

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年八月二十八日

重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月26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预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告所载内容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。本报告同时列明会计师事务所名称。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况		中欧货币A	
基金简称		中欧货币A	
基金代码		160601A	
基金运作方式		定期开放开放式	
基金合同生效日		2012年12月12日	
基金管理人		中欧基金管理有限公司	
基金托管人		中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额		243,268,210.46	
基金合同存续期限		不定期	
下属两级基金的基金简称	中欧货币A	中欧货币B	
下属两级基金的交易代码	160601A	160601B	
报告期末下属分级基金的份额总额	31,715,596.08份	211,552,614.38份	

2.2 基金产品说明	
投资目标	在力争基金资产安全性和较高流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均期限限制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的风险收益特征,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于股票型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人		基金托管人	
名称	基金管理人	基金托管人	
姓名	中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名 联系电话 电子邮箱	021-68609600 liyihai@lcfunds.com	010-66105799 custody@icbc.com.cn
客户服务电话	021-68609700, 400-700-9700	95588	
传真	021-33830351	010-66105798	

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	www.lcfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

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	
报告期末(2013年1月1日至2013年6月30日)		中欧货币A	中欧货币B
本期已实现收益	1,367,235.79	6,525,248.33	
本期公允价值变动收益	1,367,235.79	6,525,248.33	
本期净收益	1,641.37	1,763.96	
3.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	中欧货币A	中欧货币B
期末基金份额净值	31,715,596.08	211,552,614.38	
期末基金份额净值	1,000	1,000	

注:1、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。

2、本基金净利润分配按结转后计算。

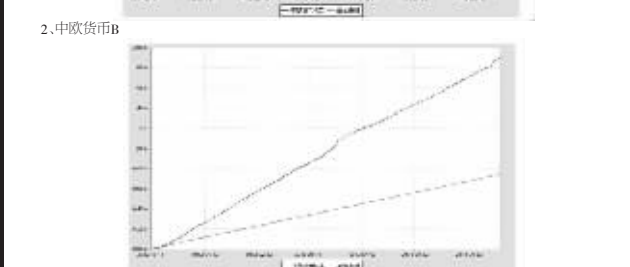
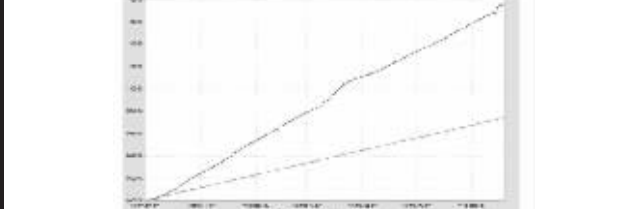
3、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数值。

3.2 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

1、中欧货币A:		阶段		份额净值收 益率①	净值收益差 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率差 标准差④	①-③	②-④
过去一个月		0.2785%	0.0074%	0.1110%	0.0000%	0.1675%	0.0074%		
过去三个月		0.7510%	0.0048%	0.3371%	0.0000%	0.4139%	0.0048%		
过去六个月		1.6413%	0.0046%	0.6717%	0.0000%	0.9696%	0.0046%		
自基金合同 生效起至今		1.7691%	0.0046%	0.7462%	0.0000%	1.0229%	0.0046%		
2、中欧货币B:		阶段		份额净值收 益率①	净值收益差 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率差 标准差④	①-③	②-④
过去一个月		0.2988%	0.0074%	0.1110%	0.0000%	0.1878%	0.0074%		
过去三个月		0.8118%	0.0048%	0.3371%	0.0000%	0.4747%	0.0048%		
过去六个月		1.7639%	0.0046%	0.6717%	0.0000%	1.0922%	0.0046%		
自基金合同 生效起至今		1.9052%	0.0046%	0.7462%	0.0000%	1.1590%	0.0046%		

注:1、本基金投资于现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款及大额存单、短期融资券、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、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、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券以及中国证监会、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。根据本基金的大类资产配置比例及其风险控制措施,我们预期未来,大额存单利率率(税后)作为现金的替代品。

2、本基金自合同生效以来,本基金基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同生效日为2012年12月12日,建仓期为2012年12月12日至2013年6月11日,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同规定。

2、截至本报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金情况简介

4.1.1 基金管理人及基金管理的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]102号文批准,于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券有限责任公司、北京百骏投资有限公司、万盛基业投资有限公司、上海资本管理有限公司。截至2013年6月30日,本基金管理人共管理14只开放式基金,即中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)、中欧新蓝筹300指数增强型证券投资基金(LOP)。

