中欧滚钱宝发起式货币市场基金

2019年第4季度报告

2019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:2020年01月18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2020年1月16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10月01日起至2019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	94,325,589,840.88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	94,266,401,261.32份	9,063,383.19份	50,125,196.37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10月01日 - 2019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	565,497,712.26	60,463.65	323,986.48
2.本期利润	565,497,712.26	60,463.65	323,986.48
3.期末基金资产净值	94,266,401,261.32	9,063,383.19	50,125,196.37

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	0.6107%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.2704%	0.0004%

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	0.6716%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.3313%	0.0004%

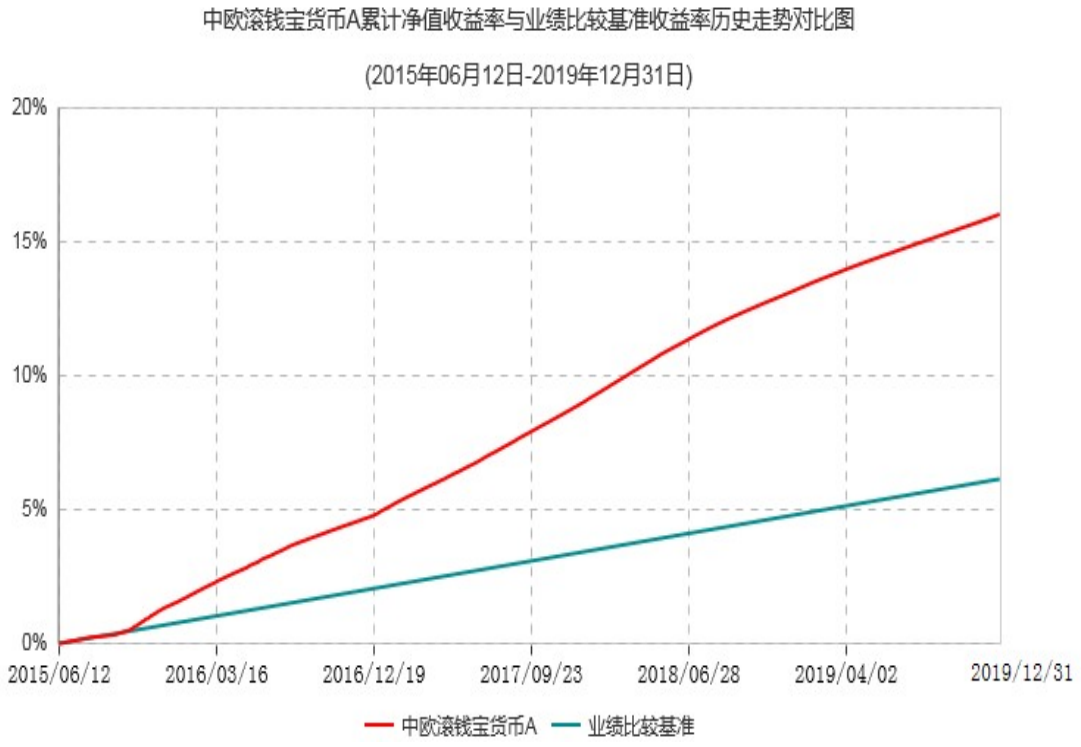
注：本基金收益分配按日结转份额。

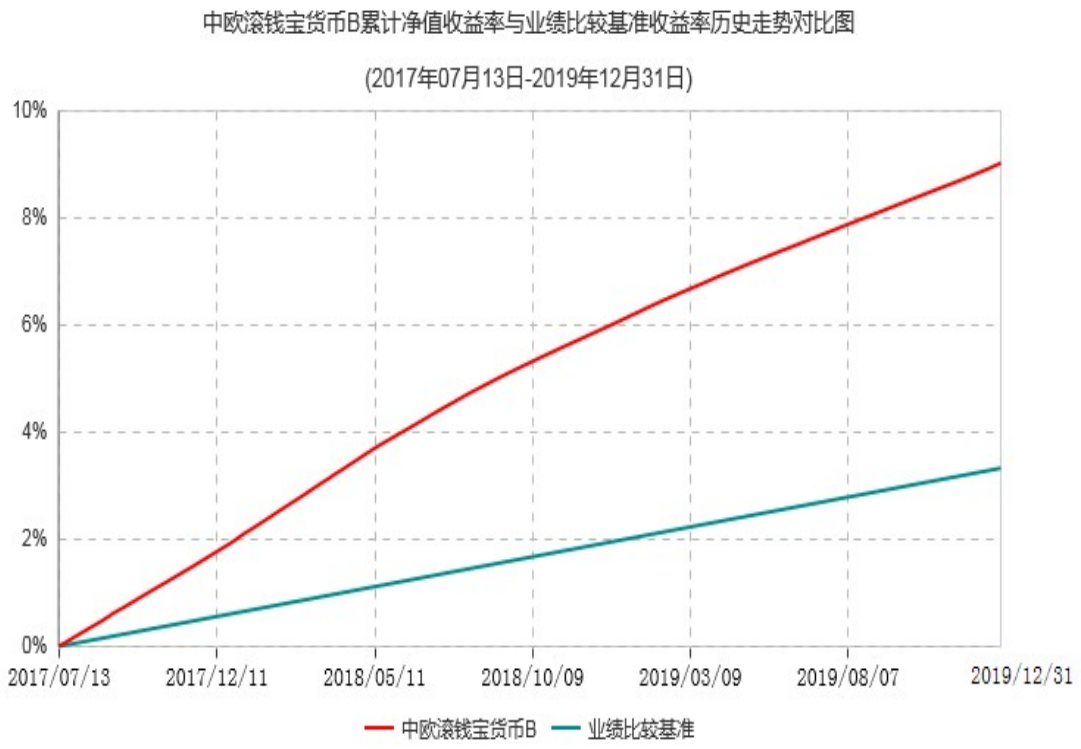
中欧滚钱宝货币C净值表现

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	0.6106%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.2703%	0.0004%

