中欧滚钱宝发起式货币市场基金
2026年第3季度报告

2026年9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：2026年10月27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约定，于 2026 年 10 月 26 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 2026 年 07 月 01 日起至 2026 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 6 月 12 日		
报告期末基金份额总额	148,484,138,639.47 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	148,348,989,347.99 份	5,931,228.40 份	129,218,063.08 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（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 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	342,223,993.90	16,878.91	313,943.80
2.本期利润	342,223,993.90	16,878.91	313,943.80
3.期末基金资产净值	148,348,989,347.99	5,931,228.40	129,218,063.08

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

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	0.2247%	0.0001%	0.3403%	0.0000%	-0.1156%	0.0001%
过去六个月	0.4775%	0.0003%	0.6769%	0.0000%	-0.1994%	0.0003%
过去一年	1.0138%	0.0003%	1.3501%	0.0000%	-0.3363%	0.0003%
过去三年	4.1551%	0.0013%	4.0504%	0.0000%	0.1047%	0.0013%
过去五年	7.9422%	0.0013%	6.7507%	0.0000%	1.1915%	0.0013%
过去七年	12.6679%	0.0014%	9.4510%	0.0000%	3.2169%	0.0014%
过去十年	24.7443%	0.0027%	13.5005%	0.0000%	11.2438%	0.0027%
自基金合同生效起至今	29.9629%	0.0032%	15.2622%	0.0000%	14.7007%	0.0032%

注：本基金收益分配按日结转份额

中欧滚钱宝货币 B

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	0.2854%	0.0001%	0.3403%	0.0000%	-0.0549%	0.0001%
过去六个月	0.5985%	0.0003%	0.6769%	0.0000%	-0.0784%	0.0003%
过去一年	1.2565%	0.0003%	1.3501%	0.0000%	-0.0936%	0.0003%
过去三年	4.9075%	0.0013%	4.0504%	0.0000%	0.8571%	0.0013%
过去五年	9.2451%	0.0013%	6.7507%	0.0000%	2.4944%	0.0013%
过去七年	14.5764%	0.0014%	9.4510%	0.0000%	5.1254%	0.0014%
自基金份额起始运作日至今	24.1033%	0.0025%	12.4472%	0.0000%	11.6561%	0.0025%

