

中欧货币市场基金2016年年度报告摘要

2016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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017年3月31日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2017年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	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			
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			
报告期末基金份额总额	2,468,327,210.19份			
基金合同存续期	不定期			
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
下属分级基金的交易代码	166014	166015	002747	002748
报告期末下属分级基金的份额总额	79,123,698.82份	2,232,129,786.34份	8,149.02份	157,065,576.01份

注：自2016年5月4日起,本基金增加C类和D类基金份额，登记机构为中欧基金管理有限公司。

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

			司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	010-66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、 400-700-9700	95588
传真		021-33830351	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2016年				2015年				2014年			
	中欧货 币A	中欧货 币B	中欧货 币C	中欧货 币D	中欧货 币A	中欧货 币B	中欧货 币C	中欧货 币D	中欧货 币A	中欧货 币B	中欧货 币C	中 欧 货 币 D
本期已 实现收 益	2,430,48 7.92	400,519, 008.89	23,636.3 7	2,159,64 7.15	6,700,22 5.49	218,444, 968.88	—	—	26,422,5 56.05	131,082, 235.19	—	—
本期利 润	2,430,48 7.92	400,519, 008.89	23,636.3 7	2,159,64 7.15	6,700,22 5.49	218,444, 968.88	—	—	26,422,5 56.05	131,082, 235.19	—	—
本期净 值收益 率	2.4265 %	2.6727 %	1.3771 %	0.7195 %	3.5264 %	3.8122 %	—	—	4.8145 %	5.0664 %	—	—
3.1.2 期末数 据和指 标	2016年末				2015年末				2014年末			
	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值	期末基 金资产 净值
期末基 金资产 净值	79,123,6 98.82	2,232,12 9,786.34	8,149.02	157,065, 576.01	103,224, 482.18	13,710,0 77,745.4 9	—	—	285,430, 391.19	3,364,90 1,411.42	—	—
期末基 金份额	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	—	—	1.0000	1.0000	—	—

净值												
----	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

注：1、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。

2、本基金A、B类份额利润分配按月结转份额，C、D类份额利润分配按日结转份额。

3、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、自2016年5月4日起，本基金增加C类和D类基金份额。

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

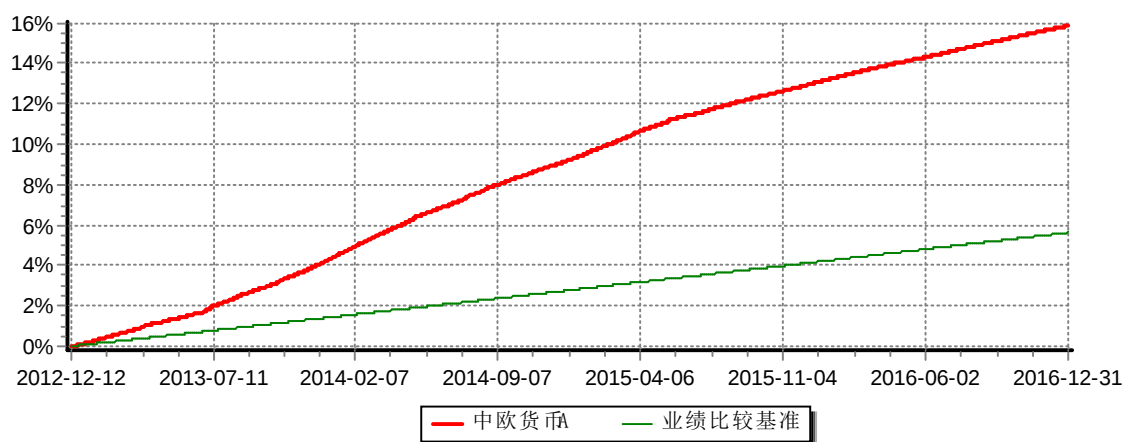
阶段 (中欧货币A)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5791 %	0.002%	0.3408 %	0%	0.2383 %	0.002%
过去六个月	1.1711 %	0.0016 %	0.6829 %	0%	0.4882 %	0.0016 %
过去一年	2.4265 %	0.0014 %	1.3629 %	0%	1.0636 %	0.0014 %
过去三年	12.525 %	0.005%	4.4919 %	0%	8.0331 %	0.005%
自基金合同生效日起至今	15.8711 %	0.0052 %	5.6304 %	0%	10.2407 %	0.0052 %
阶段 (中欧货币B)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.6399 %	0.002%	0.3408 %	0%	0.2991 %	0.002%
过去六个月	1.2933 %	0.0016 %	0.6829 %	0%	0.6104 %	0.0016 %

过去一年	2.6727 %	0.0014 %	1.3629 %	0%	1.3098 %	0.0014 %
过去三年	11.8787 %	0.0046 %	4.1369 %	0%	7.7418 %	0.0046 %
自基金合同生效日起 至今	17.0063 %	0.0052 %	5.6304 %	0%	11.3759 %	0.0052 %
阶段 (中欧货币C)	份额净 值收益 率①	份额净 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	0.5801 %	0.002%	0.3408 %	0%	0.2393 %	0.002%
过去六个月	1.1721 %	0.0016 %	0.6829 %	0%	0.4892 %	0.0016 %
自基金份额运作起至 今	1.3771 %	0.0015 %	0.7946 %	0%	0.5825 %	0.0015 %
阶段 (中欧货币D)	份额净 值收益 率①	份额净 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	0.64%	0.002%	0.3408 %	0%	0.2992 %	0.002%
自基金份额运作起至 今	0.7195 %	0.002%	0.3817 %	0%	0.3378 %	0.002%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

