

东方金元宝货币市场基金 2017年第2季度报告

2017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

报告送出日期：二〇一七年七月十九日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方金元宝货币
基金主代码	001987
交易代码	001987
前端交易代码	001987
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 23 日
报告期末基金份额总额	535,890,574.64 份
投资目标	在确保本金安全的前提下，力争获得超越业绩比较
投资策略	本基金结合自上而下和自下而上的分析，在保证资 基金的长期、稳定增值。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，基金的预期风险和预期收
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 4 月 1 日 — 2017 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	6,323,448.28

2. 本期利润	6,323,448.28
3. 期末基金资产净值	535,890,574.64

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。

3.2 基金净值表现

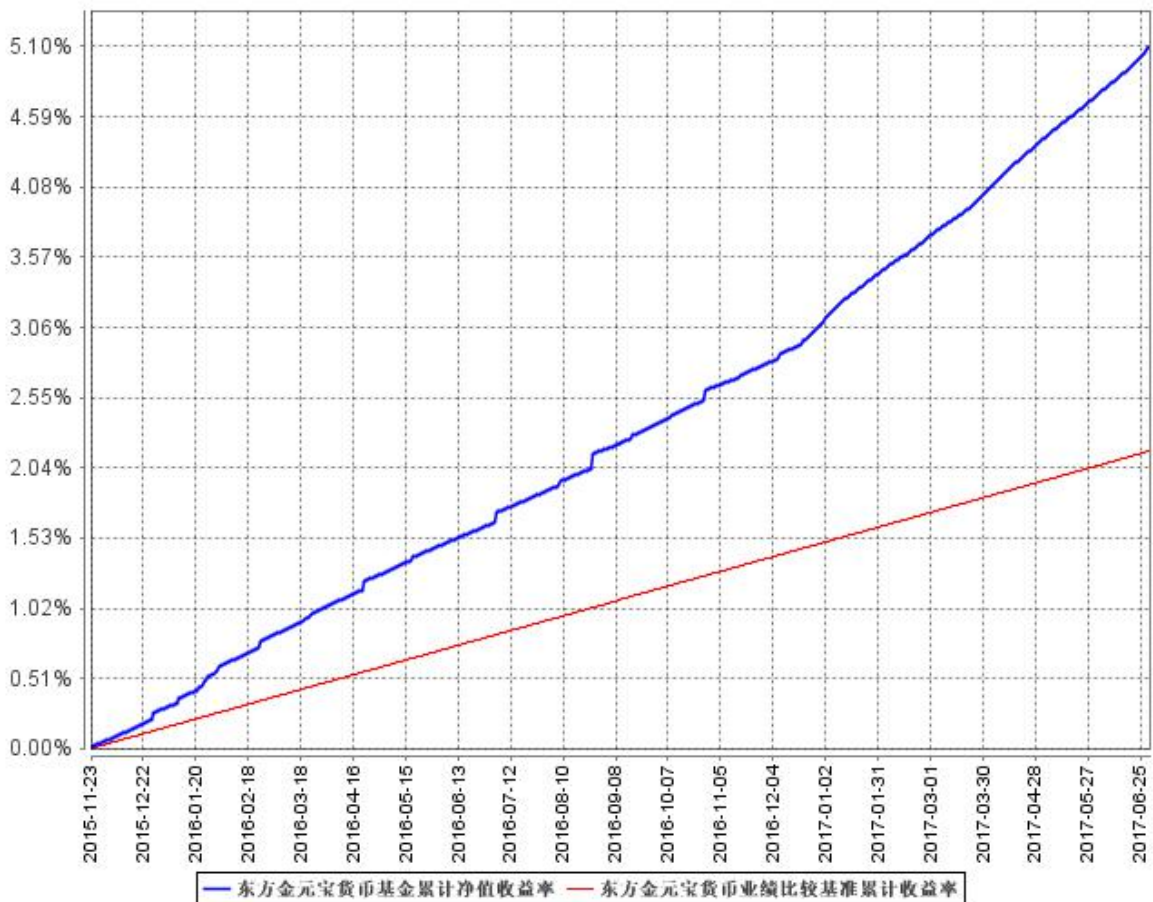
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	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	1.0190%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	0.6824%	0.0014%

