中欧滚钱宝发起式货币市场基金

2018年第4季度报告

2018年12月31日

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:2019年01月22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2019年1月21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10月01日起至2018年12月31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	94,537,887,958.66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	中欧滚钱宝货	中欧滚钱宝货

	币A	币B	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	94,418,285,192.74份	8,817,811.23份	110,784,954.69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10月01日 - 2018年12月31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	642,871,453.83	1,572,528.98	858,581.97
2.本期利润	642,871,453.83	1,572,528.98	858,581.97
3.期末基金资产净值	94,418,285,192.74	8,817,811.23	110,784,954.69

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	0.7363%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.3960%	0.0002%

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	0.7962%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.4559%	0.0002%

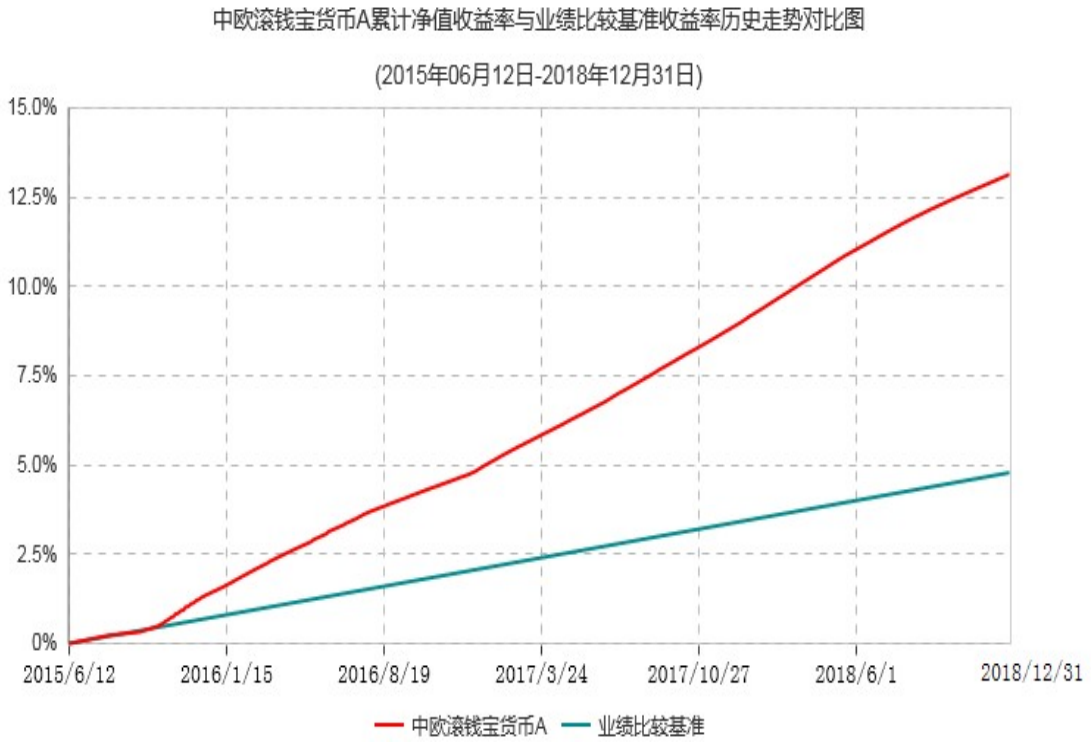
注：本基金收益分配按日结转份额。

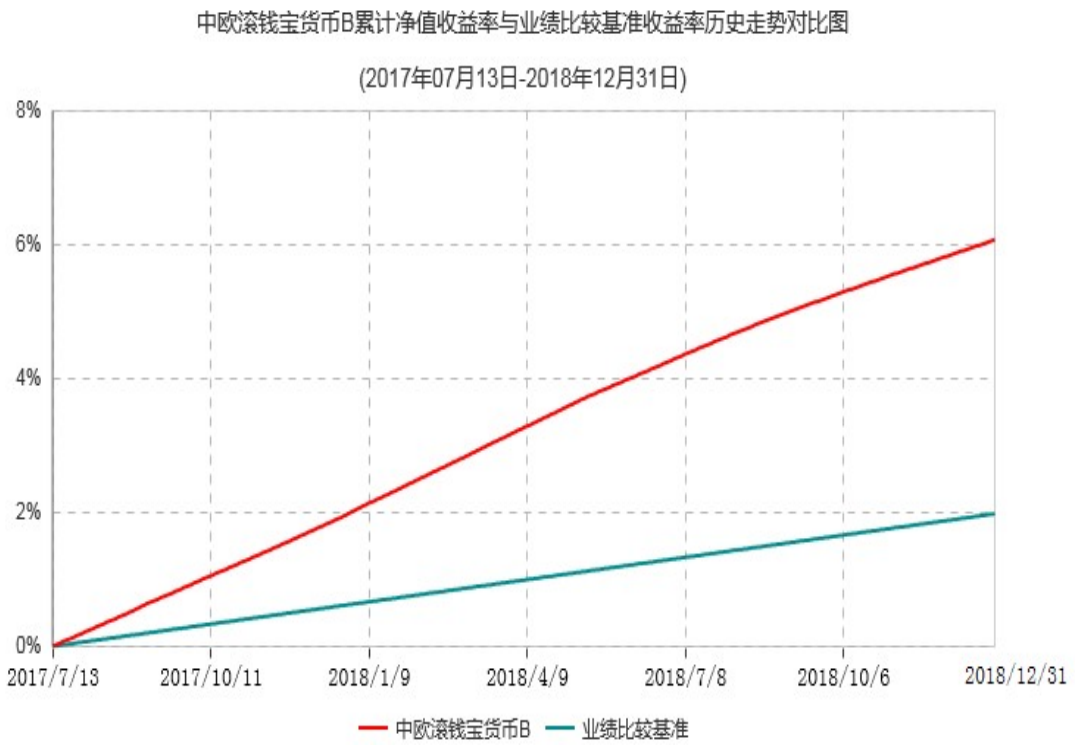
中欧滚钱宝货币C净值表现

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	0.7361%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.3958%	0.0002%