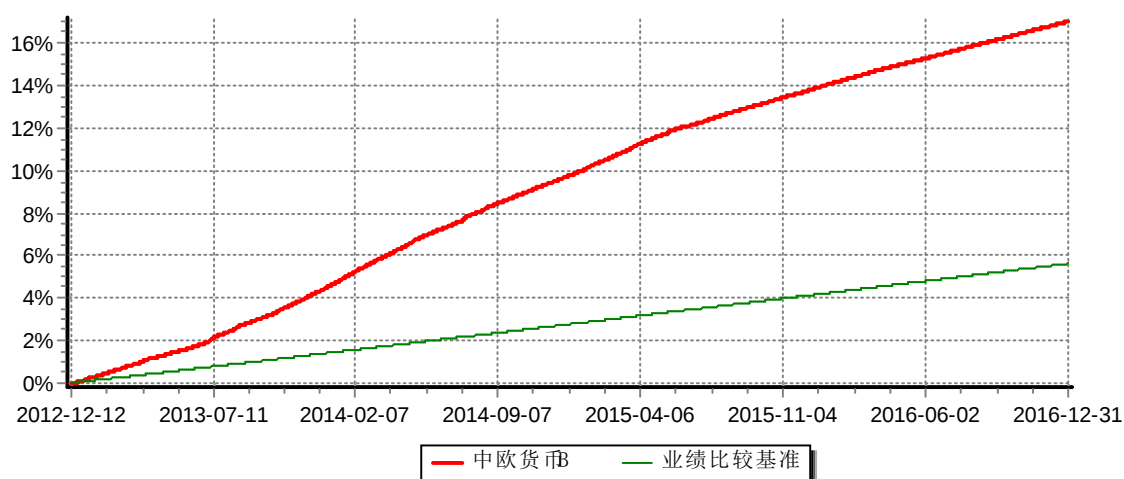
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月12日-2016年12月31日)



中欧货币B

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

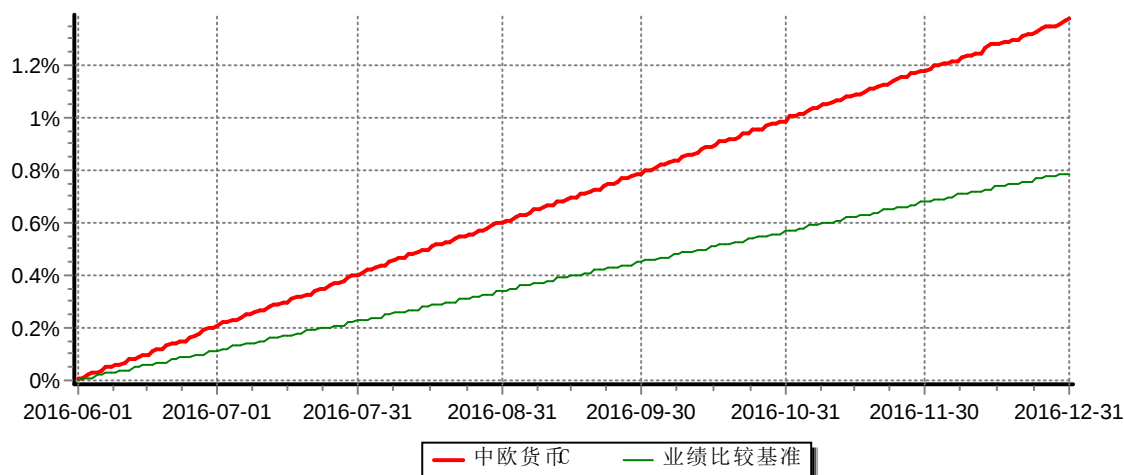
(2012年12月12日-2016年12月31日)



中欧货币C

份额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6月1日-2016年12月31日)

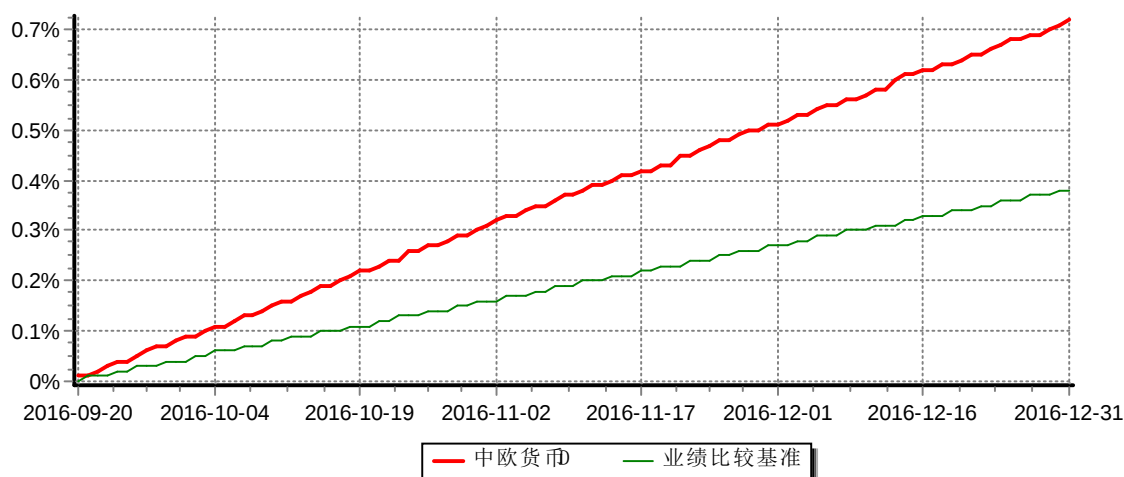


注：本基金于2016年5月4日新增C类份额。图示日期为2016年6月1日至2016年6月30日。

中欧货币D

份额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9月20日-2016年12月31日)



