

东方金账簿货币市场证券投资基金

2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 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：2012 年 3 月 28 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 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
§ 2 基金简介	3
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
3.2 基金净值表现	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	6
§ 4 管理人报告	6
§ 5 托管人报告	10
§ 6 审计报告	10
§ 7 年度财务报表	10
7.1 资产负债表	11
7.2 利润表	13
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
7.4 报表附注	15
§ 8 投资组合报告	33
8.1 期末基金资产组合情况	33
8.2 债券回购融资情况	33
8.3 基金投资组合平均剩余期限	34
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
8.5 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	35
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	35
8.7 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	35
8.8 投资组合报告附注	35
§ 9 基金份额持有人信息	36
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	36
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	37
§ 10 开放式基金份额变动	37
§ 11 重大事件揭示	37
§ 12 备查文件目录	42

§ 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
交易代码	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	400,098,253.50 份
基金合同存续期	不定期

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	吕日	辛洁
	联系电话	010-66295888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	xinjie@cmbc.com.cn
客户服务电话		010-66578578或400-628-5888	95568
传真		010-66578700	010-58560794
注册地址		北京市西城区锦什坊街28号1-	北京市西城区复兴门内大街

	4层	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	董文标

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京路 61 号新黄浦金融大厦 4 层
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、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	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
本期净值收益率	3.9558%	1.8175%	1.6419%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末基金资产净值	400,098,253.50	536,705,957.95	273,042,426.58
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
累计净值收益率	17.4650%	11.1697%	9.1853%

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

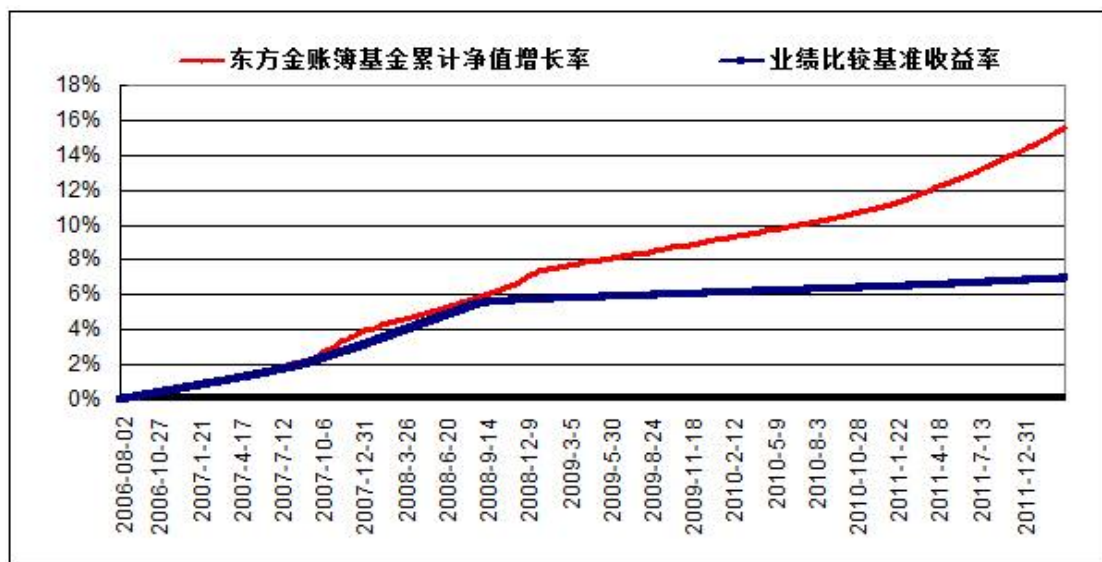
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.1853%	0.0030%	0.1260%	0.0000%	1.0593%	0.0030%
过去六个月	2.2154%	0.0027%	0.2521%	0.0000%	1.9633%	0.0027%
过去一年	3.9558%	0.0057%	0.4697%	0.0001%	3.4861%	0.0056%
过去三年	7.5832%	0.0069%	1.1897%	0.0002%	6.3935%	0.0067%
过去五年	16.5448%	0.0074%	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 自基金合同生效以来基金份额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

