# 东方金账簿货币市场证券投资基金招募说明书 便新 滴要

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 日期:二〇一四年三月 重要提示 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2日 中国证券监督管理委员会《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》(基金邵函【2006】146号)的核准,进行募集。本基金基金合 同于2006年8月2日下记"生妆,本基金对货币市场基本

时间文件的确认图》(整金部图1.2006 1/40 亏 / 10 均核准, 近 17 涉集。 本建金金亩 同于2006年18月2日正式生效、 本基金为货币市场基金。 东方基金管理有限责任公司(以下简称"本基金管理人"、"管理人"或"本公司")保证《东方金账簿货币市场证券投资基金招募说明书》(以下简称"4 招募说明书》等"或"4 招募说明书》"的约察真实"准确"完整。本《招募说明书》祭中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收

业监会核准,但中国业监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值机收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金发月风险。投资有风险,投资者在投资本基金之前,请纤有细阅读本基金的招募说明书和基仓合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险或受抗力,并对认购(或申购)本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的股票、债券,行生品等条种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。 基金的过往业绩并不预示其未来表现。 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勘勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。 投资者购买货市市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融 机构、基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证是低收益。 有关财务数据和净值表现截止日为2013年12月31日(财务数据未经审计), 如无其他特别说明,本招募说明书其他所载内容截止日为2014年2月2日。 本海要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同 是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金 份额、周成为基金份额特有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身 既表明其对基金合同的承认和接受,并按《基金法》、《运作办法》、基金合同及其 他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义 务,应详细查阅基金合同 一、基金合同生效日期

(一) 基金管理人概况 名称:东方基金管理有限责任公司 住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层 办公地址:北京市西城区锦什坊街28号1-4层 

成立日期:2004年6月11日 注册资本:成亿元人民币 经营范期:基金募集,基金销售;资产管理,中国证监会许可的其他业务 批准设立机头及机准设立文号;中国证监会证监基金字【2004】80号 基金管理公司法人许可证题号:4039 企业法人营业块照注册号:11000007042263 能名人。季息

股权结构:

2006年8月2日

内部组织结构: 股东会是公司的最高权力机构,下设董事会和监事会 董事会下设会担与风

内部组织结构:
股东会是公司的意高权力机构、下设董事会和监事会、董事会下设合规与风险控制委员会、新酬与考核委员会。公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制、下设总经理办公会、风险控制委员会、投资决策委员会、产品委员会和董事会办公室、综合管理部、人力资源部、风险管理部、监察播核部、财务部、信息技术部、登记清算部、权益投资部、固定收益部、交易部、专户业务部、捐政与量化投资部、公务业务部、中户职能部门及上海分公司、北京分公司、广州分公司、公司设督察长、分管风险管理部、监察播核部、负责组织指导公司的风险管理和监察播核工作。(二)基金管理人主要人员情况。1 董事会成员 推传先生 董事长、经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书、中国山监会资金员、中国人民银行前业中心支行行长、党委委员、中国人民银行前上中心支行制、党委委员、中国人民银行前上中心支行行长、党委委员、中国人民银行前上中心支行制、党委委员、中国人民银行前上中心支持,现任东方基金管理有限责任公司董事长、兼任东北证券股份有限公司副董事长、市林大学商学院教师、中国证券投资基金业协会理事、东方汇管资产管理有限及行董事长、杨树财先生、董事、硕士、中国证法财金计师、高级会计师、历任广西北海吉兴会、杨树财先生、董事、硕士、中国注册会计师、高级会计师、历任广西北海吉兴会、新闻总裁集财务总监、东方基金管理有限责任公司董事长、市社会计师等务所副所长、宋北证券有限责任公司对务总监、高创总裁集财务总监、东方基金管理有限责任公司董事长、现任东北证券股份有限公司总裁、副董事长、兼任中国证券外部分的新发展战略委员会副主任全分员,吉林省后级专业技术资格评审委员会评委、

限公司总裁。剧董事长、兼任中国证券业协会创新发展战略委员会副主任委员,吉林省高级专业技术资格评审委员会评委。 何俊岩先生、董事、硕士、高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师,吉林省五一劳动奖章获得者。历任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长、东北证券有限责任公司计划财务总监,东北证券有限责任公司财务部负责人、财务总监、东北证券股份有限公司副总裁兼财务总监、东方基金管理有限责任公司监事会主席,现任东北证券股份有限公司副总裁兼财务总监、东方基金管理有限责任公司监事会主席,现任东北证券股份有限公司副总裁兼任吉林省总会计师协会副会长、吉林省会计学会常务理事、吉林省金融学会理事、吉林省见义勇为基金会理事、吉林省会计学会常务理事、吉林省金融学会理事、吉林省见义勇为基金会理事、吉林省投管智用股公司董事、 

野兴哲先生,萬事,硕士,高级经济师。历任唐山朝除公司及木员,调度,河北省 委科黎部干部。河北省经济体制改革委员会干部、河北省体改委证管办副主任,河 北省证券委员会国内业务处处长、综合处处长、中国证监会石家庄特派员办公室综 合处调析员,河北证券有限责任公司总裁,顺问,现任河北省国有资产程设运营有 限公司副总裁、党委常委,兼任河北国控化工有限公司党委书记、董事长,河北卓城 企业管理服务有限公司董事、总经理。 "经历女士,董事、经济学硕士。历任黑龙江证券有限公司然则营业部交易员、 和公司总统及社会企业经验服务者等还办公司强口营业原在股上部交易员、

