446,175.87	55.14
	其中：债券	1,145,446,175.87	55.14
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	497,001,505.50	23.92
	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	400,973,889.28	19.30
4	其他各项资产	33,991,936.56	1.64
5	合计	2,077,413,507.21	100.00

7.2 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	5.32	
	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	264,829,547.58	14.67
	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

在本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过资产净值的 20% 的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

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。

7.3.2 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	46.99	14.67
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	3.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	22.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	16.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	23.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	113.22	14.67

7.4 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	245,640,764.91	13.61
	其中：政策性金融债	245,640,764.91	13.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	899,805,410.96	49.86
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,145,446,175.87	63.47
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 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	100236	10 国开 36	1,400,000	140,309,715.88	7.77

2	011599187	15 徐工 SCP001	1,000,000	100,430,481.90	5.56
3	011599365	15 建发集 SCP001	1,000,000	99,979,326.05	5.54
4	090205	09 国开 05	500,000	50,356,464.33	2.79
5	011599225	15 阳泉 SCP001	500,000	50,073,694.35	2.77
6	011524003	15 中冶 SCP003	500,000	49,985,731.70	2.77
7	041569021	15 顺国资 CP001	500,000	49,977,299.21	2.77
8	110402	11 农发 02	500,000	49,974,166.17	2.77
9	041464059	14 沈机床 CP001	400,000	40,123,544.21	2.22
10	041569007	15 东方园 林 CP001	400,000	39,984,788.20	2.22

7.6 “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	43
报告期内偏离度的最高值	0.3765%
报告期内偏离度的最低值	0.1300%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2263%

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

根据本基金基金合同规定，本基金不投资资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

7.8.2 本报告期内本基金未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券

7.8.3

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。

7.8.4 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	13,189,833.13
4	应收申购款	20,802,103.43
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	33,991,936.56

§ 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

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	32,010	14,697.09	9,965,478.18	2.12%	460,488,523.35	97.88%
东方金账簿货币 B	27	49,419,088.12	1,295,337,145.95	97.08%	38,978,233.27	2.92%
合计	32,037	56,333.91	1,305,302,624.13	72.33%	499,466,756.62	27.67%

8.2 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	1,729,764.92	0.37%
	东方金账簿货币 B	0.00	0.00%
	合计	1,729,764.92	0.10%

8.3 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	0
	东方金账簿货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方金账簿货币 A	0
	东方金账簿货币 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B
基金合同生效日（2006 年 8 月 2 日）基金份额总额	489,989,508.84	-
本报告期期初基金份额总额	487,107,255.42	436,281,401.99
本报告期基金总申购份额	1,412,331,810.66	9,270,879,233.12
减：本报告期基金总赎回份额	1,428,985,064.55	8,372,845,255.89
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	470,454,001.53	1,334,315,379.22

注：本期申购包含红利再投资、基金转换入份额，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

本报告期内，基金管理人及基金托管人的专门基金托管部门不存在重大人事变动。

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，公司存在一起未决诉讼案件，系原公司员工与公司之间的民事诉讼案件，公司为被告。截至报告日，上述诉讼仍在审理中。

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	-	-	-	-	-

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：

本基金管理人选择代理所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下 7 个方面：① 资历雄厚，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) 本报告期内本基金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	-	-	107,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 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	东方金账簿货币市场证券投资基金年度最后一日收益公告	指定报刊、网站	2015年1月1日
2	东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告	指定报刊、网站	2015年1月5日
3	关于增加增财基金为旗下基金销售渠道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	2015年1月8日
4	关于在海通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	2015年1月20日
5	东方金账簿货币市场证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	指定报刊、网站	2015年1月21日
6	关于在华安证券开通东方基金	指定报刊、网站	2015年1月30日

	旗下基金转换业务的公告		日
7	东方金账簿货币市场证券投资 基金收益支付公告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 2 日
8	东方基金管理有限公司关于基 金经理恢复履行职务的公告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 4 日
9	东方金账簿货币市场证券投资 基金春节前暂停申购及转换转 入业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 12 日
10	东方金账簿货币市场证券投资 基金春节后恢复申购及转换转 入业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 12 日
11	东方基金管理有限责任公司关 于参加数米基金网费率优惠活 动的公告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 27 日
12	关于在中信证券、中信证券（山 东）及中信证券（浙江）开通东 方基金旗下基金转换业务的公 告	指定报刊、网站	2015 年 2 月 27 日
13	东方金账簿货币市场证券投资 基金收益支付公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 2 日
14	关于在东莞证券开通东方基金 旗下基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 4 日
15	关于在华福证券和江海证券开 通东方基金旗下基金转换业务 的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 12 日
16	东方金账簿货币市场证券投资 基金招募说明书（更新）（2014 年第 2 号）	网站	2015 年 3 月 18 日
17	东方金账簿货币市场证券投资	指定报刊、网站	2015 年 3 月 18

	基金招募说明书（更新）摘要 （2014 年第 2 号）		日
18	东方金账簿货币市场证券投资 基金 2014 年年度报告	网站	2015 年 3 月 28 日
19	东方金账簿货币市场证券投资 基金 2014 年年度报告摘要	指定报刊、网站	2015 年 3 月 28 日
20	东方金账簿货币市场证券投资 基金清明节后恢复申购及转换 转入业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 30 日
21	东方金账簿货币市场证券投资 基金清明节前暂停申购及转换 转入业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 30 日
22	关于在京东电商平台开通东方 基金官方旗舰店基金网上直销 业务的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 30 日
23	关于增加上海证券为旗下基金 销售渠道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	2015 年 3 月 31 日
24	关于调整旗下基金交易所固定 收益品种估值方法的公告	指定报刊、网站	2015 年 3 月 31 日
25	东方金账簿货币市场证券投资 基金收益支付公告	指定报刊、网站	2015 年 4 月 1 日
26	东方基金管理有限责任公司关 于子公司增加注册资本的公告	指定报刊、网站	2015 年 4 月 3 日
27	东方金账簿货币市场证券投资 基金 2015 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2015 年 4 月 20 日
28	东方金账簿货币市场证券投资 基金劳动节前暂停申购及转换	指定报刊、网站	2015 年 4 月 27 日

	转入业务的公告		
29	东方金账簿货币市场证券投资基金劳动节后恢复申购及转换转入业务的公告	指定报刊、网站	2015年4月27日
30	关于增加上海利得为旗下基金销售渠道及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2015年4月28日
31	东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告	指定报刊、网站	2015年5月4日
32	关于在东海证券和广发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	2015年5月19日
33	东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告	指定报刊、网站	2015年6月1日
34	东方金账簿货币市场证券投资基金端午节后恢复申购及转换转入业务的公告	指定报刊、网站	2015年6月16日
35	东方金账簿货币市场证券投资基金端午节前暂停申购及转换转入业务的公告	指定报刊、网站	2015年6月16日
36	关于在东海证券开通东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金转换业务的公告	指定报刊、网站	2015年6月19日
37	东方基金管理有限责任公司关于子公司增加注册资本的公告	指定报刊、网站	2015年6月23日
38	关于增加恒天明泽为旗下基金销售渠道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	2015年6月29日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 一、《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》
- 二、《东方金账簿货币市场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、基金份额净值及其他临时公告

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
2015年8月27日