东方金账簿货币市场证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

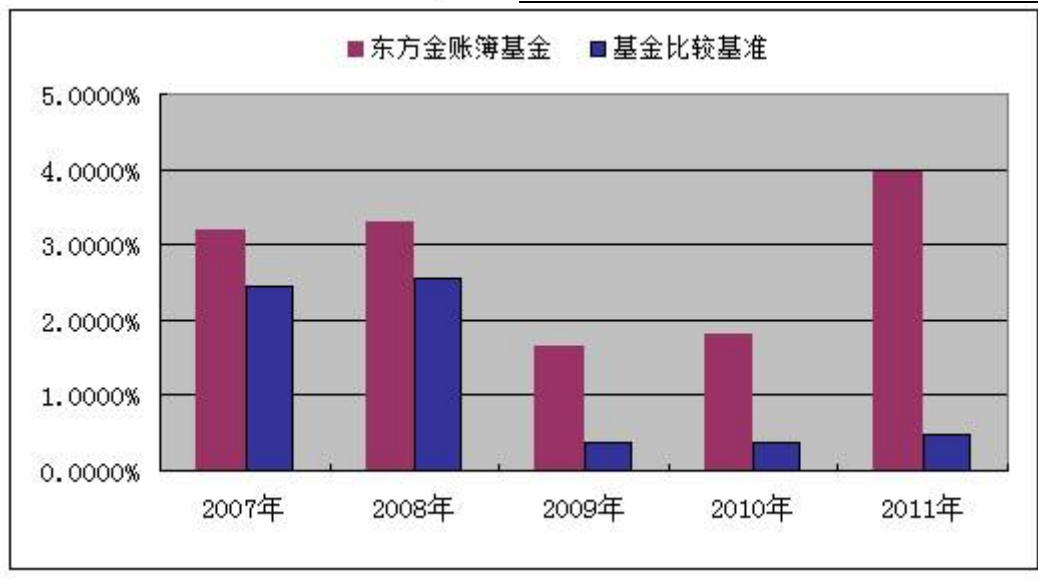
(2006 年 8 月 2 日至 2011 年 12 月 31 日)



3.2.3 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 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

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
2011	7,501,649.16	4,052,049.00	1,524,028.79	13,077,726.95	-
2010	2,463,308.94	1,282,279.51	450,174.67	4,195,763.12	-
2009	3,650,576.00	1,159,377.25	-379,569.00	4,430,384.25	-
合计	13,615,534.10	6,493,705.76	1,594,634.46	21,703,874.32	-

注：“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1亿元人民币。本公司股东为东北证券股份有限公司，持有股份46%；中辉国华实业（集团）有限公司，持有股份18%；渤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%。截止2011年12月31日，本公司管理八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。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王丹丹（女士）	本基金基金经理	2010-09-16	-	5 年	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。

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合规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

本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。

4.3.2 本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与本基金投资风格相类似的投资组合。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年，国内政策将抗通胀放在首位，央行在前三季度 6 次上调法定存款准备金率，

使之达到历史最高点，3 次加息，严厉的紧缩政策使得 GDP 增速在 4 季度降至 8.9%，CPI 也在 7 月份见顶后逐步回落。进入 4 季度，欧债危机重新升级，12 月初六大央行联手救市，国内的法定存款准备金率也下降 0.5 个百分点，货币政策明确放松。

2011 年银行间市场的资金面逐渐收紧，货币市场利率创下历史新高，资金面全年维持紧平衡。债券收益率先扬后抑，在 4 季度经济和通胀下行的驱动下，中长期利率产品和高等级信用产品的收益率明显下降。

