

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:二〇一四年三月二十九日

§1重要提示及目录

1.1重要提示  
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、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2014年3月19日复核了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。  
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。  
立信会计师事务所(特殊普通合伙)为基金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。  
本报告期内自2013年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

基金名称	东方金账簿货币市场基金
基金代码	400005
运作方式	契约型、开放式
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日期	2006年8月21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	1,530,617,293.10份
基金合同存续期限	不定期

2.2基金基本情况

基金简称	东方金账簿货币
基金全称	东方基金管理有限责任公司东方金账簿货币市场基金
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	1,530,617,293.10份
基金合同存续期限	不定期

2.3基金管理人、基金托管人

名称	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
姓名	邵卫	姓名	张勇
联系电话	010-66295888	联系电话	010-58560666
电子邮箱	shw@orient-fund.com	电子邮箱	zhangyong@cmbc.com.cn
传真	010-66295781/010-628-5888	传真	95568
网址	http://www.orient-fund.com	网址	http://www.cmbc.com.cn

2.4信息披露方式

基金年度报告的备置地点	http://www.orient-fund.com/ftp/010-A588.com
基金年度报告的备置日期	基金管理人及基金托管人住所

§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1.1期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	67,062,212.60	46,764,574.08	13,077,726.95
本期利润	67,062,212.60	46,764,574.08	13,077,726.95
本期净值增长率	4.1684%	4.2039%	3.9588%
3.1.2期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末基金份额净值	1.0000	0.978,226,090.30	400,096,333.63
期末基金份额总额	1,530,617,293.10	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00

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,由于证券市场采用成本法核算,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	基金份额净值收益率①	同期业绩比较基准收益率②	差额①-②	①-②	②-①
过去三个月	1.1516%	0.0035%	0.0882%	0.0000%	1.6343%
过去六个月	2.2792%	0.0029%	0.1764%	0.0000%	2.1026%
过去一年	4.1684%	0.0039%	0.3560%	0.0000%	3.8184%
过去三年	12.9368%	0.0055%	1.2878%	0.0028%	11.6999%
过去五年	16.9739%	0.0048%	1.9897%	0.0029%	14.2626%
自基金合同生效以来	25.5535%	0.0069%	2.7898%	0.0036%	17.8477%

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21日至2013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收益率与业绩比较基准收益率的柱状图对比图

3.2.4过去三年基金的利润分配情况

年度	已分配股利总额	直接计入所有者权益的基金份额持有人当期投资收益	应付利息	当期利润分配合计	备注
2013	57,815,312.73	7,518,986.45	1,727,913.43	67,062,212.60	-
2012	35,998,536.52	7,885,638.95	3,280,398.61	46,764,574.08	-
2011	7,501,449.16	4,052,049.00	1,524,028.74	13,077,726.95	-
合计	100,915,498.41	19,456,674.40	6,532,340.82	128,904,513.63	-

注:本基金每日分配收益,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基金管理人及其基金经理的经验

本公司管理人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《证监基金字[2004]100号》于2004年11月1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2亿元人民币,本公司股东为东北证券股份有限公司,持有股份64%、河北证券资产管理运营有限公司,持有股份27%、瀚海国际信托有限公司,持有股份9%。截止2013年12月31日,本公司管理12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、东方增长中盘混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方策略回报60指数增强型证券投资基金、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。

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	任本基金基金经理年限	证券从业年限	说明
王丹内(女士)	本基金基金经理	2010-09-16	7年	中国人民大学金融学硕士,2006年6月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方基金管理有限责任公司市场部副经理,2009年12月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,现任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,兼任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,兼任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,兼任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理。
魏航(女士)	本基金基金经理	2013-09-25	-	中国人民大学工商管理硕士,2009年12月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方基金管理有限责任公司市场部副经理,2010年12月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,现任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,兼任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,兼任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理。
魏航(女士)	本基金基金经理	2012-08-16	9年	中国人民大学工商管理硕士,2009年12月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方基金管理有限责任公司市场部副经理,2010年12月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,现任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,兼任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理,兼任东方基金管理有限责任公司基金运营部副经理。