97679天下,里事,5007年992。7715300年出现27日7878793000年第一年的交员,特区的空外走社编辑。国泰省安证券公司海口营业部研究员,海航集团对 限公司证券业务部研究签经理,海航集团财务有限公司投资银行部理财主管;现任 渤海国际信托有限公司投资部总经理,兼任国都证券有限责任公司监事。

田瑞瑋先生,独立董事,大学本科。历任中国北方干除员任本日血学。 田瑞瑋先生,独立董事,大学本科。历任中国北方工业(集团)总公司副总经理,中国工商银行党委副书记,副行长,中央金融工委委员(副部级),工商东亚金融控股有限公司全 国政协委员、工商东亚董事长;现任中国扶贫开发协会常务副会长(中组部任命、副部级)、中国金融学会常务理事、中国城市金融学会副会长、中国宏观经济学会常务

部級),中国金融学会常务理事、中国城市金融学会副会长、中国宏观经济学会常务理事、游海银行独立董事。晋商银行独立董事。金硕凭生、独立董事、教授。历任吉林大学总务办公室副主任、副教授、教授、长春税务学院党委书记、院长、长春市政协委员、吉林省政协委员、文教卫生委员会副主任、现任专林的经大学党委书记、关"等凌女士、独立董事、经济学博士。历任中国人民大学东欧中亚研究所副所长、所长;现任中国人民大学俄罗斯研究中心主任、国务院发展研究中心敦亚社会发展研究所等约高级研究员、中国俄罗斯东欧中亚学会常务理事,兼任山东诗而汇纸业股份有限公司独立董事、石靖山银行股份有限公司独立董事。为非传先生、董事、经济学博士。历任吉林省社会科学院助理研究员、东北证券股份有限公司投资银行部经理,东方基金管理有限责任公司督督长、新华基金管理有限公司董生公司筹各组副组长、安信基金管理有限责任公司副总经理,来任东方汇管资产管理有限公司副总经理,现任东方基金管理有限责任公司副总经理,现任东方汇管资产管理有限公司董事。 2.监事会成员 赵振兵先生,监事会主席,本科,高级经济师。历任河北华联商厦部门助理、副

经理、副总经理,河北省商贸集团经营二公司副总经理,河北省工贸资产经营有限 公司改革发展处副处长,河北省国有资产控股运营有限公司企业管理部副部长、资

产运营部部长;现任河北省国有资产控股运营有限公司副总裁。 杨忠燕女士,监事,哲学硕士,金融学研究生,高级经济师。曾任职北京银行等 金融机构,19年金融,证券从业经历;现任本公司监察榜椽和经理。 尚向陈先生、监事、本科。曾任职北京市化学工业研究院、中国工商银行总行;现在本公司登记清算部任职。

阿华大学法律学硕士;具有9年基金从业经历和6年保险从业经历,曾任中法人寿保险有限责任公司宣传公关及法律部签组、董事会秘书,先后任职于博内基金管理有限公司,惠申保公司,惠申保公司,惠申保公司,惠申保公司,惠申保公司,惠申保公司,惠申保公司,高申保司、高达基金管理有限公司。2009年9月加盟本公司,曾任市场部经理。 刘鸿麟先生,副总经里,吉林大学行政管理硕士,具有22年证券从业经历,曾先后任吉林物贸股份有限公司投资顾问,君安证券有限责任公司长春办事处融资融券专员,吉林省信托营业部等建负责人,新华证券股份有限公司长春问志街营业部部经理、经理。2011年6月加盟本公司,曾任总经理助理康市场总监和市场部经理。李景岩先生,曾察长,硕士研究生,中国注册会计师。具有17年证券从业经历,曾任东北证券股份有限公司起吉证券营业部财务经理、北京管理总部财务经理。2004年6月加盟本公司,曾任财务主营,财务部经理,财务负责人,综合管理部经理兼人力冷离研经组,经专理助册

兼人力资源部经理、总经理助理。 4.本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
王丹丹(女士)	2010年9月16日至今	中国人民银行研究生而金融学部上 移证等从处验力。2006年加盟大方 基金管理有限时任公司、砂红债券研 市场证券投资基金基金处理则则,提 投资基金基金处理则的。 投资基金基金处理,均为金融资价市场证券 均等基金基金处理,均为金融资价市场证券 分型证券投资基金基金处理,或为安 人业或益体来总管证券投资基金基金处理,或为安 全处理,太为稳健则税债券型证券投 资本证券投资基金基金处理,在为安 全处理,太为稳健则税债券型证券投资基金基金经理,为
(姚航)女士	2013年9月25日至今	中国人民大学工商管理硕士,10年证, 等从业长约、应该银干富宝法金管理 有限公司运营研,2010年10月加盟东 方基金管理特别。在任何市场证券投 设基金基金经理助理,现任东汀金账 據分市市场证券投资基金差差。 东方金帐海货币工资。 东方像水混合型,形在大定券投资基金差理, 东方像水混合型,并在大定券投资基金差量。
于鑫(先生)	2006年8月2日至2006年12月19日、2007年8月14日至2010年9月15日担任本 基金基金经理	
张晓东(先生)	2006年10月9日至2007年8月14日担任本基金基金经理	
5.投资决策委员会成员	3	

孙晔伟先生,总经理,投资决策委员会主任委员。简历请参见董事介绍 对中III/U工, 心态工生,12风水果安以本工工资风。即3/用参见里中7/程。 于鑫先生, 点经理助理, 东方龙港合型开放式证券投资基金基金经理, 东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理、东方利群混合型发起式证券投资基