报告期内，本基金维持逆回购和存款较高的投资比例，在利率产品收益率回落初期增持了含权浮息债，在短融收益率见顶后在一级市场积极增持新发短融，在保持基金较高流动性的同事，获取了稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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 0.4697%，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

2012 年，国内政策基调以稳增长为目标，这决定了货币政策向常态回归，但不会有大规模的放松刺激计划，同时国内房地产调控政策延续，海外经济复苏依然缓慢，国内经济的增速将继续在低位运行，但通胀的压力有所减轻，整体上有利于债券市场的表现。但不利的因素在于美国可能继续扩大量化宽松规模，以及房地产调控政策的逐步放松，预计这些可能在下半年有所体现。总体来讲，偏紧的资金面有利于提高货币市场基金的收益，我们将把流动性风险控制放在首位，为基金持有人创造稳健的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，定期和实时监察，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：（1）开展对公司各项业务的日常监管业务，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强了基金投资监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（3）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。（4）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。2012

年本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

4.7 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、基金经理和金融工程部、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有 5 年以上专业工作经验，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金融工程部；

金融工程部：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，依据金融工程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）。

4.8 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 13,077,726.95 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

§ 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，本基金应分配且已分配利润 13,077,726.95 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

信会师报字（2012）第 230005 号

东方金账簿货币市场证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的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”）财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表，2011 年度的利润表、2011 年度的所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是东方金账簿基金的基金管理人东方基金管理有限责任公司的管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，东方金账簿基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东方金账簿基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

立信会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 朱锦梅 魏星

上海市南京路 61 号新黄浦金融大厦 4 层

2012-03-23

§ 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：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	7.4.7.1	100,002,764.92	140,001,302.47
结算备付金		-	21,313,909.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	249,770,021.13	140,125,332.33
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		249,770,021.13	140,125,332.33
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	115,900,533.85	193,200,962.30
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	4,505,371.30	1,346,487.43
应收股利		-	-
应收申购款		7,700.00	41,428,150.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		470,186,391.20	537,416,143.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 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		68,309,697.53	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		8,012.27	4,940.72
应付管理人报酬		123,466.99	82,375.92
应付托管费		37,414.19	24,962.40
应付销售服务费		93,535.60	62,406.03
应付交易费用	7.4.7.7	16,685.59	9,342.80
应交税费		-	-
应付利息		21,081.86	-
应付利润		1,390,623.95	441,598.87
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	87,619.72	84,559.28
负债合计		70,088,137.70	710,186.02
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	400,098,253.50	536,705,957.95
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		400,098,253.50	536,705,957.95
负债和所有者权益总计		470,186,391.20	537,416,143.97

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 400,098,253.50 份。

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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		15,988,500.64	6,299,443.40
1. 利息收入		15,336,850.28	5,612,416.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,458,295.14	277,615.20
债券利息收入		6,926,314.22	4,529,658.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,952,240.92	805,142.75
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		651,650.36	687,026.80
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	651,650.36	687,026.80
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
减：二、费用		2,910,773.69	2,103,680.28
1. 管理人报酬		1,103,614.68	777,432.97

2. 托管费		334,428.65	235,585.81
3. 销售服务费		836,071.70	588,964.52
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
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	7.4.7.19	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

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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	536,705,957.95	-	536,705,957.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,077,726.95	13,077,726.95
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）	-136,607,704.45	-	-136,607,704.45
其中：1. 基金申购款	5,188,791,340.73	-	5,188,791,340.73
2. 基金赎回款	-5,325,399,045.18	-	-5,325,399,045.18
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）	-	-13,077,726.95	-13,077,726.95
五、期末所有者权益（基金净值）	400,098,253.50	-	400,098,253.50
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	273,042,426.58	-	273,042,426.58

