

中欧滚钱宝发起式货币市场基金

2018 年年度报告摘要

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

送出日期:2019 年 03 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|-----------------|--------------------|---------------|-----------------|
| 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 | | |
| 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 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 94,537,887,958.66份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 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 | 94,418,285,192.74份 | 8,817,811.23份 | 110,784,954.69份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 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。 |

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 | 中国民生银行股份有限公司 |

| | | | |
|---------|------|---------------------------|-----------------------|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 黎忆海 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 021-68609600 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | liyihai@zofund.com | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 021-68609700、400-700-9700 | 95568 |
| 传真 | | 021-33830351 | 010-58560798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.zofund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2018年 | | | 2017年 | | | 2016年 | | |
|---------------|------------------|---------------|--------------|----------------|---------------|--------------|---------------|----------|----------|
| | 中欧滚钱宝货币A | 中欧滚钱宝货币B | 中欧滚钱宝货币C | 中欧滚钱宝货币A | 中欧滚钱宝货币B | 中欧滚钱宝货币C | 中欧滚钱宝货币A | 中欧滚钱宝货币B | 中欧滚钱宝货币C |
| 本期已实现收益 | 1,704,258,496.77 | 38,192,795.36 | 5,799,087.94 | 199,378,405.39 | 12,262,151.81 | 2,699,631.96 | 30,940,601.03 | - | - |
| 本期利润 | 1,704,258,496.77 | 38,192,795.36 | 5,799,087.94 | 199,378,405.39 | 12,262,151.81 | 2,699,631.96 | 30,940,601.03 | - | - |
| 本期净值收益 | 3.7315% | 3.9777% | 3.7294% | 3.9759% | 2.0295% | 1.9048% | 3.3993% | - | - |

| 率 | | | | | | | | | |
|------------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------------------|------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------------|---|---|
| 3.1.2 期末数 据和指 标 | 2018年末 | | | 2017年末 | | | 2016年末 | | |
| 期末基 金资产 净值 | 94,41 8,285 ,192. 74 | 8,817 ,811. 23 | 110,7 84,95 4.69 | 4,163 ,871, 065.0 7 | 860,8 16,11 0.76 | 115,6 93,59 2.36 | 2,304 ,866, 177.8 5 | - | - |
| 期末基 金份额 净值 | 1.000 | 1.000 | 1.000 | 1.000 | 1.000 | 1.000 | 1.000 | - | - |

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。

4、本基金自2017年7月12日起增加B类、C类份额，故无2016年可比期间。

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

中欧滚钱宝货币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 |
|-----------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去三 个月 | 0.7363% | 0.0002% | 0.3403% | - | 0.3960% | 0.0002% |
| 过去六 个月 | 1.6079% | 0.0009% | 0.6805% | - | 0.9274% | 0.0009% |
| 过去一 年 | 3.7315% | 0.0016% | 1.3500% | - | 2.3815% | 0.0016% |

| | | | | | | |
|------------|----------|---------|---------|---|---------|---------|
| 过去三年 | 11.5220% | 0.0022% | 4.0500% | - | 7.4720% | 0.0022% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.1816% | 0.0036% | 4.8008% | - | 8.3808% | 0.0036% |

中欧滚钱宝货币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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.7962% | 0.0002% | 0.3403% | 0.0000% | 0.4559% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 1.7297% | 0.0009% | 0.6805% | 0.0000% | 1.0492% | 0.0009% |
| 过去一年 | 3.9777% | 0.0016% | 1.3500% | 0.0000% | 2.6277% | 0.0016% |
| 自基金份额运作日至今 | 6.0879% | 0.0015% | 1.9862% | 0.0000% | 4.1017% | 0.0015% |

中欧滚钱宝货币C

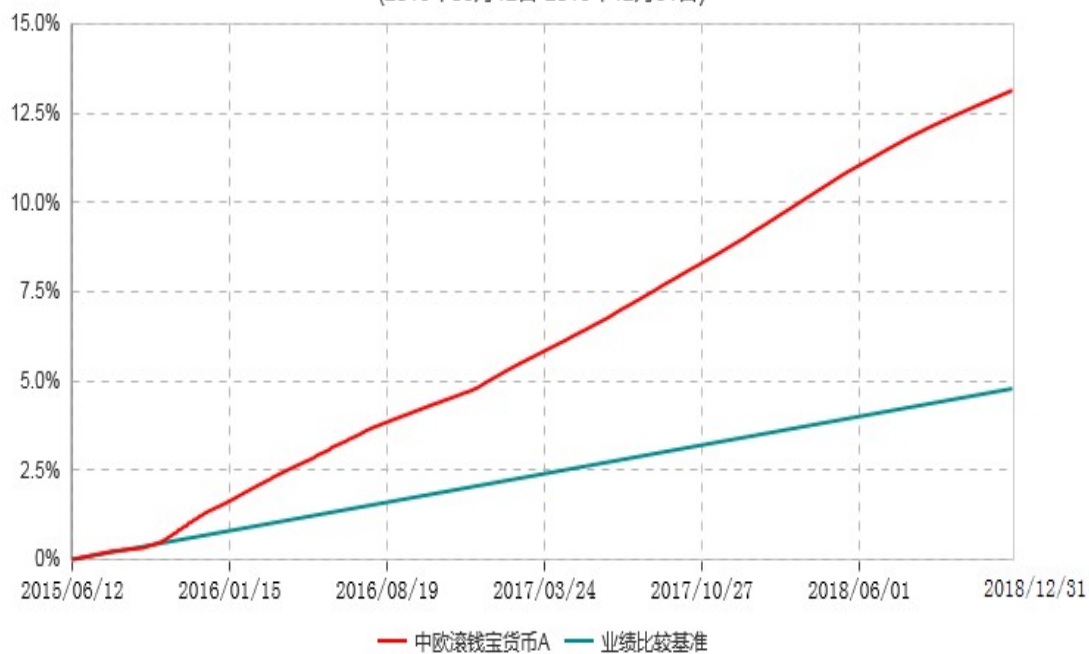
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.7361% | 0.0002% | 0.3403% | 0.0000% | 0.3958% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 1.6073% | 0.0009% | 0.6805% | 0.0000% | 0.9268% | 0.0009% |
| 过去一年 | 3.7294% | 0.0016% | 1.3500% | 0.0000% | 2.3794% | 0.0016% |
| 自基金 | 5.7052% | 0.0015% | 1.9825% | 0.0000% | 3.7227% | 0.0015% |

