

中欧滚钱宝发起式货币市场基金2015年年度报告

2015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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2016年03月29日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月23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。

本报告期自2015年6月12日起至12月31日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明	16
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	16
§6	审计报告	16
6.1	审计报告基本信息	16
6.2	审计报告的基本内容	16
§7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	21
§8	投资组合报告	41
8.1	期末基金资产组合情况	41
8.2	债券回购融资情况	42
8.3	基金投资组合平均剩余期限	42
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合	43
8.5	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	44
8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	44
8.7	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	45
8.8	投资组合报告附注	45
§9	基金份额持有人信息	46
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	47
§10	开放式基金份额变动	47
§11	重大事件揭示	48
11.1	基金份额持有人大会决议	48
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	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
11.4	基金投资策略的改变	48

11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
11.8	偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	49
11.9	其他重大事件	49
§12	备查文件目录	51
12.1	备查文件目录	51
12.2	存放地点	51
12.3	查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧滚钱宝发起式货币市场基金
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
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
报告期末基金份额总额	316,442,339.16份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	罗菲菲
	联系电话	021-68609600	010-58560666
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、	95568

	400-700-9700	
传真	021-33830351	010-58560798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	窦玉明	洪崎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层

§ 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	2015年06月12日-2015年12月31日
本期已实现收益	3,931,113.87

本期利润	3,931,113.87
本期净值收益率	1.6410%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末基金资产净值	316,442,339.16
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2015年末
累计净值收益率	1.6410%

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、本基金合同于2015年6月12日生效。

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

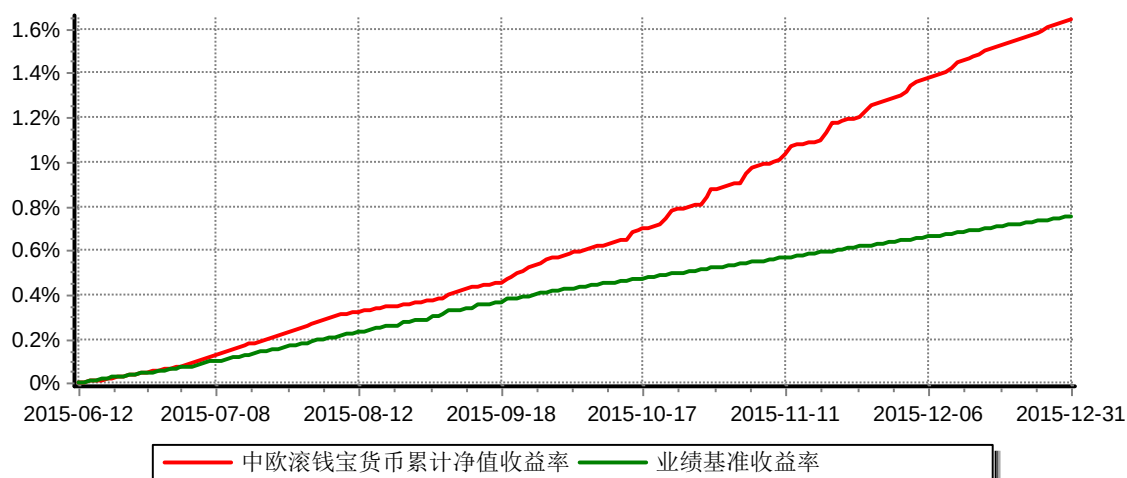
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0773 %	0.0089 %	0.3408 %	0.0000 %	0.7365 %	0.0089 %
过去六个月	1.5649 %	0.0074 %	0.6829 %	0.0023 %	0.8820 %	0.0051 %
自基金合同生效至今	1.6410 %	0.0072 %	0.7536 %	0.0022 %	0.8874 %	0.0050 %

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

中欧滚钱宝货币

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

（2015年06月12日-2015年12月31日）

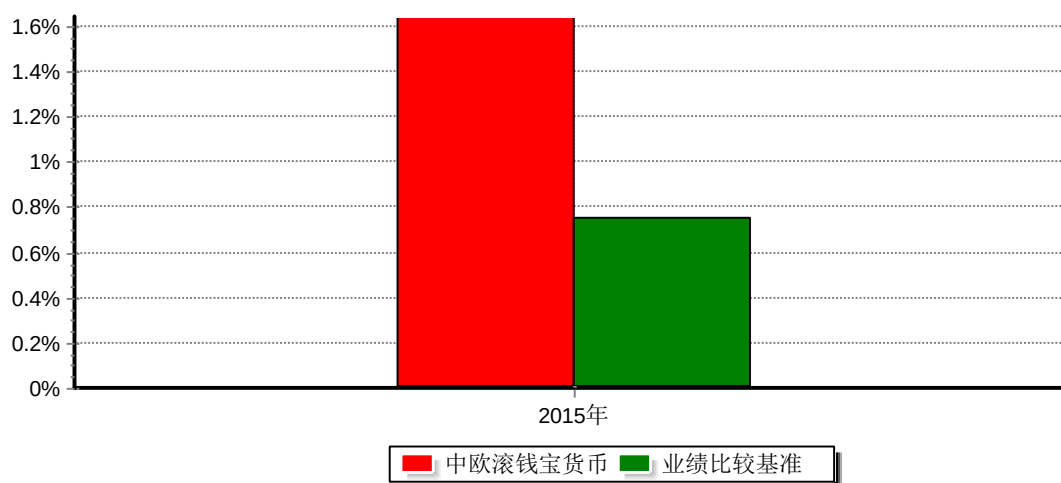


本基金基金合同生效日为2015年6月12日，自基金合同生效日至本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定。图示日期为2015年6月12日至2015年12月31日。