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4, 195, 763. 12	4, 195, 763. 12
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）	263, 663, 531. 37	-	263, 663, 531. 37
其中：1. 基金申购款	4, 303, 694, 118. 07	-	4, 303, 694, 118. 07
2. 基金赎回款	-4, 040, 030, 586. 70	-	-4, 040, 030, 586. 70
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）	-	-4, 195, 763. 12	-4, 195, 763. 12
五、期末所有者权益（基金净值）	536, 705, 957. 95	-	536, 705, 957. 95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告序号从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：单宇，主管会计工作负责人：郝丽琨，会计机构负责人：朱荣杰

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照中国财政部 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》（以下简称“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 2 号—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。

7.4.3 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成本基金的金融资产，并形成其他单位的金融负债或权益工具的合同。

金融资产应当在初始确认时划分为以下四类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；（2）持有至到期投资；（3）贷款和应收款项；（4）可供出售金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金持有的金融资产分类包括以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（在资产负债表中以交易性金融资产列示）、贷款和应收款项。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

金融负债应当在初始确认时划分为以下两类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）其他金融负债。

本基金持有的金融负债包括其他金融负债，本基金暂无划分为以公允价值计量且其变动

计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。

本基金的金融负债在初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

1. 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于交易日确认为债券投资。

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含应收利息单独核算，对于付息债券，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本。

卖出银行间同业市场交易的债券，于交易日确认债券投资收益；出售债券的成本按移动加权平均法结转。

2. 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以实际成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金计价采用摊余成本法，估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其收益期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率及上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；本基金金融工具的估值方法具体如下：

（1）银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息。

（2）债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

（3）回购协议

①基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在回购期内逐日计提利息。

②基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在回购期内逐日计提。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产，若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值。

（4）资产支持证券

基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

（5）其他

①为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按估值技术计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生不利影响，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的计价对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与采用影子定价计算的净值产生重大偏离时，基金管理人与基金托管人商定后按影子定价确定的公允价对其账面价值进行调整，并按影子定价进行后续计量，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。如基金份额净值恢复至 1.0000 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。

②如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

③如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额对应的金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回、转换及红利再投资引起的实收基金变动分别于基金相关活动确认日认列。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入：按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2) 债券利息收入：在实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；企业债券利息收入应按扣除代扣代缴的个人所得税之后的差额计量；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益，于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其债券账面价值、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入：在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33%年费率逐日计提并确认。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率逐日计提并确认。

(3) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率逐日计提并确认。

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产款的账面价值及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

(5) 其他费用

其他费用包括基金运作过程中发生的除上述费用支出以外的其他各项费用，如注册登记费、上市年费、信息披露费用、账户服务费、持有人大会费用、审计费用、律师费用等。发生的其他费用，如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时可直接计入基金损益，如果影响基金份额净值小数点后第四位的，采用待摊或预提的方法计入基金损益。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) “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。基金份额持有人当日收益的精度为 0.01 元，小数点后第 3 位采用去尾的方式，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。

(2) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为基金份额持有人记正收益；若当日净收益小于零时，为基金份额持有人记负收益；若当日净收益等于零时，基金份额持有人不记收益。

(3) 本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计收益只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，基金份额持有人可通过赎回基金份额获得现金收益；若基金份额持有人在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则将缩减基金份额持有人基金份额。若基金份额持有人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清，若收益为负值，则从基金份额持有人赎回基金款中扣除。

(4) 本基金收益每月集中结转一次。基金管理人正式运作基金财产不满一个月的，不结转。每月结转日，若基金份额持有人账户的当前累计收益为正收益，则该基金份额持有人账户的本基金份额体现为增加；反之，则该基金份额持有人账户的本基金份额体现为减少。

除了每月的例行收益结转外，每天对涉及有赎回、转换等交易的账户进行提前收益支付，将赎回或转换的基金份额对应的待支付收益提前支付给基金份额持有人。

(5) 每份基金份额享有同等分配权。

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。

(7) 在不影响基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可酌情调整本基金收益分配方式，此项调整并不需要基金份额持有人大会决议通过。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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，暂不缴纳企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	2,764.92	1,302.47
定期存款	100,000,000.00	140,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	20,000,000.00	20,000,000.00
存款期限 1 个月以内	-	120,000,000.00
存款期限 3 个月至 1 年	80,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计	100,002,764.92	140,001,302.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 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	249,770,021.13	250,189,000.00	418,978.87	0.1047
	合计	249,770,021.13	250,189,000.00	418,978.87	0.1047