| | | | | | | |
|-----------------|--|--|--|--|--|--|
| 份额运 作日至 今 | | | | | | |
|-----------------|--|--|--|--|--|--|

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

中欧滚钱宝货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年06月12日-2018年12月31日)



中欧滚钱宝货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

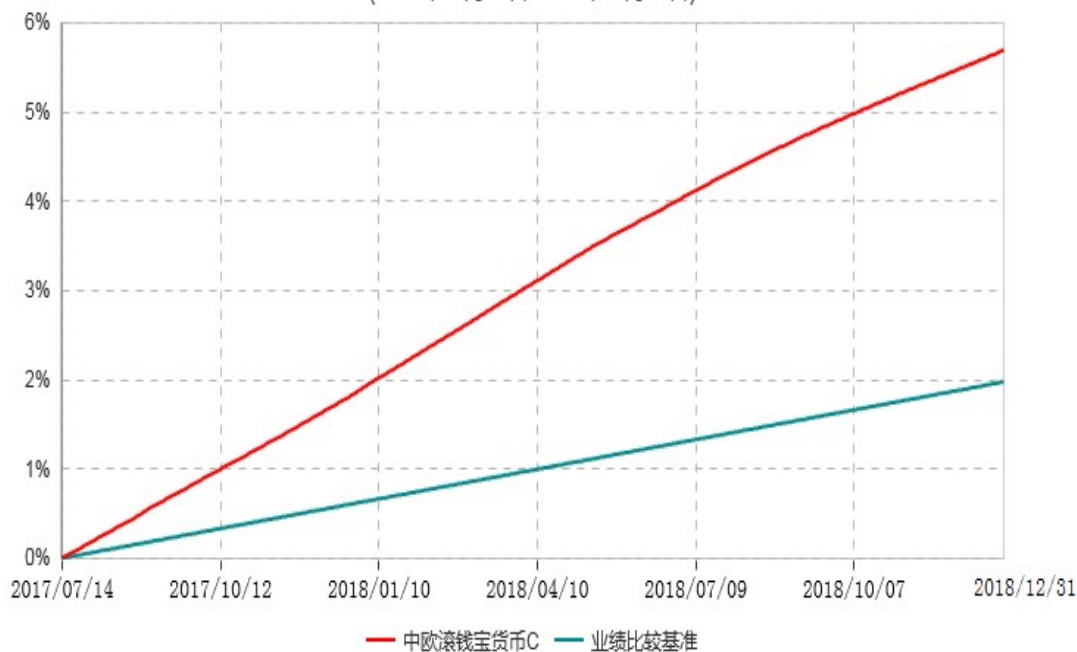
(2017年07月13日-2018年12月31日)



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。

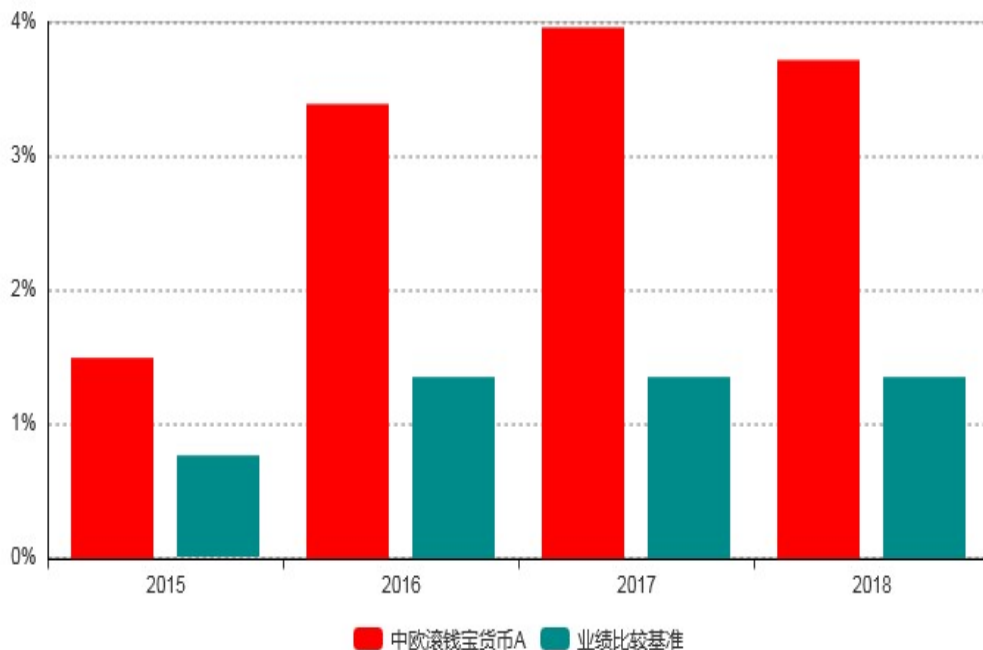
中欧滚钱宝货币C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年07月14日-2018年12月31日)

