

中欧货币市场基金 2013 年第 3 季度报告

2013 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年十月二十五日

§ 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 2013 年 10 月 23 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 2013 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	384,982,929.34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	
下属两级基金的基金简称	中欧货币A	中欧货币B
下属两级基金的交易代码	166014	166015
报告期末下属两级基金的份额总额	138,800,925.42份	246,182,003.92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(2013年7月1日-2013年9月30日)	
	中欧货币A	中欧货币B
1. 本期已实现收益	1,652,926.99	3,362,470.36
2. 本期利润	1,652,926.99	3,362,470.36
3. 期末基金资产净值	138,800,925.42	246,182,003.92

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

1. 中欧货币 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	1.1837%	0.0074%	0.3408%	0.0000%	0.8429%	0.0074%

注：本基金收益分配按日结转份额。

2. 中欧货币 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	1.2440%	0.0074%	0.3408%	0.0000%	0.9032%	0.0074%

注：本基金收益分配按日结转份额。

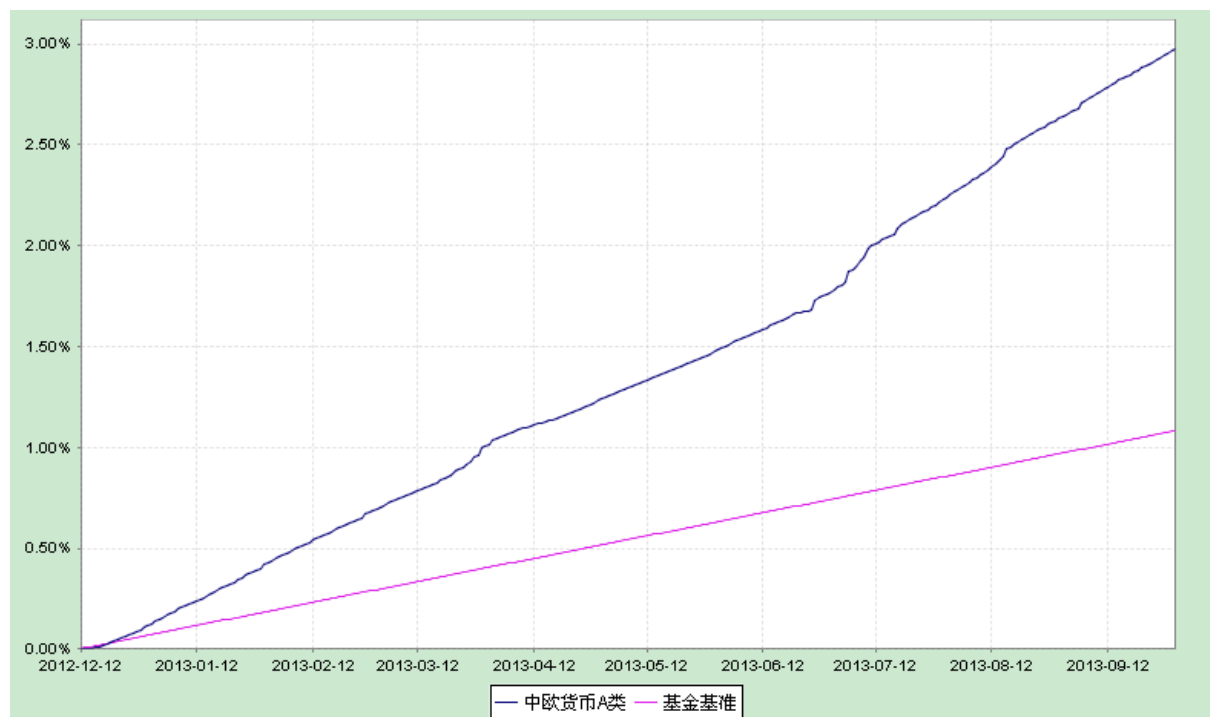
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

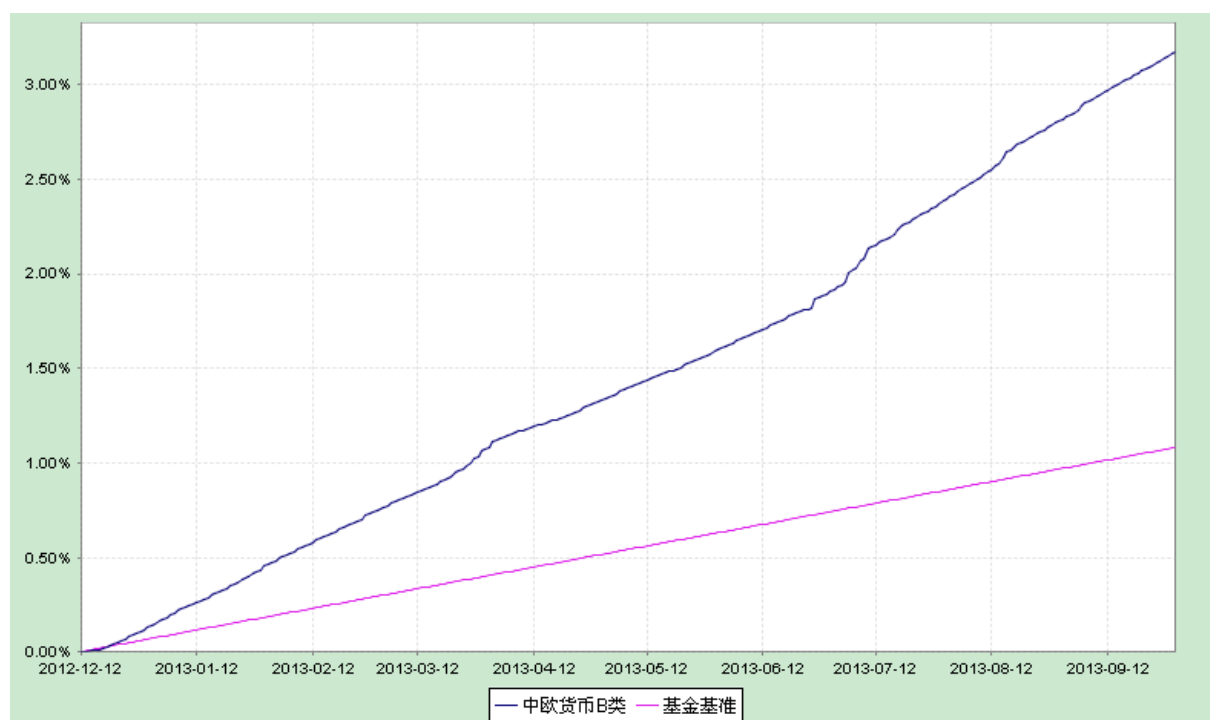
(2012 年 12 月 12 日至 2013 年 9 月 30 日)

