

## 中欧货币市场基金

## [2013] 第四季度报告

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:2014年1月21日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月17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。

基金过往业绩并不代表未来表现。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。

本基金目前无财务数据。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## § 1 基金产品概况

中欧货币

基金简称

166012 契约型开放式

基金合同生效日

2012年12月12日

报告期末基金份额总额

590,105,744.56份

投资目标

在力争基金安全性较高的流动性的基础上，追求超短期利率波动的绝对收益。

本基金将根据短期利率变化的预测，采用投资组合平均到期期限低于主动管理的投资策略，利用分析法和定性分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，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入。

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。

本基金收益风险较低，风险低于股票型基金、混合型基

金、债券型基金。

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

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

166011 166015

报告期末下属两级基金的份额总额

250,086,860.34份

250,086,860.34份

160,018,884.22份

## § 2 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2013年10月01日-2013年12月31日)

中欧货币A 中欧货币B

1.本期已实现收益

3,147,999.81 5,354,456.82

2.本期利润

3,147,999.81 5,354,456.82

3.期末基金资产净值

250,086,860.34

340,018,884.22份

注: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，本期即实现收益与本期利润相等。

3.2.1 本期每万份基金的份额净值收益及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.4% 中欧货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.3060% 0.0075% 0.3403% 0.0000% 0.9657% 0.0075%

注:本基金收益分配方式为红利转股。

2.4% 中欧货币B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.3670% 0.0075% 0.3403% 0.0000% 1.0267% 0.0075%

注:本基金收益分配方式为红利转股。

3.2.2 本基金成立以来以货币市场基金投资收益变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧货币市场基金 累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年12月12日-2013年12月31日)

1、中欧货币A

2、中欧货币B

注: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，建仓期结束后各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4.1 管理人报告

4.1.1 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

姚文輝 基金经理,中欧稳健增利分级债券型证券投资基金基金经理,中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理,中欧货币市场基金基金经理,中欧货币B基金经理,中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理,中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理,中欧货币基金经理。

2012年12月12日 - 6年 应用经济学专业硕士，历任基金经理，中欧基金管理有限公司基金经理，2011年8月加入中欧基金管理有限公司，历任中欧稳健增利分级债券型证券投资基金基金经理助理，中欧增利分级债券型证券投资基金基金经理助理，中欧增利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧增利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧增利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧增利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧增利分级债券型证券投资基金基金经理。

注:任职日期和离任日期一般情况下由公司作出决定之日，若该基金经理自基金合同生效之日起即担任，则任职日期为基金合同生效日。

2.2 从业人员的义务遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.2.3 本基金基金经理的个人情况

报告期内，本基金基金经理未按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等要求，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格执行控制公平交易原则，发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

4.3.2 非经常性交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人所有的投资组合不存在参与交易所公开竞价的各行业股票。

4.3.3 其他可能影响投资者决策的其他情况

报告期内，本基金基金经理未按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等要求，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格执行控制公平交易原则，发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

4.4 报告期内基金的业绩表现说明

本基金报告期内内申购、赎回或者买卖本基

金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## § 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

基金简称

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益

4,552,694.99

2.本期利润

-9,751,943.35

3.期初平均基金份额本期利润

-0.0183

4.期末基金份额净值

526,321.24

5.期末基金份额净值

1.041

注: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。

2.所述基金业绩指标不包括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将低于所

述的基金业绩指标。

3.2.1 本基金报告期内内申购、赎回或者买卖本基

金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## § 6 投资组合报告

6.1 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 129,962,582.76 20.26

其中:债券 129,962,582.76 20.26

2 买入返售金融资产 218,197,149.43 34.02

其中：买断式回购的买入返售金融资产 191,026,767.44 29.78

3 银行存款和结算备付金合计 273,195,583.23 42.61

4 其他资产 19,977,337.60 3.11

5 合计 641,456,653.02 100.00

注:1.任职日期和离任日期一般情况下由公司作出决定之日，若该基金经理自基金合同生效之日起即担任，则任职日期为基金合同生效日。

2.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比

率

阶段 净值增长(%) 净值增长(%) 业绩比较基准净值(%) 业绩比较基准净值(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.91% -2.68% 0.10% 0.77% -0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比

率

注:1.任职日期和离任日期一般情况下由公司作出决定之日，若该基金经理自基金合同生效之日起即担任，则任职日期为基金合同生效日。

2.所述基金业绩指标不包括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将低于所

述的基金业绩指标。

3.2.1 本基金报告期内内申购、赎回或者买卖本基

金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## § 7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

基金简称

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益

4,552,694.99

2.本期利润

-9,751,943.35

3.期初平均基金份额本期利润

-0.0183

4.期末基金份额净值

526,321.24

5.期末基金份额净值

1.041

注:1.任职日期和离任日期一般情况下由公司作出决定之日，若该基金经理自基金合同生效之日起即担任，则任职日期为基金合同生效日。

2.所述基金业绩指标不包括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将低于所

述的基金业绩指标。

3.2.1 本基金报告期内内申购、赎回或者买卖本基

金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## § 8 备查文件目录

1. 备查文件目录

2. 备查文件

3. 备查文件

4. 备查文件

5. 备查文件

6. 备查文件

7. 备查文件

8. 备查文件

9. 备查文件

10. 备查文件

11. 备查文件

12. 备查文件

13. 备查文件

14. 备查文件

15. 备查文件

16. 备查文件

17. 备查文件