中欧滚钱宝发起式货币市场基金

2023年第1季度报告

2023年03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:2023年04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2023年4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2023年01月01日起至2023年03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	105,745,919,116.44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	105,654,516,767.80份	5,590,332.94份	85,812,015.70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(2023年01月01日 - 2023年03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	492,909,160.23	28,863.32	398,512.94
2.本期利润	492,909,160.23	28,863.32	398,512.94
3.期末基金资产净值	105,654,516,767.80	5,590,332.94	85,812,015.70

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	0.4595%	0.0005%	0.3329%	0.0000%	0.1266%	0.0005%
过去六个月	0.8200%	0.0008%	0.6732%	0.0000%	0.1468%	0.0008%
过去一年	1.6667%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	0.3167%	0.0007%
过去三年	5.9091%	0.0009%	4.0472%	0.0000%	1.8619%	0.0009%
过去五年	12.1305%	0.0018%	6.7500%	0.0000%	5.3805%	0.0018%
自基金合同生效起至今	23.6602%	0.0032%	10.5337%	0.0000%	13.1265%	0.0032%

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	0.5190%	0.0005%	0.3329%	0.0000%	0.1861%	0.0005%
过去六个月	0.9407%	0.0008%	0.6732%	0.0000%	0.2675%	0.0008%
过去一年	1.9110%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	0.5610%	0.0007%
过去三年	6.6738%	0.0009%	4.0472%	0.0000%	2.6266%	0.0009%
过去五年	13.4808%	0.0018%	6.7500%	0.0000%	6.7308%	0.0018%
自基金份额运作日至今	17.0970%	0.0024%	7.7190%	0.0000%	9.3780%	0.0024%

