中欧货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018年06月30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

送出日期:2018年08月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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2018年8月27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。

本半年度报告摘要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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中欧货币			
基金主代码	166014			
基金运作方式	契约型开放式			
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	11,720,729,739.03份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	中欧货币A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D
下属分级基金的交易代码	166014	166015	002747	002748
报告期末下属分级基金的份额总额	84,973,694.54份	11,053,227,647.25份	680,114.07份	581,848,283.17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,采用投资组合平均剩余期限控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债券型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		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	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	010-66105798
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700,400-700-9700	95588
传真		021-33830351	010-66105799

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.zofund.com
基金半年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)			
	中欧货币A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D
本期已实现收益	1,722,991.78	257,234,460.13	43,097.76	35,785,116.25
本期利润	1,722,991.78	257,234,460.13	43,097.76	35,785,116.25
本期净值收益率	1.8852%	2.0065%	1.8715%	2.0064%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)			
期末基金资产净值	84,973,694.54	11,053,227,647.25	680,114.07	581,848,283.17
期末基金份额净值	1.000	1.000	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A、B类份额利润分配按月结转份额,C、D类份额利润分配按日结转份额。

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字。

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

中欧货币A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2926%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.1816%	0.0006%
过去三个月	0.8905%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.5539%	0.0008%
过去六个月	1.8852%	0.0010%	0.6695%	0.0000%	1.2157%	0.0010%
过去一年	3.8619%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	2.5119%	0.0010%
过去三年	9.7255%	0.0023%	4.0500%	0.0000%	5.6755%	0.0023%
自基金合同生效日至今	22.3749%	0.0045%	7.4932%	0.0000%	14.8817%	0.0045%

中欧货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3125%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.2015%	0.0006%
过去三个月	0.9510%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.6144%	0.0008%
过去六个月	2.0065%	0.0010%	0.6695%	0.0000%	1.3370%	0.0010%
过去一年	4.1116%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	2.7616%	0.0010%
过去三年	10.5190%	0.0023%	4.0500%	0.0000%	6.4690%	0.0023%
自基金合同生效日至今	24.0176%	0.0045%	7.4932%	0.0000%	16.5244%	0.0045%

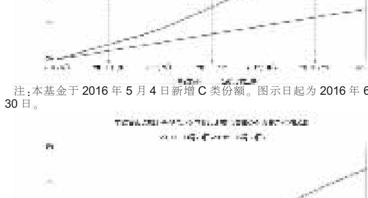
中欧货币C

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.2895%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.1785%	0.0008%
过去三个月	0.8760%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.5394%	0.0012%
过去六个月	1.8715%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	1.2020%	0.0013%
过去一年	3.8456%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	2.4956%	0.0012%
自基金份额运作日至今	7.0378%	0.0024%	2.8088%	0.0000%	4.2290%	0.0024%

中欧货币D

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3124%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.2014%	0.0006%
过去三个月	0.9509%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.6143%	0.0008%
过去六个月	2.0064%	0.0010%	0.6695%	0.0000%	1.3369%	0.0010%
过去一年	4.1115%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	2.7615%	0.0010%
自基金份额运作日至今	6.7541%	0.0022%	2.3994%	0.0000%	4.3547%	0.0022%

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



注:本基金于2016年5月4日新增C类份额。图示日起为2016年6月1日至2018年06月30日。

注:本基金于2016年5月4日新增D类份额。图示日期为2016年9月20日至2018年06月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会(证监基字[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合作公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东,注册资本为1.88亿元人民币,旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理(上海)有限公司、中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理73只开放式基金。

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	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
黄华	策略组负责人、基金经理	2017-03-24	-	9年	历任平安资产管理有限责任公司组合经理,中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理,中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责人。2016-11-10加入中欧基金管理有限公司,历任中欧基金管理有限公司基金经理助理
蒋雯文	基金经理	2018-01-30	-	6年	历任新际香港有限公司销售交易员,平安资产管理有限责任公司债券交易员,前海开源基金投资经理助理。2016-11-17加入中欧基金管理有限公司,历任中欧基金管理有限公司交易员、基金经理助理
王慧杰	基金经理助理	2017-09-26	-	6年	历任彭博咨询社(纽约)利率衍生品研发员;光大保德信基金管理有限公司研究员、基金经理。2017-04-17加入中欧基金管理有限公司
蒋雯文	基金经理助理	2017-06-22	2018-01-30	6年	历任新际香港有限公司销售交易员,平安资产管理有限责任公司债券交易员,前海开源基金投资经理助理。2016-11-17加入中欧基金管理有限公司,历任中欧基金管理有限公司交易员