1、中欧货币 A



注：本基金合同生效日为2012 年12 月12 日，建仓期为2012 年12 月12 日至2013 年6 月11 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定；截至本报告期末，基金合同生效不满一年。

2、中欧货币 B



注：本基金合同生效日为 2012 年 12 月 12 日，建仓期为 2012 年 12 月 12 日至 2013 年 6 月 11 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定；截至本报告期末，基金合同生效不满一年。

§ 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		
姚文辉	本基金基金经理，中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理，中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理	2012-12-12	-	6年	应用经济学专业硕士。历任金元证券股份有限公司固定收益总部债券投资经理。2011年8月加入中欧基金管理有限公司，历任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理助理；现任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理、中欧货币市场基金基金经理。

	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、《中欧货币市场基金基金合同》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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济数据略有反弹，资金面维持紧平衡状态，债券市场持续下跌。中欧货币坚持以流动性管理作为第一要务，以存款和短期回购作为主要配置品种，同时兼顾短期

债券的投资机会，以期为客户带来稳定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中欧货币 A 类份额净值增长率为 1.1837%，B 类份额净值增长率为 1.2440%，同期业绩比较基准增长率为 0.3408%，基金投资收益高于同期业绩比较基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计四季度资金面在外汇占款好转的背景下有望略超市场预期，但整体依然将保持紧平衡状态。我们将继续以流动性管理作为第一要务，以存款和短期回购作为主要配置品种，同时兼顾短期债券的投资机会，以期为客户带来稳定收益。

§ 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	170,170,543.05	44.02
	其中：债券	170,170,543.05	44.02
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,000,000.00	1.03
	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	208,389,216.03	53.91
4	其他各项资产	3,998,384.71	1.03
5	合计	386,558,143.79	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	5.99

	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	-	-

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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
1	2013-07-05	20.22	被 动 突破	1 个交易日
2	2013-07-08	20.37	被 动 突破	1 个交易日
3	2013-09-06	21.26	被 动 突破	1 个交易日
4	2013-09-09	21.20	被 动 突破	1 个交易日

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	96
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	99
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 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180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	12.31	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	58.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	5.22	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	7.81	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天（含）	15.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.38	-

5.4 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	19,941,439.07	5.18
	其中：政策性金融债	19,941,439.07	5.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	150,229,103.98	39.02
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	170,170,543.05	44.20
9	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。

5.5 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	041252057	12 第一农药 CP001	200,000	20,083,070.63	5.22
2	041252051	12正泰CP001	200,000	20,063,332.67	5.21
3	041259054	12三星CP001	200,000	20,057,067.34	5.21
4	041358005	13 康缘集 CP001	200,000	20,044,451.45	5.21
5	041353066	13东浩CP001	200,000	20,000,293.53	5.20
6	041366014	13 冀水泥 CP002	200,000	19,980,947.98	5.19

7	130214	13国开14	200,000	19,941,439.07	5.18
8	041364003	13 沁 新 能 源 CP001	100,000	10,007,679.16	2.60
9	041365009	13 华 通 路 桥 CP001	100,000	10,000,122.00	2.60
10	041363011	13万华CP001	100,000	9,992,139.22	2.60

5.6 “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 次
报告期内偏离度的最高值	0.1219%
报告期内偏离度的最低值	-0.0116%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0411%

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本报告期内本基金未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券。

5.8.3 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。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,776.67
3	应收利息	3,976,308.04
4	应收申购款	18,300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,998,384.71

5.8.5 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	中欧货币 A	中欧货币 B
本报告期期初基金份额总额	31,715,596.08	211,552,614.38
本报告期基金总申购份额	368,302,667.09	296,975,881.71
减：本报告期基金总赎回份额	261,217,337.75	262,346,492.17
本报告期期末基金份额总额	138,800,925.42	246,182,003.92

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人本报告期内无申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§ 8 备查文件目录

8.1 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报纸上公开披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站 (www.lcfunds.com) 查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管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

二〇一三年十月二十五日