中欧滚钱宝发起式货币市场基金

2019年第3季度报告

2019年09月30日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2019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2019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2019年07月01日起至2019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	93,675,538,939.29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	93,609,489,810.02份	9,002,919.54份	57,046,209.73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(2019年07月01日 - 2019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	564,132,205.58	59,108.50	370,164.08
2.本期利润	564,132,205.58	59,108.50	370,164.08
3.期末基金资产净值	93,609,489,810.02	9,002,919.54	57,046,209.73

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	0.6000%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.2597%	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	0.6609%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.3206%	0.0002%

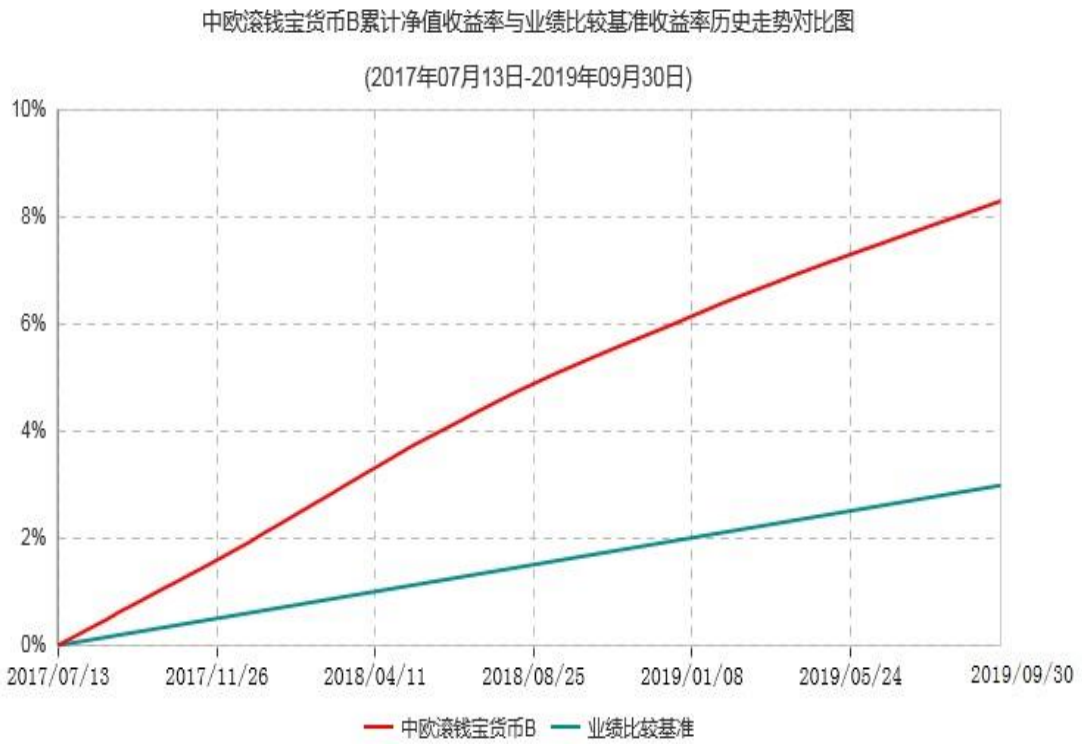
注：本基金收益分配按日结转份额。

中欧滚钱宝货币C净值表现

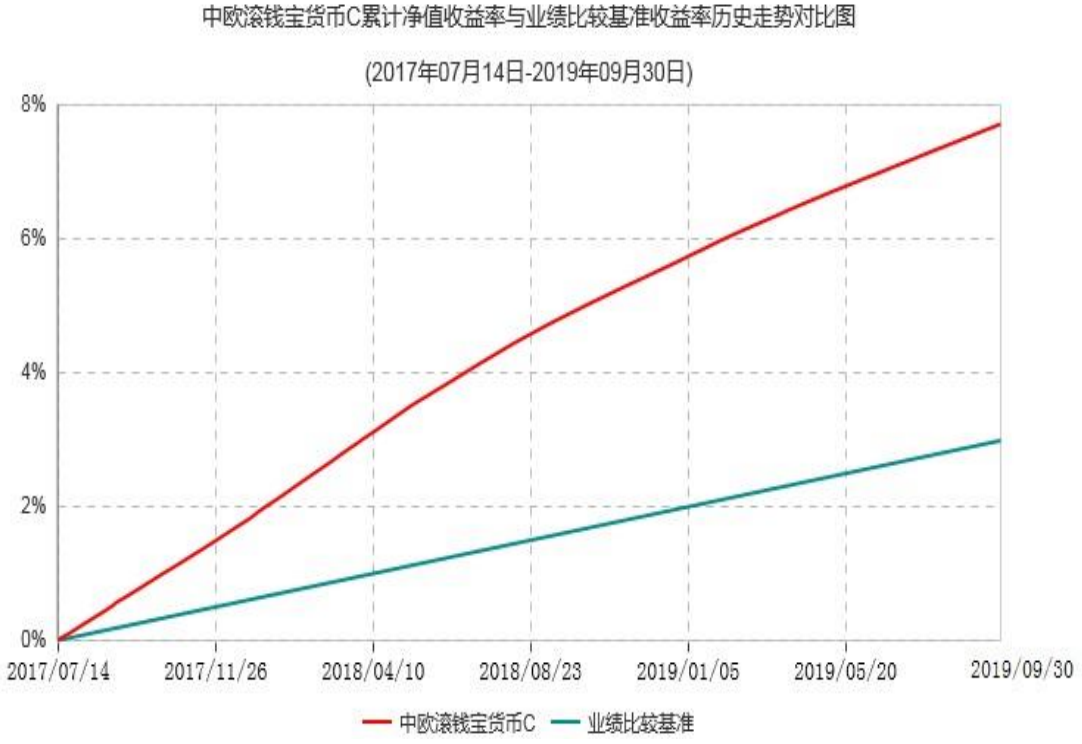
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5999%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.2596%	0.0002%

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 2019 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 2019 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		
王慧杰	基金经理	2018-08-13	-	8	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

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

2019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，全球经济增长延续了下滑态势。OECD领先指标进一步下探；全球制造业PMI连续5个月在荣枯线之下；美国制造业PMI也在8-9月跌破荣枯线，全球经济前景并不光明。受经济变化的影响，全球主要经济体货币政策延续宽松，美联储降息之后又重新扩表。另一方面，中美贸易摩擦的不确定性和其他地缘政治，对全球经济产生了负面影响，全球避险情绪升温。