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

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、根据公司安排,王慧杰自2018年8月13日起不再担任该产品的基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《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规定,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控制交易公平执行。在公平交易稽核审计过程中,针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况,我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析,并与基金经理进行了沟通确认,从最终结果看,造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同,股价波动等不可控因素,基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与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的5%的情况,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,全球政治经济环境、我国经济基本面和政策发生了一些明显的变化和转折。第一,从国际环境来看,中美贸易战明显升温,地缘政治风险加大。受外部压力的影响,国内经济增长下行压力增大,财政货币和监管政策都出现了相应的调整。与此同时,全球主要经济体经济增长出现了分化,美国经济保持超强劲增长,就业状况明显改善,消费者信心增强,但欧洲和日本则出现了放缓迹象。多方面因素的影响,净出口对经济增长的贡献在上半年两个季度扭转为负。

第二,上半年国内经济增长虽然仍表现出一定的韧性,但投资和消费增速出现了明显下滑。地产投资由于土地购置费的因素稳定在高位,但可持续性存疑。龙头房地产企业的销售数据仍然亮眼,但是同比增速开始回归理性,房产税正式提上政府工作报告,加上一线城市地产价格持续阴跌,也影响了未来地产投资增速的预期。上半年,中央政府对地方政府债务的控制力度逐步加大,PPP项目投放速度继续放缓,年初制定"清理地方政府隐形债务"的政策和"资管新规"对融资平台的非标融资收缩力度开始实质显现。基建投资增速明显下滑,甚至出现了个别月份的负增长迹象。

第三,财政、货币和监管政策出现了明显调整。首先,货币政策的方向出现了明显变化,流动性逐步确认转为"合理充裕"。为合理缓解春节因素导致银行体系流动性的波动,临时准备金动用安排(CRA)释放流动性近2万亿。年初普惠降准之后,央行在4月和6月两次进行了超预期的定向降准操作。与此同时,公开市场净投放力度开始明显加大,除4月下旬受缴税等影响银行间资金面阶段性紧张之外,银行间流动性进入全面宽松的状态。尽管银行间流动性充裕,实体经济的整体融资环境出现了紧缩和分化。社会融资存量同比增速在6月首次降至10%以内的水平。从结构上看,具备信贷融资能力的优质企业受益于银行体系流动性宽松和银行内部风险偏好的提升,融资环境边际改善。然而小微、民企和依赖于信托、委托贷款等非标融资的企业在监管政策的影响下,融资环境却出现了紧缩。其次,财政政策明显更加积极,减税、督促地方政府债专项债的加快发行。再次,监管政策出现了由急转缓的节奏。1月,监管政策短期之内密集出台。随后,受外部环境的压力,国内经济下行的压力,金融体系风险逐步积累的压力等多重因素并发影响,监管政策阶段性放缓,并且发布的资管新规和理财新规在安排上更为灵活,金融去杠杆的力度有所缓和。

债券市场运行方面,2018年上半年的市场环境可以总结为:第一,银行间流动性超预期宽松,非银体系流动性充裕。以3个月SHIBOR利率为代表的货币市场利率水平下行了65bp,一年期限AAA存单收益率也下行了60bp。第二,高低评级收益率分化,信用利差全面走扩,信用风险正在重新定价。降准之后,流动性宽松和风险偏好的降低驱使AAA高等级信用利差一直维持在较低位置。另一方面,随着低评级民企和部分资质偏弱城投主体不断爆发信用事件,并且受金融监管影响,融资渠道收紧,市场规避情绪明显,部分存在争议的个券遭到抛售,湖南、云南等部分已有风险暴露的地区的城投债券出现大幅折价成交现象。二季度权益市场的加速下跌,高额质押股权进行资本运作、同时实体经营又陷入困境的上市公司开始出现债务违约。第三,中美贸易战、地缘政治等因素的影响下,国内各类风险资产都出现比较大的波动,避险情绪升温,带动债券收益下行。中美利差虽然收窄至60bp的低位,并没有制约利率债进一步下行,投资的关注点逐步转移至国内。在这样的市场环境下,上半年债券市场出现了"牛陡"行情,期限利差扩大。年初最先确认的是资金面边际宽松,短端资产受到追捧,存单利率带动短端利率大幅下行。之后,随着中美贸易战升级,高风险资产价格调整,避险情绪升温,国内经济和金融数据明细走弱,央行超预期定向降准,货币政策确认转向,中长端收益率随之下行。10年国开债上半年下行60bp,5年AAA中票下行80bp。

