

**中欧货币市场基金**  
**2022年第3季度报告**  
**2022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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26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2022年10月25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2022年07月01日起至2022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	1,613,932,485.92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	中欧货币E
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	016223
报告期末下属分级基金的份额总额	107,820,153.77份	611,211,317.27份	11,428,452.02份	883,322,035.49份	150,527.37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(2022年07月01日 - 2022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	中欧货币E
1. 本期已实现收益	538,168.37	3,577,413.03	64,989.09	5,223,529.69	527.37
2. 本期利润	538,168.37	3,577,413.03	64,989.09	5,223,529.69	527.37
3. 期末基金资产净值	107,820,153.77	611,211,317.27	11,428,452.02	883,322,035.49	150,527.37

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 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	0.4103%	0.0040%	0.3403%	0.0000%	0.0700%	0.0040%
过去六个月	0.8537%	0.0035%	0.6768%	0.0000%	0.1769%	0.0035%
过去一年	1.8644%	0.0026%	1.3500%	0.0000%	0.5144%	0.0026%

过去三年	5.9919%	0.0019%	4.0500%	0.0000%	1.9419%	0.0019%
过去五年	12.2740%	0.0024%	6.7500%	0.0000%	5.5240%	0.0024%
自基金合同生效起至今	33.5478%	0.0042%	13.2335%	0.0000%	20.3143%	0.0042%

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	0.4712%	0.0040%	0.3403%	0.0000%	0.1309%	0.0040%
过去六个月	0.9749%	0.0035%	0.6768%	0.0000%	0.2981%	0.0035%
过去一年	2.1090%	0.0026%	1.3500%	0.0000%	0.7590%	0.0026%
过去三年	6.7573%	0.0019%	4.0500%	0.0000%	2.7073%	0.0019%
过去五年	13.6298%	0.0024%	6.7500%	0.0000%	6.8798%	0.0024%
自基金合同生效起至今	36.7289%	0.0042%	13.2335%	0.0000%	23.4954%	0.0042%

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	0.4279%	0.0040%	0.3403%	0.0000%	0.0876%	0.0040%
过去六个月	0.8777%	0.0035%	0.6768%	0.0000%	0.2009%	0.0035%
过去一年	1.8874%	0.0026%	1.3500%	0.0000%	0.5374%	0.0026%
过去三年	6.0090%	0.0019%	4.0500%	0.0000%	1.9590%	0.0019%
过去五年	12.2692%	0.0024%	6.7500%	0.0000%	5.5192%	0.0024%
自基金份额运作日至今	16.8221%	0.0025%	8.5491%	0.0000%	8.2730%	0.0025%

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	0.4712%	0.0040%	0.3403%	0.0000%	0.1309%	0.0040%
过去六个月	0.9749%	0.0035%	0.6768%	0.0000%	0.2981%	0.0035%
过去一年	2.1090%	0.0026%	1.3500%	0.0000%	0.7590%	0.0026%
过去三年	6.7574%	0.0019%	4.0500%	0.0000%	2.7074%	0.0019%
过去五年	13.6297%	0.0024%	6.7500%	0.0000%	6.8797%	0.0024%
自基金份额 运作日至今	17.6959%	0.0026%	8.1396%	0.0000%	9.5563%	0.0026%