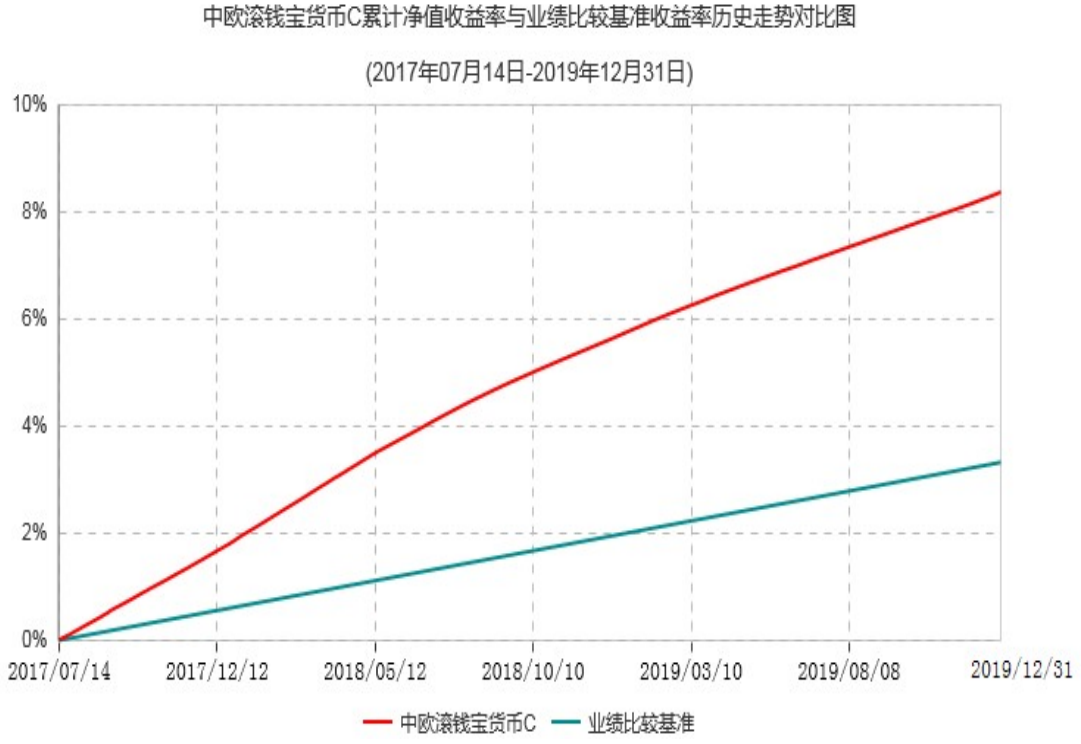
注：本基金收益分配按日结转份额。

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 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 2019 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	-	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，全球经济增长出现了回暖迹象，全球制造业PMI重返荣枯线以上。美国、日本和欧元区制造业PMI弱企稳。全球主要经济体货币政策延续宽松，主要发达国家国债收益率维持在低位甚至负利率区间。

第二，国内经济增长波动性明显下降，地产行业的韧性对经济企稳起到了关键作用。四季度市场对基本面的关注点在于通胀和通胀预期。9月CPI破3%；10月下旬，猪价持续大涨，市场对通胀的担忧加剧，进而担忧货币政策或将受到限制。直至11月央行下调MLF利率，并随后下调公开市场逆回购利率，市场彻底打消了对货币政策边际收紧的预期。

第三，四季度货币政策维持宽松，跨年流动性充裕。央行通过MLF和公开市场逆回购操作向市场投放流动性，在量价两方面保持流动性充裕。具体来看，从11月中旬开始，3m Shibor稳定在3%附近。

债券市场运行方面，四季度的债券市场的影响因素主要是通胀、流动性和中美贸易谈判的进展，收益率整体表现为先上后下。利率债收益率曲线陡峭化，信用利差压缩。四季度债券市场出现了结构性的因素，一是3年期金融债配置需求强烈，四季度下行20bp，明显超越其他期限和其他品种；二是资金面高度宽松，杠杆票息策略非常有效，绝对收益偏高个券受到追捧。

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11-12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0.6107%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；B类份额净值收益率为0.6716%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；C类份额净值收益率为0.6106%，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	37,199,877,886.29	35.30
	其中：债券	35,999,873,086.66	34.16
	资产支持证券	1,200,004,799.63	1.14
2	买入返售金融资产	12,051,586,468.14	11.43
	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	55,769,574,109.74	52.92
4	其他资产	372,853,695.15	0.35
5	合计	105,393,892,159.32	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	-	5.73
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	11,020,165,608.45	11.68
	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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

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	14.93	11.68
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	9.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	32.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	4.29	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	49.95	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		111.34	11.68

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	4,965,551,929.43	5.26
	其中：政策性金融债	4,965,551,929.43	5.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	249,270,237.07	0.26
6	中期票据	-	-

7	同业存单	30,785,050,920.16	32.64
8	其他	-	-
9	合计	35,999,873,086.66	38.17
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	111903202	19农业银行CD202	16,000,000	1,579,520,837.84	1.67
2	111903203	19农业银行CD203	15,000,000	1,480,585,706.97	1.57
3	111917113	19光大银行CD113	14,000,000	1,390,412,293.03	1.47
4	190304	19进出04	13,500,000	1,349,833,621.22	1.43
5	190206	19国开06	12,500,000	1,249,767,068.40	1.32
6	111911245	19平安银行CD245	11,000,000	1,095,316,007.83	1.16
7	111911264	19平安银行CD264	11,000,000	1,093,706,593.11	1.16
8	111911282	19平安银行CD282	11,000,000	1,092,809,507.08	1.16
9	111911277	19平安银行CD277	10,000,000	993,606,970.28	1.05
10	111905207	19建设银行CD207	10,000,000	988,180,566.21	1.05