4.1.2 基金管理人及基金管理的经验

4.1.3 基金管理人及基金管理的经验

4.1.4 基金管理人及基金管理的经验

4.1.5 基金管理人及基金管理的经验

4.1.6 基金管理人及基金管理的经验

4.1.7 基金管理人及基金管理的经验

4.1.8 基金管理人及基金管理的经验

4.1.9 基金管理人及基金管理的经验

4.1.10 基金管理人及基金管理的经验

4.1.11 基金管理人及基金管理的经验

4.1.12 基金管理人及基金管理的经验

4.1.13 基金管理人及基金管理的经验

4.1.14 基金管理人及基金管理的经验

4.1.15 基金管理人及基金管理的经验

4.1.16 基金管理人及基金管理的经验

4.1.17 基金管理人及基金管理的经验

4.1.18 基金管理人及基金管理的经验

4.1.19 基金管理人及基金管理的经验

4.1.20 基金管理人及基金管理的经验

4.1.21 基金管理人及基金管理的经验

4.1.22 基金管理人及基金管理的经验

4.1.23 基金管理人及基金管理的经验

4.1.24 基金管理人及基金管理的经验

4.1.25 基金管理人及基金管理的经验

4.1.26 基金管理人及基金管理的经验

4.1.27 基金管理人及基金管理的经验

4.1.28 基金管理人及基金管理的经验

4.1.29 基金管理人及基金管理的经验

4.1.30 基金管理人及基金管理的经验

4.1.31 基金管理人及基金管理的经验

4.1.32 基金管理人及基金管理的经验

4.1.33 基金管理人及基金管理的经验

4.1.34 基金管理人及基金管理的经验

4.1.35 基金管理人及基金管理的经验

中欧货币市场基金

2013 半年度报告摘要

报告期内,本基金管理人严格按照本基金合同约定的估值委员会议事规则以及相关法律法规的规定,有效控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司运营副经理,成员包括总经理、督察长、投资总监、基金运营部总监、监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的研究、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,防止估值错误而给基金持有人产生不利损益。基金估值委员会负责估值数据的公允情况,向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金投资品种进行估值。具体估值流程为:基金日常估值由基金管理人进行,基金托管人依据基金合同约定的估值方法、时间、程序进行复核,基金估值净值由基金管理人估值后,将估值结果以XML形式发送给基金托管人,基金托管人复核无误后返回给基金管理人,由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内有关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金估值情况变化的说明

根据基金合同的约定,本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基础,为投资者每日计算当日收益并支付,每月集中支付,每月累计收益支付方式采用红利再投资(即红利转基金份额)方式。报告期内本基金A级份额持有人每份累计收益1,367,235.79元,向B级份额持有人分配利润6,525,248.33元。

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,本基金托管人在对中国货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全按照基金合同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,中欧货币市场基金的基金管理人在中欧货币市场基金的投资运作,每万份基金收益日年化收益率、基金利润分配、基金费用计提等方面上,严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全按照基金合同履行了基金托管人应尽的义务。

5.3 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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧货币市场基金2013年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、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:中欧货币市场基金
报告截止日:2013年6月30日

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
银行存款	107,529,780.36	1,041,816,882.54
结算备付金	913,636.36	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	50,078,092.46	-
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	50,078,092.46	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	75,400,291.60	484,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,453,196.45	748,217.65
应收股利	-	-
应收申购款	51,240,767.73	90,814,556.13
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	286,615,764.96	1,617,379,656.32

负债和所有者权益

负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	-	-
应付证券清算款	41,000,000.00	205,000,000.00
应付赎回款	2,038,685.76	2,084,739.23
应付管理人报酬	42,678.90	241,422.08
应付托管费	31,175.36	73,158.20
应付销售服务费	13,141.55	69,343.09
应付交易费用	9,407.36	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	212,265.37	46,694.80
负债合计	43,347,554.50	207,515,357.40
所有者权益:		
实收基金	243,268,210.46	1,409,864,298.92
未分配利润	-	-
所有者权益合计	243,268,210.46	1,409,864,298.92
负债和所有者权益总计	286,615,764.96	1,617,379,656.32

注:报告期末(2013年6月30日),中欧货币A基金份额净值1.000元,基金份额总额243,268,210.46份,其中中欧货币A类基金份额17,516,080份,中欧货币B类基金份额221,552,614.38份。

6.2 利润表

会计主体:中欧货币市场基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

资产	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上期 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	9,554,784.34	-
1.利息收入	8,964,137.26	-
其中:存款利息收入	4,471,511.92	-
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	530,497.08	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	530,497.08	-
资产支持证券投资收益	-	-
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)	60,150.00	-
减:一、费用	1,662,300.22	-
1.管理人报酬	769,051.92	-
2.托管费	233,046.05	-
3.销售服务费	123,705.06	-
4.交易费用	-	-
5.利息支出	292,216.67	-
其中:卖出回购金融资产支出	292,216.67	-
6.其他费用	244,280.52	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	7,892,484.12	-
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	7,892,484.12	-

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中欧货币市场基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上期 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)	1,409,864,298.92	-
二、本期经营投资产生的基金净值变动(本期利润)	7,892,484.12	-
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-1,166,596,088.46	-
其中:1.基金申购款	854,150,309.41	-
2.基金赎回款	-2,020,746,397.87	-
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)	-7,892,484.12	-
五、期末所有者权益(基金净值)	243,268,210.46	-

6.4 现金流量表

项目

一、期初所有者权益(基金净值)

二、本期经营投资产生的基金净值变动(本期利润)

三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)

其中:1.基金申购款

2.基金赎回款

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)

五、期末所有者权益(基金净值)

六、现金流量表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2006]102号文核准,于2006年7月18日正式成立,由中欧基金管理有限公司(以下简称“中欧基金”)管理,并由中欧基金管理有限公司(以下简称“中欧基金”)担任基金管理人,并由中欧基金管理有限公司(以下简称“中欧基金”)担任基金托管人,并由中欧基金管理有限公司(以下简称“中欧基金”)担任基金销售机构。

6.4.2 基金的投资目标

本基金的投资目标是:在力争基金资产安全性和较高流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的稳定收益。

6.4.3 基金的投资策略

本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均期限限制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的风险收益特征,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。

6.4.4 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

6.4.5 基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于股票型基金、混合型基金及股票型基金。

6.4.6 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.1 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.2 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.3 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.4 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.5 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.6 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.7 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.8 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.9 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.10 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.11 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.12 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.13 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.14 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.15 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.16 基金管理人及基金托管人的职责

6.4.6.17 基金管理人及基金托管人的职责