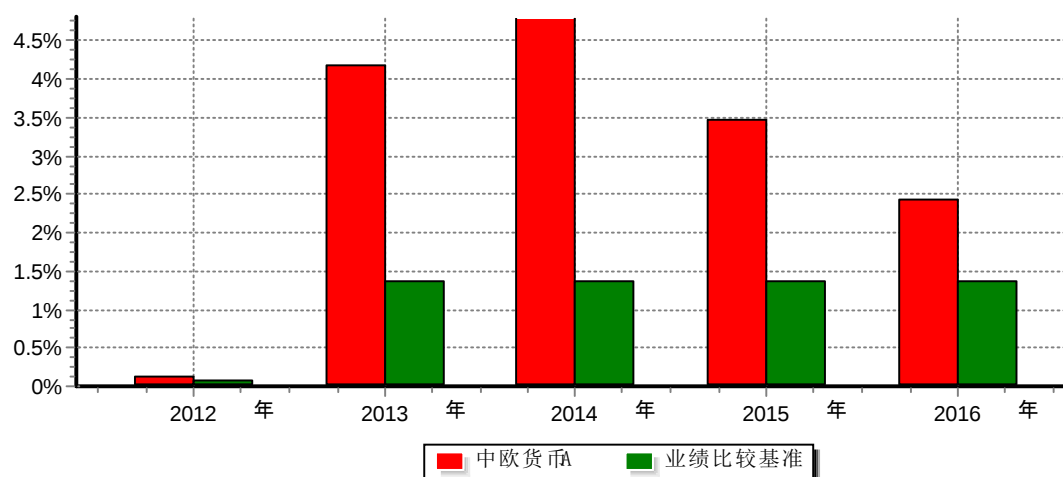
注：自2016年5月4日起，本基金增加D类基金份额，图示日期为2016年9月20日至2016年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧货币市场基金

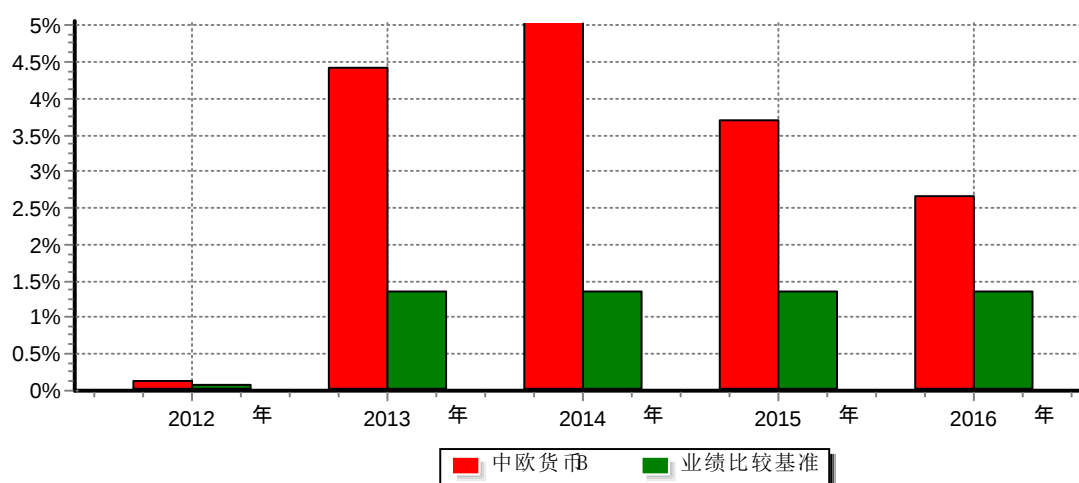
每年基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图

中欧货币A



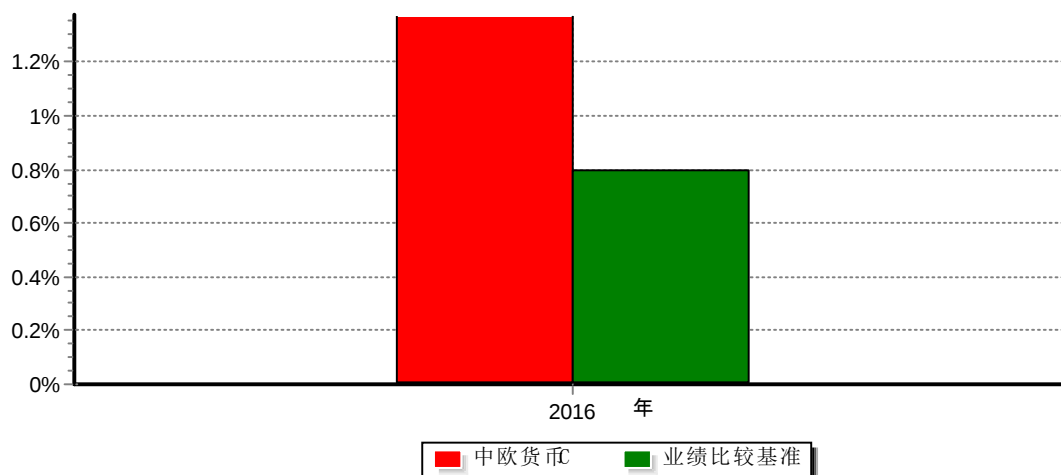
注：本基金合同生效日为2012年12月12日，2012年度数据为2012年12月12日至2012年12月31日数据。