注：本基金收益分配按日结转份额  
中欧货币E净值表现

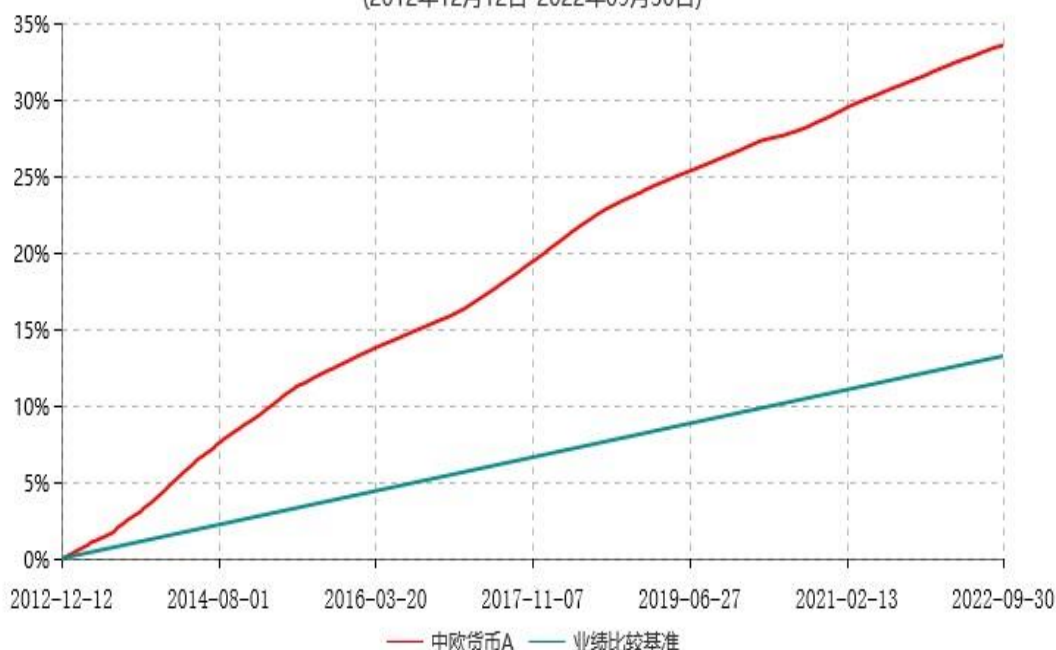
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金份额 运作日至今	0.3516%	0.0040%	0.2922%	0.0000%	0.0594%	0.0040%

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

中欧货币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

(2012年12月12日-2022年09月30日)



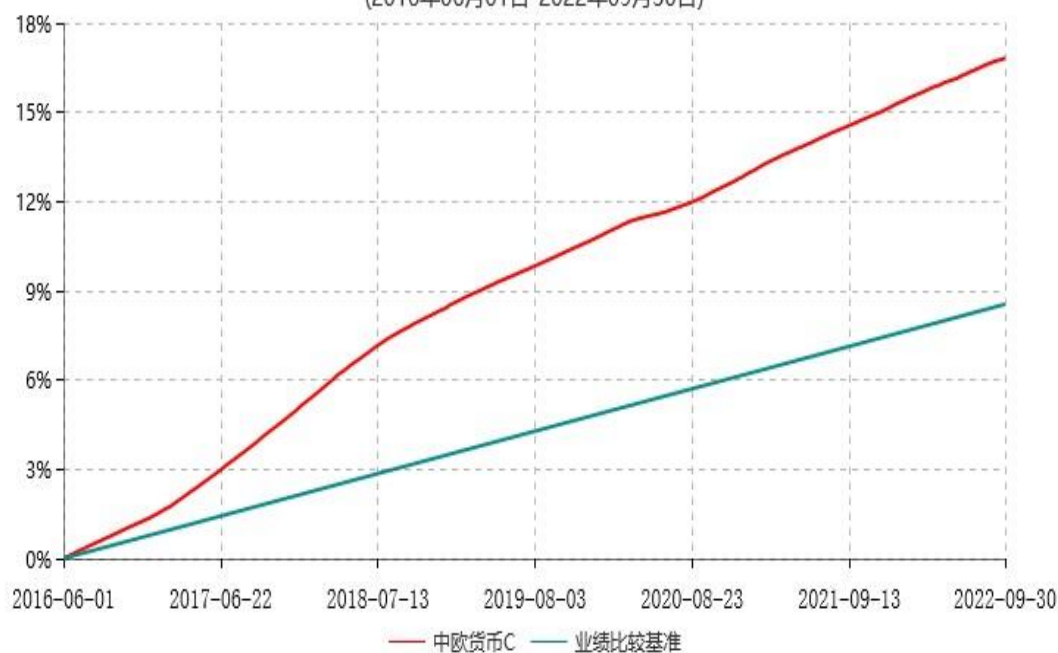
中欧货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年12月12日-2022年09月30日)