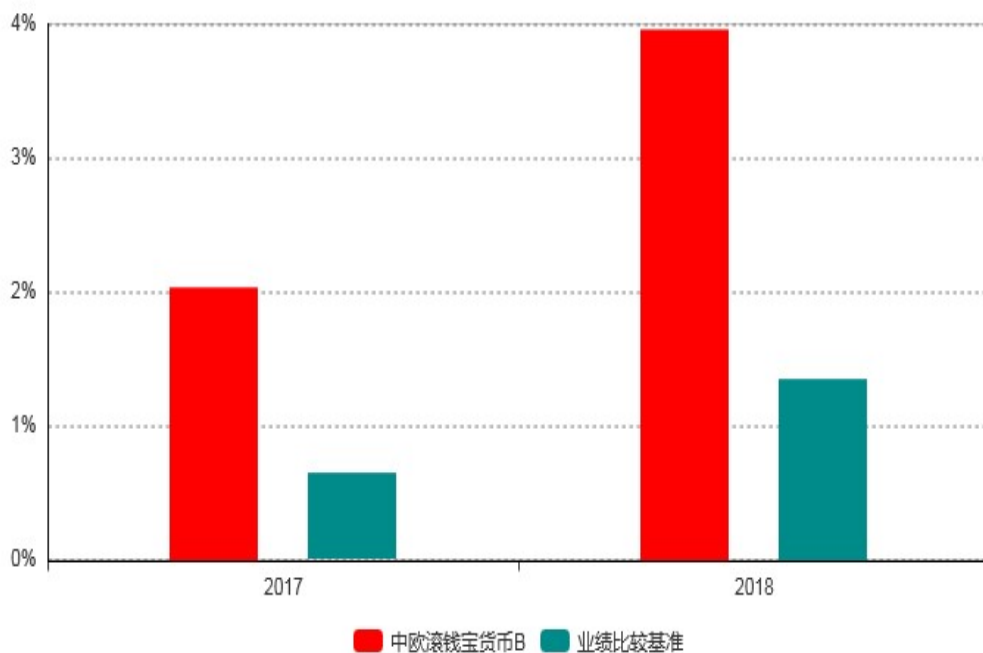


注：自 2017 年 7 月 13 日起，本基金增加 C 份额。图示日期为 2017 年 7 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日。

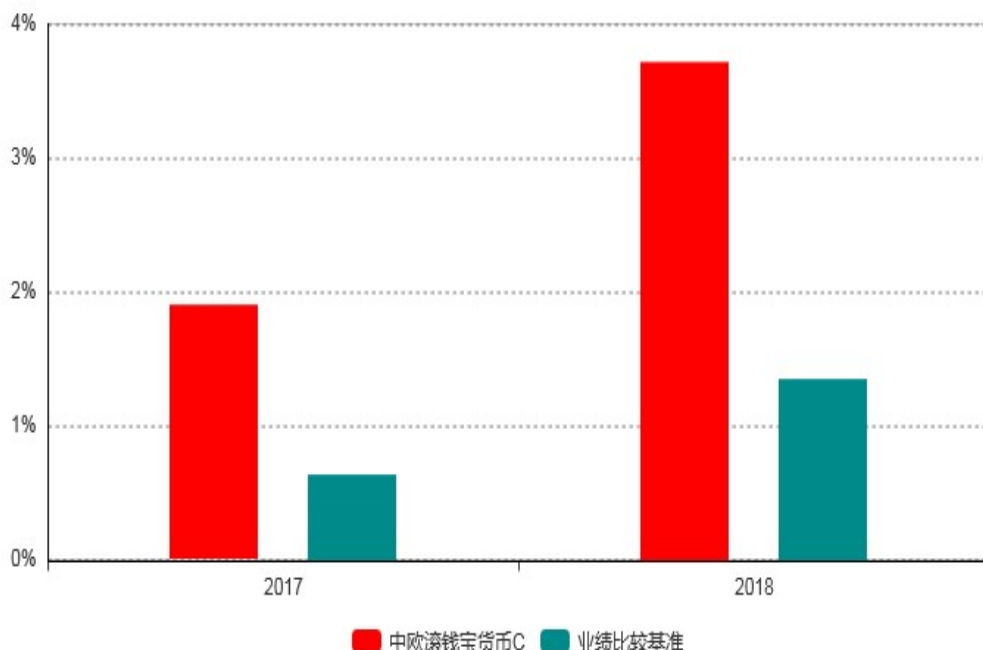
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 12 日，2015 年度数据为 2015 年 6 月 12 日至 2015 年 12 月 31 日数据。



注：2017 年 7 月 12 日本基金新增 B 类份额，2017 年度数据为 2017 年 7 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日数据。



注：2017 年 7 月 13 日本基金新增 C 类份额，2017 年度数据为 2017 年 7 月 14 日至 2017 年 12 月 31 日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