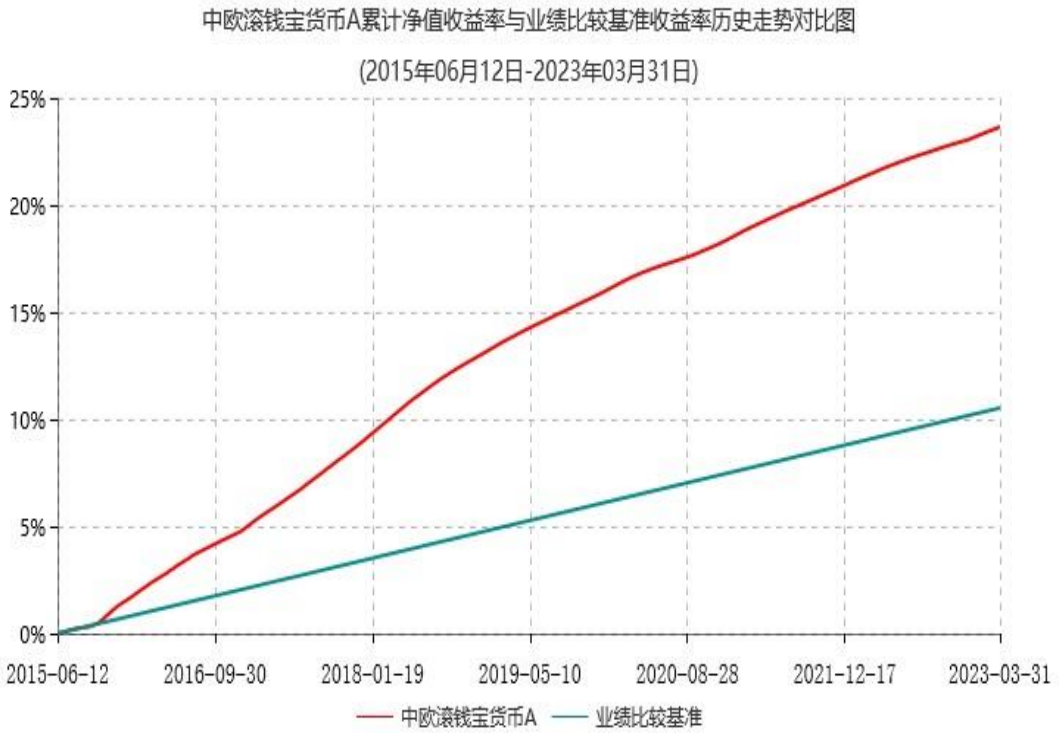
注：本基金收益分配按日结转份额

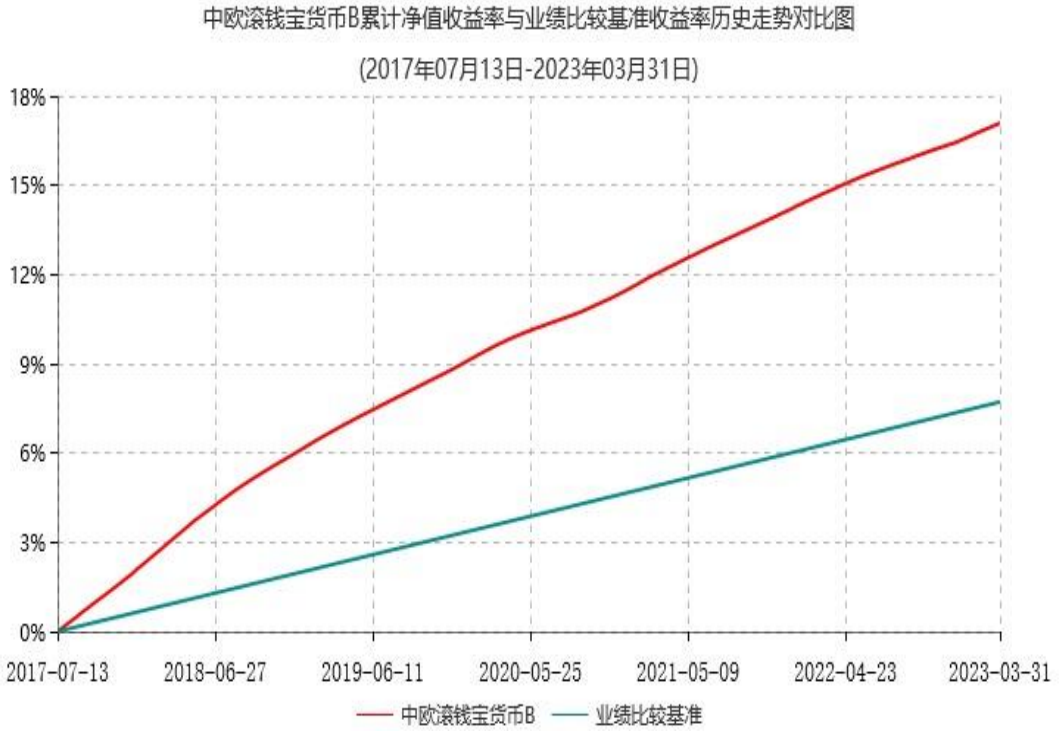
中欧滚钱宝货币C净值表现

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	0.4594%	0.0005%	0.3329%	0.0000%	0.1265%	0.0005%
过去六个月	0.8198%	0.0008%	0.6732%	0.0000%	0.1466%	0.0008%
过去一年	1.6665%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	0.3165%	0.0007%
过去三年	5.9092%	0.0009%	4.0472%	0.0000%	1.8620%	0.0009%
过去五年	12.1273%	0.0018%	6.7500%	0.0000%	5.3773%	0.0018%
自基金份额运作日至今	15.4908%	0.0024%	7.7153%	0.0000%	7.7755%	0.0024%