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	0.0328%
报告期内偏离度的最低值	-0.0026%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0061%

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	165246	19花06A1	2,000,000	200,000,000.00	0.21
1	165043	花呗72A1	2,000,000	200,000,000.00	0.21
1	138135	蚁信11A	2,000,000	200,000,000.00	0.21
1	138114	蚁信10A	2,000,000	200,000,000.00	0.21
5	1989480	19上和4A1	1,000,000	100,004,799.63	0.11
6	165217	19花05A1	1,000,000	100,000,000.00	0.11
6	165046	花呗73A1	1,000,000	100,000,000.00	0.11
6	165035	中花02A1	1,000,000	100,000,000.00	0.11

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	372,492,221.86
4	应收申购款	361,473.29
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	372,853,695.15

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	93,609,489,810.02	9,002,919.54	57,046,209.73
报告期期间基金总申购份额	336,798,147,891.27	60,463.65	8,910,182.98
报告期期间基金总赎回份额	336,141,236,439.97	-	15,831,196.34
报告期期末基金份额总额	94,266,401,261.32	9,063,383.19	50,125,196.37

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	2019-10-08	2,942.13	2,942.13	0
2	申赎	2019-10-08	161.68	161.68	0
3	申赎	2019-10-08	-161.68	-161.68	0

4	红利再投	2019-10-09	366.55	366.55	0
5	红利再投	2019-10-10	365.19	365.19	0
6	申赎	2019-10-10	12.00	12.00	0
7	申赎	2019-10-10	-12.00	-12.00	0
8	红利再投	2019-10-11	371.05	371.05	0
9	红利再投	2019-10-14	1,099.47	1,099.47	0
10	红利再投	2019-10-15	360.12	360.12	0
11	申赎	2019-10-15	2.00	2.00	0
12	申赎	2019-10-15	-2.00	-2.00	0
13	红利再投	2019-10-16	362.18	362.18	0
14	红利再投	2019-10-17	366.90	366.90	0
15	红利再投	2019-10-18	361.93	361.93	0
16	红利再投	2019-10-21	1,112.06	1,112.06	0
17	红利再投	2019-10-22	374.42	374.42	0
18	申赎	2019-10-22	6.00	6.00	0
19	申赎	2019-10-22	-6.00	-6.00	0
20	红利再投	2019-10-23	354.37	354.37	0
21	申赎	2019-10-23	1.00	1.00	0
22	申赎	2019-10-23	-1.00	-1.00	0
23	红利再投	2019-10-24	367.55	367.55	0
24	申赎	2019-10-24	1.00	1.00	0
25	申赎	2019-10-24	-1.00	-1.00	0
26	红利再投	2019-10-25	365.82	365.82	0
27	申赎	2019-10-25	117.36	117.36	0
28	申赎	2019-10-25	-117.36	-117.36	0
29	红利再投	2019-10-28	1,100.09	1,100.09	0
30	申赎	2019-10-28	14.00	14.00	0
31	申赎	2019-10-28	-14.00	-14.00	0
32	红利再投	2019-10-29	359.61	359.61	0
33	申赎	2019-10-29	303.74	303.74	0
34	申赎	2019-10-29	-303.74	-303.74	0
35	红利再投	2019-10-30	358.74	358.74	0
36	申赎	2019-10-30	1,029.00	1,029.00	0