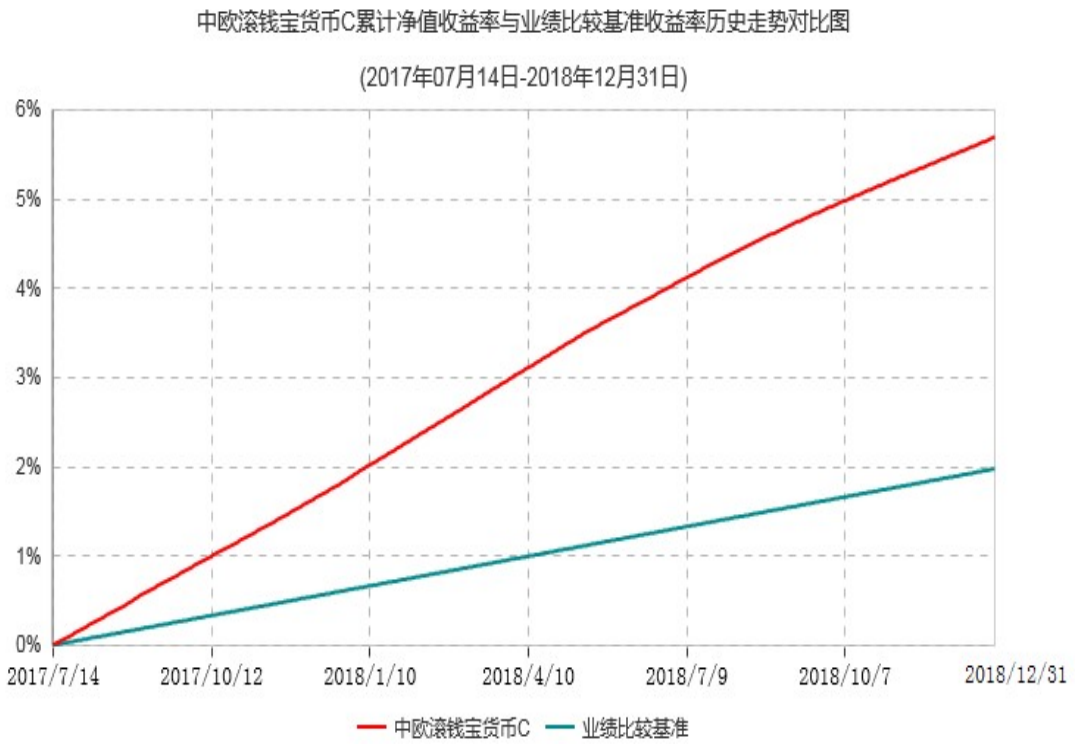
注：本基金收益分配按日结转份额。

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 12 月 31 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 12 月 31 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		
王慧杰	基金经理	2018-08-13	-	7	历任彭博咨询社（纽约）利率衍生品研发员（2009.06-2011.08），光大保德信基金管理有限公司研究员、基金经理（2011.08-2017.04）。2017-04-17加入中欧基金管理有限公司，历任基金经理助理
蒋雯文	基金经理	2018-01-30	-	7	历任新际香港有限公司销售交易员（2009.06-2011.07），平安资产管理有限责任公司债券交易员（2013.09-2016.05），前海开源基金投资经理助理（2016.09-2016.10）。2016-11-17加入中欧基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理
黄华	策略组负责人、基金经理	2017-03-24	-	10	历任平安资产管理有限责任公司组合经理（2008.08-2012.06），中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理（2012.09-2014.07），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（2014.07-2016.11）。2016-

					11-10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年四季度，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，全球经济增长延续了小幅度放缓的态势。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。一个重大的变化是美联储主席的表态释放了鸽派信号，美联储加息的预期次数降低，货币政策紧缩进程预期放缓。

第二，国内经济基本面发生了一些边际变化。首先是地产在三季度末四季度初出现了拐点。地产投资增速出现了下滑，销售出现了放缓迹象，百城未成交土地数量上升，成交土地溢价率下降都预示了行业景气度的下降。其次是基建投资，在三季度基金投资出现了单月的同比负增长，四季度单月增速明显改善，政策稳增长的效果开始显现。再次是出口，11月出口增速出现了断崖式下跌。前三季度出口增速屡次超出投资者的预期。出口增速的下滑持续性还有

待观察，但全球经济增长放缓和中美贸易摩擦的缓和，基本确定了出口增速下滑的方向。其他方面，四季度制造业投资依然强劲增长，消费如期回落，工业生产放缓。由于支撑着经济增长的地产和出口出现了明显放缓，对于经济增长的预期更为悲观。

第三，通胀预期四季度也出现了明显变化。前三季度因为多重原因，对通货膨胀甚至滞涨出现了几次担忧。四季度由于国际油价的明显下挫，叠加经济增长放缓，对通胀的担忧明显缓解。

第四，货币政策基调延续，银行间流动性保持充裕。央行10月再次降准，MLF到期等额续作。但由于MPA考核等因素的影响，跨年资金仍然出现阶段冲高的现象。