中欧货币B



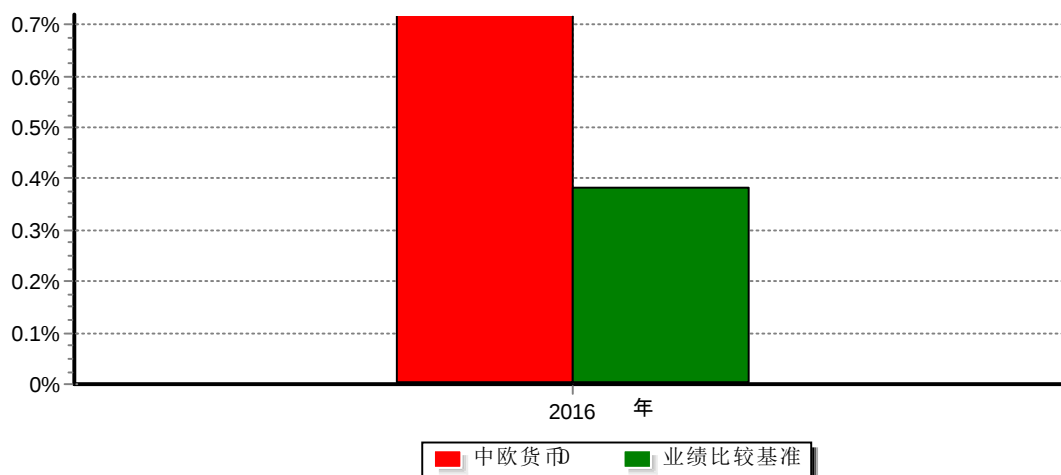
注：本基金合同生效日为2012年12月12日，2012年度数据为2012年12月12日至2012年12月31日数据。

中欧货币C



注：自2016年5月4日起，本基金增加C类基金份额,本基金份额起始运作日为2016年6月1日，2016年度数据为2016年6月1日至2016年12月31日数据。

中欧货币D



注：自2016年5月4日起，本基金增加D类基金份额,本基金份额起始运作日为2016年9月20日，2016年度数据为2016年9月20日至2016年12月31日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度 (中欧货币A)	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016年	2,430,487.92	—	—	2,430,487.92	
2015年	6,700,225.49	—	—	6,700,225.49	
2014年	26,422,556.05	—		26,422,556.05	
合计	35,553,269.46			35,553,269.46	

单位：人民币元

年度 (中欧货币B)	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016年	400,519,008.89	—	—	400,519,008.89	
2015年	218,444,968.88	—	—	218,444,968.88	
2014年	131,082,235.19	—	—	131,082,235.19	
合计	750,046,212.96	—		750,046,212.96	

单位：人民币元

年度 (中欧货币C)	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016年	23,636.37	—	—	23,636.37	
2015年	—	—	—	—	
2014年	—	—	—	—	
合计	23,636.37	—	—	23,636.37	

单位：人民币元

年度 (中欧货币D)	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016年	2,159,647.15	—	—	2,159,647.15	
2015年	—	—	—	—	

2014年	—	—	—	—	
合计	2,159,647.15	—	—	2,159,647.15	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为1.88亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司。截至2016年12月31日，本基金管理人共管理50只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙甜	基金经理	2014年11月18日	2016年8月3日	7年	历任长江养老保险股份有限公司投资助理、上海烟草（年金计划）平衡配置组合投资经理，上海海通证券资产管理有限公司海通季季红、海通海蓝宝益、海通海蓝宝银、海通月月鑫、海通季季鑫、海通半年鑫、海通年年鑫投资经理。2014年8月加入中欧基金管理有限公司，曾任投资经理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理、中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券

					投资基金基金经理、中欧瑾源灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧货币市场基金基金经理、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理、中欧睿尚定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、中欧琪和灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧瑾泉灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧琪丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧天禧纯债债券型证券投资基金基金经理、中欧天添18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
刘凌云	曾任基金经理助理，现任基金经理	2015年11月24日	2016年8月3日	9年	历任光大证券股份有限公司债券交易员，富国基金管理有限公司债券交易员、基金经理。2015年5月加入中欧基金管理有限公司，曾任基金经理助理，现任中欧货币市场基金、中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理、中欧骏

					泰货币市场基金基金经理。
刘凌云	基金经 理	2016年8月3 日	—	9年	历任光大证券股份有限公司债券交易员，富国基金管理有限公司债券交易员、基金经理。2015年5月加入中欧基金管理有限公司，曾任基金经理助理，现任中欧货币市场基金、中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理、中欧骏泰货币市场基金基金经理。