因此在这样的市场环境下,货币类基金以风险管理为首位,尤其严控信用风险,组合主动减少信用债的投资,在投资存单和存款时,集中在五大国有行和股份制银行,主动规避可能存在地域风险的城商行。存单和存款收益率在年初,3月上旬和5月中下旬逐步接近阶段高点的过程中,组合逐步配置,并在管理好流动性和遵守法律法规、把握风险控制的前提下,尽可能拉长久期并加大配置力度。组合在日常中稳健操作,维持偏低杠杆水平,合理的剩余期限。在保持收益率稳定的同时为投资者提供了较高的流动性。此外,组合在资金面短期波动带来短期限存单和债券出现调整的时候,积极把握波段操作的交易机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A类份额净值收益率为1.8852%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%;B类份额净值收益率为2.0065%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%;C类份额净值收益率为1.8715%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%;D类份额净值收益率为2.0064%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,宏观经济方面,首先,中美贸易战和中美矛盾之间如何演绎将对国内经济走势和政策应对产生重大和深远的影响,进而影响包括汇率、权益、低风险资产等在内的整个金融市场。其次,增长和就业或将成为国内财政货币监管等各项政策制定的主要出发点。预计货币政策仍将维持宽松,并逐步引导广义信贷流向实体经济。财政政策更加积极,监管政策将阶段性放缓。在多重政策的配合下,预计实体经济融资环境将有所改善,优质企业在信贷和债券市场融资更为宽松,融资成本或将显著下行;地方政府实际债务和隐形债务爆发的风险降低;"小微"、"三农"等企业在央行多次降准和财政政策的配合下,融资环境或将有所改善。再次,面对外部压力,多重政策组合的合力对实体经济的拉动作用或需要一个等待的过程。社会融资总量余额增长的企稳和回升到合意水平,投资增速特别是基建投资增速的企稳将是经济和金融数据中重点关注的宏观指标。

对于货币市场,最为确定的是资金面的宽松大概率将持续。8月初,3m Shibor已经降至3.00%的水平,之前一次偏低的资金利率水平还是在16年的11月。银行间充裕的流动性水平或将继续推动债券市场收益率下行。从资金利率和1年期存单、债券收益率来看,1年期债券收益或已接近合理水平,货币基金需要主动把握配置的时点和节奏。货币市场基金收益率将明显下行。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定,有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理,成员包括总经理、督察长、投资总监、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评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可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,基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以XBRL形式报给基金托管人,基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人,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。报告期内相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历。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利润分配情况的说明

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准,为投资者每日计算当日收益并分配,A级、B级每月集中支付,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;C级、D级每日进行支付。报告期内本基金向A级份额持有人分配利润1,722,991.78元,向B级份额持有人分配利润257,234,460.13元,向C级份额持有人分配利润43,097.76元,向D级份额持有人分配利润35,785,116.25元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金无应说明预警信息。

§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欧货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》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,完全尽职尽责地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管理人--中欧基金管理有限公司在中欧货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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2018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:2018年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	5,587,868,015.92	3,439,426,405.19
结算备付金	-	-
存出保证金	6,738.64	12,449.55
交易性金融资产	4,925,417,123.50	4,616,105,485.03
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	4,895,417,123.50	4,616,105,485.03
资产支持证券投资	30,000,000.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,841,835,730.17	4,634,144,765.52
应收证券清算款	-	-
应收利息	65,226,173.47	51,517,201.81
应收股利	-	-
应收申购款	702,088.75	558,001.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	13,421,055,870.45	12,741,764,308.10
负债和所有者权益	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017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	1,692,195,821.71	519,976,780.03
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	1,265,577.16	110,204.72
应付管理人报酬	3,957,821.11	3,187,508.21
应付托管费	1,199,339.74	965,911.58
应付销售服务费	138,157.28	115,738.16
应付交易费用	206,386.35	111,085.91
应交税费	222,739.42	220,000.00
应付利息	822,833.31	393,462.43
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	317,455.34	340,500.00
负债合计	1,700,326,131.42	525,421,191.04
所有者权益:		
实收基金	11,720,729,739.03	12,216,343,117.06
未分配利润	-	-
所有者权益合计	11,720,729,739.03	12,216,343,117.06
负债和所有者权益总计	13,421,055,870.45	12,741,764,308.10