中欧货币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

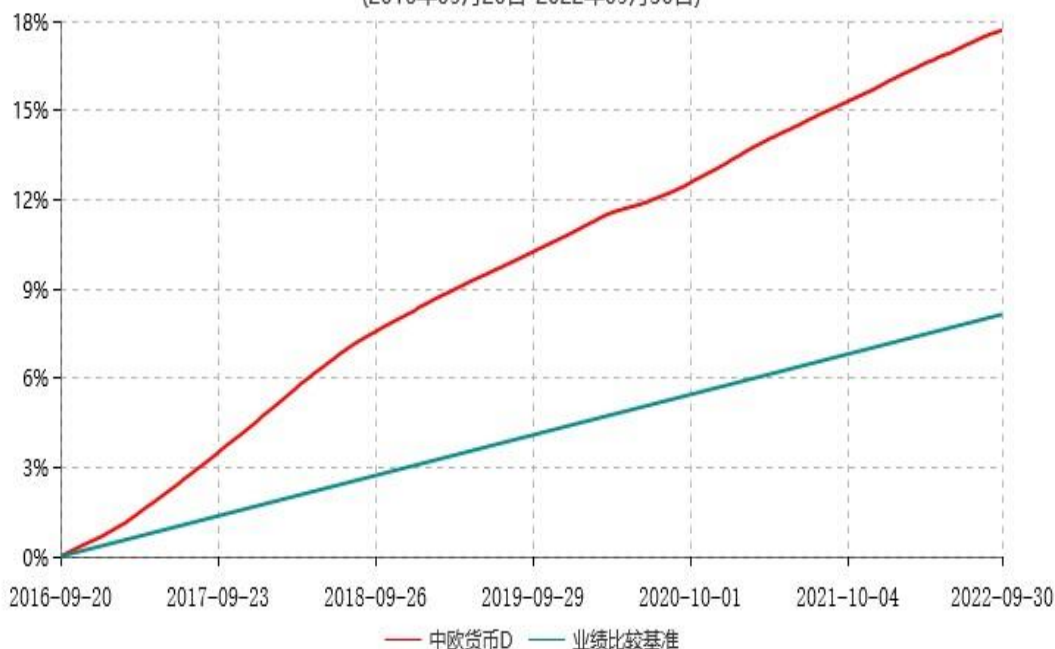
(2016年06月01日-2022年09月30日)



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 2022 年 09 月 30 日。

中欧货币D累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年09月20日-2022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 2022 年 09 月 30 日。

中欧货币E累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年07月14日-2022年09月30日)



注：本基金于 2022 年 7 月 13 日新增 E 类份额，图示日期为 2022 年 7 月 14 日至 2022 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		
张东波	基金经理	2021-08-04	-	7 年	历任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员，中山证券有限责任公司资管事业部投资主办助理。2017/09/28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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

本报告期内，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。本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易共有6次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。



本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾三季度，全球经济增长放缓，通胀高企，地缘政治冲突频发，国内经济总体延续恢复态势，但仍面临较大压力。疫情依旧零星反复，压制了内需，房地产行业的危机日渐发酵，影响居民购房意愿，九月以来陆续出台了各项宽地产政策，但效果还有待观察。在稳定宏观经济大盘的强烈诉求下，货币政策保持宽松总基调，是经济重新恢复动能的必要条件。

资金利率中枢有所波动，刚跨完半年末，资金重回宽松，7月初始，资金利率迅速回落，隔夜加权利率一直在1.2%左右，一直到8月底，资金利率开始上行。在此期间短端资产，如存单收益率，持续下行，1年存单相较于6月份下行超40bp，最低1.9%左右，但存单利率先下后上，随后到8月下旬，资金利率有所抬升，存单收益率转头上行，资金利率到9月下旬波动加大，流动性边际收紧，资金利率居高不下，机构跨季杠杆下降较快，资金仍然供不应求，跨季成本最高达到3.8%左右，然而在这种情况下，没有再突破6月份的高点，1年存单最高反弹至2.0%附近，和6月份相比仍低了30bp左右。可见流动性依然充裕，配置力量仍然强大。由于绝大多数时间内短端收益处于低位，因此仓位中配置了较高票息的资产收益相对有优势。

本基金在报告期间，兼顾流动性、控制风险的同时，择机配置优质资产。以大行、国有股份制银行、大型城农商的存单存款为主。日常操作中，维持适度的久期，杠杆水平中性，在收益率快速下行阶段没有进一步追涨，中性等待收益率反弹，力争在保障投资者的流动性管理需求的基础上，适当提高收益。

#### 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0.4103%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；B类份额净值收益率为0.4712%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；C类份额净值收益率为0.4279%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；D类份额净值收益率为0.4712%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；E类份额净值收益率为0.3516%，同期业绩比较基准收益率为0.2922%。