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规，公司制订了《公平交易管理办法》以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。在投资决策方面，基金经理共享研究报告、投研体系职权划分明确且互不干预、各基金持仓及交易信息等均能有效隔离；在交易执行方面，以系统控制和人工审阅相结合的方式，严控反向交易和同向交易；另外，中央交易室在交易执行过程中对公平交易实施一线监控，监察稽核部也会就投资交易行为进行分析和评估，定期进行公平交易的内部审计工作。

4.3.2 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。在公平交易稽核审计过程中，针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况，我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析，并与基金经理进行了沟通确认，从最终结果看，造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、股价波动等不可控因素，基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年上半年，整体经济、商品市场和金融市场均呈现出了底部振荡的形态。特别是无效产能的供给受限，大宗商品的价格波动则远远超过了平稳的经济增长，并带动PPI同比降幅迅速收窄。步入三季度，受到房地产销售持续回暖和基建投资加码的双重托底，加之产能限制措施的严格实施，带动三季度大宗商品价格再次出现明显回暖，工业企业利润总额出现较为明显的增长，各类经济增长数据均有所改善，PPI同比增幅回到正数区间，结束了54个月以来的通缩趋势。上述宏观因素影响下，利率债市场全年波动幅度加大，债市单边上涨的机会只出现在5月初至8月上旬。

2016年四季度，国内的流动性环境发生了巨大逆转。货币政策的最初变化可以追溯至8月份，央行缩短放长的公开市场操作思路在持续引导影子银行体系去杠杆，商业银行受窗口指导控制对非银机构的资金融出，导致非银机构的负债成本急剧上升。叠加年底MPA考核和部分商业银行LCR流动性指标考核的临近，银行体系主动收缩同业投资规模，影子银行体系受到了多重挤压，存单和协议存款资产收益率飙升，现金类资产收益率与几乎所有债券类资产收益率持续倒挂。此外，外部环境尤其是国际政治环境在11月初特朗普当选之后也增加了诸多不确定性，美国国债利率迅速飙升，通过强势美元将利率上行的压力传递到国内市场。

针对波动极大的市场环境，在整体操作上我们维持中性偏谨慎的策略，保持杠杆中性，持有资产剩余期限大部分时间稳定在50天-100天。在二三季度收益率下行时期也谨慎加仓，主要配置临近季度末到期的存款和存单，控制久期。并在第四季度初，逐步变现存单和久期弹性高的资产以应对年末的资产和负债双重调整冲击，在维持平稳静态收益率的前提下，提前准备流动性。即便如此，12月中旬市场单日跌幅最大时，货币基金的负偏离压力较大，通过迅速调整仓位得以平稳度过，这给货币市场也给我们带来了极大的考验。

另外，我们利用季度末货币市场利率抬升幅度较大的机会，使得基金能够积累一部分高收益低风险的流动性资产，如短期存单、存款等，在保持防御的同时，增厚货币基金收益。

4.4.2 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2.4265%，同期业绩比较基准增长率为1.3629%；B类份额净值增长率为2.6727%，同期业绩比较基准率为1.3629%；自基金运作至今，C类份额净值收益率为1.3771%，同期业绩比较基准收益率为0.7946%；自基金运作至今，D类份额净值收益率为0.7195%，同期业绩比较基准收益率为0.3817%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去一年的国际政治、经济环境错综复杂，英国“脱欧”，特朗普当选美国总统，贸易保护主义抬头，这些事件在接下来的2017年将持续对其他政治经济事件造成影响，且形势的变数可能更大。伴随着美联储的第二次加息，以及G20峰会之后各主要经济体对“量宽”政策的反思，各国的无风险利率均出现了明显反弹。全球性的货币政策转向似乎已经出现，经济增长政策的着力点纷纷转向财政刺激。作为近几轮经济周期中，加息速度最慢的一次，美联储下一次加息的时点就格外重要。自金融危机之后伴随全球金融市场多年的货币超常宽松环境一俟改变，资产价格也必将随之调整。

国内形势上，各地房地产限购限贷政策的持续作用下，房地产行业的景气周期已经进入低谷，但是基建领域“PPP”的大量开展对经济的托底作用仍存，工业企业的固定资产投资也现曙光。因此，2017年的房地产行业景气周期下行对经济增长的负面拖累也许会相对较小。此外，考虑到过去一年的工业企业盈利改善、企业和流通渠道中较低的存货水平，工业企业的固定资产投资增速可能出现3年来的首次回暖，企业主动补库存和设备更新的动力对经济的拉动或将十分显著，可能给2017年的经济增长带来一定的推动。

国内通胀方面，供给侧改革的深入推进，使得黑色产业链领域企业盈利显著恢复到工业企业的平均利润率区间。2017年供给侧改革的成功经验也将推广到其它过剩产能行业，势必给上游工业品带来持续的价格动力，进而向中游和下游行业传导。外部环境方面，特朗普政府上台之后，对中东石油产区国家的政策变化，给地区的稳定带来极大的不确定性，也成为支持油价在相对高位运行的重要外部因素。并且从基数效应的角度考虑，2017年上半年的PPI同比增幅一致预期攀高，原油、煤炭和钢材价格逐步通过产业链传导至中下游产品甚至消费品领域，工业品持续涨价给核心CPI带来的上行压力也十分明显。