中欧滚钱宝货币A

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|------------------|---------------|----------|------------------|----|
| 2018年 | 1,704,258,496.77 | - | - | 1,704,258,496.77 | - |
| 2017年 | 199,378,405.39 | - | - | 199,378,405.39 | - |
| 2016年 | 30,940,601.03 | - | - | 30,940,601.03 | - |
| 合计 | 1,934,577,503.19 | - | - | 1,934,577,503.19 | - |

中欧滚钱宝货币B

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|----|--------------|------------|----------|----------|----|
| | | | | | |

| | | 出金额 | | | |
|-------|---------------|-----|---|---------------|---|
| 2018年 | 38,192,795.36 | - | - | 38,192,795.36 | - |
| 2017年 | 12,262,151.81 | - | - | 12,262,151.81 | - |
| 合计 | 50,454,947.17 | - | - | 50,454,947.17 | - |

中欧滚钱宝货币C

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应 付赎回款转 出金额 | 应付利润本 年变动 | 年度利润分配 合计 | 备注 |
|-------|------------------|-----------------------|--------------|--------------|----|
| 2018年 | 5,799,087.94 | - | - | 5,799,087.94 | - |
| 2017年 | 2,699,631.96 | - | - | 2,699,631.96 | - |
| 合计 | 8,498,719.90 | - | - | 8,498,719.90 | - |

§ 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有限公司、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2.20亿元人民币，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12月31日，本基金管理人共管理67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 | | 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 | 历任平安资产管理有限责 任公司组合经理（2008.0 |

| | | | | | |
|-----|--------|------------|------------|---|---|
| | | | | | 8-2012.06)，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 |
| 蒋雯文 | 基金经理助理 | 2017-06-22 | 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 |
| 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 |
| 王慧杰 | 基金经理助理 | 2017-09-26 | 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 |
| 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 |
| 张东波 | 基金经理助理 | 2018-10-23 | - | 4 | 历任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员（2014.09-2017.02），中山证券有限责任公司资管事业部投资主办助理（2017.02-2017.09）。2017-09-28加入中欧基金管理有限公司 |

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，蒋雯文自2019年2月19日起不再担任本基金的基金经理，并于2019年2月20日进行了信息披露。黄华自2019年3月15日不再担任本基金的基金经理，并于2019年3月16日进行了信息披露。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规，公司制订了《公平交易管理办法》以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。在投资决策方面，基金经理共享研究报告、投研体系职权划分明确且互不干预、各基金持仓及交易信息等均能有效隔离；在交易执行方面，以系统控制和人工审阅相结合的方式，严控反向交易和同向交易；另外，中央交易室在交易执行过程中对公平交易实施一线监控，监察稽核部也会就投资交易行为进行分析和评估，定期进行公平交易的内部审计工作。

4.3.2 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。

4.3.3 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

回顾2018年，全球政治经济环境、我国经济形势和政策都发生了明显的变化和转折，这些变化和转折也深深影响了资本市场。

第一，最为瞩目和意外的是中美贸易摩擦的升级和演变。外部压力对国内经济基本面和政策都产生了重大影响。

第二，2017年国内经济增长表现的韧性在2018年并没有延续，内需不足，投资和消费增速都出现了明显下滑。消费增速滑落至个位数增长。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”对融资平台的非标端收缩力度开始实质显现，前三季度基建投资增速出现了断崖式下滑，甚至出现了个别月份的负增长迹象。这一迹象直到四季度

在积极财政政策的效果下才得以缓解。随着对通胀的担忧转为对滞涨的担忧，四季度资本市场对经济基本面的预期走向了通缩衰退。

第三，货币、财政和监管政策出现了明显的调整。伴随着经济下行压力加大，整个政策基调从“稳健货币，紧信用”过度到“宽货币，紧信用”，再过度到“宽货币，宽信用”。和2017年相比，年初资金面边际转宽松，公开市场净投放力度开始明显加大。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。在年中，货币政策方向性变化得到了确认，流动性确认转为“合理充裕”。下半年，央行在10月再次降准。财政政策年中转为更加积极，下半年地方政府债大量发行。

然而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连续下降，在年末降至10%以内的水平。从结构上看，受监管政策的影响，表外融资快速萎缩，因此小微民企等依赖于信托和委托贷款等非标融资的企业，融资环境出现了紧缩。而具备信贷融资能力的优质企业融资环境边际改善。融资环境的恶化影响到实体经济，迫使监管政策放缓，金融去杠杆的力度有所缓和，小微民企融资逐步得到央行和银保监会的支持。

2018年债券市场走出了几乎是没有调整的单边牛市。10年期国开债全年下行120bp，1年期国开债下行170bp，收益率曲线陡峭化。5年期AAA中票下行140bp，5年期AA中票下行90bp，信用利差走扩。2018年也是信用风险频发的一年，低评级民企和部分资质偏弱城投主体不断爆发信用事件；受股票市场影响，高股权质押同时实体经济陷入困境的上市公司出现债务违约。

2018年，货币基金严控信用风险，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3.7315%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%；B类份额净值收益率为3.9777%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%；C类份额净值收益率为3.7294%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%。

