中欧货币市场基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月24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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧货币			
场内简称	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			
报告期末基金份额总额	16,156,555,659.18份			
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。			
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
下属分级基金场内简称	中欧货A	中欧货B	–	–
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	66,186,072.24份	15,749,230,628.96份	1,503,409.11份	339,635,548.87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(2018年07月01日 – 2018年09月30日)			
	中欧货币A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D
1.本期已实现收益	539,625.57	144,130,486.08	9,922.03	5,947,162.23
2.本期利润	539,625.57	144,130,486.08	9,922.03	5,947,162.23
3.期末基金资产净值	66,186,072.24	15,749,230,628.96	1,503,409.11	339,635,548.87

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

中欧货币A净值表现

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	0.7234%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.3831%	0.0010%

注:本基金收益分配按日结转份额。

中欧货币B净值表现

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	0.7845%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.4442%	0.0010%

注:本基金收益分配按日结转份额。

中欧货币C净值表现

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	0.7240%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.3837%	0.0011%

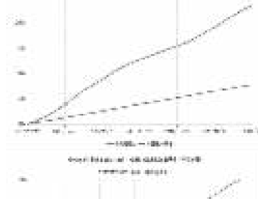
注:本基金收益分配按日结转份额。

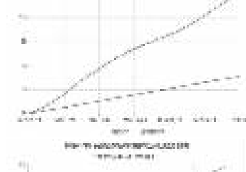
中欧货币D净值表现

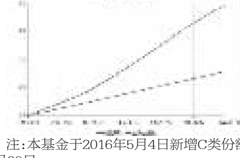
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7845%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.4442%	0.0010%

注:本基金收益分配按日结转份额。

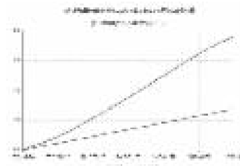
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较







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09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09月30日。

§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		
黄华	策略组负责人、基金经理	2017-03-24	2018-09-28	10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	–	7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

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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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,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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年三季度,全球政治经济环境、我国的经济基本面和宏观政策可以总结为以下几个方面:第一,全球经济增长和上半年相比,出现了小幅度放缓。从OECD经济领先指标和全球制造业PMI等领先指标来看,全球制造业边际上出现了走弱的迹象。主要经济体的增长维持着分化的状态。美国经济依然保持超强劲增长,就业状况明显改善,消费者信心增强。欧洲和日本则出现了放缓迹象。

第二,上半年开始的贸易摩擦对我国出口的实际影响尚未显现,出口增速屡次超投资者的预期。我们认为有多方面的原因:首先,美国经济的强劲增长,美国企业的主动补库存需求,对我国出口有拉动作用;其次,人民币对主要贸易国的贬值也能够很大程度上对冲关税提高带来的竞争力减弱,而提高关税目前还只发生在美国,对其他贸易国的出口在贬值的过程中反而收益;再次,我国出口的产品主要为初级工业品和来料加工产品,无论美国还是东盟国家,短时间内都没有足够的产能来替代。因此,在三季度,我们看到贸易战的影响更多在于投资者的心理预期和金融市场。

第三,内需放缓,地产和制造业投资依然不弱,基建投资仍在拖累,整体投资增速连续放缓。在本轮居民部门加杠杆到偏高水平之后,可支配收入的自然增长不足以支撑消费高水平增长。

第四,对于通货膨胀甚至滞涨的担忧卷土重来。担忧来自几个方面:首先,7月政治局常务会议提出财政政策更加积极,对于基建加码的预期拉动了黑色的上涨;其次,贸易摩擦和关税的正式落地,对于输入性通胀的预期升温;再次,寿光水灾和持续多发猪瘟,增加了对于食品项的担忧;最后,PPI中生活资料的增长引发了通胀传导的忧虑。

第五,货币政策的相对独立性,政策"稳健中性"和流动性"合理充裕"的深层意图得到了正确解析。美联储9月加息,央行再次并未跟随上调公开市场利率,体现了货币政策的相对独立性。多次下调存款准备金率,8-9月每月两次MLF,频繁通过公开市场操作平抑资金波动,体现了货币政策不紧;信贷增速、社会融资规模存量增速的合理水平,体现了货币政策不松。从银行间流动性来看,值得注意的是在8月上旬,隔夜和7天质押回购短期跌落在偏低水平,远低于公开市场利率和开盘利率,但随后出现了快速修正,DR007稳定高于公开市场政策利率。这一快速修正体现了流动性并不是"大水漫灌"的思维。市场逐步认知流动性"合理充裕"是资金利率在合理区间内保持平稳。