虽然，实体经济贷款利率和融资成本不会短期内抬高，但受到通胀因素的拉动，金融体系中货币政策的收紧甚至加息是大概率的事。

银行体系监管政策收紧是2017年另一个重要的风险来源。MPA将影子银行体系

全面纳入监管之后，过去两年增速最快的同业理财受到的冲击最为直接。银行为同业理财付出的综合负债成本更高，其资产端的倒挂问题也已经持续超过半年，同样的问题也存在于零售理财领域。同时，商业银行LCR流动性的考核过渡期已经进入倒数第二年，资产规模2000亿以上的商业银行，在2017年底LCR指标需要达到90%，这将给一定规模的商业银行在执行央行公开市场操作和自身满足LCR标准时，需要考虑多个流动性资产负债项目的存量比例和流量控制，特别将限制流动性向中小银行、农商行和非银机构的溢出，这给整个货币市场利率带来上行的压力和增加考核时点的波动。

但是，我们也看到了一部分风险的消退。一是外管局在2017年春节前颁布的最新通知首次允许内保外贷资金全额汇回境内，并且不占用银行在该业务上的短期外债余额指标。这个渠道的打通意味着外储持续减少的压力大为缓解，短期内人民币单边贬值的预期将得到极大抑制，有利于国内货币政策的独立施行。

二是，企业层面的发行人还本付息的信用风险明显降低。供给侧改革的稳步推进以及存货周期的轮动，给企业带来持续超过一年的盈利改善，现金流方面的压力受到缓解；而且过剩领域国有企业债转股的有序推进，显著改善了企业的资产负债表。虽然部分经营不善的实体企业仍有可能出现点状的违约事件，但并不会给市场带来过大的冲击。

综上所述，2017年全年来看，债券投资将回归票息，尽量降低风险暴露。具体来说，短久期高流动性资产适宜标配。尤其对于货币基金，在货币政策收紧的环境下，融资成本的波动增大，一旦加息通道形成，资金成本或成螺旋式上升。因此，货币基金的杠杆应保持低位，在季末、年末、节前等关键时点保持充裕流动性，以便有机会储备高收益的债券、存单、存款等。同时，债券和存单总量需要控制仓位，以应对阶段性债市收益大幅飙升时对负偏离的压力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理，成员包括总经理、督察长、投资总监，基金运营部总监，监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期

内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，A级、B级每月集中支付，每月累计收益支付方式采用红利再投资（即红利转基金份额）方式；C级、D级每日进行支付。报告期内本基金向A级份额持有人分配利润2,430,487.92元，向B级份额持有人分配利润400,519,008.89元，向C级份额持有人分配利润23,636.37元，向D级份额持有人分配利润2,159,647.15元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中欧货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中欧货币市场基金的管理人--中欧基金管理有限公司在中欧货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧货币市场基金2016年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告期基金年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧货币市场基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产：		
银行存款	5,836,618.17	4,687,458,684.34
结算备付金		
存出保证金	6,616.73	—
交易性金融资产	1,605,936,848.07	8,956,432,867.65
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	1,410,936,848.07	8,956,432,867.65
资产支持证券投资	195,000,000.00	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	833,455,350.20	1,599,945,452.99
应收证券清算款	—	—
应收利息	25,543,027.93	86,907,904.15
应收股利	—	—
应收申购款	18,708.00	14,670,177.93
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—

资产总计	2,470,797,169.10	15,345,415,087.06
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	1,526,997,989.50
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	561,023.08	97,575.71
应付管理人报酬	881,830.81	3,171,821.34
应付托管费	267,221.47	961,157.96
应付销售服务费	43,935.77	117,186.53
应付交易费用	130,418.21	160,273.66
应交税费	220,000.00	220,000.00
应付利息	—	96,354.69
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	365,529.57	290,500.00
负债合计	2,469,958.91	1,532,112,859.39
所有者权益:		
实收基金	2,468,327,210.19	13,813,302,227.67
未分配利润	—	—
所有者权益合计	2,468,327,210.19	13,813,302,227.67
负债和所有者权益总计	2,470,797,169.10	15,345,415,087.06

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.000元，基金份额总额2,468,327,210.19份，其中A类基金份额总额79,123,698.82份，B类基金份额总额2,232,129,786.34份，C类基金份额总额8,149.02份，D类基金份额总额157,065,576.01份。

7.2 利润表

会计主体：中欧货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年01月01日至 2015年12月31日
一、收入	501,053,122.76	263,245,649.14
1.利息收入	478,564,250.03	229,732,387.51
其中：存款利息收入	151,572,418.24	103,362,528.07
债券利息收入	293,491,163.44	106,477,410.56
资产支持证券利息收入	3,932,102.56	268,757.52
买入返售金融资产收入	29,568,565.79	19,623,691.36
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	18,431,901.97	33,493,861.63
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	18,083,217.62	33,493,861.63
资产支持证券投资收益	348,684.35	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	—	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,056,970.76	19,400.00
减：二、费用	95,920,342.43	38,100,454.77
1. 管理人报酬	50,503,805.84	22,190,370.43
2. 托管费	15,304,183.59	6,724,354.61

3. 销售服务费	1,775,867.02	1,116,353.53
4. 交易费用	789.50	200.00
5. 利息支出	27,878,753.92	7,512,278.32
其中：卖出回购金融资产支出	27,878,753.92	7,512,278.32
6. 其他费用	456,942.56	556,897.88
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	405,132,780.33	225,145,194.37
减：所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	405,132,780.33	225,145,194.37