债券市场运行方面，2018年四季度的债券市场值得关注的地方有以下几方面：第一，四季度股债跷跷板效应明显，股市下跌成为债券收益率下行的催化剂。第二，美联储鸽派表态，美债收益率下行，打开了我国利率债收益率下行的空间。第三，从机构投资者行为来看，四季度出现了银行的配置力量，并带动了收益率的下行。第四，受民企座谈会和央行、银保监会长期以来对小微民企融资的政策支持的影响，民企规避情绪出现了部分缓解。但信用利差仍然出现了分化。我们观察到15年下半年以来和之前相比，信用利差整体压缩了一个台阶，可能和债券市场的发展，理财委外的扩容等相关。18年以来，我们观察到AA+和AAA之间的利差处于在低位，而AA和AA+的利差仍然在走扩。我们认为信用利差的结构变化仍将持续。

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12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0.7363%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；B类份额净值收益率为0.7962%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；C类份额净值收益率为0.7361%，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	30,873,118,358.32	31.07
	其中：债券	30,873,118,358.32	31.07
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,218,267,486.83	7.26
	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	60,610,928,288.87	60.99
4	其他资产	676,867,195.43	0.68
5	合计	99,379,181,329.45	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	-	2.88
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	4,792,183,091.69	5.07
	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	105
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	89

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	12.65	5.07
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	20.87	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	25.74	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	8.52	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	36.62	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.41	5.07

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	1,079,000,903.12	1.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,713,690,620.67	3.93
	其中：政策性金融债	3,713,690,620.67	3.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	26,080,426,834.53	27.59
8	其他	-	-