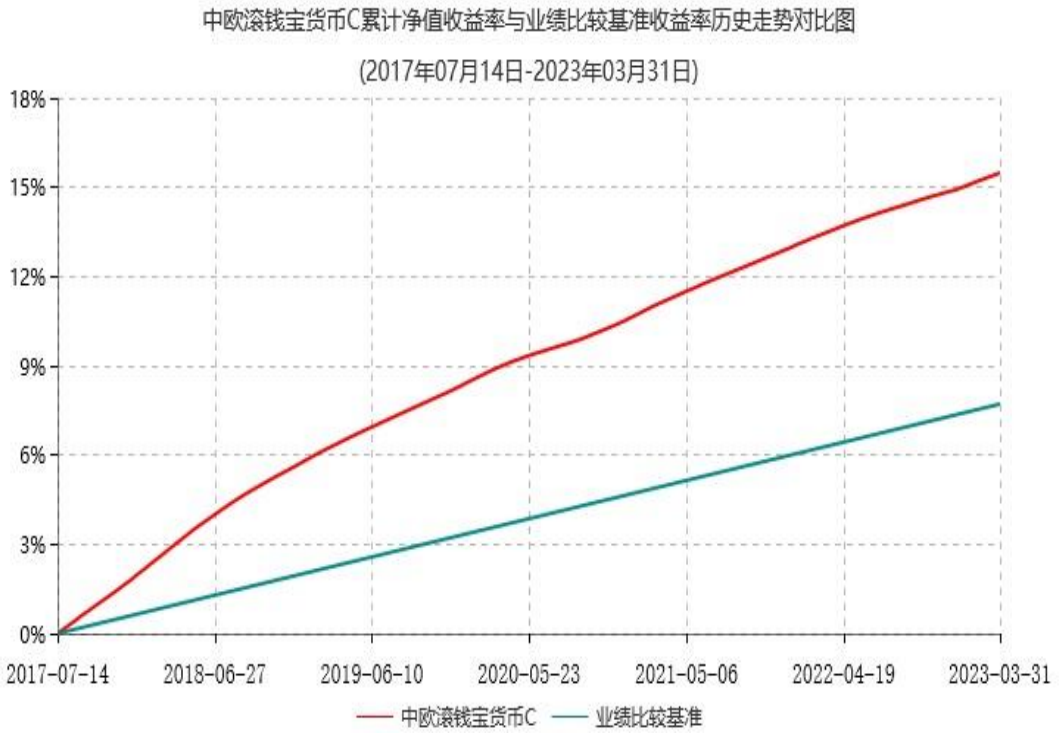
注：本基金收益分配按日结转份额

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 2023 年 03 月 31 日。



注：自 2017 年 7 月 12 日起，本基金增加 C 份额。图示日期为 2017 年 7 月 14 日至 2023 年 03 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	-	11年	历任彭博咨询社（纽约）利率衍生品研发员，光大保德信基金管理有限公司研究员、基金经理。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	2022-09-30	-	8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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

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

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26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

回顾一季度，国内经济复苏保持向好的势头，带动贷款的需求明显回暖，社融数据亮眼。中国人民银行发布调查报告显示，我国企业家宏观经济热度指数为33.8%，比上季上升10.3个百分点；银行家宏观经济热度指数为40.2%，比上季上升22.8个百分点。一季度，我国贷款总体需求指数为78.4%，比上季上升19.0个百分点，比上年同期上升6.1个百分点。年初，央行工作会议定调全年，贯彻二十大会议精神，对于货币市场而言，坚持稳健的货币政策更加灵活适度。流动性上面，合理充裕，为经济复苏保驾护航，同时，走出疫情阴霾之后，货币政策逐渐回归正常，围绕政策利率上下波动。一季度初始，受刺激经济、贷款预期较好的影响，同业存单收益率1月份上行，随着资金的宽裕状态不改，同业存单收益率2月开始下行，但随着1月份贷款数据的公布，2月下旬存单收益率再度上行，3月下旬开始央行公开市场投放超1万亿跨季资金，以及降准0.25个百分点，维护跨季流动性，收益率再度小幅下行。总体而言，货币市场收益率窄幅波动，一季度为经济复苏开了个好头，在去年底银行理财负反馈事件之后，货币政策稳字当头。

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、大型城农商行的存单存款为主，以优质AAA信用债配置为辅。日常操作中，维持适度久期，杠杆水平中性，时刻关注负债端情况变化，在保障投资者的流动性管理需求的基础上，力争努力提高收益。

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0.4595%，同期业绩比较基准收益率为0.3329%；B类份额净值收益率为0.5190%，同期业绩比较基准收益率为0.3329%；C类份额净值收益率为0.4594%，同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

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	48,378,580,988.87	43.16
	其中：债券	48,378,580,988.87	43.16
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	27,933,667,927.03	24.92
	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	35,768,486,566.27	31.91
4	其他资产	98,733.21	0.00
5	合计	112,080,834,215.38	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	-	2.08
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	6,280,722,984.42	5.94
	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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

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	31.00	5.94
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	28.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	3.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	31.21	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		105.65	5.94

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	1,440,817,653.86	1.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,942,379,509.87	4.67
	其中：政策性金融债	4,138,776,793.00	3.91
4	企业债券	710,682,226.81	0.67
5	企业短期融资券	5,817,868,853.47	5.50
6	中期票据	1,661,116,227.53	1.57
7	同业存单	33,805,716,517.33	31.97
8	其他	-	-
9	合计	48,378,580,988.87	45.75
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	220206	22国开06	19,800,000	2,010,288,117.89	1.90
2	180309	18进出09	11,500,000	1,194,871,649.26	1.13
3	229976	22贴现国债76	10,900,000	1,084,788,842.63	1.03
4	112205140	22建设银行CD140	10,500,000	1,039,586,952.28	0.98
5	112315143	23民生银行CD143	10,000,000	994,257,996.51	0.94
6	112204032	22中国银行CD032	9,500,000	940,657,200.25	0.89
7	042280296	22电网CP01	9,000,000	910,718,507.84	0.86

		0			
8	112313035	23浙商银行CD035	7,000,000	689,098,117.66	0.65
9	112309041	23浦发银行CD041	6,000,000	597,873,263.27	0.57
10	012283773	22电网SCP015	5,000,000	502,617,366.20	0.48

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	0.0308%
报告期内偏离度的最低值	-0.0001%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0105%

