东方金证通货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018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：二〇一八年八月二十八日

§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2018年8月27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2018年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方金证通货币
基金主代码	002243
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月18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	353,478,372.37份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在确保基金资产低风险和高流动性的前提下，通过基金主动的投资管理，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金结合自上而下和自下而上的分析，在保证资产的安全性和流动性的前提下，进行积极的投资组合管理，追求基金的长期、稳定增值。
业绩比较基准	人民币活期存款利率（税后）
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益低于股票型基金、混合型基金、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	罗菲菲
	联系电话	010-66295888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgbfxjdzx@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

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	8,988,418.76
本期利润	8,988,418.76
本期净值收益率	1.8800%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	353,478,372.37
期末基金份额净值	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，按日结转份额。

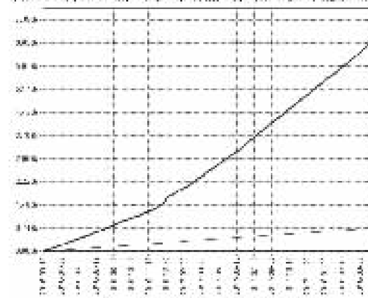
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.3059%	0.0017%	0.0288%	0.0000%	0.2771%	0.0017%
过去三个月	0.9240%	0.0012%	0.0873%	0.0000%	0.8367%	0.0012%
过去六个月	1.8800%	0.0012%	0.1736%	0.0000%	1.7064%	0.0012%
过去一年	3.8800%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	3.5300%	0.0010%
过去三年	7.3919%	0.0038%	0.7999%	0.0000%	6.5920%	0.0038%
自基金合同生效起至今	7.3919%	0.0038%	0.7999%	0.0000%	6.5920%	0.0038%

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



§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（以下简称"本公司"）。本公司经中国证监会"证监基金字[2004]80号"批复批准于2004年6月11日成立。截至2018年6月30日，本公司注册资本3亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币19200万元，占公司注册资本的64%；河北省国有资产控股运营有限公司出资人民币8100万元，占公司注册资本27%；渤海国际信托股份有限公司出资人民币2700万元，占公司注册资本的9%。截至2018年6月30日，本公司管理43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、东方策略成长混合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、东方核心动力混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、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、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方稳定增利债券型证券投资基金、东方金元宝货币市场证券投资基金、东方大健康混合型证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方合家保本混合型证券投资基金、东方量化成长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、固定收益部副总经理、投资决策委员会委员	2016年3月18日	-	14年	固定收益部副总经理，投资决策委员会委员，中国人民大学工商管理硕士，14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、东方赢家保本混合型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（于2017年5月11日起转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于2018年1月17日转型为东方成长收益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、东方岳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、东方成长收益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、东方民丰回报赢安混合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。

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、《东方金证通货币市场基金基金合同》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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资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

2018年上半年严监管持续、信用环境有所收紧、货币政策结构性趋稳，一方面金融严监管政策持续推进，在紧信用、堵偏门、开正门的背景下，非标收缩、表外回表、表内同业理财压缩，机构负债端仍面临压力，另一方面宏观审慎框架愈加完善，为传统货币政策释放空间，二者协同配合，从而守住不发生系统性金融风险的底线。央行既通过降准置换MLF、扩充MLF质押品范围等手段提高流动性总量水平、缓解银行资负压力、促进贷款派生，也通过降准促进债转股、结构性支持小微企业贷款等方式对冲融资缺口压力。从债券市场来看，2018年上半年债券收益率震荡下行，10年国债、国开债收益率分别较年初下行41BP、58BP。资金面保持宽松，短端下行明显，超过150BP，收益率曲线陡峭化。

报告期内，本基金规模变化较大，极力做好流动性管理，同时按照新颁布的流动性管理新规的各项要求调整组合，在关键性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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018年1月1日起至2018年6月30日，本基金净值增长率为1.8800%，业绩比较基准收益率为0.1736%，高于业绩比较基准1.7064%。

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2018年下半年，国内宏观经济下台阶的趋势较为明确，贸易摩擦对出口的负面冲击将在下半年更为明显，房地产调控仍将保持定力，关注财政政策、地方债发行提速对基建的托底。在经济下行、信用收缩、银行资负仍存压力的背景下，政策仍有一定放松空间，或体现为"宽货币+结构性稳信用"的格局，流动性总量将维持合理充裕，社融信贷数据将有所修复。

总体而言，面对相对较为宽松的流动性局面，本基金将保持中性偏长久期，均衡配置同业存款、大额存单、逆回购、金融债和短期融资券等品种，以追求相对稳定的投资收益。同时强调组合流动性管理，精选流动性好、资质好的个券，重视持仓债券的信用风险，避免债券资产违约的情况出现。