项目		上年度末 2010 年 12 月 31 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	140,125,332.33	139,980,000.00	-145,332.33	-0.0271
	合计	140,125,332.33	139,980,000.00	-145,332.33	-0.0271

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2011 年 12 月 31 日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场		-	-
银行间市场		115,900,533.85	-
合计		115,900,533.85	-
项目		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场		5,000,000.00	-
银行间市场		188,200,962.30	-
合计		193,200,962.30	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	27.86	13.40
应收定期存款利息	520,344.36	30,888.89
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	285.75	4,871.61
应收债券利息	3,730,738.30	973,235.32
应收买入返售证券利息	253,968.89	333,173.47
应收申购款利息	6.14	4,304.74

其他	-	-
合计	4,505,371.30	1,346,487.43

7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	16,685.59	9,342.80
合计	16,685.59	9,342.80

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	119.72	59.28
预提费用	87,500.00	84,500.00
合计	87,619.72	84,559.28

注：预提费用包括按日计提的审计费和银行间账户维护费。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	536,705,957.95	536,705,957.95
本期申购	5,188,791,340.73	5,188,791,340.73
本期赎回（以“-”号填列）	-5,325,399,045.18	-5,325,399,045.18
本期末	400,098,253.50	400,098,253.50

注：申购包含红利再投资、基金转换入份额；赎回包含基金转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	13,077,726.95	-	13,077,726.95

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	-13,077,726.95	-	-13,077,726.95
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,665.03	918.17
定期存款利息收入	2,393,717.97	90,055.56
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	58,510.67	178,016.16
其他	3,401.47	8,625.31
合计	2,458,295.14	277,615.20

注：“其他”为基金申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	961,948,712.61	809,136,130.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	953,161,195.44	800,999,709.74
减：应收利息总额	8,135,866.81	7,449,393.60
债券投资收益	651,650.36	687,026.80

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

7.4.7.18 交易费用

本报告期及上年度可比期间，本基金无交易费用。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
银行间账户维护费	21,000.00	18,000.00
银行汇划费用	31,214.89	31,662.04
合计	332,214.89	329,662.04

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中辉国华实业（集团）有限公司	本基金管理人股东
渤海国际信托有限公司	本基金管理人股东（2011 年 10 月 8 日起）
河北省国有资产控股运营有限公司	本基金管理人股东
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
上海城投控股股份有限公司	本基金管理人股东（截至 2011 年 10 月 7 日）

注：经本基金管理人 2011 年第二次临时股东大会审议通过，并经中国证监会证监许可

[2011]1621 号文审核批准，渤海国际信托有限公司受让上海城投控股股份有限公司所持股份成为本基金管理人股东。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例
东北证券股份有限公司	28,000,000.00	100.00%	1,315,300,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,103,614.68	777,432.97
其中：支付销售机构的客户维护费	363,074.82	240,966.65

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	334,428.65	235,585.81

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。

7.4.10.2.3 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
东方基金管理有限责任公司	46,450.04
中国民生银行股份有限公司	3,591.58
东北证券股份有限公司	2,040.82
合计	52,082.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
东方基金管理有限责任公司	39,666.94

中国民生银行股份有限公司	3,345.34
东北证券股份有限公司	882.03
合计	43,894.31

注：①计提标准：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。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	40,002,764.92	216,098.47	1,302.47	918.17

注：本期末余额中包含 40,000,000.00 元定期存款。

7.4.10.6 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，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

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
7,501,649.16	4,052,049.00	1,524,028.79	13,077,726.95	-