第二，国内经济增长继续下行，通胀水平有所抬升。首先，三季度PMI全部在50荣枯线之下，我们持续关注的就业指标也未见起色。其次，内需弱的格局没有改变，特别是地产投资增速终于出现了下滑，新开工和土地溢价率等前瞻指标预示了行业景气度的回落。 再次，三季度CPI受食品价格的影响有所抬升。核心CPI仍在下滑，工业品价格走向通缩。我们认为当前对通胀的担忧属于结构性通胀，而并非由于需求引发的全局性通胀，不同于经济过热和信贷投放过快带来的通胀，食品上涨引发的通胀导致货币政策急剧收紧的可能性很小。

第三，包商事件短期冲击之后，三季度货币政策逐步正常化。受经济下行压力影响，央行三季度再次降准。银行体系流动性维持合理充裕，在部分时间点出现阶段性紧张。整体来看，8-9月银行间回购利率水平有所抬升。

债券市场运行方面，2019年三季度的债券市场值得关注的地方有以下几方面：第一，基本面的走势和货币政策的预期决定了三季度债债券收益率下行的方向。中美贸易摩擦始终影响着债券市场的波动。第二，我们关注到整个8月份银行间市场回购利率相比上半年都系统的提升了一个台阶，猜测是央行受制于汇率和通胀的制约，将短端维持在偏高的水平。整体来看，三季度收益率曲线陡峭下行，同时信用利差明显收窄，信用债表现好于利率债。

在这样的市场环境下，货币基金在日常中稳健操作，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。基金择时配置，存单和存款收益率在8-9月逐步接近阶段高点的过程中，组合加大配置力度。基金主动防范流动性风险，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和农商行。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0.6000%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；B类份额净值收益率为0.6609%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；C类份额净值收益率为0.5999%，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	30,946,061,305.73	31.31
	其中：债券	30,946,061,305.73	31.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	11,671,067,830.66	11.81
	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	55,703,665,688.37	56.35
4	其他资产	528,647,237.22	0.53
5	合计	98,849,442,061.98	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	-	3.07
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	5,126,156,387.44	5.47
	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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