感谢基金持有人对本基金的信任和支持，我们将本着勤勉尽责的精神，秉承"诚信是基、回报为金"的原则，力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及相关会计核算业务细则，本管理人对所管理的基金各项资产进行核算，本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下：

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"），成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任1名，委员会副主任1-2名，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：

1.委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

2.运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3.投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称"停牌有价证券"）时，根据估值委员会要求和运营部的估值方案，负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当，对估值方法有失公允性的"停牌有价证券"，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

4.风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述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）。

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8,988,418.76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 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

本报告期内，本基金托管人在对东方金证通货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的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，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，本基金已分配利润8,988,418.76元。

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

由东方金证通货币市场基金管理人—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、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：东方金证通货币市场基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	109,874,167.25	52,890,929.61
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	247,685,089.96	167,501,374.52
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	247,685,089.96	167,501,374.52
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	60,656,410.98	24,643,356.96
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,431,726.40	828,249.68
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	419,647,394.59	245,863,910.77
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	65,699,767.15	38,029,660.98
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	110,549.60	82,180.36
应付托管费	35,375.88	26,297.71
应付销售服务费	110,549.60	82,180.36
应付交易费用	18,066.63	17,500.83
应交税费	-	-
应付利息	10,235.24	5,641.24
应付利润	48,614.66	22,994.52
递延所得税负债	-	-
其他负债	135,863.46	199,000.00
负债合计	66,169,022.22	38,465,456.00
所有者权益：		
实收基金	353,478,372.37	207,398,454.77
未分配利润	-	-
所有者权益合计	353,478,372.37	207,398,454.77
负债和所有者权益总计	419,647,394.59	245,863,910.77

注：报告截止日2018年6月30日，东方金证通货币基金份额净值1.0000元，基金份额总额353,478,372.37份。

6.2 利润表

会计主体：东方金证通货币市场基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	10,726,967.65	1,923,698.76
1.利息收入	10,700,133.85	1,922,505.39
其中：存款利息收入	2,314,312.31	993,760.47
债券利息收入	5,805,182.93	478,854.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,580,638.61	449,890.58
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	26,833.80	1,193.37
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	26,833.80	1,193.37
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.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：二、费用	1,738,548.89	395,709.68
1. 管理人报酬	603,569.19	120,260.96
2. 托管费	193,142.13	38,483.49
3. 销售服务费	603,569.19	120,260.96
4. 交易费用	1.49	135.00
5. 利息支出	212,841.98	13,064.01
其中：卖出回购金融资产支出	212,841.98	13,064.01
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	125,424.91	103,505.26
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	8,988,418.76	1,527,989.08
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	8,988,418.76	1,527,989.08

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方金证通货币市场基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	207,398,454.77	-	207,398,454.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	8,988,418.76	8,988,418.76
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）	146,079,917.60	-	146,079,917.60
其中：1.基金申购款	6,465,011,802.20	-	6,465,011,802.20
2.基金赎回款	-6,318,931,884.60	-	-6,318,931,884.60
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）	-	-8,988,418.76	-8,988,418.76
五、期末所有者权益（基金净值）	353,478,372.37	-	353,478,372.37

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	88,574,772.46	-	88,574,772.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,527,989.08	1,527,989.08
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）	51,307,581.06	-	51,307,581.06
其中：1.基金申购款	853,923,579.79	-	853,923,579.79
2.基金赎回款	-802,615,998.73	-	-802,615,998.73
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）	-	-1,527,989.08	-1,527,989.08
五、期末所有者权益（基金净值）	139,882,353.52	-	139,882,353.52

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：

______ 刘鸿鹏 ______ 　　______ 刘鸿鹏 ______ 　　_____ 肖向辉 ____

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方金证通货币市场基金（以下简称"本基金"）根据2015年11月19日中国证监会《关于准予东方金证通货币市场基金注册的批复》（证监许可【2015】2652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《东方金证通货币市场基金基金合同》自2016年3月14日至2016年3月16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200,054,098.90元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）"瑞华验字【2016】第01300004号"验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方金证通货币市场基金基金合同》于2016年3月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,057,099.15份基金单位，其中认购资金利息折合3,000.25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《东方金证通货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于：现金；通知存款；期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具及法律

法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 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》、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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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

本基金在本报告期间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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《财政部、国家税务总局关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税，存款利息收入不征收增值税。

根据规定，基金产品运营过程中发生的增值税应税行为，以基金产品管理人为增值税纳税人。

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，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、销售机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国民生银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	0	0	20,580,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