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中欧货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	13,813,302,227.67	—	13,813,302,227.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		405,132,780.33	405,132,780.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-11,344,975,017.48	—	-11,344,975,017.48
其中：1.基金申购款	74,369,927,027.84	—	74,369,927,027.84
2.基金赎回款	-85,714,902,045.32	—	-85,714,902,045.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	-405,132,780.33	-405,132,780.33
五、期末所有者权益(基金净值)	2,468,327,210.19	—	2,468,327,210.19

项 目	上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,650,331,802.61	—	3,650,331,802.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	225,145,194.37	225,145,194.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	10,162,970,425.06	—	10,162,970,425.06
其中：1.基金申购款	39,739,259,447.60	—	39,739,259,447.60
2.基金赎回款	-29,576,289,022.54	—	-29,576,289,022.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	-225,145,194.37	-225,145,194.37
五、期末所有者权益（基金净值）	13,813,302,227.67	—	13,813,302,227.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧货币市场基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]1345号《关于核准中欧货币市场基金募集的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,577,108,157.32元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第500号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧货币市场基金基金合同》于2012年12月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,577,387,226.51份基金份额，包含认购资金利息折合279,069.19份基金份额，其中货币A的基金份额总额为597,867,438.95份，包含认购资金利息折合154,281.63份，货币B的基

金份额总额为979,519,787.56份，包含认购资金利息折合124,787.56份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据投资者持有本基金的份额数量不同，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成A类和B类两类基金份额；并根据投资者基金账户所持有份额数量是否不低于500万份进行不同类别基金份额的判断和处理，其中不低于500万份的为B类份额，低于500万份的为A类份额。两类基金份额分别设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。

根据本基金管理人中欧基金管理有限公司2016年5月4日《中欧基金管理有限公司关于中欧货币市场基金新增基金份额类别的公告》和《中欧货币市场基金基金合同(修订)》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自2016年5月4日起对本基金增加C类和D类份额并相应修改基金合同。新增C类和D类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司。本基金根据投资者持有本基金的份额数量不同，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成C类和D类两类基金份额；并根据投资者基金账户所持有份额数量是否不低于500万份进行不同类别基金份额的判断和处理，其中不低于500万份的为D类份额，低于500万份的为C类份额。两类基金份额分别设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、短期融资券、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2017年3月31日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中

国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作的规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司 ("中欧基金")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司("万盛基业")	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司("北京百骏")	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a ("意大利意联银行")	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙) ("上海睦亿合伙")	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司 ("中欧盛世资管")	基金管理人的控股子公司
钱滚滚财富投资管理(上海)有限公司 ("钱滚滚财富")	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间2015年01月01日 至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国都证券有限责任公司 ("国都证券")	201,560,273.98	100.00%	—	—

7.4.8.1.3 债券回购交易

无。

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间2015年01月 01日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	50,503,805.84	22,190,370.43
其中：支付销售机构的客户维护费	355,277.16	428,025.68

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间2015年01月 01日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	15,304,183.59	6,724,354.61

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务 费的各关联方 名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	中欧货币A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D	合计
中欧基金	1,065,049.92	491,653.33	1,943.11	8,444.58	1,567,090.94
中国工商银行	89,370.56	24.85	—	—	89,395.41
国都证券	1,375.05	1,011.66	—	—	2,386.71
合计	1,155,795.53	492,689.84	1,943.11	8,444.58	1,658,873.06

单位：人民币元

获得销售服务 费的各关联方 名称	上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	中欧货币A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D	合计
中欧基金	680,079.13	34,146.33	—	—	714,225.46
中国工商银行	208,927.03	2,040.19	—	—	210,967.22
国都证券	286.74	2,091.89	—	—	2,378.63
合计	889,292.90	38,278.41	—	—	927,571.31

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和C类基金份额约定的销售服务费年费率为0.25%，B类基金份额和D类基金份额约定的销售服务费年费率为0.01%。销售服务费的计算公式为：

对应级别日销售服务费＝前一日对应级别基金资产净值×约定年费率 / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的 各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
中国工商银行	—	—	—	—	30,884,0	3,383,02

					20,000.00	6.17
上年度可比期间 2015年01月01日至2015年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	194,061,127.80	61,819,571.23	—	—	4,136,780,000.00	255,120.97

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日				上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31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A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D
报告期期初持有的基金份额	—	501,979,090.25	—	—	—	20,454,811.39	—	—
报告期期间申购/买入总份额	—	910,759,001.94	—	407,065,576.01	—	589,524,278.86	—	—
报告期期间因拆分变动份额	—	—	—	—	—	—	—	—
减：报告期期间赎回/卖出总份额	—	1,407,526,272.87	—	250,000,000.00	—	108,000,000.00	—	—
报告期期末持有的基金份额	—	5,211,819.32	—	157,065,576.01	—	501,979,090.25	—	—
报告期期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.23%	—	100.00%	—	3.66%	—	—

注：申购份额含红利再投、转入份额，赎回份额含转出份额。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方本报告期内均未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间2015年01月01日 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	5,836,618.17	148,182.68	2,458,684.34	27,573.42

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为1,410,936,848.07元，属于第三层次的余额为195,000,000.00,无属于第一层余额(2015年12月31日：第二层次8,956,432,867.65元，无属于第一和第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 资产支持证券投资
2016年4月1日	-
购买	395,000,000.00
出售	-200,308,283.56
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	308,283.56
2016年12月31日	195,000,000.00
2016年12月31日仍持有的资产计入2016年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