略成长股票型开放式证券投资基金基金经里、东方利群混合型发起式证券投资基金,投资决策委员会副主任委员。清华大学IMBA、CFA、13年证券从业经历。曾任生记证券有限公司资产管理部投资经理。2005年加盟东方基金管理有限责任公司,曾任基金管理部处理,投资副总监、投资总监、投资决策委员会委员、东方精选证券投资基金基全经理助理,东方金帐南货币市场证券投资基金基金经理、东方精选证券投资基金基金经理或证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理、东方该个动力股票型开放式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、疾力疾不准含型开放式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、投资决策委员会委员。西北大学经济学博士、12年证券从业经历。曾任健桥证券股份公司行业公司部经理、天治基金管理公司研究员、基金经理、投资部配监,建信基金管理公司可介贷人、基金经理、及资和配监,建信基金管理公司可分户投资部总监助理。副总监。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司。

盟东方基金管理有限责任公司。 王丹丹女士,固定收益部副总经理,东方强化收益债券型证券投资基金基金经 理,东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理,东方稳健同报债券型证券投资基金基金经理、本基金基金经理,投资决策委员会委员。简历请参见本基金基金 至理订组。 呼振翼先生,东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金经理,东方精选 混合型开放式证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员。对外经济贸易大学金

融学硕士,18年期货和证券从业经历。历任高斯达期货公司投资经理,金鹏期货公司投资经理,海南证券研究员,湘财证券研究员、投资理财部经理,民生证券研究 员、行业组组长。2010年5月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究员、东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理助理。6.上述人员之间不存在近亲属关 三、基金托管人 (一)基金托管人概况

1.基本情况 名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称"中国民生银行")

住所:北京市西城区复兴门内大街2号办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号 法定代表人: 董文标 成立时间:1996年2月7日 基金托管业务批准文号:证选基金字[2004]101号 组织形式:股份有限公司(上市) 注册资本:28,365,885,227元人民币 存续期间:持续经营 电话:010-58860666 联系人:关忱

中国民生银行于1996年1月12日在北京正式成立,是我国首家主要由非公有制 企业人股的全国性股份制商业银行、同时又是严格按照《公司法》和《商业银行、 法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范 的现代企业制度,使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行,而为国内外经 的现代企业的度,使中国民生银行有别于国有银行和具地商业银行,而为国外外经济界。金融界所关注。中国民生银行成之十余年来,业务不断拓展,规模不断扩大,效益逐年递增,并保持了良好的资产质量。
2000年12月19日,中国民生银行入股股票(60016)在上海证券交易所挂牌上市。2003年3月18日,中国民生银行70亿可转级公司债券在上交所正式挂牌交易。
2004年11月8日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了68亿元人民币次级

2004年11月8日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了58亿元人民市次级债券,成为中国第一家在全国银行同债券市场成功裁员发行次级债券的商业银行。2005年10月26日,民生银行成功完成股权分置改革,成为国内首家完成股权分置改革的商业银行,为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例中国民生银行自上市以来,按照"团结奋进,开拓创新,培育人才;严格管理,规范行为,敬业守法;讲究质量,提高效益,健康发展"的经营发展方针,在改革发展与管理等方面进行了有益探索,先后推出了"大集中"科技平台、"两案"考核机局、"三卡"工程,独立评审制度、八大基础管理系统,集中处理商业模式及事业部改革

等制度创新,实现了低风险、快增长、高效益的战略目标,树立了充满生机与活力的 崭新的商业银行形象。 2007年11月,民生银行获得2007第一财经金融品牌价值榜十佳中资银行称号, 同时荣获《卫世纪经济报道》等机构评选的"最佳贸易融资银行家"。 2007年12月,民生银行荣获《福布斯》颁发的第三届"亚太地区最大规模上市 今世纪中部"或

企业50號"奖项。 2008年7月,民生银行荣获"2008年中国最具生命力百强企业"第三名 在《2008中国商业银行竞争力评价报告,中民生银行核心竞争力排名第6位,

在公司治理知流程银行是并分评的蛋白。中民生银行级心竞并分评名场。60元,在公司治理对流程银行两个单项评价中位列第一。 2009年6月,民生银行在 "2009年中国本土银行网站竞争力评测活动"中获 2009年中国本土银行网站"最佳服务质量奖"。 2009年9月,在大连召开的第二届中国中小企业融资论坛上,中国民生银行被评为"2009中国中小企业金融服务十佳机构"。在"第十届中国优秀财经证券网站评选"中,民生银行荣膺"最佳安全性能奖"和"2009年度最佳银行网站"两项大规

2009年11月21日,在第四届 "21世纪亚洲金融年会" 上,民生银行被评为

2009年11月21日,在第四届 "21世纪亚洲金融年会"上,民生银行被评为 "2009年亚洲最佳风险管理银行"。 2009年12月9日,在电《理财周报》主办的 "2009年第二届最受尊敬银行评选 暨2009年第三届中国最佳银行理财产品评选"中,民生银行获得了 "2009年申国最受尊敬银行"、"最佳服务私人银行"、"2009年最佳零售银行"多个奖项。 2010年2月3日,在"卓越2009年度金融理财排行榜"评选活动中,中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评,荣获卓越2009年度金融理财排行榜"十佳电子银行"奖。 2010年10月,在经济观察报主办的 "2009年度中国最佳银行评选"中,民生银行获得评委会奖— "中国银行业十年改革创新奖"。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓著的银行而特别设立的。