债券市场运行方面,2018年三季度的市场环境围绕着几条主线:第一,资金面平稳。可以说在整个三季度资金面没有过紧的时候。整体来看银行和非银体系流动性充裕,在个别时间点是过于充裕。由于以货币基金为代表的非银机构同向融出短期质押资金,交易拥挤导致7D回购利率长期在偏低水平。从市场利率来看,以3个月SHIBOR利率为代表的货币市场利率在三季度下行了130bp,3m AAA 存单下行了80bp到3%以内, 1Y AAA存单收益率也下行了70bp。再无4%以上的短期限高等级资产。

第二,信用风险发生了分化。首先,上半年担忧的融资平台系统性风险大幅降低。7月的政治局常务会议"保证在建项目的资金需求",给融资平台领域松了绑。其次,三季度的民企违约明显加速。尽管银保监会和央行几次提出要加大向短期出现融资困难的有前景有市场的民企的融资支持,民企实际上仍然面临融资渠道收紧的问题。尤其是内部现金流不佳,并且上市公司或控股股东发行人股票质押占比过高,严重依赖债券或非标等融资的企业,市场规避情绪明显,存在争议的个券遭到抛售。因此,在这样的环境下,低评级信用利差继续走扩。

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8月中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。

4.5 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0.7234%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%;B类份额净值收益率为0.7845%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%;C类份额净值收益率为0.7240%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%;D类份额净值收益率为0.7845%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§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	5,450,004,155.80	31.45
	其中:债券	5,442,789,155.80	31.41
	资产支持证券	7,215,000.00	0.04
2	买入返售金融资产	6,389,943,544.94	36.87
	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	5,433,584,530.44	31.35
4	其他资产	57,253,078.83	0.33
5	合计	17,330,785,310.01	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	–	2.10
	其中:买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	1,166,088,650.86	7.22
	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个交易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

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%。

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	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

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。

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	50.70	7.22
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	19.93	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	18.12	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	1.06	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	17.11	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	106.91	7.22

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。

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	609,642,712.20	3.77
2	央行票据	–	–
3	金融债券	260,818,085.25	1.61
	其中:政策性金融债	260,818,085.25	1.61
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	4,572,328,358.35	28.30
8	其他	–	–
9	合计	5,442,789,155.80	33.69
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.6 报告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

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	111882063	18宁波银行CD141	4,000,000	399,038,027.31	2.47
2	111710543	17兴业银行CD543	3,000,000	299,366,199.96	1.85
3	111717257	17光大银行CD257	3,000,000	299,341,885.49	1.85
4	111817027	18光大银行CD027	3,000,000	298,859,955.86	1.85
5	111820169	18广发银行CD169	3,000,000	298,554,684.49	1.85
6	111820172	18广发银行CD172	3,000,000	298,487,396.12	1.85
7	111818267	18华夏银行CD267	3,000,000	298,236,810.55	1.85
8	030009	03国债09	2,000,000	200,215,238.90	1.24
9	111810360	18兴业银行CD360	2,000,000	199,646,129.26	1.24
10	111803138	18农业银行CD138	2,000,000	197,227,481.61	1.22

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0715%
报告期内偏离度的最低值	0.0003%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0307%

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%。

5.8 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889112	18上和1A1	300,000	7,215,000.00	0.04

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,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。

5.9.2 本基金投资的17兴业银行CD543(111710543.IB)和18兴业银行CD543(111810360.IB)的发行主体兴业银行的郑州分行于2017年12月29日收到银保河南监管局行政处罚信息,其严重违反审慎经营规则,违反国家规定从事投资业务,河南银监局决定没收违法所得6588.246万元,并处1倍罚款,罚没合计1.31亿元,另对违反审慎经营规则违法行为罚款50万元。兴业银行股份有限公司青岛分行于2017年12月28日收到青岛银监局行政处罚信息,其违反国家规定从事投资活动,被青岛银监局予以警告,没收违法所得人民币1.16亿元,并处以1倍罚款人民币1.16亿元,罚没合计2.32亿元。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17兴业银行CD543(111710543.IB)和18兴业银行CD543(111810360.IB)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。其余九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。