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	23.46	5.47
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	18.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	30.89	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	4.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	28.29	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.96	5.47

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,867,174,581.51	6.26
	其中：政策性金融债	5,867,174,581.51	6.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,207,317,778.44	2.36
6	中期票据	-	-
7	同业存单	22,871,568,945.78	24.42
8	其他	-	-
9	合计	30,946,061,305.73	33.04
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	111903072	19农业银行CD072	24,000,000	2,385,200,300.51	2.55
2	180410	18农发10	21,700,000	2,170,049,655.83	2.32
3	190304	19进出04	11,500,000	1,149,720,157.21	1.23
4	111908120	19中信银行CD120	10,000,000	993,762,329.79	1.06
5	190302	19进出02	7,800,000	779,191,668.76	0.83
6	111922008	19邮储银行CD008	6,000,000	596,282,928.94	0.64
7	111910358	19兴业银行CD358	6,000,000	589,059,453.44	0.63
8	111907009	19招商银行CD009	5,000,000	498,362,890.66	0.53
9	111985	19上海农商银	5,000,000	497,940,246.	0.53

	915	行CD070		52	
10	111918316	19华夏银行CD316	5,000,000	497,885,254.00	0.53

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	0.0323%
报告期内偏离度的最低值	0.0039%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0143%

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19中信银行CD120的发行主体中信银行股份有限公司于2018年11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〕14号），主要违法事实包括：（一）理财资金违规缴纳土地款；（二）自有资金融资违规缴纳土地款；（三）为非保本理财产品提供保本承诺；（四）本行信贷资金为理财产品提供融资；（五）收益权转让业务违规提供信用担保；（六）项目投资审核严重缺位，共罚款2280万元；且公司于2019年7月3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（2019）12号），主要违法事实包括：（一）未按规定提供报表且逾期未改正；（二）错报、漏报银行业监管统计资料；（三）未向监管部门报告重要信息系统运营中断事件；（四）信息系统控制存在较大安全漏洞，未做到有效的安全控制；（五）未按企业划型标准将多家企业划分为小微型企业，报送监管数据不真实；（六）向关系人发放信用贷

款、向关系人发放担保贷款的条件优于其他借款人同类贷款条件；（七）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（八）贷后管理不到位导致贷款资金被挪用；（九）以流动资金贷款名义发放房地产开发贷款；（十）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（十一）投资同一家银行机构同期非保本理财产品采用风险权重不一致；（十二）购买非保本理财产品签订可提前赎回协议，未准确计量风险加权资产；（十三）未按规定计提资产支持证券业务的风险加权资产，没收33.6677万元，罚款2190万元，合计2223.6677万元。

本基金投资的19邮储银行CD008的发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司于2019年7月3日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚（银保监罚决字〔2019〕11号），主要违法事实包括：（一）未按监管要求对代理营业机构进行考核；（二）劳务派遣工违规担任综合柜员；（三）员工信息管理不到位；（四）未按规定开展审计工作。共罚款140万元。

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19中信银行CD120（111908120.IB）和19邮储银行CD008（111922008.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。其余前十大持有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	472,227.66
3	应收利息	528,076,816.39
4	应收申购款	98,193.17
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	528,647,237.22

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	95,423,691,426.99	8,943,811.04	65,822,695.06

报告期期间基金总申购份额	300,578,610,507.77	59,108.50	12,855,458.03
报告期期间基金总赎回份额	302,392,812,124.74	0.00	21,631,943.36
报告期期末基金份额总额	93,609,489,810.02	9,002,919.54	57,046,209.73