#### 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	934,877,406.20	56.19
	其中：债券	934,877,406.20	56.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	527,163,960.92	31.68
	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	201,740,983.99	12.13
4	其他资产	-	-
5	合计	1,663,782,351.11	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	-	2.60
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	48,977,797.48	3.03
	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	38
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

### 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	各期限负债占基金资
----	--------	-----------	-----------

		产净值的比例 (%)	产净值的比例 (%)
1	30天以内	60.02	3.03
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.89	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	27.83	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	102.74	3.03

#### 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	91,459,503.44	5.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	494,588,859.72	30.64
6	中期票据	-	-
7	同业存单	348,829,043.04	21.61
8	其他	-	-
9	合计	934,877,406.20	57.93
10	剩余存续期超过397天的浮动	-	-

	利率债券		
--	------	--	--

### 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	012282634	22东航SCP011	1,000,000	100,212,808.19	6.21
2	210016	21付息国债16	700,000	71,477,672.11	4.43
3	072110074	21国泰君安CP006	500,000	51,164,644.76	3.17
4	072210069	22国信证券CP013	500,000	50,488,492.65	3.13
5	012282464	22粤海SCP006	500,000	50,187,214.40	3.11
6	072210128	22东吴证券CP008	500,000	50,091,660.27	3.10
7	112174276	21成都银行CD297	500,000	49,885,443.22	3.09
8	112285954	22广州农村商业银行CD096	500,000	49,879,829.46	3.09
9	112109299	21浦发银行CD299	500,000	49,854,192.69	3.09
10	112105261	21建设银行CD261	500,000	49,821,940.62	3.09

### 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	0.0538%
报告期内偏离度的最低值	0.0178%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0390%

#### 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 报告期末按摊余成本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21浦发银行CD299的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于2022年09月02日受到国家外汇管理局上海市分局的上海汇管罚字（2022）3111220601号，于2022年08月17日受到上海市市场监管局的沪市监总处（2022）322021000345号，于2022年03月21日受到银保监会的银保监罚决字（2022）25号，于2021年11月15日受到国家外汇管理局上海市分局的上海汇管罚字（2021）3121210802号。罚没合计1694.19万元人民币。本基金投资的21成都银行CD297的发行主体成都银行股份有限公司于2022年07月08日受到央行成都分行的成银罚字（2022）20号。罚没合计194.6万元人民币。本基金投资的21建设银行CD261的发行主体中国建设银行股份有限公司于2022年03月21日受到银保监会的银保监罚决字（2022）14号。罚没合计470万元人民币。本基金投资的22国信证券CP013的发行主体国信证券股份有限公司于2022年02月11日受到央行深圳市中心支行的深人银罚（2022）9号。罚没合计105万元人民币。本基金投资的22广州农村商业银行CD096的发行主体广州农村商业银行股份有限公司于2022年01月28日受到广东银保监局的粤银保监罚决字（2022）9号，于2021年12月31日受到央行广州分行的广州银罚字[2021]19号。罚没合计690万元人民币。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。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

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 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	中欧货币E
报告期期初基金份	129,497,7	840,582,4	16,930,15	1,218,30	-

额总额	67.71	93.88	3.20	7,348.61	
报告期期间基金总 申购份额	106,830,0 21.74	31,142,40 7.29	4,306,79 5.99	232,065,4 34.46	150,527.3 7
报告期期间基金总 赎回份额	128,507,6 35.68	260,513,5 83.90	9,808,49 7.17	567,050,7 47.58	-
报告期期末基金份 额总额	107,820,1 53.77	611,211,3 17.27	11,428,45 2.02	883,322,0 35.49	150,527.3 7

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	2022-07-01	119,583.84	119,583.84	0
2	红利再投	2022-07-04	97,556.31	97,556.31	0
3	红利再投	2022-07-05	31,861.47	31,861.47	0
4	红利再投	2022-07-06	33,115.87	33,115.87	0
5	红利再投	2022-07-07	29,865.48	29,865.48	0
6	红利再投	2022-07-08	118,501.26	118,501.26	0
7	红利再投	2022-07-11	81,538.82	81,538.82	0
8	红利再投	2022-07-12	15,316.57	15,316.57	0
9	红利再投	2022-07-13	14,886.47	14,886.47	0
10	红利再投	2022-07-14	37,744.35	37,744.35	0
11	申赎	2022-07-14	150,000.00	150,000.00	0
12	红利再投	2022-07-15	59,428.46	59,428.46	0
13	红利再投	2022-07-18	79,560.46	79,560.46	0
14	红利再投	2022-07-19	27,124.64	27,124.64	0
15	红利再投	2022-07-20	123,469.69	123,469.69	0
16	红利再投	2022-07-21	26,296.88	26,296.88	0
17	红利再投	2022-07-22	26,191.48	26,191.48	0
18	红利再投	2022-07-25	78,043.03	78,043.03	0
19	红利再投	2022-07-26	24,266.61	24,266.61	0
20	申赎	2022-07-26	-90,003,705.3 4	-90,003,705.3 4	0
21	红利再投	2022-07-27	24,193.62	24,193.62	0
22	红利再投	2022-07-28	110,352.81	110,352.81	0