注：“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。

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 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 68,309,697.53 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
1181157	11 锦州港 CP01	2012-01-04	100.08	100,000	10,007,656.60
1181160	11 华晨 CP01	2012-01-04	100.22	100,000	10,022,469.67
1181301	11 昆自 CP01	2012-01-04	100.37	300,000	30,109,693.58
1181309	11 晋能源 CP01	2012-01-04	100.03	100,000	10,003,147.03
1181313	11 韶能 CP01	2012-01-04	99.82	90,000	8,983,778.50
合计	-	-	-	690,000	69,126,745.38

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、金融工程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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2011年12月31日	上年末 2010年12月31日
A-1	180,232,536.75	80,002,783.73
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	180,232,536.75	80,002,783.73

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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险即债券无法以合适的价格变现的风险，一方面是债券市场的深度和广度决定的，另一方面可以看作利率风险和信用风险的集中反映（无法有效规避利率风险和信用风险

的结果即是损伤了资产的流动性)。货币基金最重要的特性就是流动性，本基金管理人通过资产种类配置、利率预期策略、个券选择以及严格跟踪和监控投资集中度等方式，在遵守法规约束的情况下，提升组合的流动性，并定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 12 月 31 日	6 个月 以内	6 个月—1 年	1—5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	100,002,764.92	—	—	—	100,002,764.92
结算备付金	—	—	—	—	—
交易性金融资产— 债券投资	159,676,395.91	90,093,625.22	—	0.00	249,770,021.13
买入返售金融资产	115,900,533.85	—	—	0.00	115,900,533.85
应收利息	—	—	—	4,505,371.30	4,505,371.30
应收申购款	7,700.00	—	—	—	7,700.00
应收证券清算款	0.00	—	—	—	—
资产总计	375,587,394.68	90,093,625.22	—	4,505,371.30	470,186,391.20
负债					
卖出回购金融资产	68,309,697.53	—	—	—	68,309,697.53
应付证券清算款	—	—	—	—	0.00
应付赎回款	—	—	—	8,012.27	8,012.27
应付管理人报酬	—	—	—	123,466.99	123,466.99
应付托管费	—	—	—	37,414.19	37,414.19
应付交易费用	—	—	—	16,685.59	16,685.59
应付销售服务费	—	—	—	93,535.60	93,535.60
应付利息	—	—	—	21,081.86	21,081.86

应付利润	-	-	-	1,390,623.95	1,390,623.95
其他负债	-	-	-	87,619.72	87,619.72
负债总计	68,309,697.53	-	-	1,778,440.17	70,088,137.70
利率敏感度缺口	307,277,697.15	90,093,625.22	-	2,726,931.13	400,098,253.50
上年度末2010年12月31日	6个月以内	6个月—1年	1—5年	不计息	合计
资产					
银行存款	140,001,302.47	-	-	-	140,001,302.47
结算备付金	21,313,909.09	-	-	-	21,313,909.09
交易性金融资产— 债券投资	90,122,006.40	50,003,325.93	-	-	140,125,332.33
买入返售金融资产	193,200,962.30	-	-	-	193,200,962.30
应收利息	-	-	-	1,346,487.43	1,346,487.43
应收申购款	41,428,150.35	-	-	-	41,428,150.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	486,066,330.61	50,003,325.93	-	1,346,487.43	537,416,143.97
负债					
卖出回购金融资产	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,940.72	4,940.72
应付管理人报酬	-	-	-	82,375.92	82,375.92
应付托管费	-	-	-	24,962.40	24,962.40
应付交易费用	-	-	-	9,342.80	9,342.80
应付销售服务费	-	-	-	62,406.03	62,406.03
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	441,598.87	441,598.87
其他负债	-	-	-	84,559.28	84,559.28
负债总计	-	-	-	710,186.02	710,186.02
利率敏感度缺口	486,066,330.61	50,003,325.93	-	636,301.41	536,705,957.95

7.4.13.4.1.2 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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	市场利率上调 0.25%	-925,713.90	-214,866.06
	市场利率下调 0.25%	935,204.62	215,301.05