公司治理、强励机制、风险官建、产品创新、官建架构、商业模式穴不方面创新表现 卓著的银行而特别设立的。 2011年12月,在由中国金融认证中心(CFCA)联合近40家成员行共同举办的 2011中国电子银行年会上,民生银行荣获"2011年中国网上银行最佳网银安全 奖"。这是继2009年、2010年荣获"吐国网上银行最佳网银安全奖"后,民生银行第 三次获此殊荣,是第三方权威安全认证机构对民生银行网上银行安全性的高度肯

2012年6月20日,在国际经济高峰论坛上,民生银行贸易金融业务以其

2011—2012年度的出色业绩和产品创新最终荣获,2012年中国卓越贸易金融银行"奖项。这也是民生银行继2010年荣获英国《金融时报》"中国银行业成就奖—最佳贸易金融银行奖"之后第三次获此殊荣。 #Xは14の31種間11天 <旧第二の状比殊宗。 2012年11月29日,民生银行在《The Asset》杂志举办的2012年度AAA国家 奖項评选中获得・中国最佳银行-新秀奖。

奖项评选中获得"中国最佳银行—新秀奖"。
2.主要人员情况
检养率、女,北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理(主持工作)。曾就职于中国投资银行总行。意大和联会信贷银行北京代表处,中国民生银行金融市场部和资产托管部。历任中国投资银行总行业务经理,意大利联合信贷银行北京代表处,我,中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理,副总经理,部总经理,自产国的政策和前瞻性的战略眼光。
3.基金托管业务经营情况
中国民生银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格,成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势,大力发展托管业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高质托管服务的原则,高起点地建议系统、完善制度。组织人员。资产托管部间前共有员工52人,平均年龄33起,也是规则显过系统、完善制度。组织人员。资产托管部间前共有员工52人,平均年龄33

起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工52人,平均年龄33岁,100%员工拥有大学本科以上学历,80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员100%都具有基金从业资格。截止到2013年12月31日,本行共托管基金28只,分 别为天治品质优选混合型证券投资基金、融通易支付货币市场证券投资基金、东方 精选混合型开放式证券投资基金、天治天得利货币市场基金、东方金账簿货币市场 基金、长信增利动态策略证券投资基金、华商领先企业混合型证券投资基金、银华 等证100指数分级证券投资其全 化商策略精选灵活配置混合刑证券投资其全 N 大保德信信用添益债券型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、建信 ※证其木面60次息刑耳的式指数证券投资其全 建信經证其木面60次息刑耳的式 深证基本而60交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国投端银端源保本混合型证券投资基金、新商聚潮新思维混合型证券投资基金、其间等值增强债券型证券投资基金、工根瑞信睿智深证 100指数分级证券投资基金、农银工理行业轮动股票型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯低稳定增利18个月定期开放信券型证券投资基金、原根士丹利华鑫纯低稳定增利18个月定期开放信券型证券投资基金、建信资企心保本混合型证券投资基金、德邦德利货市市场基金、工程取省部都债券型证券投资基金、中银口和分级债券型证券投资基金和汇添富全额宝货市市场基金、托管基金资产净值为671.06亿元。(二)基金托管人的内部控制制度。大管基金资产净值为671.06亿元。1内部风险经制目标强化等位表。

合规依法经营,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系,保障业务正常运行,维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

2.内部风险控制组织结构 中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生 "福民主席"以近7月成立。 银行股份有限公司稽核密、资产托管部的设备核能管处及资产托管部各业务处室 共同组成。总行籍核配对各业务部门风险控制工作进行指导。监督。资产托管部内 设建业、专职的内部监督储核处、负责议定托管业务风险控制工作应依据В与计 划,组织、指导、协调、监督各业务处室风险控制工作的实施。各业务处室在各自职 责范围内实施具体的风险控制措施,

3.內部风座控制原则 (1)全面性原则:风险控制必须覆盖资产托管部的所有处室和岗位,渗透各项业 (1)全面性原则,以隐矩制必须覆盖资产托管部的所有处室和岗位,渗透各项业务过程和业务岗位。每位员工对自己岗位服费范围内的风险负责。 (2)独立性原则;资产托管部设立独立的稽核监督处,该处室保持高度的独立性和极能生,负责对托管业务风险控制工作进行相导和监督。 (3)相互制约原则;各处室在内部组织结构的设计上现形成中种相互制约的机制,建立不同的位之间的部衡体系。 (4)定性和定量相结合原则;建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客 观性和操作性。 (6)防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门 与行政,研发和管销等部门严格分离。 4内部双险控制制度取措施 (1)制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格 的人员行为规范等一系列规章制度。 (2)建立建全的组织管理结构:前后台分离,不同部门,岗位相互牵制。 (3)建立建全的组织管理结构:前后台分离,不同部门,岗位相互牵制。 (6)建立建全的组织管理结构:前后台分离,不同部门,岗位相互牵制。 (6)风险识别与评估:稽核监督处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实 施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监

(5)人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理

立急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中 5.资产托管部内部风险控制

5.资产托管部外商邓风险控制 中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。 (1)坚持风险管理与业务发展同等重要的温金。托管业务是商业银行新兴的中间业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起战特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展。新问题新情况不断出现,中国民生银行股份有限公司资产任管部始终各风险管理成在产业务发展问章重要的位置,视风险防范和控制沙托管业务生存和及展的生命线。 (2)实施全员风险管理、完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与、只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效、中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理、将风险控制责任落实到具体业务处室和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