注：本基金每日分配收益，按日结转份额。

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

东方金元宝货币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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2015 年 11 月 23 日	-	12 年	中国人民大学工商管理硕士，12 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、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，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、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理。

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、《东方金元宝货币市场基金合同》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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

从基本面来看，2017 年二季度经济表现平稳、韧性较强，需求好于预期，工业企业利润增长强劲，主要港口吞吐量也显示贸易或仍处于较高景气区间。从政策来看，2017 年二季度金融监管机构密集发布文件，去杠杆思路明确，银监会的“三套利、三违反、四不当”引发市场担忧，6 月以来严监管略有缓和，银行业务自查报告可延期 3 个月提交，或体现监管层加强协同，以避免极端冲击，从而实现温和去杠杆的目标。

从资金面来看，4 月在委外赎回传闻、缴税、月末等因素的扰动下，货币市场利率有所上行；4 月过后非跨季资金较为充裕，跨季资金相对供应不足，同业存单一级发行利率随之攀升，好在

央行释放维稳预期，在 6 月上旬加大 MLF 及跨月 OMO 投放，并未跟随美联储加息而上调公开市场操作利率，资金利率中枢略有下行。

报告期内，本基金规模相对稳定，在做好流动性管理的同时抓住了半年末资金紧张的时点，重点配置了三个月、六个月的存款及 cd，取得较好收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017 年 4 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日，本基金净值增长率为 1.0190%，业绩比较基准收益率为 0.3366%，高于业绩比较基准 0.6824%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	197,090,535.85	31.75
	其中：债券	197,090,535.85	31.75
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	199,600,619.40	32.16
	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	220,367,424.83	35.50
4	其他资产	3,611,585.40	0.58
5	合计	620,670,165.48	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	3.00	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	84,201,237.90	15.71
	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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	95
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	97
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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 120 天的情况。

5.3.2 报告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	51.31	15.71
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	36.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	1.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	25.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	115.15	15.71

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	39,932,516.24	7.45
	其中：政策性金融债	39,932,516.24	7.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	157,158,019.61	29.33
8	其他	-	-
9	合计	197,090,535.85	36.78
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

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	111710277	17 兴业银行 CD277	300,000	29,709,606.54	5.54
2	111707141	17 招商银行 CD141	300,000	29,694,275.07	5.54
3	111719185	17 恒丰银行 CD185	300,000	29,685,628.34	5.54
4	111780303	17 中原银行 CD144	200,000	19,553,268.02	3.65
5	111780022	17 乐山商行 CD067	200,000	19,550,870.68	3.65
6	111780298	17 贵州银行 CD032	200,000	19,075,777.72	3.56
7	160419	16 农发 19	100,000	9,995,204.08	1.87
8	170203	17 国开 03	100,000	9,993,664.56	1.86
9	170408	17 农发 08	100,000	9,992,077.56	1.86
10	170204	17 国开 04	100,000	9,951,570.04	1.86

5.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0264%
报告期内偏离度的最低值	-0.0135%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0077%
------------------------	---------

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

**5.8 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

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	1,120,886.25
4	应收申购款	2,490,699.15
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,611,585.40

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	384,871,508.99
报告期期间基金总申购份额	1,202,069,740.69
报告期期间基金总赎回份额	1,051,050,675.04
报告期期末基金份额总额	535,890,574.64

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170517 至 20170630	0.00	300,000,000.00	0.00	301,578,054.25	56.28%
	2	20170401 至 20170524	302,820,035.08	0.00	304,622,802.08	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。

(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时,可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本,可能造成基金净值的波动。

(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时,基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理,可能会影响投资者赎回。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 一、《东方金元宝货币市场基金基金合同》
- 二、《东方金元宝货币市场基金托管协议》
- 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、基金份额净值及其临时公告

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

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。

东方基金管理有限责任公司

2017 年 7 月 19 日