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。  
③基金管理人在本报告期内的基金运作遵守《证券投资基金法》、《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》及其各项实施细则、《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和基金合同的约定。  
4.2管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.2.1公平交易制度和内部控制  
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,各投资组合经理享有平等研究资源,在获得投资信息、投资建议及决策支持方面享有公平的机会。基金管理人实行集中交易制度,建立公平交易执行制度,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的公平交易程序,实行价格优先、时间优先、非公开竞价交易申购赎回集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立确定投资计划,在严格控制价格的前提下,基金管理人按照比例优先、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。  
基金管理人定期对报告期内公平交易情况的同期内交易价差、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。  
4.2.2公平交易制度的执行情况  
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各环节中公平对待不同投资组合,无直接或间接与第三方的交易安排或利益输送行为,未发现利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。  
公司按照《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》和《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》的规定对2013年报告期内所有投资组合间交易价差进行了分析,公司采集全部四个季度,不同时间窗口(日、3日、5日、日内)的同期内交易价差,在限定期限内交易价差为劣及劣%的数量水平下,同期内交易价差进行了分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析,分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同期内交易价差方面未出现异常。  
4.2.3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。  
基金管理人定期对报告期内公平交易情况的同期内交易价差、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。  
4.3基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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:2013年12月31日

资产	附注号	期末数 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
流动资产:			
银行存款	7.4.7.1	450,196,851.51	300,277,272.03
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	624,578,122.36	590,553,245.06
其中:短期融资券	-	-	-
基金投资	624,578,122.36	590,553,245.06	
资产支持证券	-	-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	380,001,490.00	199,000,538.50
应收证券清算款	-	-	20,880,286.30
应收利息	7.4.7.5	11,059,490.76	11,479,614.55
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	-	225,733,323.53
预付款项	-	-	152,360.00
其他应收款	7.4.7.6	1,691,569,288.16	1,122,343,317.34
资产总计		1,691,569,288.16	1,122,343,317.34
负债和所有者权益			
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	-	992.30
应付管理人报酬	-	364,164.87	300,143.68
应付托管费	-	110,352.98	93,982.95
应付销售服务费	-	275,842.45	234,957.31
应付交易费用	7.4.7.7	3,486,670.00	22,442.65
预收利息	-	-	-
应付利息	-	13,548.96	14,944.15
应付利润	-	4,879,522.69	3,151,619.27
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	7.4.7.8	89,000.01	89,014.83
负债合计		160,949,046.30	144,117,227.04
所有者权益			
实收基金	7.4.7.9	1,530,617,293.10	978,226,090.30
未分配利润	7.4.7.10	1,320,617,293.10	1,122,343,317.34
所有者权益合计		1,499,369,288.16	1,122,343,317.34

注:1.本报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,530,617,293.10份。  
2.本报告中资产、负债和所有者权益附注号为年度报告正文中对应的附注号,投资者想了解附注内容,应阅读载于基金管理人网站的年度报告正文。  
7.2利润分配  
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12月31日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		92,715,512.54	97,085,282.99
1.利息收入		79,397,610.03	81,124,662.03
其中:存款利息收入	7.4.7.11	19,527,988.96	18,581,527.40
债券利息收入		30,409,655.96	29,629,326.75
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产利息收入		28,459,987.11	11,913,711.88
其他利息收入	-	-	-
2.投资收益		4,000,671.51	5,961,316.96
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		4,000,671.51	5,961,316.96
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
其中:交易性金融资产	7.4.7.13	-	-
其他公允价值变动收益	7.4.7.13	-	-
4.其他收入(损失以“-”号填列)		250.00	-
减:一、费用		15,553,299.94	10,321,308.91
1.管理人报酬		4,000,671.51	3,795,888.84
2.托管费		1,636,576.57	1,150,260.20
3.销售服务费		4,091,416.81	2,875,650.52
4.交易费用		74.7.18	-
5.利息支出		4,143,402.27	2,128,397.77
其中:卖出回购金融资产支出		4,143,402.27	2,128,397.77
6.其他费用	7.4.7.19	381,242.02	371,148.58
二、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		67,062,212.60	46,764,574.08
减:所得税费用	-	-	-
三、净利润(净收益以“-”号填列)		67,062,212.60	46,764,574.08