行行自步級應主风級區等域,特別級定制以日花吳到美泽區更介並為相望另同近。每 (3)建立分工明确、相互牽制的风险控制组织结构。 托曾部通过建立纵向双人 制,横向多处室制的内部组织结构,形成不同处室、不同岗位相互制衡的组织结构。 (4)以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部 十分重视的强控制制度的建设,已经建立了一整套内部风险控制制度,包括业务管 理办法、内部控制制度。员工行为规范、岗位职责及溢抵所有后台运作环节的操作 手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善 (5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要,制度落

实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部 设置专职槽核监督处,依照有关法律规章、最两个月对业务的运行进行一次槽核检 查。总行槽接那也不定期对资产托管部进行稽核检查 (6)将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中,技术控制风险比制度 影制风险更加可靠。可将人为不确定因素隆至最低。托管业务系统需求不仅从业务

, 上回20ms, 20ms, 10 秒/03小卿定因繁隆至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证,托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和超序 根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定,对基金的投 资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算。基金资产净值的计算。基金管 理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎 回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、会规性进行监督和核查。 基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关 法律法规规定的行为。应及时以节面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收 到通知后应及时核对确认并以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收 等人有权随时对通知事项进行复查。督促基金管理人改正、基金管理人对基金托管 // 通知的法理解如组工会。

人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。 基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通

四、相关服务机构

1.东方基金管理有限责任公司直销中心 住所:北京市西城区辖什坊街28号1-4层 办公地址:北京市西城区辖什坊街28号3层 法定代表人:崔伟

联系人:张婷 电话:010-66295921 传直:010-66578690 网址:www.orient-fund.com或www.df5888.com 2.电子交易:

2.电子交易: 投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回等业务,具体业务 推简迟及业务规则请登录本公司网站查询。 本公司网址:www.orient-fund.com 或www.df5888.com。 (二)代销机构: 1.中国民生银行股份有限公司 住所:北京市西城区复兴门内大街2号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号 法定代表人,首文标

法定代表人:董文标 联系人:杨成茜 电话:010-57092619 传真:010-57092611 客户服务电话:95568

2.中国建设银行股份有限公司 住所:北京市西城区金融大街25 号 办公地址:北京市西城区届市口大街1号院1号楼长安兴融中心

客户服务电话:95533 网址:www.ccb.com 3.中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街1号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼 客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn 5.招商银行股份有限公司 住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦 办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦 法定代表人:傅育宁 联系人:邓炯鹏 自活:0755-83077278

电话:0755-83077278 传真:0755-83195109 客户服务电话:95555 网肚:www.cmbchina.com 6.中国邮政储蓄银行股份有限公司 住所邮取市西城区金融大街3号 办公地址:北京市西城区金融大街3号 法定代表人:李雪华 联系人:王硕 传真:010-68858117 客户服务电话:95580 网址:www.psbc.com

网址:www.psbc.com 7.北京银行股份有限公司 在所:北京市西城区金融大街甲17号首层 办公地址:北京市西城区金融大街下17号首层 办公地址:北京市西城区金融大街丙17号 法定代表人:闫冰竹 电话:010-66223587 传真:010-66226045

客户服务电话:95526

B.交通银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69年 办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

网址:www.abchina.co 10.东莞银行股份有限公司 注册地址: 东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦 办公地址: 东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦 法定代表人:廖玉林 联系人:陈幸 **担**话:0769−22119061

客户服务电话:95599

传真.0769-22117730 客户服务电话:4001196228(全国)、96228(广东省内) 网址:www.dongguanbank.cn 11.东北证券股份有限公司 住所:长春市自由大路1138号 办公地址:长春市自由大路1138号 法定代表人;矫正中 联系人;潘楷 电话:0431-85096709 客户服务电话:4006000686 网址:www.nesc.cm

网址:www.nesc.cn 12.中国银河证券股份有限公司 住所:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座 办公地址:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座 法定代表人: 陈有安 电话:010-66568888

传真:010-66568990 客户服务电话:400-888-8888 网班: WWW.CIIIIBSUOCEACHIMAI 13广发证券股份有限公司 住所:广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼 办公地址:广州市天河北路大都会广场5.18、19、36、38、41、42、43、44 楼

客户服务电话:95521 网址:www.gtja.com 15.东方证券股份有限公司 住所:上海市中山南路318号2号楼22层-29层 办公地址,上海市中山南路318号2号楼22层\_29层

法定代表人,王益民

联系人:吴宇 电话:021-63325888 传真:021-63326173 | 184:121-05326178 | 客户服务电话:021-962506或40088-88506 | 网址:www.dfzq.com.cn | 16.海通证券股份有限公司 16海通证券股份有限公司 住所:上海市港海中路98号 办公地址:上海市黄浦区广东路689号 法定代表人:王开国 联系人:李笑鸣 电话:021-23219275

传真:021–23219100 客户服务电话:021–95553、400–8888–001 或拨打各城市营业网点咨询电话 网址:www.htsec.com 17.中信建投证券股份有限公司 住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼 办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人: 王常青 联系人:权唐 电话:010-85130588 传真:010-65182261 客户服务电话:400-8888-108 18.山西证券股份有限公司 住所:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼 办公地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

办公地址:上海市静安区新闸路1508号3楼 法定代表人:薛峰 传真:021-22169134

客户服务电话:10108998 20.国信证券股份有限公司 住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人:何如 联系人, 齐膝燕

