

# 东方金账簿货币市场证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 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：二〇一七年一月二十一日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2017 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本基金管理人于 2016 年 11 月 16 日在指定媒介和本基金管理人网站发布《关于东方金账簿货币市场证券投资基金根据〈货币市场基金监督管理办法〉修订基金合同的公告》。上述公告可通过《中国证券报》、《证券时报》及东方基金管理有限责任公司网站查阅。修订后的基金合同、基金合同摘要、托管协议可通过东方基金管理有限责任公司网站查阅。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	3,576,628,575.59 份
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。

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	
下属分级基金的基金简称	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B
下属分级基金的交易代码	400005	400006
报告期末下属分级基金的份额总额	285,082,407.12 份	3,291,546,168.47 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年10月1日—2016年12月31日）	
	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B
1. 本期已实现收益	1,522,447.37	39,109,575.37
2. 本期利润	1,522,447.37	39,109,575.37
3. 期末基金资产净值	285,082,407.12	3,291,546,168.47

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

###### 东方金账簿货币 A

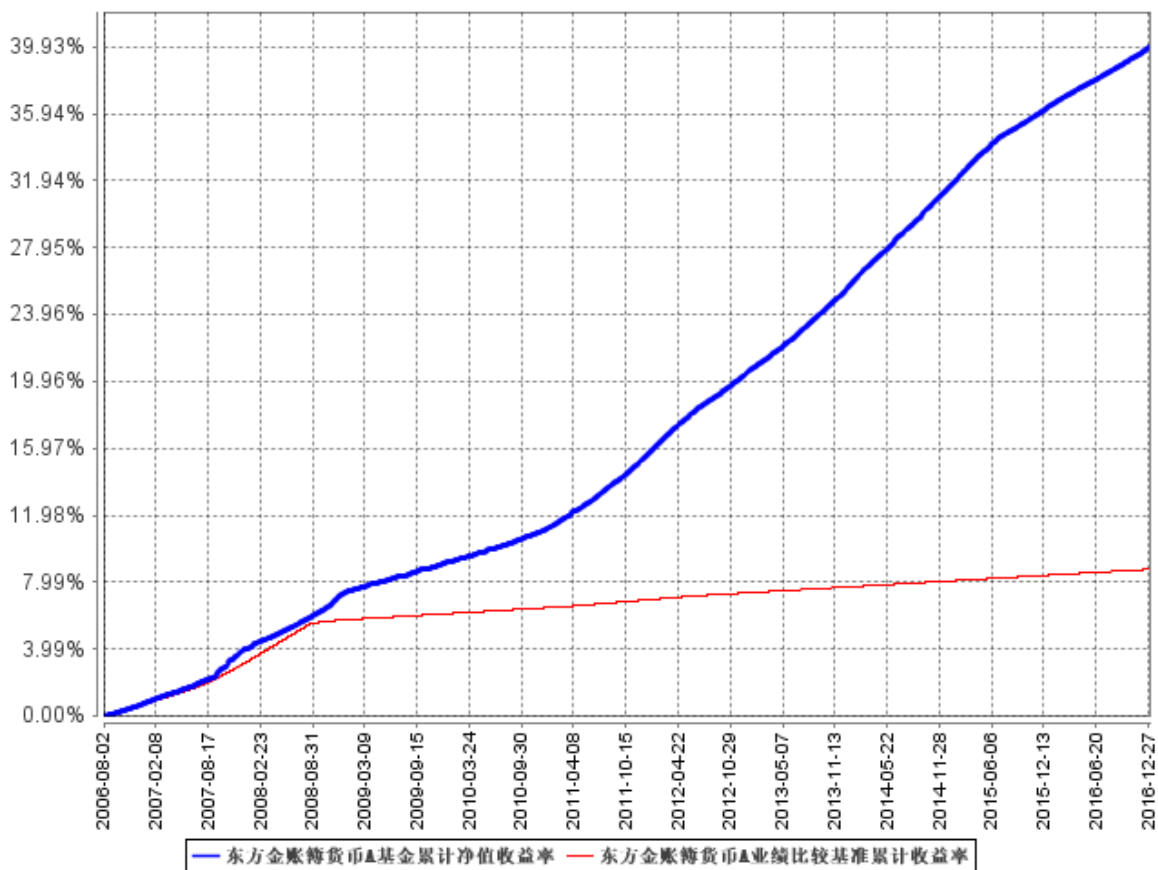
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7181%	0.0043%	0.0880%	0.0000%	0.6301%	0.0043%