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:2013年1月1日至2013年12月31日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)		978,226,090.30	-
二、本期综合收益总额		67,062,212.60	46,764,574.08
三、本期基金份额变动		552,391,202.80	-
其中:1.基金申购款		7,600,446,690.91	-
2.基金赎回款		-7,048,055,488.21	-
3.基金转换转入		-67,062,212.60	-
4.基金转换转出		-	-
5.期末所有者权益(基金净值)		1,530,617,293.10	1,122,343,317.34

7.4.2关联方交易

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12月31日

资产	附注号	期末数 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
流动资产:			
银行存款	7.4.7.1	450,196,851.51	300,277,272.03
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	624,578,122.36	590,553,245.06
其中:短期融资券	-	-	-
基金投资	624,578,122.36	590,553,245.06	
资产支持证券	-	-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	380,001,490.00	199,000,538.50
应收证券清算款	-	-	20,880,286.30
应收利息	7.4.7.5	11,059,490.76	11,479,614.55
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	-	225,733,323.53
预付款项	-	-	152,360.00
其他应收款	7.4.7.6	1,691,569,288.16	1,122,343,317.34
资产总计		1,691,569,288.16	1,122,343,317.34
负债和所有者权益			
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	-	992.30
应付管理人报酬	-	364,164.87	300,143.68
应付托管费	-	110,352.98	93,982.95
应付销售服务费	-	275,842.45	234,957.31
应付交易费用	7.4.7.7	3,486,670.00	22,442.65
预收利息	-	-	-
应付利息	-	13,548.96	14,944.15
应付利润	-	4,879,522.69	3,151,619.27
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	7.4.7.8	89,000.01	89,014.83
负债合计		160,949,046.30	144,117,227.04
所有者权益			
实收基金	7.4.7.9	1,530,617,293.10	978,226,090.30
未分配利润	7.4.7.10	1,320,617,293.10	1,122,343,317.34
所有者权益合计		1,499,369,288.16	1,122,343,317.34

注:1.本报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,530,617,293.10份。  
2.本报告中资产、负债和所有者权益附注号为年度报告正文中对应的附注号,投资者想了解附注内容,应阅读载于基金管理人网站的年度报告正文。  
7.2利润分配  
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12月31日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		92,715,512.54	97,085,282.99
1.利息收入		79,397,610.03	81,124,662.03
其中:存款利息收入	7.4.7.11	19,527,988.96	18,581,527.40
债券利息收入		30,409,655.96	29,629,326.75
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产利息收入		28,459,987.11	11,913,711.88
其他利息收入	-	-	-
2.投资收益		4,000,671.51	5,961,316.96
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		4,000,671.51	5,961,316.96
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
其中:交易性金融资产	7.4.7.13	-	-
其他公允价值变动收益	7.4.7.13	-	-
4.其他收入(损失以“-”号填列)		250.00	-
减:一、费用		15,553,299.94	10,321,308.91
1.管理人报酬		4,000,671.51	3,795,888.84
2.托管费		1,636,576.57	1,150,260.20
3.销售服务费		4,091,416.81	2,875,650.52
4.交易费用		74.7.18	-
5.利息支出		4,143,402.27	2,128,397.77
其中:卖出回购金融资产支出		4,143,402.27	2,128,397.77
6.其他费用	7.4.7.19	381,242.02	371,148.58
二、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		67,062,212.60	46,764,574.08
减:所得税费用	-	-	-
三、净利润(净收益以“-”号填列)		67,062,212.60	46,764,574.08

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:2013年1月1日至2013年12月3