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	57,253,078.83
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	其他	–
7	合计	57,253,078.83

5.9.4 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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	84,973,694.54	11,053,227,647.25	680,114.07	581,848,283.17
报告期期间基金总申购份额	14,703,816.49	12,265,244,339.09	1,420,652.55	1,307,978,217.45
报告期期间基金总赎回份额	33,491,438.79	7,569,241,357.38	597,357.51	1,550,190,951.75
报告期期末基金份额总额	66,186,072.24	15,749,230,628.96	1,503,409.11	339,635,548.87

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。

§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	红利再投	2018-07-02	1,716.26	1,716.26	0.0000
2	红利再投	2018-07-03	555.97	555.97	0.0000
3	红利再投	2018-07-04	538.23	538.23	0.0000
4	红利再投	2018-07-05	522.57	522.57	0.0000
5	红利再投	2018-07-06	537.52	537.52	0.0000
6	红利再投	2018-07-09	1,421.28	1,421.28	0.0000
7	红利再投	2018-07-10	511.31	511.31	0.0000
8	红利再投	2018-07-11	586.35	586.35	0.0000
9	红利再投	2018-07-12	446.35	446.35	0.0000
10	红利再投	2018-07-13	453.71	453.71	0.0000
11	红利再投	2018-07-16	1,367.96	1,367.96	0.0000
12	红利再投	2018-07-17	457.18	457.18	0.0000
13	红利再投	2018-07-18	503.38	503.38	0.0000
14	红利再投	2018-07-19	497.80	497.80	0.0000
15	申赎	2018-07-19	-9,986.00	-9,986.00	0.0150
16	红利再投	2018-07-20	462.62	462.62	0.0000
17	红利再投	2018-07-23	1,388.24	1,388.24	0.0000
18	红利再投	2018-07-24	461.95	461.95	0.0000
19	红利再投	2018-07-25	487.44	487.44	0.0000
20	红利再投	2018-07-26	450.77	450.77	0.0000
21	红利再投	2018-07-27	491.25	491.25	0.0000
22	红利再投	2018-07-30	1,389.28	1,389.28	0.0000
23	红利再投	2018-07-31	451.72	451.72	0.0000
24	红利再投	2018-08-01	455.31	455.31	0.0000
25	红利再投	2018-08-02	452.08	452.08	0.0000
26	红利再投	2018-08-03	564.79	564.79	0.0000
27	红利再投	2018-08-06	1,314.45	1,314.45	0.0000
28	红利再投	2018-08-07	436.04	436.04	0.0000
29	红利再投	2018-08-08	428.96	428.96	0.0000
30	红利再投	2018-08-09	511.90	511.90	0.0000
31	红利再投	2018-08-10	419.01	419.01	0.0000
32	红利再投	2018-08-13	1,289.76	1,289.76	0.0000
33	红利再投	2018-08-14	409.98	409.98	0.0000
34	红利再投	2018-08-15	449.35	449.35	0.0000
35	红利再投	2018-08-16	408.90	408.90	0.0000
36	红利再投	2018-08-17	414.02	414.02	0.0000
37	红利再投	2018-08-20	1,223.24	1,223.24	0.0000
38	红利再投	2018-08-21	378.56	378.56	0.0000
39	红利再投	2018-08-22	418.01	418.01	0.0000
40	红利再投	2018-08-23	407.07	407.07	0.0000
41	红利再投	2018-08-24	408.91	408.91	0.0000
42	红利再投	2018-08-27	1,203.56	1,203.56	0.0000
43	红利再投	2018-08-28	419.94	419.94	0.0000
44	红利再投	2018-08-29	400.27	400.27	0.0000
45	红利再投	2018-08-30	399.92	399.92	0.0000
46	红利再投	2018-08-31	398.35	398.35	0.0000
47	红利再投	2018-09-03	1,193.87	1,193.87	0.0000
48	红利再投	2018-09-04	394.65	394.65	0.0000
49	红利再投	2018-09-05	391.33	391.33	0.0000
50	红利再投	2018-09-06	389.76	389.76	0.0000
51	红利再投	2018-09-07	388.00	388.00	0.0000
52	红利再投	2018-09-10	1,166.16	1,166.16	0.0000
53	红利再投	2018-09-11	390.32	390.32	0.0000
54	红利再投	2018-09-12	388.15	388.15	0.0000
55	红利再投	2018-09-13	381.09	381.09	0.0000
56	红利再投	2018-09-14	381.70	381.70	0.0000
57	红利再投	2018-09-17	1,140.88	1,140.88	0.0000
58	红利再投	2018-09-18	372.04	372.04	0.0000
59	红利再投	2018-09-19	367.67	367.67	0.0000
60	红利再投	2018-09-20	364.93	364.93	0.0000
61	红利再投	2018-09-21	364.85	364.85	0.0000
62	红利再投	2018-09-25	1,462.77	1,462.77	0.0000
63	红利再投	2018-09-26	368.36	368.36	0.0000
64	红利再投	2018-09-27	377.77	377.77	0.0000
65	红利再投	2018-09-28	413.11	413.11	0.0000
合计			29,622.93	29,622.93	