###### 东方金账簿货币 B

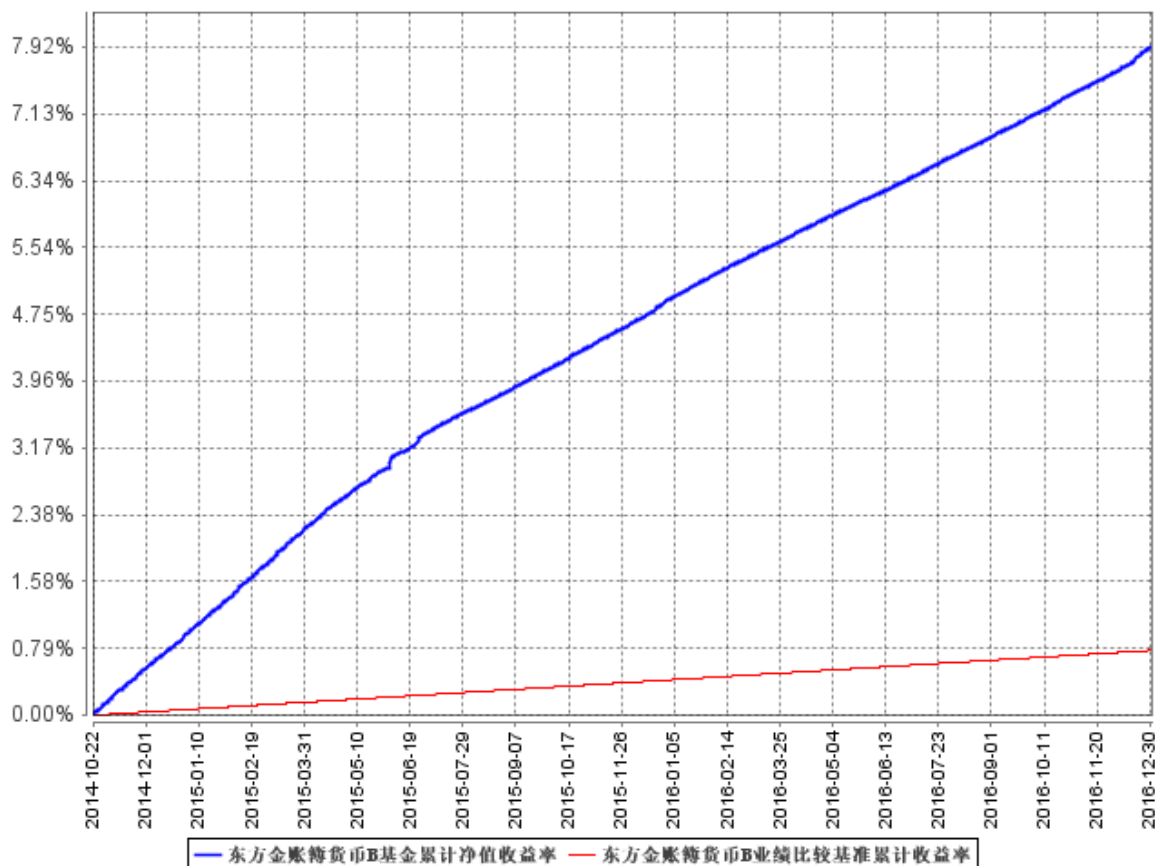
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7785%	0.0043%	0.0880%	0.0000%	0.6905%	0.0043%

### 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

东方金账簿货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方金账簿货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金每日分配收益，按月结转份额。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
姚航（女士）	本基金基金经理	2013年9月25日	-	12年	中国人民大学工商管理硕士，12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，现任东方金账簿货币市场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、东方新思路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、东方金元宝货币市场基金经理、东方金证通货币市场基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
周薇（女士）	本基金基金经理	2014 年 8 月 28 日	2016 年 11 月 3 日	7 年	北京大学金融学硕士，7 年证券从业经历，曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012 年 7 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任固定收益部债券研究员、投资经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理。现任东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理、东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金。

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合规守信情况的说明

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作基金资产，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 公平交易专项说明

#### 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内的公平交易程序；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 报告期内基金投资策略和运作分析

从基本面来看，2016 年四季度国内经济表现平稳，通胀中枢上移。海外市场方面，美国就业、通胀数据表现良好，特朗普提出的“基建、减税、贸易保护”等政策议题，大幅提升了全球风险偏好和通胀预期。从政策面来看，2016 年 12 月中央经济工作会议弱化经济增长目标，推动供给侧改革，弱化地产投资属性，防范资产泡沫。货币政策方面，17 年货币政策被定调为稳健中性，再提“流动性闸门”，央行态度边际收紧；财政政策方面，将更加积极有效，预算安排要