9	合计	30,873,118,358.32	32.66
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	1,511,741,450.17	1.60
2	111806216	18交通银行CD216	10,000,000	992,302,009.28	1.05
3	111810553	18兴业银行CD553	9,000,000	880,674,544.21	0.93
4	180201	18国开01	8,300,000	830,694,316.46	0.88
5	111810569	18兴业银行CD569	7,000,000	696,463,318.11	0.74
6	111804080	18中国银行CD080	7,000,000	685,356,802.01	0.72
7	189946	18贴现国债46	6,800,000	679,471,990.25	0.72
8	111803138	18农业银行CD138	6,500,000	646,560,287.30	0.68
9	111804085	18中国银行CD085	6,000,000	597,119,566.38	0.63
10	111817242	18光大银行CD242	6,000,000	596,291,801.26	0.63

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	0.0465%
报告期内偏离度的最低值	-0.0073%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0272%

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18光大银行CD242的发行主体中国光大银行股份有限公司于2018年11月9日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚（银保监银罚决字〔2018〕10号），主要违法事实包括：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）以误导方式违规销售理财产品；（三）以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；（四）违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；（五）同业投资违规接受担保；（六）通过同业投资或贷款虚增存款规模。共罚款1120万元。

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18光大银行CD242（111817242.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。其余六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。

本基金投资的18兴业银行CD553和18兴业银行CD569的发行主体兴业银行股份有限公司于2018年4月19日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚（银保监银罚决字〔2018〕1号），主要违法事实包括：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。共罚款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18兴业银行CD553(总价)（111810553.IB）和18兴业银行CD569(总价)（111810569.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。其余六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。

本基金投资的18交通银行CD216的发行主体交通银行股份有限公司于2018年11月9日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚（银保监银罚决字〔2018〕12号），主要违法事实包括：（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力，共罚款690万元；且于2018年11月9日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚（银保监银罚决字〔2018〕13号），主要违法事实包括：并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位，共罚款50万元。

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18交通银行CD216（111806216.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。其余六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	676,867,195.43
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	676,867,195.43

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	83,905,116,743.91	475,097,468.30	118,019,414.81
报告期期间基金总申购份额	277,037,015,908.63	1,572,528.98	51,776,520.24
报告期期间基金总赎回份额	266,523,847,459.80	467,852,186.05	59,010,980.36
报告期期末基金份额总额	94,418,285,192.74	8,817,811.23	110,784,954.69

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	2018-10-08	4,521.80	4,521.80	0.00
2	申赎	2018-10-08	90.00	90.00	0.00
3	申赎	2018-10-08	-90.00	-90.00	0.00
4	红利再投	2018-10-09	452.15	452.15	0.00
5	申赎	2018-10-09	130.00	130.00	0.00
6	申赎	2018-10-09	-130.00	-130.00	0.00
7	红利再投	2018-10-10	452.47	452.47	0.00
8	红利再投	2018-10-11	453.37	453.37	0.00
9	申赎	2018-10-11	10.00	10.00	0.00
10	申赎	2018-10-11	-10.00	-10.00	0.00
11	红利再	2018-10-1	448.76	448.76	0.00

	投	2			
12	申赎	2018-10-12	574.00	574.00	0.00
13	申赎	2018-10-12	-574.00	-574.00	0.00
14	红利再投	2018-10-15	1,336.66	1,336.66	0.00
15	申赎	2018-10-15	277.00	277.00	0.00
16	申赎	2018-10-15	-277.00	-277.00	0.00
17	红利再投	2018-10-16	445.74	445.74	0.00
18	申赎	2018-10-16	1,707.00	1,707.00	0.00
19	申赎	2018-10-16	-1,707.00	-1,707.00	0.00
20	红利再投	2018-10-17	443.54	443.54	0.00
21	申赎	2018-10-17	624.00	624.00	0.00
22	申赎	2018-10-17	-624.00	-624.00	0.00
23	红利再投	2018-10-18	441.00	441.00	0.00
24	申赎	2018-10-18	387.00	387.00	0.00
25	申赎	2018-10-18	-387.00	-387.00	0.00
26	红利再投	2018-10-19	441.64	441.64	0.00
27	申赎	2018-10-19	411.00	411.00	0.00
28	申赎	2018-10-19	-411.00	-411.00	0.00