注:本基金管理人运用固有资金申赎(包含转换)本基金所适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	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	持有份额	份额占比
机构	1	2018年07月01日至2018年07月19日;2018年07月27日至2018年07月29日;2018年08月22日至2018年09月30日	3,373,180,924.94	999,882,513.67	0.00	4,373,063,438.61	27.11%
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中欧货币市场基金相关批准文件

2、《中欧货币市场基金基金合同》

3、《中欧货币市场基金托管协议》

4、《中欧货币市场基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司
2018年10月24日

中欧滚钱宝发起式货币市场基金

2018年第三季度报告

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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2018年10月23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2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧滚钱宝货币		
基金主代码	001211		
基金运作方式	契约型、开放式、发起式		
基金合同生效日	2015年06月12日		
报告期末基金份额总额	84,498,233,627.02份		
投资目标	在综合考虑基金资产收益性、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7天通知存款税后利率		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	中欧滚钱宝货币A	中欧滚钱宝货币B	中欧滚钱宝货币C
下属分级基金的交易代码	001211	004938	004939
报告期末下属分级基金的份额总额	83,905,116,743.91份	475,097,468.30份	118,019,414.81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(2018年07月01日 – 2018年09月30日)		
	中欧滚钱宝货币A	中欧滚钱宝货币B	中欧滚钱宝货币C
1.本期已实现收益	669,126,199.83	4,601,986.89	1,273,355.16
2.本期利润	669,126,199.83	4,601,986.89	1,273,355.16
3.期末基金资产净值	83,905,116,743.91	475,097,468.30	118,019,414.81

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

中欧滚钱宝货币A净值表现

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	0.8652%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.5249%	0.0007%

注:本基金收益分配按日结转份额。

中欧滚钱宝货币B净值表现

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	0.9261%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.5858%	0.0007%

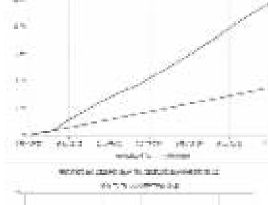
注:本基金收益分配按日结转份额。

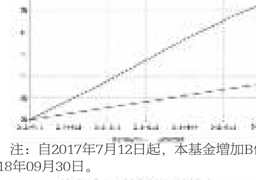
中欧滚钱宝货币C净值表现

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	0.8648%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.5245%	0.0007%

注:本基金收益分配按日结转份额。

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





注:自2017年7月12日起,本基金增加B份额。图示日期为2017年7月13日至2018年09月30日。

注:自2017年7月13日起,本基金增加C份额。图示日期为2017年7月14日至2018年09月30日。

§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		
黄华	策略组负责人、基金经理	2017-03-24	–	10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	–	7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	2018-08-13	–	7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,历任基金经理助理

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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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,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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年三季度,全球政治经济环境、我国的经济基本面和宏观政策可以总结为以下几个方面:第一,全球经济增长和上半年相比,出现了小幅度放缓。从OECD经济领先指标和全球制造业PMI等领先指标来看,全球制造业边际上出现了走弱的迹象。主要经济体的增长维持着分化的状态。美国经济依然保持超强劲增长,就业状况明显改善,消费者信心增强。欧洲和日本则出现了放缓迹象。