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2019年，对全球经济和国内经济基本面有以下几个初步判断。第一，全球经济增长有所弱化，从OECD领先经济指标和全球制造业PMI等领先指标来看，全球主要经济体都出现了增长走弱的迹象。美联储、欧央行等全球重要央行的鸽派表态，是相比2018年一个重要的变化，也加大了国内货币政策的空间。2018年中国央行并没有跟随美联储加息而调整货币市场基准利率，2019年货币市场基准利率存在下调的空间。第二，国内经济基本面上半年来看大概率仍然处于经济走弱，通胀不足为虑的组合中。2018年年中开始的“宽货币宽信用”的各项政策对实体经济产生的作用和效果需要不断的跟踪和观察，社会融资总量、信贷等金融数据的总量和结构数据，春季开工情况，地产销售数据和建安投资的恢复情况，工业品价格走势等都是关键指标。在全球经济整体放缓的背景下，经济即使企稳后的表现很有可能是阶段性走平而非触底回升。第三，预计上半年货币政策维持宽松，继续引导广义信贷流向实体经济。财政政策更加积极，监管政策继续阶段性放缓，政策合力意在为实体经济提供和改善融资需求。

我们预计上半年的基本面和政策组合仍然有利于债券市场，经济尚未企稳，通胀无忧，货币政策持续宽松，货币资金利率稳定在低位。从资金利率和短端债券收益率来看，短端债券收益率或已接近合理水平，但套息策略的空间仍在。短债基金的集中发行和规模的迅速扩张对短久期债券的需求加大，或将有利于短端收益率维持在偏低水平。尽管如此，需要密切关注的是实体经济的融资需求何时可能企稳回升，是否将带动资金利率上行，毕竟当前短端债券收益率已经下行至接近2016年的水平，是值得警惕的。长端收益率受经济基本面直接影响，降准后的供求关系影响，需要持续关注这两方面。

从信用风险层面来看，2019年企业外部现金流风险可能相对缓和，但受经济走弱的影响，内部现金流的压力明显增大。3-4月份信用债到期和回售压力巨大，需要警惕低资质债券存在的信用风险，高低评级之间的信用利差可能走扩。货币基金将维持稳健操作，主动规避中低评级资质偏差的主体，保证组合的安全性。

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，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，且每日进行支付。报告期内本基金向A类份额持有人分配利润1,704,258,496.77元，向B类份额持有人分配利润38,192,795.36元，向C类份额持有人分配利润5,799,087.94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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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滚钱宝发起式货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人-中欧基金管理有限公司在中欧滚钱宝发起式货币市场基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金实施利润分配的金额为1,748,250,380.07元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

由中欧滚钱宝发起式货币市场基金管理人-中欧基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告期基金年度财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧滚钱宝发起式货币市场基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 60,610,928,288.87 | 2,063,682,192.34 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 30,873,118,358.32 | 2,305,369,476.24 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 30,873,118,358.32 | 2,276,689,476.24 |
| 资产支持证券投资 | - | 28,680,000.00 |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7,218,267,486.83 | 925,842,020.42 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 676,867,195.43 | 26,185,983.32 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | 558,247.77 |

| | | |
|-----------------|---------------------------|----------------------------|
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 99,379,181,329.45 | 5,321,637,920.09 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年12月31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 | 4,792,183,091.69 | 178,199,532.70 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 1,189.76 | - |
| 应付管理人报酬 | 21,391,154.51 | 1,315,535.96 |
| 应付托管费 | 3,819,849.02 | 234,917.13 |
| 应付销售服务费 | 19,097,450.18 | 1,002,771.53 |
| 应付交易费用 | 472,055.33 | 45,941.22 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 3,949,569.96 | 115,453.36 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 379,010.34 | 343,000.00 |
| 负债合计 | 4,841,293,370.79 | 181,257,151.90 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 94,537,887,958.66 | 5,140,380,768.19 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 94,537,887,958.66 | 5,140,380,768.19 |
| 负债和所有者权益总计 | 99,379,181,329.45 | 5,321,637,920.09 |

注：报告截止日2018年12月31日，中欧滚钱宝货币市场基金份额净值为人民币1.000元，基金份额总额94,537,887,958.66份，其中A类基金份额总额94,418,285,192.74份，B类基金份额总额8,817,811.23份，C类基金份额总额110,784,954.69份。

7.2 利润表

会计主体：中欧滚钱宝发起式货币市场基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 |
|------------------------|---------------------------|------------------------------------|
| 一、收入 | 2,093,498,551.61 | 251,195,854.10 |
| 1. 利息收入 | 2,088,112,905.21 | 249,678,034.21 |
| 其中：存款利息收入 | 1,416,150,654.89 | 105,781,907.27 |
| 债券利息收入 | 478,022,116.55 | 70,051,994.63 |
| 资产支持证券利息收入 | 148,483.41 | 7,858,348.73 |
| 买入返售金融资产收入 | 193,791,650.36 | 65,985,783.58 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 5,385,646.40 | 1,517,819.89 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 5,385,646.40 | 1,482,135.73 |
| 资产支持证券投资 | - | 35,684.16 |
| 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 | 345,248,171.54 | 36,855,664.94 |
| 1. 管理人报酬 | 147,578,242.62 | 15,385,408.75 |
| 2. 托管费 | 26,353,257.47 | 2,747,394.34 |
| 3. 销售服务费 | 129,588,649.47 | 11,749,249.80 |
| 4. 交易费用 | 405.00 | 200.00 |
| 5. 利息支出 | 41,182,024.08 | 6,562,299.83 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 41,182,024.08 | 6,562,299.83 |
| 6. 税金及附加 | 534.57 | - |
| 7. 其他费用 | 545,058.33 | 411,112.22 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 1,748,250,380.07 | 214,340,189.16 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 1,748,250,380.07 | 214,340,189.16 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧滚钱宝发起式货币市场基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31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) | 5,140,380,768.19 | - | 5,140,380,768.19 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 1,748,250,380.07 | 1,748,250,380.07 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减 | 89,397,507,190.47 | - | 89,397,507,190.47 |