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	2019-07-01	1,153.93	1,153.93	0
2	红利再投	2019-07-02	380.31	380.31	0
3	红利再投	2019-07-03	375.95	375.95	0
4	申赎	2019-07-03	8.00	8.00	0
5	申赎	2019-07-03	-8.00	-8.00	0
6	红利再投	2019-07-04	364.20	364.20	0
7	申赎	2019-07-04	3.00	3.00	0
8	申赎	2019-07-04	-3.00	-3.00	0
9	红利再投	2019-07-05	361.12	361.12	0
10	申赎	2019-07-05	6.00	6.00	0
11	申赎	2019-07-05	-6.00	-6.00	0
12	红利再投	2019-07-08	1,087.54	1,087.54	0
13	申赎	2019-07-08	1.00	1.00	0
14	申赎	2019-07-08	-1.00	-1.00	0
15	红利再投	2019-07-09	360.85	360.85	0
16	红利再投	2019-07-10	360.66	360.66	0
17	红利再投	2019-07-11	386.83	386.83	0
18	红利再投	2019-07-12	397.99	397.99	0
19	红利再投	2019-07-15	1,081.67	1,081.67	0
20	红利再投	2019-07-16	358.45	358.45	0
21	申赎	2019-07-16	8.00	8.00	0
22	申赎	2019-07-16	-8.00	-8.00	0
23	红利再投	2019-07-17	378.02	378.02	0
24	红利再投	2019-07-18	371.96	371.96	0

25	红利再投	2019-07-19	382.40	382.40	0
26	红利再投	2019-07-22	1,108.13	1,108.13	0
27	红利再投	2019-07-23	370.22	370.22	0
28	红利再投	2019-07-24	375.30	375.30	0
29	申赎	2019-07-24	91.18	91.18	0
30	申赎	2019-07-24	-91.18	-91.18	0
31	红利再投	2019-07-25	396.55	396.55	0
32	申赎	2019-07-25	30.27	30.27	0
33	申赎	2019-07-25	-30.27	-30.27	0
34	红利再投	2019-07-26	373.97	373.97	0
35	申赎	2019-07-26	10.00	10.00	0
36	申赎	2019-07-26	-10.00	-10.00	0
37	红利再投	2019-07-29	1,104.46	1,104.46	0
38	申赎	2019-07-29	76.89	76.89	0
39	申赎	2019-07-29	-76.89	-76.89	0
40	红利再投	2019-07-30	368.37	368.37	0
41	申赎	2019-07-30	33.84	33.84	0
42	申赎	2019-07-30	-33.84	-33.84	0
43	红利再投	2019-07-31	368.67	368.67	0
44	申赎	2019-07-31	3.00	3.00	0
45	申赎	2019-07-31	-3.00	-3.00	0
46	红利再投	2019-08-01	377.16	377.16	0
47	申赎	2019-08-01	5.00	5.00	0
48	申赎	2019-08-01	-5.00	-5.00	0
49	红利再投	2019-08-02	407.09	407.09	0
50	红利再投	2019-08-05	1,097.81	1,097.81	0
51	红利再投	2019-08-06	364.71	364.71	0
52	申赎	2019-08-06	2.00	2.00	0
53	申赎	2019-08-06	-2.00	-2.00	0
54	红利再投	2019-08-07	363.68	363.68	0
55	申赎	2019-08-07	3.00	3.00	0
56	申赎	2019-08-07	-3.00	-3.00	0
57	红利再投	2019-08-08	363.57	363.57	0

58	申赎	2019-08-08	6.92	6.92	0
59	申赎	2019-08-08	-6.92	-6.92	0
60	红利再投	2019-08-09	373.31	373.31	0
61	申赎	2019-08-09	37.50	37.50	0
62	申赎	2019-08-09	-37.50	-37.50	0
63	红利再投	2019-08-12	1,085.71	1,085.71	0
64	申赎	2019-08-12	11.00	11.00	0
65	申赎	2019-08-12	-11.00	-11.00	0
66	红利再投	2019-08-13	362.73	362.73	0
67	申赎	2019-08-13	0.50	0.50	0
68	申赎	2019-08-13	-0.50	-0.50	0
69	红利再投	2019-08-14	365.88	365.88	0
70	申赎	2019-08-14	15.00	15.00	0
71	申赎	2019-08-14	-15.00	-15.00	0
72	红利再投	2019-08-15	364.27	364.27	0
73	红利再投	2019-08-16	365.98	365.98	0
74	申赎	2019-08-16	2.88	2.88	0
75	申赎	2019-08-16	-2.88	-2.88	0
76	红利再投	2019-08-19	1,098.07	1,098.07	0
77	红利再投	2019-08-20	366.03	366.03	0
78	申赎	2019-08-20	16.00	16.00	0
79	申赎	2019-08-20	-16.00	-16.00	0
80	红利再投	2019-08-21	365.86	365.86	0
81	申赎	2019-08-21	10.00	10.00	0
82	申赎	2019-08-21	-10.00	-10.00	0
83	红利再投	2019-08-22	394.19	394.19	0
84	申赎	2019-08-22	5.88	5.88	0
85	申赎	2019-08-22	-5.88	-5.88	0
86	红利再投	2019-08-23	366.58	366.58	0
87	红利再投	2019-08-26	1,095.92	1,095.92	0
88	红利再投	2019-08-27	364.75	364.75	0
89	申赎	2019-08-27	3.00	3.00	0
90	申赎	2019-08-27	-3.00	-3.00	0