第二,上半年开始的贸易摩擦对我国出口的实际影响尚未显现,出口增速屡次超投资者的预期。我们认为有多方面的原因:首先,美国经济的强劲增长,美国企业的主动补库存需求,对我国出口有拉动作用;其次,人民币对主要贸易国的贬值也能够很大程度上对冲关税提高带来的竞争力减弱,而提高关税目前还只发生在美国,对其他贸易国的出口在贬值的过程中反而收益;再次,我国出口的产品主要为初级工业品和来料加工产品,无论美国还是东盟国家,短时间内都没有足够的产能来替代。因此,在三季度,我们看到贸易战的影响更多在于投资者的心理预期和金融市场。

第三,内需放缓,地产和制造业投资依然不弱,基建投资仍在拖累,整体投资增速连续放缓。在本轮居民部门加杠杆到偏高水平之后,可支配收入的自然增长不足以支撑消费高水平增长。

第四,对于通货膨胀甚至滞涨的担忧卷土重来。担忧来自几个方面:首先,7月政治局常务会议提出财政政策更加积极,对于基建加码的预期拉动了黑色的上涨;其次,贸易摩擦和关税的正式落地,对于输入性通胀的预期升温;再次,寿光水灾和持续多发猪瘟,增加了对于食品项的担忧;最后,PPI中生活资料的增长引发了通胀传导的忧虑。

第五,货币政策的相对独立性,政策"稳健中性"和流动性"合理充裕"的深层意图得到了正确解析。美联储9月加息,央行再次并未跟随上调公开市场利率,体现了货币政策的相对独立性。多次下调存款准备金率,8-9月每月两次MLF,频繁通过公开市场操作平抑资金波动,体现了货币政策不紧;信贷增速、社会融资规模存量增速的合理水平,体现了货币政策不松。从银行间流动性来看,值得注意的是在8月上旬,隔夜和7天质押回购短期跌落在偏低水平,远低于公开市场利率和开盘利率,但随后出现了快速修正,DR007稳定高于公开市场政策利率。这一快速修正体现了流动性并不是"大水漫灌"的思维。市场逐步认知流动性"合理充裕"是资金利率在合理区间内保持平稳。

债券市场运行方面,2018年三季度的市场环境围绕着几条主线:第一,资金面平稳。可以说在整个三季度资金面没有过紧的时候。整体来看银行和非银体系流动性充裕,在个别时间点是过于充裕。由于以货币基金为代表的非银机构同向融出短期质押资金,交易拥挤导致7D回购利率长期在偏低水平。从市场利率来看,以3个月SHIBOR利率为代表的货币市场利率在三季度下行了130bp,3m AAA 存单下行了80bp到3%以内, 1Y AAA存单收益率也下行了70bp。再无4%以上的短期限高等级资产。

第二,信用风险发生了分化。首先,上半年担忧的融资平台系统性风险大幅降低。7月的政治局常务会议"保证在建项目的资金需求",给融资平台领域松了绑。其次,三季度的民企违约明显加速。尽管银保监会和央行几次提出要加大向短期出现融资困难的有前景有市场的民企的融资支持,民企实际上仍然面临融资渠道收紧的问题。尤其是内部现金流不佳,并且上市公司或控股股东发行人股票质押占比过高,严重依赖债券或非标等融资的企业,市场规避情绪明显,存在争议的个券遭到抛售。因此,在这样的环境下,低评级信用利差继续走扩。

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8月中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。

4.5 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0.8652%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%;B类份额净值收益率为0.9261%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%;C类份额净值收益率为0.8648%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§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	18,681,931,280.74	21.67
	其中:债券	18,681,931,280.74	21.67
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	10,884,485,223.26	12.63
	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	56,154,099,550.05	65.15
4	其他资产	472,506,074.71	0.55
5	合计	86,193,022,128.76	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	–	2.23
	其中:买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	1,653,991,079.01	1.96
	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个交易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

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%。

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	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

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。

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	25.33	1.96
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	15.13	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	9.74	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	1.11	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	50.13	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	101.45	1.96

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。

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	1,158,131,748.73	1.37
2	央行票据	–	–
3	金融债券	3,107,046,764.94	3.68
	其中:政策性金融债	3,107,046,764.94	3.68
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	14,416,752,767.07	17.06
8	其他	–	–
9	合计	18,681,931,280.74	22.11
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.6 报告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