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.000元,基金份额总额11,720,729,739.03份。其中A类基金份额净值总额84,973,694.54份,B类基金份额总额11,053,227,647.25份,C类基金份额总额680,114.07份,D类基金份额总额581,848,283.17份。

6.2 利润表

会计主体:中欧货币市场基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入	335,700,905.24	77,743,399.15
1.利息收入	334,213,126.95	77,347,883.10
其中:存款利息收入	159,710,868.20	27,617,240.11
债券利息收入	101,896,779.10	16,937,151.99
资产支持证券利息收入	53,432.71	2,628,219.18
买入返售金融资产收入	72,552,046.94	30,165,271.82
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,487,778.29	395,516.05
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,487,778.29	395,516.05
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
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)	-	-
减:二、费用	40,915,239.32	9,297,764.63
1.管理人报酬	24,572,855.77	6,150,169.41
2.托管费	7,446,319.97	1,863,687.76
3.销售服务费	857,232.28	294,421.16
4.交易费用	94.16	225.15
5.利息支出	7,807,557.69	781,068.97
其中:卖出回购金融资产支出	7,807,557.69	781,068.97
6.税金及附加	1,103.68	-
7.其他费用	230,075.77	208,192.18
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	294,785,665.92	68,445,634.52
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	294,785,665.92	68,445,634.52

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:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	12,216,343,117.06	-	12,216,343,117.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	294,785,665.92	294,785,665.92
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)	-495,613,378.03	-	-495,613,378.03
其中:1.基金申购款	37,960,342,000.72	-	37,960,342,000.72
2.基金赎回款	-38,455,955,378.75	-	-38,455,955,378.75
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)	-	-294,785,665.92	-294,785,665.92
五、期末所有者权益(基金净值)	11,720,729,739.03	-	11,720,729,739.03
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,468,327,210.19	-	2,468,327,210.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,445,634.52	68,445,634.52
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)	2,218,155,496.82	-	2,218,155,496.82
其中:1.基金申购款	12,124,202,050.49	-	12,124,202,050.49
2.基金赎回款	-9,906,046,553.67	-	-9,906,046,553.67
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)	-	-68,445,634.52	-68,445,634.52
五、期末所有者权益(基金净值)	4,686,482,707.01	-	4,686,482,707.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

刘建平	杨毅	王音然
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

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[2012]1345号《关于核准中欧货币市场基金募集的批复》核准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,577,108,157.32元,经向中国证监会备案,《中欧货币市场基金基金合同》于2012年12月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,577,387,226.51份基金份额,包含认购资金利息折合279,069.19份基金份额,其中货币A的基金份额总额为597,867,438.95份,包含认购资金利息折合154,281.63份,货币B的基金份额总额为979,519,787.56份,包含认购资金利息折合124,787.56份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款、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。

本基金投资业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按7%、3%和2%的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司("中欧基金")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 债券交易

无。

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券	2,892,187,800.00	100.00%	-	-

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,572,855.77	6,150,169.41
其中:支付销售机构的客户维护费	157,918.42	110,802.81

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下:

H=E× 0.33%÷ 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,446,319.97	1,863,687.76

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E× 0.10%÷ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 中欧货币A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D	合计
中国工商银行股份有限公司	46,963.10	571.76	0.00	0.00	47,534.86
国都证券	3.62	0.00	0.00	0.00	3.62
中欧基金	32,220.14	632,426.35	2,633.62	93,493.54	760,773.65
合计	79,186.86	632,998.11	2,633.62	93,493.54	808,312.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 中欧货币A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D	合计
中国工商银行股份有限公司	42,326.91	189.66	0.00	0.00	42,516.57
国都证券	588.96	0.00	0.00	0.00	588.96
中欧基金	32,773.82	171,301.84	68.50	6,352.53	210,496.69
合计	75,689.69	171,491.50	68.50	6,352.53	253,602.22

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给基金管理人,再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和C类基金份额约定的销售服务费年费率为0.25%,B类基金份额和D类基金份额约定的销售服务费年费率为0.01%。销售服务费的计算公式为:

对应级别日销售服务费=前一日对应级别基金资产净值× 约定年费率/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	332,350,000.00	191,215.07
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧货币A

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2012年12月12日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

中欧货币B

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2012年12月12日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	5,211,819.32
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	5,211,819.32
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

中欧货币C

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2012年12月12日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

中欧货币D

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2012年12月12日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	22,599,108.34	157,065,576.01
报告期间申购/买入总份额	229,038.49	241,743,232.52
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	17,758,242.29	347,268,109.89
报告期末持有的基金份额	5,069,904.54	51,540,698.64
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.87%	61.12%

注:1、总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

2、本基金管理人于本报告期内通过中欧基金管理有限公司直销机构赎回本基金,适用费率严格遵守本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

截止本报告期期末,除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	868,015.92	41,412.52	412,751.29	49,149.40

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行同业利率/约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,692,195,821.71元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
130229	13国开29	2018-07-03	100.01	1,000,000	100,009,516.74
170207	17国开07	2018-07-02	100.01	1,349,000	134,920,097.52
170207	17国开07	2018-07-03	100.01	1,501,000	150,122,362.03
170410	17农发10	2018-07-02	100.03	2,800,000	280,076,436.29
189918	18贴现国债18	2018-07-03	99.84	500,000	49,920,497.20
111711505	17平安银行CD505	2018-07-05	99.29	76,000	7,545,832.19
111713098	17浙商银行CD098	2018-07-05	99.17	2,500,000	247,917,071.05
111803108	18农业银行CD108	2018-07-05	99.31	2,000,000	198,614,633.76
111806141	18交通银行CD141	2018-07-04	99.39	2,000,000	198,781,322.62
111806142	18交通银行CD142	2018-07-05	99.39	151,000	15,007,899.40
111809147	18浦发银行CD147	2018-07-04	99.39	41,000	4,075,015.78
111810244	18兴业银行CD244	2018-07-05	99.35	1,786,000	177,433,645.15
111810253	18兴业银行CD253	2018-07-05	99.28	1,000,000	99,275,177.56
111810263	18兴业银行CD263	2018-07-05	99.22	222,000	22,025,755.05
111811143	18平安银行CD143	2018-07-05	99.28	1,000,000	99,278,260.14
111817123	18光大银行CD123	2018-07-05	99.13	1,000,000	99,133,009.14
合计				18,926,000	1,884,136,531.62

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 公允价值

6.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项以及其他金融负债,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

6.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年06月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为4,925,417,123.50元,无属于第二层次、第三层次的余额(2017年12月31日:属于第二层次的余额为人民币4,616,105,485.03元,无划分为第一层次和第三层次的余额)。

6.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.10.1.2.3 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期末发生变动。

6.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

6.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2018年8月28日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	4,925,417,123.50	36.70
	其中:债券	4,895,417,123.50	36.48
	资产支持证券	30,000,000.00	0.22
2	买入返售金融资产	2,841,835,730.17	21.17
	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	5,587,868,015.92	41.64
4	其他各项资产	65,935,000.86	0.49
5	合计	13,421,055,870.45	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		3.62
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,692,195,821.71	14.44
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

7.3.2 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	30.44	14.44
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	34.77	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	43.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	5.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	113.94	14.44

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,920,497.20	0.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	665,128,412.58	5.67
	其中:政策性金融债	665,128,412.58	5.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,999,443.02	0.09
7	同业存单	4,170,368,770.70	35.58
8	其他	-	-
9	合计	4,895,417,123.50	41.77
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111812112	18北京银行CD112	5,000,000	497,637,612.00	4.25
2	111808161	18中信银行CD161	3,000,000	297,510,367.61	2.54
3	170207	17国开07	2,850,000	285,042,459.55	2.43
4	170410	17农发10	2,800,000	280,076,436.29	2.39
5	111808148	18中信银行CD148	2,500,000	248,472,983.76	2.12
6	111713098	17浙商银行CD098	2,500,000	247,917,071.05	2.12
7	111806141	18交通银行CD141	2,000,000	198,781,322.62	1.70
8	111810244	18兴业银行CD244	2,000,000	198,693,891.55	1.70
9	111803108	18农业银行CD108	2,000,000	198,614,633.76	1.69
10	111815244	18民生银行CD244	2,000,000	198,559,797.65	1.69

