

东方金账簿货币市场证券投资基金

3.4.3 异常交易行为的专项说明  
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。  
基金管理人管理的投资组合参与的交易对手公允价值不存在同日反向交易,不存在同日反向交易成交较多的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。  
4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩变动情况的说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩变动情况  
2012年,海外发达经济体(美国、欧元区、日本)继续维持以刺激经济增长、发展中国  
家通过降息、降准松放货币政策,海外经济增长有所稳定。国内方面,货币政策以2011年  
的偏紧和中性,央行在上半年两次下调法定存款准备金率,两次下调存贷款基准利率,  
基于经济在下半年开始加速,经济增长在3季度见底,4季度明显回升,PPPI环比跌幅收窄,CPI  
受基础能源涨幅趋缓而下降。

一、本期所有者权益(基金净值)	536, 005, 95.95		536, 005, 95.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-13, 077, 726.95		-13, 077, 726.95
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)	-136, 607, 704.45		-136, 607, 704.45
其中:1.基金申购款	5, 188, 791, 340.73		5, 188, 791, 340.73
2.基金赎回款	-5, 325, 399, 045.18		-5, 325, 399, 045.18
四、本期基金份额持有人应分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-13, 077, 726.95		-13, 077, 726.95
五、期末所有者权益(基金净值)	400, 098, 253.50		400, 098, 253.50

2	资产支持证券	-	-
	买入返售金融资产	199,000,538.50	17.73
	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	300,277,272.93	26.75
4	其他各项资产	32,512,260.85	2.90
	合计	1,122,343,317.34	100.00

11.8 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。

东方基金管理有限公司  
二〇一三年三月二十七日

11.7.2 不报告期内本基金租用由券利率交易并未发生变更						金额单位：人民币元	
11.7.2.2 本基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况							
券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		
	成交金额	占当期债券成交比例	成交金额	占当期回购成交比例	成交金额	占当期权证成交比例	
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	
11.8 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。							
<p style="text-align: right;"> <b>东方基金管理有限责任公司</b>  <b>二〇一三年三月二十七日</b> </p>							