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	180207	18国开07	15,100,000	1,513,239,952.76	1.79
2	111897162	18广州农村商业银行CD021	10,000,000	994,531,367.25	1.18
3	111897054	18广州农村商业银行CD019	8,700,000	865,344,521.21	1.02
4	180201	18国开01	6,600,000	662,021,099.20	0.78
5	111803138	18农业银行CD138	6,500,000	641,046,828.10	0.76
6	189935	18贴现国债35	5,000,000	499,113,520.15	0.59
7	111803127	18农业银行CD127	5,000,000	495,260,596.73	0.59
8	111805181	18建设银行CD181	5,000,000	493,190,798.14	0.58
9	111808205	18中信银行CD205	5,000,000	493,068,561.18	0.58
10	111818248	18华夏银行CD248	5,000,000	493,039,777.63	0.58

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0978%
报告期内偏离度的最低值	0.0364%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0528%

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%

5.8 报告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

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,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。

5.9.2 本基金投资的前十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。

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	471,604,147.74
4	应收申购款	901,926.97
5	其他应收款	–
6	其他	–
7	合计	472,506,074.71

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	中欧滚钱宝货币A	中欧滚钱宝货币B	中欧滚钱宝货币C
报告期期初基金份额总额	68,528,762,826.46	521,441,279.96	169,305,482.39
报告期期间基金总申购份额	253,068,166,433.41	9,601,986.89	73,947,076.79
报告期期间基金总赎回份额	237,691,812,515.96	55,945,798.55	125,233,144.37
报告期期末基金份额总额	83,905,116,743.91	475,097,468.30	118,019,414.81