电话:0755-82130833 传真:0755-82133952 传真。0755-82133952 客户服务电话:95536 网址:www.guosen.com.cn 21.中信证券股份有限公司 住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座 办公地址:北京朝阳区亮马桥路48号 法定代表人:王东明 联系人:陈忠 电话:010-60838888 传真:010-60833799

传真:010-60833799 客户服务电话:各地营业部咨询电话

网址:www.ecitic.com 22.申银万国证券股份有限公司 住所:上海市常熟路171号 办公地址:上海市常熟路171号 法定代表人:储晓明 联系人: 李清怡

电话:021-54041654 传真:021-54033888 客户服务电话:95523或4008895523 23.东海证券有限责任公司 住所: 江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼 法定代表人:刘化军 联系人:梁旭 电话:0519-50586660

传真:0519-88157761 客户服务电话:400-888-8588 网址:www.longone.com.cm 24.中信证券 : 浙江 / 有限责任公司 住所:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层 办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

传真:0571-85783771 客户服务电话:0571-95548

网址:www.bigsun.com.cn 25.国元证券股份有限公司 住所:安徽省合肥市寿春路178号 办公地址:安徽省合肥市寿春路178号 法定代表人:蔡咏 联系人:祝丽萍 电话:0551-2257012 传真:0551-2272100

网址:www.essence.com.cn 27.中信万通证券有限责任公司 

法定代表人:杨宝林 联系人:吴忠超 电话:0532-85022326 客户服务电话:95548 网址:www.zxwt.com.cn 28.长江证券股份有限公司

传真:0755-82558355 客户服务电话:4008001001

网址:www.95579.com 29.招商证券股份有限公司 住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层 办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层 联系人:林迎生

传真:0755-82943636 客户服务电话:95565、4008888111 网址:www.newone.com.cn 30.齐鲁证券有限公司 办公地址:济南市经七路86号23层

办公地址:济南市经七路86号23层 法定代表人:李玮 联系人:吴阳 电话:0631-68889156 传真:0631-68889752 客户服务电话:96538 网址:www.qlzu.com.cm 31.江海证券有限公司 住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号 办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号 法定代表人:孙名扬 联系人:张宇宏 电话:0451-82338663 电话:0451-82336863 传真:0451-82287211 客户服务电话:400-666-2288

网址:www.jhzq.com.cn 32.宏源证券股份有限公司 住所:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦 办公地址:北京市西城区太平桥大街19号 法定代表人: 冯戎 联系人:李巍

法定代表人:黄金琳 传真:0591-87383610 客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)

网址:www.hfzq.com.cn 34.五矿证券有限公司 住所:深圳市福田区金田路4028号经贸中心48楼 办公地址:深圳市福田区金田路4028号经贸中心48楼

联系人:高克南 电话:0755-82545707 传真:0591-87383610

传真、0691-87383610 客户服务电话:40018-40028 网肚:www.wkzq.com.cn 36.恒泰长财证券有限责任公司 住所:长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33股 办公地址:长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33股 法定代表人:赵培武 联系人:曲志诚 申请。0431-82945299

映系人: 曲志城 电话: 0431-82945299 传真: 0431-82946531 客户服务电话: 0431-82951765

住所:广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼 去定代表人:张运勇

客户服务电话:961130(省内直拨,省外请加拨区号0769) 网址:www.dgzq.com.cn 37. 华安证券股份有限公司

传 真: 0731-85832214 客户服务电话:95571 39.恒泰证券股份有限公司 注册地址:内蒙古呼和浩特新城区新华东街111号 办公地址:内蒙古呼和浩特新城区新华东街111号 联系人:罗俊峰

程 第10471-4361259 客户服务电话:0471-4961259 网 址:www.cnht.com.cn 40.上海长量基金销售投资顾问有限公司

网址:www.erichfund.com 41.杭州数米基金销售有限公司 办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼 去定代表人:陈柏青

联系人:张裕

办公地址: 深圳市罗湖区深南东路6047号发展银行大厦25楼I、J单 法定代表人: 薛皓 联系人: 童彩平 电话:0755-33227950 传真:0755-83280798 8字服务电话:400 678 8887 网址: www.zlfundcn及www.jmmw.com 43.上海好宝基金销售有限公司 住所:上海市和口区场中路685弄37号4号楼449室 办公地址:上海市湘东南路1118号哪尔多斯国际大厦903-906室 法定代表人:杨文斌

传真:021-68596916 客户服务电话:400 700 9665 44.上海天天基金销售有限公司

联系人:除班 电话:021-54509998-2010 传真:021-64385308 客户服务电话:400 1818 188 网址:www.1234567.com.cn (三)份额登记机构 名称:东方基金管理有限责任公司 任所:北京市西城区第什坊街28号1-4层 办公地址:北京市西城区第什坊街28号1-4层 步次代表人:崔伟 联系人:张砂 电话:010-66295879 传真:010-66578680 网址:www.orient-fund.com或www.df5888.