适应推进供给侧结构性改革、降低企业税费负担。

从债券市场来看，2016 年四季度债券市场波动较大，收益率大幅上行。10 月下旬，债券受广义理财可能纳入 MPA 考核以及资金面紧张的影响，收益率有所上行；11 月，债券市场继续调整，一方面资金面因素持续扰动，另一方面特朗普上台引发市场通胀预期，外盘债券收益率大幅度上行；12 月，债市迎来年内最大幅度下跌，中上旬央行对流动性支持不足，叠加货基、债基大规模赎回以及券商违约事件，市场出现踩踏，国债期货首现跌停，银行收紧对非银机构融资，市场进入暴跌、赎回、高估值甩券的负反馈中，10 年国开 160210 最高曾飙涨超过 3.9%，下旬随着央行提供流动性、证监会协调券商违约事件，债市情绪暂稳定，止跌回调。

报告期内，本基金规模也有所缩减，在极力做好流动性管理的同时抓住了四季末资金紧张的时点，重点配置了三个月、六个月的存款及存单，取得较好收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2016 年 10 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为 0.7181%，业绩比较基准收益率为 0.0880%，高于业绩比较基准 0.6301%；本基金 B 类净值增长率为 0.7785%，业绩比较基准收益率为 0.0880%，高于业绩比较基准 0.6905%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	1,740,709,581.02	48.55
	其中：债券	1,740,709,581.02	48.55
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,405,521,469.28	39.21
	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	424,960,100.66	11.85
4	其他资产	13,851,250.19	0.39
5	合计	3,585,042,401.15	100.00



## 5.2 报告期债券回购融资情况

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	8.00	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

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	2016 年 12 月 19 日	28.87	连续遭遇巨额赎回	2016-12-21
2	2016 年 12 月 20 日	55.68	连续遭遇巨额赎回	2016-12-21

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 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	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

### 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。

### 5.3.2 报告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	50.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	2.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	17.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

4	90 天(含)-120 天	12.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	8.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	91.29	-

#### 5.4 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。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	289,990,095.73	8.11
	其中：政策性金融债	289,990,095.73	8.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	314,945,513.55	8.81
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,135,773,971.74	31.76
8	其他	-	-
9	合计	1,740,709,581.02	48.67
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160204	16 国开 04	1,500,000	149,991,463.58	4.19
2	160414	16 农发 14	1,100,000	109,999,865.90	3.08
3	011699844	16 龙源电力 SCP007	1,000,000	99,963,956.90	2.79
4	111692335	16 东莞银行 CD018	1,000,000	99,911,224.68	2.79
5	111695302	16 大连农商行 CD047	1,000,000	99,892,150.90	2.79
6	111697722	16 珠海华润银行 CD019	1,000,000	99,312,955.80	2.78
7	111619102	16 恒丰银行 CD102	1,000,000	99,177,072.51	2.77

8	111692938	16 西安银行 CD007	1,000,000	98,978,688.10	2.77
9	111620155	16 广发银行 CD155	1,000,000	98,963,249.50	2.77
10	111695089	16 温州银行 CD089	1,000,000	98,374,768.22	2.75

### 5.7 “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	3
报告期内偏离度的最高值	0.0991%
报告期内偏离度的最低值	-0.3742%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0738%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
1	2016 年 12 月 19 日	-0.2747%	因四季度债券市场出现巨幅调整，并引发货币基金赎回潮。	2016-12-22
2	2016 年 12 月 20 日	-0.3742%	因四季度债券市场出现巨幅调整，并引发货币基金赎回潮。	2016-12-22
3	2016 年 12 月 21 日	-0.2570%	因四季度债券市场出现巨幅调整，并引发货币基金赎回潮。	2016-12-22

### 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。

### 5.8 报告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。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

#### 5.9.2

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查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	13,846,730.19
4	应收申购款	4,520.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,851,250.19

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方金账簿货币 A	东方金账簿货币 B
报告期期初基金份额总额	195,032,034.08	6,103,715,657.42
报告期期间基金总申购份额	245,079,855.00	5,516,789,458.18
报告期期间基金总赎回份额	155,029,481.96	8,328,958,947.13
报告期期末基金份额总额	285,082,407.12	3,291,546,168.47

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2016年12月 21日	78,000,000.00	78,000,000.00	0.00%
合计			78,000,000.00	78,000,000.00	

注：根据《东方金账簿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。

## §8 备查文件目录

### 8.1 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、基金份额净值及其临时公告

## 8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

## 8.3 查阅方式

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](http://www.orient-fund.com)）查阅。

东方基金管理有限责任公司  
2017 年 1 月 21 日