			不可观察输入值	
	2016年12月31日公允价值	估值技术	名称	范围/与公允价值之间的加权平均值关系
交易性金融资产——				
资产支持证券投资	195,000,000.00	现金流量折现法	折现率	3.35%-3.50% 负相关

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产 的比例（%）
1	固定收益投资	1,605,936,848.07	65.00
	其中：债券	1,410,936,848.07	57.10
	资产支持证券	195,000,000.00	7.89
2	买入返售金融资产	833,455,350.20	33.73
	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	5,836,618.17	0.24
4	其他各项资产	25,568,352.66	1.03
5	合计	2,470,797,169.10	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	7.84	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	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较的简单平均值。

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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	126
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期
1	2016-12-06	126	巨额赎回	5
2	2016-12-07	122	巨额赎回	4
3	2016-12-09	121	巨额赎回	3
4	2016-12-12	124	巨额赎回	1

8.3.2 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	44.71	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	7.71	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	16.56	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	6.51	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天（含）	23.35	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		98.83	—

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：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240天。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	311,353,013.44	12.61
	其中：政策性金融债	311,353,013.44	12.61
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	799,949,858.92	32.41
6	中期票据	51,115,124.28	2.07
7	同业存单	248,518,851.43	10.07

8	其他	—	—
9	合计	1,410,936,848.07	57.16
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

注：上表中，付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。

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净 值 比例(%)
1	140208	14国开08	1,000,000	100,673,274.92	4.08
2	011699856	16魏桥铝电SCP008	1,000,000	99,987,236.62	4.05
3	111697298	16广东顺德农商行CD080	1,000,000	99,430,035.29	4.03
4	111697369	16广州农村商业银行CD127	1,000,000	99,425,923.31	4.03
5	140407	14农发07	900,000	90,313,940.38	3.66
6	041658004	16鲁宏桥CP001	900,000	89,986,788.50	3.65
7	041662004	16鲁宏桥CP002	800,000	80,047,440.12	3.24
8	011698356	16大北农科SCP001	800,000	79,976,718.10	3.24
9	011699911	16魏桥铝电SCP009	700,000	69,990,141.71	2.84
10	011698593	16新希望SCP002	600,000	59,986,351.99	2.43

8.7 “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	3

报告期内偏离度的最高值	0.1204
报告期内偏离度的最低值	-0.3100
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0600

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
1	2016-12-15	-0.2593%	市场资金面趋紧, 债券收益率大幅上行, 致使偏离度绝对值上升超过0.25%。	3
2	2016-12-16	-0.3100%	市场资金面趋紧, 债券收益率大幅上行, 致使偏离度绝对值上升超过0.25%。	2
3	2016-12-19	-0.2643%	市场资金面趋紧, 债券收益率大幅上行, 致使偏离度绝对值上升超过0.25%。	1

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%。

8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
----	------	------	-----------	------	------------------

1	142121	花呗06A1	1,000,000.00	100,000,000.00	4.05
2	142118	借呗03A1	500,000.00	50,000,000.00	2.03
3	142374	中电优A	450,000.00	45,000,000.00	1.82

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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，按票面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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,616.73
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	25,543,027.93
4	应收申购款	18,708.00
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	25,568,352.66

8.9.4 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
中欧货 币A	42,768	1,850.07	22,449,939. 42	28.37%	56,673,759. 40	71.63%
中欧货 币B	38	58,740,257. 54	2,232,129,7 86.34	100.00 %	—	—
中欧货 币C	2	4,074.51	—	—	8,149.02	100.00 %
中欧货 币D	1	157,065,576 .01	157,065,576 .01	100.00 %	—	—
合计	42,809	57,659.07	2,411,645,3 01.77	97.70%	56,681,908. 42	2.30%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份 额比例
基金管理人所有从业人员持 有本基金	中欧货币A	10.34	0.00%
	中欧货币B	—	—
	中欧货币C	—	—
	中欧货币D	—	—
	合计	10.34	0.00%

注：基金管理人的从业人员持有中欧货币A的份额总数占货币A比例为0.000013%，占货币基金总份额比例为0.00000042%。上表比例为四舍五入结果。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投 资和研究部门负责人持有本 开放式基金	中欧货币A	0
	中欧货币B	0
	中欧货币C	0

	中欧货币D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧货币A	0
	中欧货币B	0
	中欧货币C	0
	中欧货币D	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧货币A	中欧货币B	中欧货币C	中欧货币D
基金合同生效日(2012年12月12日)基金份额总额	597,878,537.69	979,537,971.24	—	—
本报告期期初基金份额总额	103,224,482.18	13,710,077,745.49	—	—
本报告期基金总申购份额	232,491,454.73	73,694,424,988.14	7,585,823.66	435,424,761.31
减：本报告期基金总赎回份额	-256,592,238.09	-85,172,372,947.29	-7,577,674.64	-278,359,185.30
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	79,123,698.82	2,232,129,786.34	8,149.02	157,065,576.01

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2016年5月7日发布公告，卞玺云女士自2016年5月7日起担任中欧基金管理有限公司督察长职务。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会和上海证监局报告。

11.2.2报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门发生的重大人事变动
本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为115,000.00元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券	1	201,560,273.98	100.00%	—	—		—	

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况。

中欧基金管理有限公司
二〇一七年三月三十一日