23	红利再投	2022-07-29	22,792.62	22,792.62	0
24	红利再投	2022-08-01	68,249.79	68,249.79	0
25	红利再投	2022-08-02	22,350.26	22,350.26	0
26	红利再投	2022-08-03	23,231.09	23,231.09	0
27	红利再投	2022-08-04	106,447.50	106,447.50	0
28	红利再投	2022-08-05	21,623.09	21,623.09	0
29	红利再投	2022-08-08	63,869.16	63,869.16	0
30	红利再投	2022-08-09	21,175.70	21,175.70	0
31	红利再投	2022-08-10	21,948.39	21,948.39	0
32	红利再投	2022-08-11	107,946.97	107,946.97	0
33	红利再投	2022-08-12	21,065.42	21,065.42	0
34	红利再投	2022-08-15	62,841.15	62,841.15	0
35	红利再投	2022-08-16	20,881.06	20,881.06	0
36	红利再投	2022-08-17	21,812.46	21,812.46	0
37	红利再投	2022-08-18	103,892.49	103,892.49	0
38	红利再投	2022-08-19	21,117.75	21,117.75	0
39	红利再投	2022-08-22	63,950.29	63,950.29	0
40	红利再投	2022-08-23	21,369.04	21,369.04	0
41	红利再投	2022-08-24	21,390.07	21,390.07	0
42	红利再投	2022-08-25	62,752.22	62,752.22	0
43	红利再投	2022-08-26	21,352.53	21,352.53	0
44	红利再投	2022-08-29	65,198.64	65,198.64	0
45	红利再投	2022-08-30	21,661.61	21,661.61	0
46	红利再投	2022-08-31	22,178.97	22,178.97	0
47	红利再投	2022-09-01	103,532.12	103,532.12	0
48	红利再投	2022-09-02	22,111.96	22,111.96	0
49	红利再投	2022-09-05	65,700.52	65,700.52	0
50	红利再投	2022-09-06	21,712.05	21,712.05	0
51	红利再投	2022-09-07	20,169.83	20,169.83	0
52	红利再投	2022-09-08	19,518.44	19,518.44	0
53	红利再投	2022-09-09	19,851.40	19,851.40	0
54	红利再投	2022-09-13	79,345.21	79,345.21	0
55	红利再投	2022-09-14	19,971.71	19,971.71	0

56	红利再投	2022-09-15	54,536.97	54,536.97	0
57	红利再投	2022-09-16	19,311.27	19,311.27	0
58	红利再投	2022-09-19	57,857.97	57,857.97	0
59	红利再投	2022-09-20	19,389.93	19,389.93	0
60	红利再投	2022-09-21	19,665.19	19,665.19	0
61	红利再投	2022-09-22	19,912.54	19,912.54	0
62	红利再投	2022-09-23	18,665.53	18,665.53	0
63	红利再投	2022-09-26	88,118.80	88,118.80	0
64	红利再投	2022-09-27	19,762.12	19,762.12	0
65	红利再投	2022-09-28	55,464.14	55,464.14	0
66	红利再投	2022-09-29	24,617.61	24,617.61	0
67	红利再投	2022-09-30	25,426.77	25,426.77	0
合计			-86,869,066.87	-86,869,066.87	

注：本基金管理人运用自有资金申赎（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	2022年7月1日至2022年9月30日	955,885,699.76	4,333,415.40	135,729,361.68	824,489,753.48	51.09%
	2	2022年9月14日至2022年9月30日	343,297,082.08	1,753,183.67	0.00	345,050,265.75	21.38%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

注：申购份额含红利再投份额、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

### 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媒介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](http://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

2022年10月26日