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。

§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	红利再投	2018-07-02	0.66	0.66	0.0000
2	红利再投	2018-07-03	0.33	0.33	0.0000
3	红利再投	2018-07-04	0.32	0.32	0.0000
4	红利再投	2018-07-05	0.32	0.32	0.0000
5	红利再投	2018-07-06	0.33	0.33	0.0000
6	红利再投	2018-07-09	0.96	0.96	0.0000
7	红利再投	2018-07-10	0.32	0.32	0.0000
8	红利再投	2018-07-11	0.31	0.31	0.0000
9	红利再投	2018-07-12	0.31	0.31	0.0000
10	红利再投	2018-07-13	0.31	0.31	0.0000
11	红利再投	2018-07-16	0.93	0.93	0.0000
12	红利再投	2018-07-17	0.31	0.31	0.0000
13	红利再投	2018-07-18	0.32	0.32	0.0000
14	红利再投	2018-07-19	0.31	0.31	0.0000
15	红利再投	2018-07-20	0.31	0.31	0.0000
16	红利再投	2018-07-23	0.93	0.93	0.0000
17	红利再投	2018-07-24	0.31	0.31	0.0000
18	红利再投	2018-07-25	0.31	0.31	0.0000
19	红利再投	2018-07-26	0.31	0.31	0.0000
20	红利再投	2018-07-27	0.31	0.31	0.0000
21	红利再投	2018-07-30	0.93	0.93	0.0000
22	红利再投	2018-07-31	0.31	0.31	0.0000
23	红利再投	2018-08-01	0.31	0.31	0.0000
24	红利再投	2018-08-02	0.32	0.32	0.0000
25	红利再投	2018-08-03	0.31	0.31	0.0000
26	红利再投	2018-08-06	0.91	0.91	0.0000
27	红利再投	2018-08-07	0.30	0.30	0.0000
28	红利再投	2018-08-08	0.30	0.30	0.0000
29	红利再投	2018-08-09	0.30	0.30	0.0000
30	红利再投	2018-08-10	0.30	0.30	0.0000
31	申赎	2018-08-10	5,000,000.00	5,000,000.00	0.0000
32	红利再投	2018-08-13	1,517.21	1,517.21	0.0000
33	红利再投	2018-08-14	513.72	513.72	0.0000
34	红利再投	2018-08-15	497.29	497.29	0.0000
35	红利再投	2018-08-16	496.13	496.13	0.0000
36	红利再投	2018-08-17	486.31	486.31	0.0000
37	红利再投	2018-08-20	1,454.33	1,454.33	0.0000
38	红利再投	2018-08-21	486.42	486.42	0.0000
39	红利再投	2018-08-22	485.22	485.22	0.0000
40	红利再投	2018-08-23	488.86	488.86	0.0000
41	红利再投	2018-08-24	487.95	487.95	0.0000
42	红利再投	2018-08-27	1,478.90	1,478.90	0.0000
43	红利再投	2018-08-28	488.05	488.05	0.0000
44	红利再投	2018-08-29	489.46	489.46	0.0000
45	申赎	2018-08-29	327.00	327.00	0.0000
46	申赎	2018-08-29	-327.00	-327.00	0.0000
47	红利再投	2018-08-30	493.26	493.26	0.0000
48	申赎	2018-08-30	153.00	153.00	0.0000
49	申赎	2018-08-30	-153.00	-153.00	0.0000
50	红利再投	2018-08-31	490.36	490.36	0.0000
51	申赎	2018-08-31	99.00	99.00	0.0000
52	申赎	2018-08-31	-99.00	-99.00	0.0000
53	红利再投	2018-09-03	1,455.50	1,455.50	0.0000
54	申赎	2018-09-03	71.00	71.00	0.0000
55	申赎	2018-09-03	-71.00	-71.00	0.0000
56	红利再投	2018-09-04	482.65	482.65	0.0000
57	申赎	2018-09-04	36.00	36.00	0.0000
58	申赎	2018-09-04	-36.00	-36.00	0.0000
59	红利再投	2018-09-05	482.56	482.56	0.0000
60	申赎	2018-09-05	9.00	9.00	0.0000
61	申赎	2018-09-05	-9.00	-9.00	0.0000
62	红利再投	2018-09-06	478.78	478.78	0.0000
63	申赎	2018-09-06	8.00	8.00	0.0000
64	申赎	2018-09-06	-8.00	-8.00	0.0000
65	红利再投	2018-09-07	473.68	473.68	0.0000
66	红利再投	2018-09-10	1,415.21	1,415.21	0.0000
67	申赎	2018-09-10	12.00	12.00	0.0000
68	申赎	2018-09-10	-12.00	-12.00	0.0000
69	红利再投	2018-09-11	469.97	469.97	0.0000
70	申赎	2018-09-11	8.00	8.00	0.0000
71	申赎	2018-09-11	-8.00	-8.00	0.0000
72	红利再投	2018-09-12	470.40	470.40	0.0000
73	申赎	2018-09-12	19.00	19.00	0.0000
74	申赎	2018-09-12	-19.00	-19.00	0.0000
75	红利再投	2018-09-13	468.71	468.71	0.0000
76	红利再投	2018-09-14	467.21	467.21	0.0000
77	申赎	2018-09-14	8.00	8.00	0.0000
78	申赎	2018-09-14	-8.00	-8.00	0.0000
79	红利再投	2018-09-17	1,390.45	1,390.45	0.0000
80	红利再投	2018-09-18	460.53	460.53	0.0000
81	红利再投	2018-09-19	457.21	457.21	0.0000
82	申赎	2018-09-19	10.00	10.00	0.0000
83	申赎	2018-09-19	-10.00	-10.00	0.0000
84	红利再投	2018-09-20	455.39	455.39	0.0000
85	申赎	2018-09-20	10.00	10.00	0.0000
86	申赎	2018-09-20	-10.00	-10.00	0.0000
87	红利再投	2018-09-21	454.57	454.57	0.0000
88	申赎	2018-09-21	10.00	10.00	0.0000
89	申赎	2018-09-21	-10.00	-10.00	0.0000
90	红利再投	2018-09-25	1,814.53	1,814.53	0.0000
91	申赎	2018-09-25	15.00	15.00	0.0000
92	申赎	2018-09-25	-15.00	-15.00	0.0000
93	红利再投	2018-09-26	457.09	457.09	0.0000
94	申赎	2018-09-26	335.00	335.00	0.0000
95	申赎	2018-09-26	-335.00	-335.00	0.0000
96	红利再投	2018-09-27	449.92	449.92	0.0000
97	申赎	2018-09-27	193.00	193.00	0.0000
98	申赎	2018-09-27	-193.00	-193.00	0.0000
99	红利再投	2018-09-28	447.27	447.27	0.0000
100	申赎	2018-09-28	125.00	125.00	0.0000
101	申赎	2018-09-28	-125.00	-125.00	0.0000
合计			5,023,417.91	5,023,417.91	

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立已满三年,本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中欧滚钱宝发起式货币市场基金相关批准文件

2、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金合同》

3、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金托管协议》

4、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:客户服务中心电话:021-68609700,400-700-9700

中欧基金管理有限公司
2018年10月24日