37	申赎	2019-10-30	-1,029.00	-1,029.00	0
38	红利再投	2019-10-31	356.10	356.10	0
39	申赎	2019-10-31	1,050.34	1,050.34	0
40	申赎	2019-10-31	-1,050.34	-1,050.34	0
41	红利再投	2019-11-01	361.80	361.80	0
42	申赎	2019-11-01	872.48	872.48	0
43	申赎	2019-11-01	-872.48	-872.48	0
44	红利再投	2019-11-04	1,096.72	1,096.72	0
45	申赎	2019-11-04	331.96	331.96	0
46	申赎	2019-11-04	-331.96	-331.96	0
47	红利再投	2019-11-05	366.51	366.51	0
48	申赎	2019-11-05	918.30	918.30	0
49	申赎	2019-11-05	-918.30	-918.30	0
50	红利再投	2019-11-06	364.66	364.66	0
51	申赎	2019-11-06	139.10	139.10	0
52	申赎	2019-11-06	-139.10	-139.10	0
53	红利再投	2019-11-07	355.50	355.50	0
54	申赎	2019-11-07	134.22	134.22	0
55	申赎	2019-11-07	-134.22	-134.22	0
56	红利再投	2019-11-08	361.45	361.45	0
57	申赎	2019-11-08	54.54	54.54	0
58	申赎	2019-11-08	-54.54	-54.54	0
59	红利再投	2019-11-11	1,087.50	1,087.50	0
60	申赎	2019-11-11	53.84	53.84	0
61	申赎	2019-11-11	-53.84	-53.84	0
62	红利再投	2019-11-12	359.28	359.28	0
63	申赎	2019-11-12	534.44	534.44	0
64	申赎	2019-11-12	-534.44	-534.44	0
65	红利再投	2019-11-13	357.81	357.81	0
66	申赎	2019-11-13	608.40	608.40	0
67	申赎	2019-11-13	-608.40	-608.40	0
68	红利再投	2019-11-14	360.91	360.91	0
69	申赎	2019-11-14	764.00	764.00	0

70	申赎	2019-11-14	-764.00	-764.00	0
71	红利再投	2019-11-15	361.93	361.93	0
72	申赎	2019-11-15	447.00	447.00	0
73	申赎	2019-11-15	-447.00	-447.00	0
74	红利再投	2019-11-18	1,089.88	1,089.88	0
75	申赎	2019-11-18	413.00	413.00	0
76	申赎	2019-11-18	-413.00	-413.00	0
77	红利再投	2019-11-19	362.41	362.41	0
78	申赎	2019-11-19	214.05	214.05	0
79	申赎	2019-11-19	-214.05	-214.05	0
80	红利再投	2019-11-20	367.80	367.80	0
81	红利再投	2019-11-21	369.53	369.53	0
82	申赎	2019-11-21	39.00	39.00	0
83	申赎	2019-11-21	-39.00	-39.00	0
84	红利再投	2019-11-22	370.57	370.57	0
85	申赎	2019-11-22	570.82	570.82	0
86	申赎	2019-11-22	-570.82	-570.82	0
87	红利再投	2019-11-25	1,117.25	1,117.25	0
88	申赎	2019-11-25	3,248.72	3,248.72	0
89	申赎	2019-11-25	-3,248.72	-3,248.72	0
90	红利再投	2019-11-26	373.06	373.06	0
91	申赎	2019-11-26	572.12	572.12	0
92	申赎	2019-11-26	-572.12	-572.12	0
93	红利再投	2019-11-27	371.69	371.69	0
94	申赎	2019-11-27	404.50	404.50	0
95	申赎	2019-11-27	-404.50	-404.50	0
96	红利再投	2019-11-28	374.14	374.14	0
97	申赎	2019-11-28	299.14	299.14	0
98	申赎	2019-11-28	-299.14	-299.14	0
99	红利再投	2019-11-29	376.12	376.12	0
100	申赎	2019-11-29	244.00	244.00	0
101	申赎	2019-11-29	-244.00	-244.00	0
102	红利再投	2019-12-02	1,127.13	1,127.13	0