网址:www.orient-fund.com或www.df5888.com (四)律师事务所和经办律师 名称上海市通力律师事务所

住所: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼 负责人:韩炯 联系人: 吕红 传真: 021-31358600

(五)会计师事务所和经办注册会计师 住所:上海市南京东路61号新黄浦金融大厦4层 办公地址:北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层 法定代表人:朱建弟

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 经中国证监会、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 的员币中场上具。 如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在

七、基金的投资策略

5.稳健配置原则

(一)投资原则 1.合规性原则 本基金将严格按照《暂行规定》和基金合同的有关规定,选择监管当局批准 的,适合投资的货币市场金融工具构建投资组合。同时对投资组合中不同投资产品 与金融工具的投资化例进行严格控制,平均剩余期限不得超过180天(6) 2.流动性侧重原则 根据对自投资金融品种期限结构的分析和投资货币市场基金投资者不同的流 动性偏好,通过对不同投资产品未来现金流的预测,在构建组合时应侧重流动性的 需求,实现本基金流动性高的特征,最大限度地保证投资者的流动性需求。 2.55分件原则

5.根據配直原則 根据各品种的交易活跃程度、相对收益、信用等级和剩余期限等重要指标來确 定相应的配置比例,基金的资产配置比例严格按照基金合同和国家相关法律、法规 规定的限期执行。在相对稳定的市场环境下,基金的资产配置比例将保持相对稳 定、尽量不做过多的成外性调整。

配置比例。通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例,寻找具有投资价值的投资品种,增持相对低估、价格将上升的, 能给组合带来相对较高回报的类属;减持相对高估、价格将下降的,给组合带来相 对较低回报的类属,借以取得较高的总回报。并通过控制存款的比例、保留充足的 可变现资产和平均安排回购到期期限,保证组合的充分流动性。 3.收益率曲线策略 3.收益举曲线乘略 收益曲线策略即在不同期限投资品种之间进行的配置,通过考察收益率曲线 的动态变化及预期变化,通过积极使用买入并持有、骑乘收益率曲线等交易策略,

寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超 额收益。在期限配置方面,将在剩余期限决策的基础上,在不增加总体利率风险的 情况下,集中于决定期限利差变化的因素,从不同期限的债券的相对价值变化中实

现超额收益。
 4个券选择策略
 在正确拟合收益率曲线的基础上,及时发现偏离市场收益率的债券,并找出这些债券价格偏离的原因、同时,基于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限 股,从而指导相对价值投资,选择投资于定价低估的短期债券品种。
 5.无风险套利操作策略
 由于市场环境差异以及市场参与成员的不同,市场中常常存在无风险套利机会。随着市场环境差异以及市场参与成员的不同,市场中常常存在无风险套利机会。随着市场有效性的继点,无风险套利机会。基金管理人将贯彻谨慎的原则,充分把握市场无风险套利机会。为基金份额得身人带来更大收益。
 同时,随着市场的发展。新的货币投资工具的推出,会产生新的无风险套利机会。本基金将加强对市场前沿的研究,及时发现市场中新的无风险套利机会。,本基金将加强对市场前沿的研究,及时发现市场中新的无风险套利机会,扩大基金份资收益。

三)投资决策依据和决策程序

市场结构变化、市场资金供求等因素的研究与分析,建立相关研究模型,并据此作 出对短期未来市场利率的预测报告,作为投资决策依据之一。 基金管理人的研究和投资部门定期或不定期举行投资研究联席会议,讨论宏 观经济环境、利率走势,短期融资券发行人信用级别变化等相关问题,作为投资决

策的重要依据之一。 如果基金经理认为影响利率的因素产生了重大变化,还可以临时提出变更投 资决策,并报投资决策委员会审批。

企及以供來 投资決策委员会根据基金合同、相关法律法规、本基金管理人有关规章制度确 定基金的投资原则以及基金的资产配置比例范围,审批总体投资方案和重大投资

。 基金经理根据投资决策委员会确定的投资对象、类属配置、期限配置等总体投 基金经理帐册投资代来安风云哪足时对风风水、突腾腾压,水河水阻压,可必胜及 资方案,并结合研究人员提供的投资建议,自己的研究与分析判断、基金申购赎回 情况和市场整体情况,构建并优化投资组合。对于超出权限范围的投资,按照公司 权限审批治程,提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

3.投资执行。中央交易室接到指令后,首先应对 中央交易室接到指令后,首先应对 指令予以诽核、然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确。不规范或者不 合规的,中央交易室应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该 项交易的判断和建议、以便基金经理及时调整交易策略。 4组合监控与调整 基金管理 化闭险管理部门将密切关注宏观经济和市场变化,结合基金申购 和赎回导致的现金流量情况。每日对组合的风险和流动性进行监控,确保基金的备 项风险控制指标维持在合理水平,确保组合的流动性能够减足基金份额持有人的 赎回要求

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境变化和实际 对上述投资决策程序做出调整。

对上述投资决策程序做出调整。 //、基金的业绩比较基准 本基金以货币市场工具为投资对象,每日的平均剩余期限控制在180 天内,本 基金的业绩比较基准为银行税后活期利率。 在合理的市场化利率基准推出的情况下,本基金管理人可根据投资目标和投 资策略,确定变更业绩比较基准,并及时公告。 当法律法规变化或市场有更加合理的业绩比较基准时,本基金管理人有权对 供加偿担企用发现在不规模。

本投资组合报告所载数据截至2013年12月31日(财务数据未经审计)。 1.报告期末基金资产组合情况

程告期债券回购融资情况 占基金资产净值比值 : 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%的价

(1)投资组合平均剩余期限基本情况 的技资组合平均剩余期限最低值 报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

3.基金投资组合平均剩余期际

中,剩余存续期超过3g

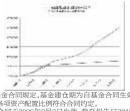
60天(含 [中,剩余存绘期超过39] 90天(含)-其中:剩余存续期超过397 报告期末按券种品种分类的债券投资组 产净值比例大小排名的前一 与期末按摊金成本占基。 债券名称 债券数量(张 摊余成本(元