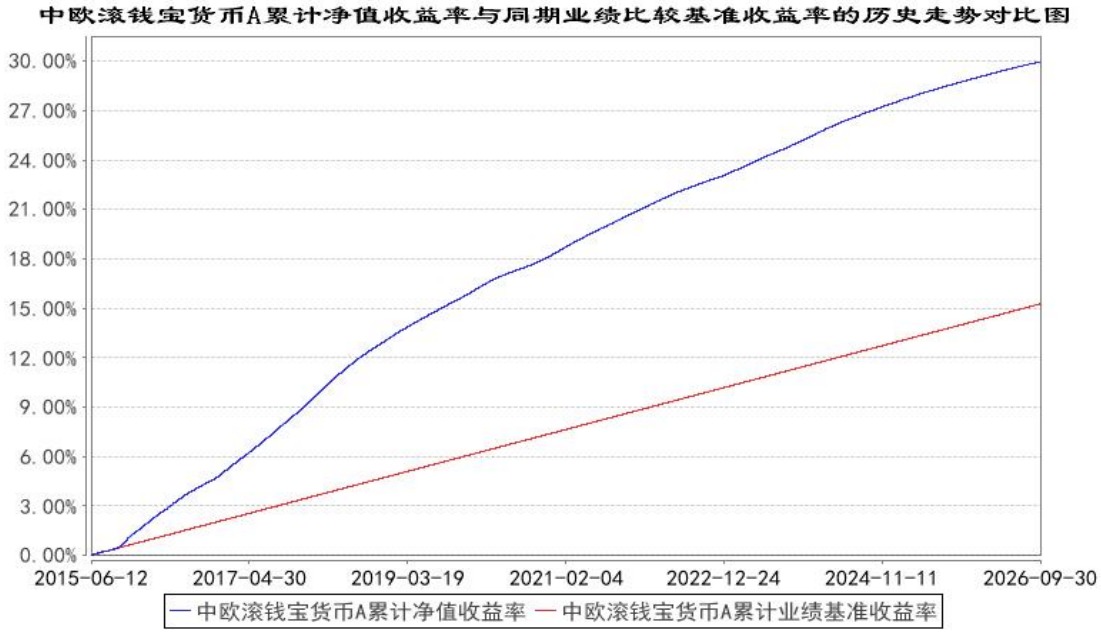
注：本基金收益分配按日结转份额

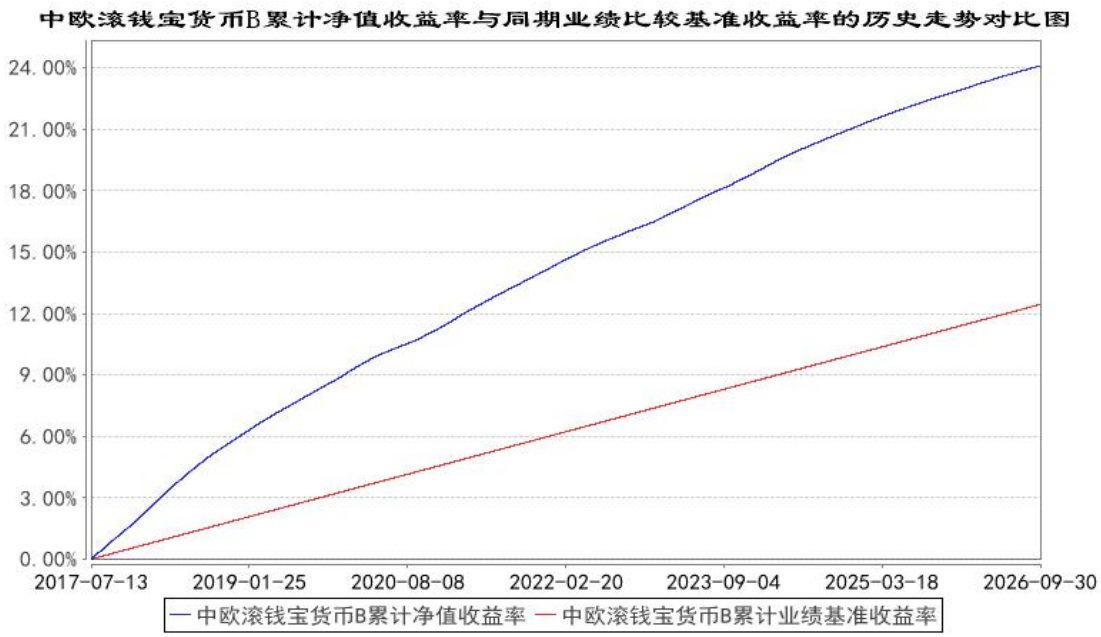
中欧滚钱宝货币 C

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	0.2246%	0.0001%	0.3403%	0.0000%	-0.1157%	0.0001%
过去六个月	0.4773%	0.0003%	0.6769%	0.0000%	-0.1996%	0.0003%
过去一年	1.0137%	0.0003%	1.3501%	0.0000%	-0.3364%	0.0003%
过去三年	4.1552%	0.0013%	4.0504%	0.0000%	0.1048%	0.0013%
过去五年	7.9422%	0.0013%	6.7507%	0.0000%	1.1915%	0.0013%
过去七年	12.6678%	0.0014%	9.4510%	0.0000%	3.2168%	0.0014%
自基金份额起始运作日至今	21.3771%	0.0025%	12.4435%	0.0000%	8.9336%	0.0025%