103	申赎	2019-12-02	112.00	112.00	0
104	申赎	2019-12-02	-112.00	-112.00	0
105	红利再投	2019-12-03	376.08	376.08	0
106	申赎	2019-12-03	96.20	96.20	0
107	申赎	2019-12-03	-96.20	-96.20	0
108	红利再投	2019-12-04	386.21	386.21	0
109	申赎	2019-12-04	6.00	6.00	0
110	申赎	2019-12-04	-6.00	-6.00	0
111	红利再投	2019-12-05	382.11	382.11	0
112	申赎	2019-12-05	44.76	44.76	0
113	申赎	2019-12-05	-44.76	-44.76	0
114	红利再投	2019-12-06	380.77	380.77	0
115	申赎	2019-12-06	68.00	68.00	0
116	申赎	2019-12-06	-68.00	-68.00	0
117	红利再投	2019-12-09	1,191.76	1,191.76	0
118	申赎	2019-12-09	95.00	95.00	0
119	申赎	2019-12-09	-95.00	-95.00	0
120	红利再投	2019-12-10	401.39	401.39	0
121	申赎	2019-12-10	245.00	245.00	0
122	申赎	2019-12-10	-245.00	-245.00	0
123	红利再投	2019-12-11	410.56	410.56	0
124	申赎	2019-12-11	175.00	175.00	0
125	申赎	2019-12-11	-175.00	-175.00	0
126	红利再投	2019-12-12	390.59	390.59	0
127	申赎	2019-12-12	370.00	370.00	0
128	申赎	2019-12-12	-370.00	-370.00	0
129	红利再投	2019-12-13	393.24	393.24	0
130	申赎	2019-12-13	473.00	473.00	0
131	申赎	2019-12-13	-473.00	-473.00	0
132	红利再投	2019-12-16	1,175.57	1,175.57	0
133	申赎	2019-12-16	363.00	363.00	0
134	申赎	2019-12-16	-363.00	-363.00	0
135	红利再投	2019-12-17	388.32	388.32	0

136	申赎	2019-12-17	537.50	537.50	0
137	申赎	2019-12-17	-537.50	-537.50	0
138	红利再投	2019-12-18	387.55	387.55	0
139	申赎	2019-12-18	164.60	164.60	0
140	申赎	2019-12-18	-164.60	-164.60	0
141	红利再投	2019-12-19	391.26	391.26	0
142	申赎	2019-12-19	2,177.38	2,177.38	0
143	申赎	2019-12-19	-2,177.38	-2,177.38	0
144	红利再投	2019-12-20	395.97	395.97	0
145	申赎	2019-12-20	3,908.42	3,908.42	0
146	申赎	2019-12-20	-3,908.42	-3,908.42	0
147	红利再投	2019-12-23	1,208.22	1,208.22	0
148	申赎	2019-12-23	3,509.10	3,509.10	0
149	申赎	2019-12-23	-3,509.10	-3,509.10	0
150	红利再投	2019-12-24	409.24	409.24	0
151	申赎	2019-12-24	3,021.68	3,021.68	0
152	申赎	2019-12-24	-3,021.68	-3,021.68	0
153	红利再投	2019-12-25	419.30	419.30	0
154	申赎	2019-12-25	258.40	258.40	0
155	申赎	2019-12-25	-258.40	-258.40	0
156	红利再投	2019-12-26	423.11	423.11	0
157	申赎	2019-12-26	442.16	442.16	0
158	申赎	2019-12-26	-442.16	-442.16	0
159	红利再投	2019-12-27	427.07	427.07	0
160	申赎	2019-12-27	281.72	281.72	0
161	申赎	2019-12-27	-281.72	-281.72	0
162	红利再投	2019-12-30	1,285.15	1,285.15	0
163	申赎	2019-12-30	317.48	317.48	0
164	申赎	2019-12-30	-317.48	-317.48	0
165	红利再投	2019-12-31	430.47	430.47	0
166	申赎	2019-12-31	262.10	262.10	0
167	申赎	2019-12-31	-262.10	-262.10	0
合计			34,731.87	34,731.87	

§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 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 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

10.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

10.3 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

2020年01月18日