(1)基金计价方法说明 本基金采用摊余成本法计价。 (2)本报台期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮 动利率债券,但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的

(4)其他各项资产构成

十一、基金的业绩 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产 ·保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表 投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 业绩比较基准 收益率(3) 自基金合同生效以来基金累计净值收益率



基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。 (二)托管费率: 基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。

(三)相管政用: 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。

基金销售服务费农前一日基金资产净值的0.25%年费率计提, 十三,对招募设制书更新部分的说明 本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》以(以下简称《基金法》)、 (证券投资基金运作管理办法》以(下简称《运作办法》)、(证券投资基金销售管理 方法》以(下简称《简档办法》)、(证券投资基金信息被露曾理办法》以(下简称《信息 包息披露办法》)及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投 经额据还述过证证。并且比较的证:

長披露办法》)及其他有关法律法规的要求、结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新、主要内容如下。 (一)在"重要提示"部分,更新了"招募说明书有关财务数据的截止日期"及 "其他内容的截止日期"。 (二)在"三、基金管理人"部分,更新了基金管理人的相关内容。 (三)在"四、基金托管人"部分,更新了基金托管人的相关内容。 (四)在"五、相关服务机构"部分,更新了直销机构、代销机构和份额登记机构的信息

本基金托管人复核,但未经审计。 (七)在"九、基金的业绩"部分,更新了"基金净值表现"和"本基金累计净值

上述内容仅为本基金更新招募说明书的梳要,详细资料须以本更新招募说明 书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容,可登录东方基金管理

东方基金管理有限责任公司 2014年3月18日

网址:www.cczq.net 36.东莞证券有限责任公司 住所:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座 网址:www.hazq.com 38.方正证券股份有限公司 任府:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22 - 24层 办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22 - 24层 电话: 0731-85832503

电话:0471-4972042 传真:0471-4961259

40.上海长量基金销售投资顾问有限公司 住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址:上海市浦东新区浦东大道655号裕景国际B座16层 法定代表人:张妖 电话:021-58788678-8201 传真:021-58787698 客户服务电话:400 089 1289 颐址:www.erichfund.com

电话:021-60897840 客户服务电话:400 076 6123 网址:www.fund123.cn 42.深圳众禄基金销售有限公司 住所:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1.1单元

办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼 去定代表人:其实 联系人:陈琪

电话:010-68286868 传真:010-88210608 经办注册会计师:朱锦娟 魏星 五.基金名称和基金类型 (一)本基金名称:东方金账簿货市市场证券投资基金 (二)本基金类型:货市市场基金 (三)基金运作方式:契约型开放式 (一)基金的投资目标 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。 (二)基金的投资方向 (二)基金的投资方向 本基金主要投资于金融工具,包括:现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行

履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,

本基金主要投资于中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性和高信 用级别的货币市场工具。 4.目标剩余期限原则 4.目标剩示房限房则 根据对宏观经济,市场环境和未来利率变动趋势的判断,深人分析收益率曲线 与资金促求状况。确定并控制投资组合平均剩余期限,把握买卖时机。基金的平均 剩余期限控制在180天以内(含)。如果预测利率将上升,可以适当降低投资组合的 目标剩余期限;如果预测利率将下降,则可以适当增加投资组合的目标剩余期限。

(二)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。 1.剩余期限目标控制 根据对宏观经济指标、财政与货币政策、金融监管政策,市场结构变化、市场资 金供求等因素的研究与分析,并结合本公司开发的债券超额回报率预测模型,对未 来一股时期的短期市场利率的走势进行判断,由投资决策委员会决定或调整投资 组合的剩余期限。 2. 类据尼增车略

0.回购录响 根据对市场走势的判断,合理选择恰当的回购策略,以实现资产的增值。通过 回购可以进行放大,在市场上升的时候增加获取收益的能力,并利用买入一回购融 资—再投资的机制提高资金使用效率,博取更大的差价收益。在市场下跌时,则可 使用采断式回购资路以规避风险。

1.投资分析 根据基金管理人投研团队对宏观经济指标、财政与货币政策、金融监管政策、

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证 7. 报告期末投公允訂直台基金员产停间 投资明细 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 。 (3)本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调 香.或在报告编制日前一年内受到公开谴责,处罚的情刑

注:①本基金基金合同规定,基金建仓期为自基金合同生效之日起六个月,建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。 ②本基金基金合项资产配置比例符合合同约定。 ②本基金基金合同于2006年8月2日生效,截至报告日2013年12月31日,基金合同生效不满八年,各项资产配置比例符合基金合同规定。 十二、费用概览

思。 (五)在"七、基金份额的申购与赎回"部分,更新了"申购与赎回办理的场""定期定额投资计划"、"基金转换"等内容。 (六)在"八、基金的投资"部分,更新了"基金投资组合报告"的内容,基金投合报告截止日期更新为2013年12月31日,该部分内容均按有关规定编制,并经合任路、与保健、但五级产进

(七)在"九,基金的业绩"部分,更新了"基金净恒水观"和 一个基金参口中电 增长秦与业域比较基准收益率的历史主势对比图"。该部分内容均按照有关规定编制,并经本基金托管人复核。但相关财务数据未经审计。 (八)在"二十、对基金份额持有人的服务"部分,更新相关服务信息。 (九)在"二十一、对桂也拉被新事项"部分,更新有关服务信息, (九)在"二十一、其他应按数事项"部分,更新为从上效招募说明书(更新)截 止日2013年8月2日至本次招募说明书(更新)截止日2014年2月2日之间的信息被