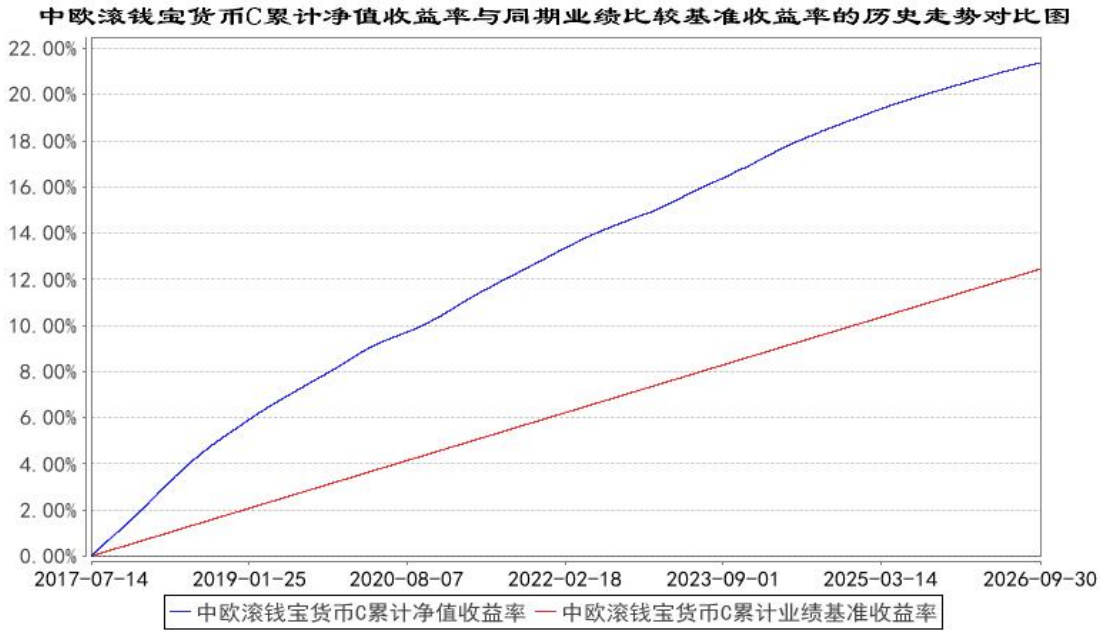
注：本基金收益分配按日结转份额

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 2026 年 09 月 30 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 2026 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		
管志玉	基金经理	2026-09-02	-	18 年	历任博时基金管理有限公司交易员，西南

	/基金经理助理				证券股份有限公司投资经理，开源证券股份有限公司投资主办，建信理财有限责任公司高级投资经理。2023-09-18 加入中欧基金管理有限公司。
王慧杰	基金经理	2026-09-02	-	15 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	2026-09-02	11 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。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中管志玉担任本基金的基金经理。

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 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

2026 年三季度，经济基本面整体延续弱修复，边际动能有所放缓，生产端好于需求端，内外分化的格局进一步加深。出口保持高景气，7、8 月出口同比分别为 23.9%和 25.0%；内需继续走弱，社零当月同比降到 0.6%和 0.4%，1-8 月固定资产投资累计同比下降 7.2%，地产销售和开工降幅都在扩大。制造业 PMI 在 7 月跌到 49.2%，回到荣枯线以下，之后逐月回升，9 月回到 50.1%。通胀方面，CPI 中枢从二季度的 1%左右回落，7、8 月分别为 0.5%和 0.8%。PPI 在 6 月达到 4.1%后见顶回落，7 月降至 3.5%，8 月因大宗商品扰动回升至 3.8%，整体在高位磨顶。