7.7 "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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0485%
报告期内偏离度的最低值	-0.0026%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0162%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1889112	18上和1A1	300,000	30,000,000.00	0.26

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.000元。

7.9.2 本基金投资的:1、18中信银行CD161(111808161.IB)和18中信银行CD148(111808148.IB)的发行主体中信银行于2017年11月24日发布的《关于中信银行股份有限公司公开发行申请文件反馈意见的回复》称,因涉嫌违反法律法规,中信银行及其部分控股子公司、分支机构受到中国银监会(包括中国银监会派出机构)及其他行政机构的处罚;2、18兴业银行CD244的发行主体兴业银行于2018年5月4号收到中国银行保险监督管理委员会发出的《行政处罚信息公开表》(银保监银罚决字[2018]1号)。兴业银行因重大关联交易未按规定审查审批且未像监管部门报告,非真实转让信贷资产,无授信额度或超授信额度办理同业业务,债券卖出回购业务违规出表等事项,依据《商业银行与内部人和股东关联交易管理办法》第六条、第八条、第二十二条、第二十五条、第四十二条、第四十四条,《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条等条例,被处以罚款5870万元。

在上述公告公布后,本基金管理人对该公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对以上3个证券的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。其余七名证券的发行主体本报告期内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、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,738.64
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	65,226,173.47
4	应收申购款	702,088.75
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	65,935,000.86

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因,投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
中欧货币A	49,322	1,722.84	26,206,393.54	30.84%	58,767,301.00	69.16%
中欧货币B	42	263,172,086.84	11,035,940,253.99	99.84%	17,287,393.26	0.16%
中欧货币C	97	7,011.49	241,238.93	35.47%	438,875.14	64.53%
中欧货币D	15	38,789,885.54	581,848,283.17	100.00%	-	-
合计	49,476	236,897.28	11,644,236,169.63	99.35%	76,493,569.40	0.65%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	保险类机构	3,373,180,924.94	28.78%
2	银行类机构	1,021,048,886.87	8.71%
3	银行类机构	1,003,424,443.12	8.56%
4	保险类机构	696,742,672.71	5.94%
5	基金类机构	506,900,224.78	4.32%
6	保险类机构	426,140,351.76	3.64%
7	保险类机构	400,856,525.24	3.42%
8	基金类机构	340,627,619.02	2.91%
9	保险类机构	315,323,209.80	2.69%
10	基金类机构	303,940,030.96	2.59%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧货币A	13.88	0.00%
	中欧货币B	-	-
	中欧货币C	1,171.51	0.17%
	中欧货币D	-	-
	合计	1,185.39	0.00%

注:截至本报告期末,本基金管理人从业人员持有本基金A类份额实际占比为0.0004%,持有本基金总份额的实际占比为0.000010%,上表展示的比例系四舍五入后的结果。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧货币A	0
	中欧货币B	0
	中欧货币C	0
	中欧货币D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧货币A	0
	中欧货币B	0
	中欧货币C	0
	中欧货币D	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	中欧货币A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D
基金合同生效日(2012年12月12日)基金份额总额	597,878,537.69	979,537,971.24	-	-
本报告期期初基金份额总额	86,667,077.95	11,770,092,014.94	241,197.34	359,342,826.83
本报告期基金总申购份额	118,273,028.68	31,471,104,642.16	27,627,424.40	6,343,336,905.48
减:本报告期基金总赎回份额	119,966,412.09	32,187,969,009.85	27,188,507.67	6,120,831,449.14
本报告期期末基金份额总额	84,973,694.54	11,053,227,647.25	680,114.07	581,848,283.17

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,为本基金审计的会计事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
川财证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注:1.根据中国证监会的有关规定,我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上,选择基金专用交易席位,并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内,本基金新增租用川财证券上海交易单元和中泰证券上海交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	2,892,187,800.00	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1.根据中国证监会的有关规定,我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上,选择基金专用交易席位,并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内,本基金新增租用川财证券上海交易单元和中泰证券上海交易单元。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年6月19日至2018年6月30日	1,356,592,883.03	5,068,439,003.10	3,051,850,961.19	3,373,180,924.94	28.83%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况,在市场情况突变的情况下,可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险,本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对,并在基金运作中对流动性进行严格的管理,降低流动性风险,保护中小投资者利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

中欧基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日