29	红利再投	2018-10-22	1,307.96	1,307.96	0.00
30	申赎	2018-10-22	356.00	356.00	0.00
31	申赎	2018-10-22	-356.00	-356.00	0.00
32	红利再投	2018-10-23	435.55	435.55	0.00
33	申赎	2018-10-23	210.00	210.00	0.00
34	申赎	2018-10-23	-210.00	-210.00	0.00
35	红利再投	2018-10-24	437.12	437.12	0.00
36	申赎	2018-10-24	58.00	58.00	0.00
37	申赎	2018-10-24	-58.00	-58.00	0.00
38	红利再投	2018-10-25	435.93	435.93	0.00
39	申赎	2018-10-25	56.00	56.00	0.00
40	申赎	2018-10-25	-56.00	-56.00	0.00
41	红利再投	2018-10-26	437.41	437.41	0.00
42	申赎	2018-10-26	30.00	30.00	0.00
43	申赎	2018-10-26	-30.00	-30.00	0.00
44	红利再投	2018-10-29	1,316.27	1,316.27	0.00
45	申赎	2018-10-29	4.00	4.00	0.00
46	申赎	2018-10-2	-4.00	-4.00	0.00

		9			
47	红利再投	2018-10-30	443.07	443.07	0.00
48	红利再投	2018-10-31	442.95	442.95	0.00
49	红利再投	2018-11-01	439.56	439.56	0.00
50	红利再投	2018-11-02	441.78	441.78	0.00
51	红利再投	2018-11-05	1,313.12	1,313.12	0.00
52	红利再投	2018-11-06	435.09	435.09	0.00
53	红利再投	2018-11-07	440.46	440.46	0.00
54	红利再投	2018-11-08	438.52	438.52	0.00
55	红利再投	2018-11-09	436.12	436.12	0.00
56	红利再投	2018-11-12	1,244.51	1,244.51	0.00
57	红利再投	2018-11-13	431.09	431.09	0.00
58	红利再投	2018-11-14	432.74	432.74	0.00
59	红利再投	2018-11-15	421.70	421.70	0.00
60	红利再投	2018-11-16	434.65	434.65	0.00
61	红利再投	2018-11-19	1,269.43	1,269.43	0.00
62	红利再投	2018-11-20	416.70	416.70	0.00
63	红利再投	2018-11-21	418.45	418.45	0.00

64	红利再投	2018-11-22	433.27	433.27	0.00
65	红利再投	2018-11-23	421.55	421.55	0.00
66	红利再投	2018-11-26	1,283.36	1,283.36	0.00
67	红利再投	2018-11-27	422.32	422.32	0.00
68	红利再投	2018-11-28	425.16	425.16	0.00
69	红利再投	2018-11-29	427.30	427.30	0.00
70	红利再投	2018-11-30	429.14	429.14	0.00
71	红利再投	2018-12-03	1,292.71	1,292.71	0.00
72	红利再投	2018-12-04	430.15	430.15	0.00
73	红利再投	2018-12-05	430.39	430.39	0.00
74	红利再投	2018-12-06	429.27	429.27	0.00
75	红利再投	2018-12-07	437.02	437.02	0.00
76	红利再投	2018-12-10	1,268.68	1,268.68	0.00
77	红利再投	2018-12-11	422.33	422.33	0.00
78	红利再投	2018-12-12	423.80	423.80	0.00
79	红利再投	2018-12-13	439.20	439.20	0.00
80	红利再投	2018-12-14	420.80	420.80	0.00
81	红利再	2018-12-1	1,277.50	1,277.50	0.00

	投	7			
82	红利再投	2018-12-18	423.68	423.68	0.00
83	红利再投	2018-12-19	425.07	425.07	0.00
84	红利再投	2018-12-20	428.83	428.83	0.00
85	红利再投	2018-12-21	432.50	432.50	0.00
86	红利再投	2018-12-24	1,300.38	1,300.38	0.00
87	红利再投	2018-12-25	437.02	437.02	0.00
88	红利再投	2018-12-26	443.89	443.89	0.00
89	红利再投	2018-12-27	441.04	441.04	0.00
90	红利再投	2018-12-28	442.22	442.22	0.00
合计			39,595.89	39,595.89	

§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

2019年01月22日