债券市场方面，基本面对债市形成支撑，政策面上整体偏向顺风，核心是货币政策宽松预期，财政与地产政策形成一定扰动。从单月来看，7 月份，跨季后流动性回笼，超长特别国债招标偏弱，长端收益率在窄幅区间内震荡。中下旬央行加量续作买断式逆回购和 MLF，资金转向均衡偏松；政治局会议释放加大逆周期调节的信号，宽松预期升温。超长端在下旬率先突破，30-10 年利差快速压缩，10 年国债下至 1.71%，1 年期 AAA 存单收益率则小幅上行至 1.48%附近。8 月份，出口和通胀回落对债市偏利好，但央行 7 天逆回购连续地量或零投放，DR001 成为短端调控的锚，1 年国债上行近 8bp 至 1.22%，1 年 AAA 存单在 1.48%附近窄幅波动。长端受政府债供给高峰和股债跷跷板压制，10 年国债在 1.70%附近拉锯。9 月份，税期叠加政府债缴款，DR001 升至 1.47%的年内高点，央行重启 14 天逆回购、加量续作 MLF，帮助资金平稳跨季。月末 PSL 降息 25bp，以结构性工具替代总量宽松，30 年国债下至 2.07%的年内新低，10 年国债收于 1.68%附近，1 年 AAA 存单收益率在 9 月末结束了两个多月的震荡，收益率下行至 1.47%下方。

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，以优质 AAA 信用债配置为辅。日常操作中，维持适度的久期，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，努力提高收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 0.2247%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；基金 B 类份额净值增长率为 0.2854%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；基金 C 类份额净值增长率为 0.2246%，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	75,287,990,586.98	48.38
	其中：债券	75,287,990,586.98	48.38
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	9,363,531,319.89	6.02
	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	70,955,242,394.81	45.60
4	其他资产	256,116.84	0.00
5	合计	155,607,020,418.52	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	2.64	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	7,050,130,063.86	4.75
	其中：买断式回购融资	-	-

注：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	109
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	98

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	18.86	4.75

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	23.56	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	38.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.54	4.75

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	公允价值（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	9,659,607,746.59	6.51
	其中：政策性金融债	5,012,216,773.54	3.38
4	企业债券	245,531,298.52	0.17
5	企业短期融资券	1,824,234,598.00	1.23
6	中期票据	51,524,271.27	0.03
7	同业存单	63,507,092,672.60	42.77
8	其他	-	-
9	合计	75,287,990,586.98	50.70
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 报告期末按公允价值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）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	09250409	25 农发清发 09	47,300,000	4,737,589,675.54	3.19
2	112621224	26 渤海银行 CD224	20,000,000	1,993,788,014.24	1.34
3	112605161	26 建设银行	15,000,000	1,495,139,532.56	1.01

		CD161			
4	112610137	26兴业银行CD137	15,000,000	1,492,987,700.96	1.01
5	112693743	26重庆银行CD012	15,000,000	1,488,593,235.08	1.00
6	112613074	26浙商银行CD074	15,000,000	1,487,205,681.66	1.00
7	112694895	26中原银行CD058	11,000,000	1,094,901,014.22	0.74
8	112617027	26光大银行CD027	11,000,000	1,092,666,700.23	0.74
9	112692978	26厦门国际银行CD005	11,000,000	1,092,260,278.86	0.74
10	112692635	26深圳农商银行CD022	10,000,000	997,058,298.05	0.67

5.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0125%
报告期内偏离度的最低值	0.0031%
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

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

本基金按照实际利率计算账面价值，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1.0000元。

5.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体中，渤海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、中国人民银行天津市分行的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中

国人民银行的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。重庆银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局重庆监管局、国家外汇管理局重庆市分局的处罚。中原银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行河南省分行的处罚。中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。厦门国际银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行厦门市分行(国家外汇管理局厦门市分局)的处罚。深圳农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局深圳监管局、中国人民银行深圳市分行(国家外汇管理局深圳市分局)的处罚。

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	255,923.64
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	193.20
6	其他	-
7	合计	256,116.84

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

项目	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	153,492,893,448.98	5,914,909.08	154,957,362.68
报告期期间基金总申购份额	304,931,428,306.55	16,878.91	31,987,707.69
报告期期间基金总赎回份额	310,075,332,407.54	559.59	57,727,007.29

报告期期末基金份额总额	148,348,989,347.99	5,931,228.40	129,218,063.08

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	-	16,867.03	-	-
合计			16,867.03	-	

注：本基金管理人运用固有资金交易本基金所适用的费率符合基金合同、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、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；

2、基金管理人业务资格批件、营业执照

3、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

2026 年 10 月 27 日