| | | | |
|--|------------------------------------|-------------------|---------------------|
| 少以“-”号填列) | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 724,883,874,840.21 | - | 724,883,874,840.21 |
| 2. 基金赎回款 | -635,486,367,649.74 | - | -635,486,367,649.74 |
| 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） | - | -1,748,250,380.07 | -1,748,250,380.07 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 94,537,887,958.66 | - | 94,537,887,958.66 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31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） | 2,304,866,177.85 | 0.00 | 2,304,866,177.85 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 214,340,189.16 | 214,340,189.16 |
| 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） | 2,835,514,590.34 | - | 2,835,514,590.34 |
| 其中：1. 基金申购款 | 53,190,917,355.63 | - | 53,190,917,355.63 |
| 2. 基金赎回款 | -50,355,402,765.29 | - | -50,355,402,765.29 |
| 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） | - | -214,340,189.16 | -214,340,189.16 |

| | | | |
|-----------------|------------------|---|------------------|
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 5,140,380,768.19 | - | 5,140,380,768.19 |
|-----------------|------------------|---|------------------|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧滚钱宝发起式货币市场基金（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[2015]476号《关于准予中欧滚钱宝发起式货币市场基金注册的批复》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《中欧滚钱宝发起式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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币40,000,000.00元，经向中国证监会备案，《中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金合同》于2015年06月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为40,000,000.00份基金份额，募集期间未产生利息。本基金的基金管理人及注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金为发起式基金。基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员认购金额不低于1,000万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及本基金基金合同和招募说明书的约定，为满足投资者的理财需求，经征托管人中国民生银行股份有限公司同意并报中国证监会备案，本基金管理人决定自2017年7月12日起增加本基金的场外B类、C类基金份额类别并相应修改基金合同、托管协议。本基金根据销售渠道和销售服务费的不同分设三类基金份额：A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额。在本基金的基金份额分类实施后，本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金A类基金份额类别。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行存款和大额存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券和中期票据、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、短期融资券、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持类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：同期七天通知存款税后利率。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策和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相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

7.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.3 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[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。

7.4.6.4 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。

7.4.7 关联方关系

| 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 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 国都证券股份有限公司（“国都证券”） | 基金管理人的股东 |
| 万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”） | 基金管理人的股东 |
| 北京百骏投资有限公司（“北京百骏”） | 基金管理人的股东 |
| Unione di Banche Italiane S.p.a（“意大利意联银行”） | 基金管理人的股东 |
| 上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海睦亿合伙”） | 基金管理人的股东 |
| 自然人股东 | 基金管理人的股东 |
| 中欧盛世资产管理(上海)有限公司（“中欧盛世资管”） | 基金管理人的控股子公司 |
| 中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司（“钱滚滚”） | 基金管理人的控股子公司 |

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 147,578,242.62 | 15,385,408.75 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 98,351,465.81 | 81,111.97 |

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0.28%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.28\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 26,353,257.47 | 2,747,394.34 |

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0.05%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 |
|--------------|-------------------------------|
| | |

| 名称 | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
|----------------------------|------------------------------------|--------------|--------------|---------------|
| | 中欧滚钱宝货币 A | 中欧滚钱宝货币 B | 中欧滚钱宝货币 C | 合计 |
| 中欧基金 | 1,481,743.26 | 90,734.99 | 0.00 | 1,572,478.25 |
| 中国民生 银行股份 有限公司 | 8,582,251.67 | 0.00 | 0.00 | 8,582,251.67 |
| 合计 | 10,063,994.93 | 90,734.99 | 0.00 | 10,154,729.92 |
| 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12月31日 | | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 中欧滚钱宝货币 A | 中欧滚钱宝货币 B | 中欧滚钱宝货币 C | 合计 |
| 中欧基金 | 11,554,974.24 | 28,463.15 | 0.00 | 11,583,437.39 |
| 中国民生 银行股份 有限公司 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 11,554,974.24 | 28,463.15 | 0.00 | 11,583,437.39 |

注：

本基金A类基金份额和C类基金份额的销售服务费相同，按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。本基金的B类基金份额销售服务费按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提。销售服务费计提的计算公式具体如下：

$H = E \times \text{该类基金份额的 } 0.25\% \div \text{当年天数}$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日的该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月5个工作日内根据划款指令从基金财产中一次性支付登记机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.3 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

| 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 | | | | | | |
|------------------------------------|--------|------|-------|------|------------------|------------|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国民生银行股份有限公司 | - | - | - | - | 1,000,086,000.00 | 120,771.71 |
| 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国民生银行股份有限公司 | - | - | - | - | 588,964,000.00 | 57,774.33 |

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧滚钱宝货币A

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 2018年01月01日至2018年12月31日 | 2017年01月01日至2017年12月31日 |
| 基金合同生效日（2015年06月12日）持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 81,570,399.02 | 193,834,369.58 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 5,743,816.22 | 162,736,029.44 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖 | 87,311,070.95 | 275,000,000.00 |

| | | |
|---------------------|----------|---------------|
| 出总份额 | | |
| 报告期末持有的基金份额 | 3,144.29 | 81,570,399.02 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | 1.96% |