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22建设银行CD140的发行主体于2023年02月16日受到银保监会的银保监罚决字〔2023〕10号，于2022年09月30日受到银保监会的银保监罚决字〔2022〕51号，于2022年09月09日受到银保监会的银保监罚决字〔2022〕44号。罚没合计7801.56万元人民币。本基金投资的22中国银行CD032的发行主体于2023年02月16日受到银保监会的银保监罚决字〔2023〕5号，于2022年05月26日受到银保监会的银保监罚决字〔2022〕29号。罚没合计1800.00万元人民币。 本基金投资的23民生银行CD143的发行主体中国民生银行股份有限公司于2023年02月16日受到银保监会的银保监罚决字〔2023〕2号。

罚没合计6672.46万元人民币。 本基金投资的23浦发银行CD041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。罚没合计1268.19万元人民币。 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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,796.25
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	70,936.96
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	98,733.21

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	104,063,404,441.17	5,561,469.62	95,678,241.67
报告期期间基金总申购份额	259,679,998,883.41	28,863.32	21,747,074.82
报告期期间基金总赎回份额	258,088,886,556.78	-	31,613,300.79
报告期期末基金份额总额	105,654,516,767.80	5,590,332.94	85,812,015.70

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	2023-01-03	1,409.40	1,409.40	0
2	红利再投	2023-01-04	342.49	342.49	0
3	红利再投	2023-01-05	310.67	310.67	0
4	红利再投	2023-01-06	369.66	369.66	0
5	红利再投	2023-01-09	888.08	888.08	0
6	红利再投	2023-01-10	293.49	293.49	0
7	红利再投	2023-01-11	285.65	285.65	0
8	红利再投	2023-01-12	292.43	292.43	0
9	红利再投	2023-01-13	292.41	292.41	0
10	红利再投	2023-01-16	1,057.99	1,057.99	0
11	红利再投	2023-01-17	440.44	440.44	0
12	红利再投	2023-01-18	309.38	309.38	0
13	红利再投	2023-01-19	334.27	334.27	0
14	红利再投	2023-01-20	325.24	325.24	0
15	红利再投	2023-01-30	3,230.86	3,230.86	0
16	红利再投	2023-01-31	402.98	402.98	0
17	红利再投	2023-02-01	354.83	354.83	0
18	红利再投	2023-02-02	330.66	330.66	0
19	红利再投	2023-02-03	312.22	312.22	0
20	红利再投	2023-02-06	931.66	931.66	0
21	红利再投	2023-02-07	306.87	306.87	0
22	红利再投	2023-02-08	297.66	297.66	0
23	红利再投	2023-02-09	314.96	314.96	0
24	红利再投	2023-02-10	328.05	328.05	0
25	红利再投	2023-02-13	926.73	926.73	0
26	红利再投	2023-02-14	312.55	312.55	0
27	红利再投	2023-02-15	311.98	311.98	0
28	红利再投	2023-02-16	335.88	335.88	0
29	红利再投	2023-02-17	301.98	301.98	0
30	红利再投	2023-02-20	913.96	913.96	0
31	红利再投	2023-02-21	306.24	306.24	0
32	红利再投	2023-02-22	307.96	307.96	0

33	红利再投	2023-02-23	310.62	310.62	0
34	红利再投	2023-02-24	328.70	328.70	0
35	红利再投	2023-02-27	949.77	949.77	0
36	红利再投	2023-02-28	315.42	315.42	0
37	红利再投	2023-03-01	312.55	312.55	0
38	红利再投	2023-03-02	319.21	319.21	0
39	红利再投	2023-03-03	329.11	329.11	0
40	红利再投	2023-03-06	926.96	926.96	0
41	红利再投	2023-03-07	307.05	307.05	0
42	红利再投	2023-03-08	299.33	299.33	0
43	红利再投	2023-03-09	298.96	298.96	0
44	红利再投	2023-03-10	288.83	288.83	0
45	红利再投	2023-03-13	896.54	896.54	0
46	红利再投	2023-03-14	302.17	302.17	0
47	红利再投	2023-03-15	305.66	305.66	0
48	红利再投	2023-03-16	318.51	318.51	0
49	红利再投	2023-03-17	321.87	321.87	0
50	红利再投	2023-03-20	961.68	961.68	0
51	红利再投	2023-03-21	312.86	312.86	0
52	红利再投	2023-03-22	312.45	312.45	0
53	红利再投	2023-03-23	314.10	314.10	0
54	红利再投	2023-03-24	318.74	318.74	0
55	红利再投	2023-03-27	960.28	960.28	0
56	红利再投	2023-03-28	324.10	324.10	0
57	红利再投	2023-03-29	345.02	345.02	0
58	红利再投	2023-03-30	354.14	354.14	0
59	红利再投	2023-03-31	372.19	372.19	0
合计			29,186.45	29,186.45	

注：本基金管理人运用固有资金申赎（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 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媒介上公开披露的各项公告

10.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

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

2023年04月22日