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

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	603,569.19	120,260.96
其中：支付销售机构的客户维护费	398,222.69	39,176.77

注：①计提标准：基金管理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：

$H = E \times 0.25\% \div$ 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，由基金管理人于次月前三个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于三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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	193,142.13	38,483.49

注：①计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的0.08%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.08\% \div$ 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，由基金管理人于次月前三个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于三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、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	161.54
东北证券股份有限公司	603,368.10
合计	603,529.64

获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	60,894.79
合计	60,894.79

注：①计提标准：基金销售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：

$H = E \times 0.25\% \div$ 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提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人于次月前三个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于三个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日（2016年3月18日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	50,017,007.60
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	50,017,007.60
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	35.7600%

注：根据《东方金证通货币市场证券投资基金招募说明书》的规定，本基金不收取申购费。

6.4.8.4.2 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均未投资本基金。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	874,167.25	139,160.89	11,265,864.42	41,646.40

注：①存款期末余额中包含定期存款。

②当期利息收入包括由关联方保管的活期存款、定期存款和备付金存款产生的利息收入。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018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65,699,767.15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
111811076	18平安银行CD076	2018年7月2日	99.04	130,000	12,874,754.84
111809170	18浦发银行CD170	2018年7月2日	99.20	300,000	29,759,458.05
111809147	18浦发银行CD147	2018年7月2日	99.39	300,000	29,817,248.38
合计				730,000	72,451,461.27

-

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年06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。

6.4.10 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	247,685,089.96	59.02
	其中：债券	247,685,089.96	59.02
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	60,656,410.98	14.45
	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	109,874,167.25	26.18
4	其他各项资产	1,431,726.40	0.34
5	合计	419,647,394.59	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	2.41	
	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	65,699,767.15	18.59
	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	2018年4月23日	20.51	连续多日出现巨额赎回，导致该比例被动超标	1天

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	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
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120天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120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	23.06	18.59
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	16.87	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	58.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	5.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	13.93	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		118.31	18.59

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

7.5 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	39,964,288.59	11.31
	其中：政策性金融债	39,964,288.59	11.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	207,720,801.37	58.76
8	其他	-	-
9	合计	247,685,089.96	70.07
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	111809147	18浦发银行CD147	300,000	29,817,248.38	8.44
2	111818128	18华夏银行CD128	300,000	29,817,132.52	8.44
3	111809170	18浦发银行CD170	300,000	29,759,458.05	8.42
4	170410	17农发10	200,000	19,994,478.83	5.66
5	180207	18国开07	200,000	19,969,809.76	5.65
6	111818158	18华夏银行CD158	200,000	19,834,129.42	5.61
7	111819120	18恒丰银行CD120	200,000	19,820,361.56	5.61
8	111811076	18平安银行CD076	200,000	19,807,315.14	5.60
9	111814097	18江苏银行CD097	200,000	19,601,895.24	5.55
10	111893640	18哈尔滨银行CD064	100,000	9,897,541.24	2.80

7.7 "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	0.1183%
报告期内偏离度的最低值	-0.0012%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0344%

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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

7.9.2

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。

7.9.3 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	1,431,726.40
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,431,726.40

§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

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
11,887	29,736.55	20,062,767.89	5.68%	333,415,604.50	94.32%

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	企业客户委托资金	16,576,137.02	4.69
2	个人客户委托资金	5,349,635.82	1.51
3	个人客户委托资金	3,919,072.81	1.11
4	个人客户委托资金	3,504,992.43	0.99
5	个人客户委托资金	3,070,718.55	0.87
6	个人客户委托资金	2,814,382.77	0.80
7	个人客户委托资金	2,738,685.71	0.77
8	个人客户委托资金	2,563,357.27	0.73
9	个人客户委托资金	2,145,667.15	0.61
10	个人客户委托资金	2,129,927.52	0.60

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	21.12	0.0000%

8.5 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年3月18日）基金份额总额	200,057,099.15
本报告期期初基金份额总额	207,398,454.77
本报告期基金总申购份额	6,465,011,802.20
减：本报告期基金总赎回份额	6,318,931,884.60
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	353,478,372.37

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，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

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于2018年4月19日公告，根据工作需要，任命张庆先生担任本公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

本报告期内，基金管理人发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

截至报告期末，公司不存在诉讼情况。

本报告期内无涉及本基金基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本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

本基金本报告期内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	
南京证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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

券商选择标准：①资力雄厚，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）本报告期内本基金无新增租用交易单元。

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
南京证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

东方基金管理有限责任公司

2018年8月28日