中欧滚钱宝货币B

份额单位：份

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年12 月31日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12 月31日 |
|-----------------------------|-----------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2015年06月12日）持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 10,082,500.56 | 0.00 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 5,019,535.81 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 5,062,964.75 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 57.42% | 0.00% |

中欧滚钱宝货币C

份额单位：份

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年12 月31日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12 月31日 |
|-----------------------------|-----------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2015年06月12日）持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |

| | | |
|---------------------|-------|-------|
| 报告期初持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | 0.00% |

注：

- 1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。
- 2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。
- 3、截止本报告期末，本基金管理人持有本基金 A 类份额的实际占比为 0.000003%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

中欧滚钱宝货币A

| 关联方名称 | 本期末 2018年12月31日 | | 上年度末 2017年12月31日 | |
|-------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| 钱滚滚 | 6.41 | 0.00% | 13,471.03 | 0.00% |
| 自然人股东 | 7,017,786.86 | 0.01% | 853,090.26 | 0.02% |

中欧滚钱宝货币B

| 关联方名称 | 本期末 2018年12月31日 | | 上年度末 2017年12月31日 | |
|-------|--------------------|---------|---------------------|---------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额 |

| | | 占基金总份额的比例 | | 占基金总份额的比例 |
|-------|------|-----------|------|-----------|
| 钱滚滚 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 自然人股东 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |

中欧滚钱宝货币C

| 关联方名称 | 本期末 2018年12月31日 | | 上年度末 2017年12月31日 | |
|-------|--------------------|----------------------|---------------------|----------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 |
| 钱滚滚 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 自然人股东 | 101,318.30 | 0.09% | 97,668.43 | 0.08% |

注：

- 1、截止本报告期末，钱滚滚持有本基金A类份额的实际占比为0.00000001%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。
- 2、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。
- 3、上报告期末钱滚滚持有本基金A类份额的实际占比为0.0003%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

7.4.8.5 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12月31日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日 | |
|--------------|-------------------------------|----------------|------------------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 6,380,928,288.87 | 118,246,743.58 | 232,682,192.34 | 9,959,937.43 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行同业利率/约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

于2018年12月31日，本基金持有1,000,000张中国民生银行股份有限公司发行的同业存单，成本总额为人民币100,000,000.00元，估值总额为人民币99,289,337.61元，占基金资产净值的比例为0.1050%（于2017年12月31日，无）

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2018年12月31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4,792,183,091.69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 |
|--------|--------|------------|--------|-----------|----------------|
| 140202 | 14国开02 | 2019-01-04 | 100.12 | 700,000 | 70,084,833.83 |
| 160202 | 16国开02 | 2019-01-04 | 100.01 | 1,900,000 | 190,012,710.38 |
| 160301 | 16进出01 | 2019-01-04 | 99.92 | 1,661,000 | 165,968,669.09 |
| 160415 | 16农发15 | 2019-01-03 | 100.04 | 700,000 | 70,030,544.13 |
| 180201 | 18国开01 | 2019-01-02 | 100.08 | 3,000,000 | 300,250,957.76 |
| 180201 | 18国开01 | 2019-01-03 | 100.08 | 3,000,000 | 300,250,957.76 |
| 180201 | 18国开01 | 2019-01-04 | 100.08 | 2,300,000 | 230,192,400.95 |
| 180207 | 18国开07 | 2019-01-03 | 100.12 | 7,000,000 | 700,807,294.78 |
| 180207 | 18国开07 | 2019-01-04 | 100.12 | 3,000,000 | 300,345,983.48 |
| 180207 | 18国开07 | 2019-01-07 | 100.12 | 5,000,000 | 500,576,639.13 |
| 180209 | 18国开09 | 2019-01-03 | 100.17 | 2,100,000 | 210,365,731.17 |

| | | | | | |
|-----------|-----------------|------------|--------|------------|------------------|
| 180301 | 18进出01 | 2019-01-03 | 100.04 | 2,200,000 | 220,093,274.58 |
| 180404 | 18农发04 | 2019-01-03 | 100.25 | 1,500,000 | 150,373,065.25 |
| 189933 | 18贴现国债33 | 2019-01-04 | 99.92 | 334,000 | 33,374,519.75 |
| 189946 | 18贴现国债46 | 2019-01-03 | 99.92 | 1,031,000 | 103,019,944.40 |
| 189946 | 18贴现国债46 | 2019-01-09 | 99.92 | 5,050,000 | 504,607,875.11 |
| 189948 | 18贴现国债48 | 2019-01-04 | 99.88 | 3,500,000 | 349,567,056.96 |
| 111805195 | 18建设银行CD1 95 | 2019-01-03 | 99.45 | 1,000,000 | 99,445,536.56 |
| 111808205 | 18中信银行CD2 05 | 2019-01-03 | 99.47 | 531,000 | 52,817,183.21 |
| 111809234 | 18浦发银行CD2 34 | 2019-01-03 | 98.85 | 266,000 | 26,293,220.80 |
| 111810543 | 18兴业银行CD5 43 | 2019-01-02 | 97.89 | 516,000 | 50,512,566.63 |
| 111818115 | 18华夏银行CD1 15 | 2019-01-02 | 99.48 | 2,084,000 | 207,315,675.68 |
| 合计 | | | | 48,373,000 | 4,836,306,641.39 |