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

7.4.14 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	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
	合计	470,186,391.20	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.29	
	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

在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%。

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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	142
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

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	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

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	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

8.5 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	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

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	4
报告期内偏离度的最高值	0.2739%
报告期内偏离度的最低值	-0.2438%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1133%

8.7 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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

8.8.2 报告期内持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本超过当日基金资产净值 20% 的情况说明：

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期
1	2011-03-04	20.35	被动超比例	2 天
2	2011-03-07	20.72	被动超比例	1 天
3	2011-03-10	20.21	被动超比例	2 天
4	2011-03-11	20.01	被动超比例	1 天
5	2011-03-15	20.04	被动超比例	2 天
6	2011-03-16	20.02	被动超比例	1 天
7	2011-03-21	20.61	被动超比例	1 天
8	2011-03-24	22.10	被动超比例	3 天
9	2011-03-25	22.48	被动超比例	2 天
10	2011-03-28	23.56	被动超比例	1 天
11	2011-04-01	28.28	被动超比例	2 天
12	2011-04-06	29.73	被动超比例	1 天

8.8.3 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。

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	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

§ 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

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
18,661	21,440.34	51,009,798.71	12.75%	349,088,454.79	87.25%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	15,042.88	0.00%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年8月2日)基金份额	489,989,508.84
本报告期期初基金份额总额	536,705,957.95
本报告期基金总申购份额	5,188,791,340.73
减：本报告期基金总赎回份额	5,325,399,045.18
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	400,098,253.50

注：基金总申购份额包含基金红利再投、转换入份额，基金总赎回份额包含基金转出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

经本基金管理人第三届董事会第一次会议决议，并经中国证监会核准，本基金管理人于2011年3月1日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，杨树财先生担任本基金管理人董事长，李维雄先生不再担任公司董事长。经本基金管理人2011年第二次临时股东会决议，聘任田瑞璋先生担任第三届董事会独立董事，矫艾辛女士不再担任本基金管理人独立董事。经本基金管理人2011年第三次临时股东会决议，聘任崔伟先生、彭铭巧

女士担任第三届董事会董事，张兴志先生、安红军先生不再担任本基金管理人董事。经本基金管理人第三届董事会第四次会议决议并经中国证监会核准，本基金管理人于 2011 年 12 月 1 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，崔伟先生担任本基金管理人董事长，杨树财先生不再担任公司董事长。经本基金管理人第三届董事会第六次临时会议决议并经中国证监会核准，本基金管理人于 2011 年 12 月 17 日发布了《东方基金管理有限责任公司变更高管人员的公告》，聘任仝岩女士担任本基金管理人副总经理。

本基金管理人已分别通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站对上述高级管理人员、董事变更情况履行了信息披露义务，并在本基金及本基金管理人管理的其他基金的招募说明书-基金管理人部分及时更新了上述高级管理人员、董事变更情况。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内发生一起涉及基金管理人的诉讼案件，系原本基金管理人员工与本基金管理人之间的民事诉讼案件，本基金管理人为被告。该案件一审判决本基金管理人胜诉，二审尚未宣判。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 80,000.00 元；截至 2011 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 4 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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）交易单元的选择标准和程序：

券商选择标准：①资质雄厚，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，并能提供全面的信息服；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人，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：由研究部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。

(2) 本报告期内本基金租用的券商交易单元未发生变更。

11.7.2 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		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	-	-	28,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 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。

11.9 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	本基金收益结转公告	指定报刊、网站	2011-01-04
2	本公司旗下基金净值公告	指定报刊、网站	2011-01-04
3	本基金 2010 年第 4 季度报告	指定报刊、网站	2011-01-24
4	本基金春节前暂停申购及基金转换转入的公告	指定报刊、网站	2011-01-28
5	本基金收益结转公告	指定报刊、网站	2011-02-01
6	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-03-01