91	红利再投	2019-08-28	372.30	372.30	0
92	红利再投	2019-08-29	370.02	370.02	0
93	红利再投	2019-08-30	368.02	368.02	0
94	红利再投	2019-09-02	1,102.92	1,102.92	0
95	红利再投	2019-09-03	367.75	367.75	0
96	红利再投	2019-09-04	366.68	366.68	0
97	申赎	2019-09-04	13.00	13.00	0
98	申赎	2019-09-04	-13.00	-13.00	0
99	红利再投	2019-09-05	366.72	366.72	0
100	红利再投	2019-09-06	364.58	364.58	0
101	红利再投	2019-09-09	1,093.81	1,093.81	0
102	申赎	2019-09-09	2.88	2.88	0
103	申赎	2019-09-09	-2.88	-2.88	0
104	红利再投	2019-09-10	366.77	366.77	0
105	申赎	2019-09-10	3.00	3.00	0
106	申赎	2019-09-10	-3.00	-3.00	0
107	红利再投	2019-09-11	371.88	371.88	0
108	申赎	2019-09-11	7.00	7.00	0
109	申赎	2019-09-11	-7.00	-7.00	0
110	红利再投	2019-09-12	369.18	369.18	0
111	申赎	2019-09-12	2.00	2.00	0
112	申赎	2019-09-12	-2.00	-2.00	0
113	红利再投	2019-09-16	1,479.72	1,479.72	0
114	申赎	2019-09-16	2.88	2.88	0
115	申赎	2019-09-16	-2.88	-2.88	0
116	红利再投	2019-09-17	376.05	376.05	0
117	红利再投	2019-09-18	366.59	366.59	0
118	申赎	2019-09-18	1,464.46	1,464.46	0
119	申赎	2019-09-18	-1,464.46	-1,464.46	0
120	红利再投	2019-09-19	374.13	374.13	0
121	申赎	2019-09-19	1,249.82	1,249.82	0
122	申赎	2019-09-19	-1,249.82	-1,249.82	0
123	红利再投	2019-09-20	369.24	369.24	0

124	申赎	2019-09-20	729.10	729.10	0
125	申赎	2019-09-20	-729.10	-729.10	0
126	红利再投	2019-09-23	1,100.37	1,100.37	0
127	申赎	2019-09-23	369.50	369.50	0
128	申赎	2019-09-23	-369.50	-369.50	0
129	红利再投	2019-09-24	367.64	367.64	0
130	申赎	2019-09-24	657.06	657.06	0
131	申赎	2019-09-24	-657.06	-657.06	0
132	红利再投	2019-09-25	371.91	371.91	0
133	申赎	2019-09-25	192.00	192.00	0
134	申赎	2019-09-25	-192.00	-192.00	0
135	红利再投	2019-09-26	376.02	376.02	0
136	申赎	2019-09-26	220.44	220.44	0
137	申赎	2019-09-26	-220.44	-220.44	0
138	红利再投	2019-09-27	372.03	372.03	0
139	申赎	2019-09-27	221.84	221.84	0
140	申赎	2019-09-27	-221.84	-221.84	0
141	红利再投	2019-09-30	1,110.87	1,110.87	0
142	申赎	2019-09-30	146.64	146.64	0
143	申赎	2019-09-30	-146.64	-146.64	0
合计			34,756.05	34,756.05	

§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

基金管理人及基金托管人的住所。

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10月24日