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

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、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

1.2 以公允价值计量的金融工具

1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的交易性金融资产中属于第二层次的余额为人民币30,873,118,358.32元，无划分为第一层次和第三层次的余额。（于2017年12月31日，属于第二层次的余额为人民币2,305,369,476.24元，无划分为第一层次和第三层次的余额。）

1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的交易性金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。

1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的交易性金融资产第三层次公允价值本期未发生变动。

2. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重要承诺事项。

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。

4. 财务报表的批准

本财务报表已于2019年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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 | 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 | 其他各项资产 | 676,867,195.43 | 0.68 |
| 5 | 合计 | 99,379,181,329.45 | 100.00 |

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例(%) | |
|----|--------------|--------------|--------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 4.11 | |
| | 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 | 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较的简单平均值。

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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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 | 118 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 53 |

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。

8.3.2 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 | 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 |

8.4 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。

8.5 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 | 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，付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。

8.6 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 | 180207 | 18国开07 | 15,100,000 | 1,511,741,450.17 | 1.60 |
| 2 | 111806216 | 18交通银行C D216 | 10,000,000 | 992,302,009.28 | 1.05 |
| 3 | 111810553 | 18兴业银行C D553 | 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C D569 | 7,000,000 | 696,463,318.11 | 0.74 |
| 6 | 111804080 | 18中国银行C D080 | 7,000,000 | 685,356,802.01 | 0.72 |
| 7 | 189946 | 18贴现国债4 6 | 6,800,000 | 679,471,990.25 | 0.72 |
| 8 | 111803138 | 18农业银行C D138 | 6,500,000 | 646,560,287.30 | 0.68 |
| 9 | 111804085 | 18中国银行C D085 | 6,000,000 | 597,119,566.38 | 0.63 |
| 10 | 111817242 | 18光大银行C D242 | 6,000,000 | 596,291,801.26 | 0.63 |

8.7 “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 | 0.0978% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0158% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0342% |

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%。

8.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。 本基金投资的18兴业银行CD553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。 本基金投资的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。 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视为，认为上述处罚不会对18交通银行CD216（111806216. IB）、18光大银行CD242（111817242. IB）、18兴业银行CD553(总价)（111810553. IB）、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。

8.9.3 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 | - |
| 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 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 676,867,195.43 |

8.9.4 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 中欧滚钱宝货币A | 8,202,171 | 11,511.38 | 904,033.33 | 0.00% | 94,417,381,159.41 | 100.00% |
| 中欧滚钱宝货币B | 2 | 4,408,905.62 | 8,817,811.23 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 中欧滚钱宝货币C | 75,086 | 1,475.44 | 0.00 | 0.00% | 110,784,954.69 | 100.00% |
| 合计 | 8,277,259 | 11,421.40 | 9,721,844.56 | 0.01% | 94,528,166,114.10 | 99.99% |

注：截止本报告期末，滚钱宝A的机构客户持有份额实际占比为0.0010%、个人客户持有份额实际占比为99.9990%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

9.2 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 | 个人 | 28,475,250.15 | 0.03% |
| 2 | 个人 | 24,369,039.93 | 0.03% |
| 3 | 个人 | 15,762,467.01 | 0.02% |
| 4 | 个人 | 14,379,052.62 | 0.02% |
| 5 | 个人 | 12,408,365.51 | 0.01% |
| 6 | 个人 | 11,936,763.11 | 0.01% |
| 7 | 个人 | 11,656,078.69 | 0.01% |

| | | | |
|----|----|--------------|-------|
| 8 | 个人 | 9,830,687.57 | 0.01% |
| 9 | 个人 | 9,219,811.22 | 0.01% |
| 10 | 个人 | 8,917,950.73 | 0.01% |

9.3 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 | 中欧滚钱宝货币A | 18,437,366.25 | 0.02% |
| | 中欧滚钱宝货币B | 0.00 | 0.00% |
| | 中欧滚钱宝货币C | 303,359.72 | 0.27% |
| | 合计 | 18,740,725.97 | 0.02% |

9.4 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 | 中欧滚钱宝货币A | >100 |
| | 中欧滚钱宝货币B | 0 |
| | 中欧滚钱宝货币C | 10~50 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中欧滚钱宝货币A | 0~10 |
| | 中欧滚钱宝货币B | 0 |
| | 中欧滚钱宝货币C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立已满3年，本报告期内无发起式资金持有份额情况。

§ 10 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 |
|--|----------|----------|----------|

| | | | |
|----------------------------|--------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2015年06月12日)基金份额总额 | 40,000,000.00 | - | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,163,871,065.07 | 860,816,110.76 | 115,693,592.36 |
| 本报告期基金总申购份额 | 721,189,191,111.32 | 3,226,379,980.31 | 468,303,748.58 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 630,934,776,983.65 | 4,078,378,279.84 | 473,212,386.25 |
| 本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份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内,基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于2018年4月19日公告,根据工作需要,任命张庆先生担任本公司资产托管部总经理,主持资产托管部相关工作。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为130,000.00元人民币。截至本报告期末,该事务所已向本基金提供2年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 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，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

11.7.2 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 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | 431,967,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |

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，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

11.8 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。

中欧基金管理有限公司
二〇一九年三月二十八日