7	本公司变更高管人员的公告	指定报刊、网站	2011-03-01
8	本公司变更法定代表人的公告	指定报刊、网站	2011-03-10
9	本公司董事变更的公告	指定报刊、网站	2011-03-10
10	本基金招募说明书更新（2010 年第 2 号）	指定报刊、网站	2011-03-18
11	本基金招募说明书更新摘要（2010 年第 2 号）	指定报刊、网站	2011-03-18
12	本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	2011-03-29
13	本基金清明节前暂停申购的公告	指定报刊、网站	2011-03-29
14	本基金 2010 年年度报告（摘要）	指定报刊、网站	2011-03-31
15	本基金 2010 年年度报告（正文）	指定报刊、网站	2011-03-31
16	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-04-01
17	本公司旗下基金 2010 年年度报告更正公告	指定报刊、网站	2011-04-01
18	本基金 2011 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2011-04-22
19	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-05-03
20	本公司迁址公告	指定报刊、网站	2011-05-03
21	本基金在中信证券开通日常定期定额投资业务公告	指定报刊、网站	2011-05-17
22	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-06-01
23	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-07-01
24	本基金 2011 年第 2 季度报告	指定报刊、网站	2011-07-19
25	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-08-01
26	本基金 2011 年半年度报告（摘要）	指定报刊、网站	2011-08-27
27	本基金 2011 年半年度报告（正文）	网站	2011-08-27
28	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-09-01
29	本公司关于增加五矿证券为旗下基金代销渠道的公告	指定报刊、网站	2011-09-05
30	本基金招募说明书更新（2011 年第 1 号）	网站	2011-09-15
31	本基金招募说明书更新摘要（2011 年第 1 号）	指定报刊、网站	2011-09-15
32	本基金国庆节后恢复日常申购及转换转入业务的公告	指定报刊、网站	2011-09-27
33	本基金国庆节前暂停申购及转换转入业务的公告	指定报刊、网站	2011-09-27
34	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-10-10
35	本公司股权变更等相关事项的公告	指定报刊、网站	2011-10-13

36	本公司关于开通短信服务的通知	网站	2011-10-14
37	本基金 2011 年第 3 季度报告	指定报刊、网站	2011-10-26
38	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-11-01
39	本公司关于网上交易平台开通中国建设银行卡定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2011-11-11
40	本公司关于增加恒泰长财证券为旗下基金代销渠道的公告	指定报刊、网站	2011-11-17
41	本公司关于增加东莞证券为旗下基金代销渠道的公告	指定报刊、网站	2011-11-23
42	本公司关于开通汇付天下“天天盈”账户网上直销业务的公告	指定报刊、网站	2011-11-28
43	本基金收益支付公告	指定报刊、网站	2011-12-01
44	本公司变更高管人员的公告	指定报刊、网站	2011-12-01
45	本公司变更高管人员的公告	指定报刊、网站	2011-12-17
46	本基金元旦后恢复申购及转换转入业务的公告	指定报刊、网站	2011-12-27
47	本基金元旦前暂停申购及转换转入业务的公告	指定报刊、网站	2011-12-27

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1. 经中国证监会《关于核准东方基金管理有限责任公司变更住所的批复》（证监许可[2011]1075 号）的核准，本基金管理人住所由“中国北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层”变更为“中国北京市西城区锦什坊街 28 号 1 至 4 层”，办公地址也进行了相应变更。

本基金管理人于 2011 年 7 月 14 日通过中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站披露了上述变更事项，履行了信息披露义务；办理了相关工商变更手续。

2. 经中国证监会《关于核准东方基金管理有限责任公司变更股权的批复》（证监许可[2011]1621 号）的核准，渤海国际信托有限公司受让上海城投控股股份有限公司持有的本基金管理人股权成为本基金管理人新股东。

本基金管理人于 2011 年 10 月 13 日通过中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站披露了上述变更事项，履行了信息披露义务；办理了相关工商变更手续。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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。

13.3 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

2012年3月28日