

东方金账簿货币市场证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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决策权；

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

登记清算部：负责估值事宜的内部协调，依据风险管理部提供的公允价值对投资品种进行估值，计算基金资产净值及基金份额净值，并按照监管部门的要求进行相关信息披露工 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（适用货币市基金）或影子定价（适用货币市基金）。

4. 管理人对于报告期内基金估值情况的说明
本报告期末，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际情况作，本基金应分配且已分配利润27,787,767.94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说明
中国民生银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）根据《东方金账簿货币市场证券投资基金合同》和《东方金账簿货币市场证券投资基金托管协议》，按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本托管人对基金管理人——东方基金管理有限公 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核 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。

5.2 管理人对于报告期内基金投资运作的说明
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核 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 管理人对于本半年度报告中财务信息内容的真实、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数据、净值表现、投资组合情况、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：2013年6月30日
单位：人民币元

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产：		
银行存款	130,501,152.43	300,277,272.93
结算备付金	-	-
交易保证金	-	-
应收货币资金	720,168,108.36	590,553,245.06
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	720,168,108.36	590,553,245.06
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	420,001,510.00	199,000,538.50
应收证券清算款	20,734,693.42	20,880,286.30
应收利息	10,170,056.25	11,479,614.55
应收股利	-	-
应收申购款	13,368,422.95	152,360.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,314,943,943.41	1,122,343,317.34

负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
应付货币资金	-	-
应付债券	-	-
卖出回购金融资产款	4,999,877.50	140,199,529.90
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	19,792.58	992.30
应付管理人报酬	479,505.44	310,143.68
应付托管费	145,304.69	93,982.95
应付销售服务费	363,261.73	234,957.31
应付交易费用	40,140.31	22,042.65
应交税费	-	-
应付利息	2,144.42	14,944.15
应付利润	4,175,822.20	3,151,619.27
递延所得税负债	-	-
其他负债	148,056.14	89,014.83
负债合计	10,373,905.01	144,117,227.04
所有者权益：		
实收基金	1,304,570,038.40	978,226,090.30
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,304,570,038.40	978,226,090.30
负债和所有者权益总计	1,314,943,943.41	1,122,343,317.34

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额1,304,570,038.40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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

资产	本期末 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	35,353,645.96	28,697,011.82
1.利息收入	32,810,028.15	25,402,322.84
其中：存款利息收入	8,967,708.05	9,637,861.76
债券利息收入	12,621,430.80	9,027,580.82
资产支持证券投资收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,220,889.30	6,736,880.26
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	2,543,617.81	3,294,688.98
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,543,617.81	3,294,688.98
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减：一、费用	7,565,878.02	4,285,610.36
管理人报酬	2,488,779.34	1,742,354.00
2.托管费	754,175.57	527,985.99
3.销售服务费	1,885,438.97	1,319,965.10
4.交易费用	-	-
5.利息支出	2,249,590.05	515,087.33
其中：卖出回购金融资产支出	2,249,590.05	515,087.33
6.其他费用	187,894.09	180,217.94
二、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	27,787,767.94	24,411,401.46
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	27,787,767.94	24,411,401.46

6.3 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

项目	本期末 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	978,226,090.30	978,226,090.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,787,767.94
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	326,343,948.10	326,343,948.10
其中：1.基金申购款	3,310,210,536.50	3,310,210,536.50
2.基金赎回款	-2,983,866,588.40	-2,983,866,588.40
四、本期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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,304,570,038.40	1,304,570,038.40

6.4 现金流量表
会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

项目	本期末 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	978,226,090.30	978,226,090.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,787,767.94
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	326,343,948.10	326,343,948.10
其中：1.基金申购款	3,310,210,536.50	3,310,210,536.50
2.基金赎回款	-2,983,866,588.40	-2,983,866,588.40
四、本期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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,304,570,038.40	1,304,570,038.40

6.5 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

项目	本期末 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	978,226,090.30	978,226,090.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,787,767.94
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	326,343,948.10	326,343,948.10
其中：1.基金申购款	3,310,210,536.50	3,310,210,536.50
2.基金赎回款	-2,983,866,588.40	-2,983,866,588.40
四、本期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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,304,570,038.40	1,304,570,038.40

6.6 现金流量表
会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

项目	本期末 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	978,226,090.30	978,226,090.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,787,767.94
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	326,343,948.10	326,343,948.10
其中：1.基金申购款	3,310,210,536.50	3,310,210,536.50
2.基金赎回款	-2,983,866,588.40	-2,983,866,588.40
四、本期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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,304,570,038.40	1,304,570,038.40

6.7 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

项目	本期末 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	978,226,090.30	978,226,090.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,787,767.94
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	326,343,948.10	326,343,948.10
其中：1.基金申购款	3,310,210,536.50	3,310,210,536.50
2.基金赎回款	-2,983,866,588.40	-2,983,866,588.40
四、本期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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,304,570,038.40	1,304,570,038.40

6.8 现金流量表
会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

项目	本期末 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	978,226,090.30	978,226,090.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,787,767.94
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	326,343,948.10	326,343,948.10
其中：1.基金申购款	3,310,210,536.50	3,310,210,536.50
2.基金赎回款	-2,983,866,588.40	-2,983,866,588.40
四、本期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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,304,570,038.40	1,304,570,038.40

6.9 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

项目	本期末 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	978,226,090.30	978,226,090.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,787,767.94
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	326,343,948.10	326,343,948.10
其中：1.基金申购款	3,310,210,536.50	3,310,210,536.50
2.基金赎回款	-2,983,866,588.40	-2,983,866,588.40
四、本期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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,304,570,038.40	1,304,570,038.40

6.10 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

项目	本期末 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	978,226,090.30	978,226,090.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,787,767.94
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	326,343,948.10	326,343,948.10
其中：1.基金申购款	3,310,210,536.50	3,310,210,536.50
2.基金赎回款	-2,983,866,588.40	-2,983,866,588.40
四、本期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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,304,570,038.40	1,304,570,038.40

6.11 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.12 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.13 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.14 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.15 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.16 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.17 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.18 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.19 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.20 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.21 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.22 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.23 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.24 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.25 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.26 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.27 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.28 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.29 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.30 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.31 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.32 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.33 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.34 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.35 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.36 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.37 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.38 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.39 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.40 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.41 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.42 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.43 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.44 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.45 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.46 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.47 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.48 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.49 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.50 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.51 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.52 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年6月30日
单位：人民币元

6.53 所有者权益 基金份额 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：2013年1月1日至2013年