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

中欧滚钱宝货币

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



注：本基金合同生效日为2015年6月12日，2015年度数据为2015年6月12日至2015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	已按再投资形式	直接通过应付	应付利润	年度利润	备注

	转实收基金	赎回款转出金 额	本年变动	分配合计	
2015年	3,931,113.87	—	—	3,931,113.87	
合计	3,931,113.87	—	—	3,931,113.87	

§ 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2015年12月31日，本基金管理人共管理34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	本基金基金经理, 中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理, 中欧稳健收益债券型证券	2015年06月12日	—	6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, 现任中欧货币市

	投资基金基金经理，中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧琪和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，中欧瑾泉灵活配置混合型证				场基金基金经理，中欧睿达定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理，中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金经理，中欧琪和灵活配置混合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，中欧瑾泉灵活配置混合型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，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。
--	---	--	--	--	--

	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， 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				
刘凌云	本基金 基金经 理助理	2015年11月 24日	—	8年	历任上海民创投资管理有 限公司项目经理，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，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不公平交易的情况。

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

2015年三季度随着货币基金对存单投资的放开，我们加大了对股份制银行存单的投资，较好的提升了组合收益。四季度我们加大了对过剩行业的发行人的甄别和清理，到年末基本完成过剩行业的清理，因此没有受到市场抛售的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值收益率为1.6410%，同期业绩比较基准收益率为0.7536%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年，传统行业去产能压力仍大，供给侧改革仍面临一个长期、复杂和困难的局面，整体宏观经济下行压力仍存。在经济下行的大周期里，稳增长仍需要一个低利率的货币政策环境。事实上，央行在过去一段时间里已经采取各种手段实行“利率走廊”，显示了货币政策已经在为防范风险做准备。因此在当前的经济形势下，短端利率水平将在小幅波动的基础上保持稳定。

基于我们对市场的判断，在经济下行、短端利率保持稳定的大背景下，本基金将在组合流动性和收益性上做出一个平衡的选择，在信用研究方面投入更大的精力，总体上将继续保持稳健的投资组合，在中高等级信用债、存单和银行存款之间进行合理的配置，

在保持流动性的基础上，为持有人带来稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

（一）法律法规的培训和落实

2015年，全国人民代表大会常务委员会修订了《中华人民共和国证券投资基金法》，监管机构相继颁布了一系列法律法规，涵盖货币市场基金、新股发行、股票期权、债券发行、资产管理八条底线、沪港通、融资融券、养老金投资等多项内容。公司在收到以上文件后第一时间通过电子邮件向相关部门和员工传达了有关内容。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读。重要法律法规和业内重大新闻或违规事件，提交公司风险控制委员会进行重点讨论或提示。

（二）规章制度的建设

2015年，公司的制度体系已在完整性、合理性、有效性等各个方面较之前年度有进一步改进。公司全年共制订或修订制度流程十余项，内容涵盖管理会议、投资运作、投资决策委员会及风险控制委员会章程、员工投资管理、费用管理、内幕交易防控、人力资源、IT治理、IT设备采购等各项内容。

（三）风险控制

为适应风险管理体系的未来发展方向并实现风险管理目标，2015年公司对原有风险管理架构进行了调整。2015年5月，公司风险管理部正式组建，集中负责投研业务的风险管理，非投研业务风险管理仍由监察稽核部负责。同时，公司进一步厘清了投资决策委员会及风险控制委员会的职责定位，并相应修改了委员会章程。

投资决策委员会为公司投资业务的最高决策机构，风险管理架构调整后，投资决策委员会会议内容包括公司旗下组合月度绩效风险评估回顾、业内风险案例讨论，业内领先风控制度学习，投资研究相关内部管理制度、管理办法的制定等。风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，会议内容包括重要风控制度及政策审议、各业务部门风险控制情况汇报，监管动态跟踪以及行业内重大风险事件讨论等。投资决策委员会和风险控制委员会的定期召开可有效防范和控制风险，确保公司规范经营。

2015年，公司各项业务的风险控制情况较为理想，未发生重大风险事件。

（四）内部稽核审计

2015年，公司完成了针对基金会计估值业务、公平交易、FM系统权限、员工投资申报及利益冲突情况、反洗钱业务以及信息管制等各项业务的稽核审计工作，并出具稽核审计报告。通过内部稽核审计工作，进一步保证了各项法律法规和公司内部制度的有效落实。

在今后的工作中，我们将继续提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范

各种风险，保障基金合规运作。

4.7 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。

4.8 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，且每日进行支付。报告期内本基金向份额持有人分配利润3,931,113.87元。

4.9 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滚钱宝发起式货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在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合规守信、净值计算等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人—中欧基金管理有限公司在中欧滚钱宝发起式货币市场基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金实施利润分配的金额为 3,931,113.87 元。

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

由中欧滚钱宝发起式货币市场基金管理人—中欧基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第22290号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧滚钱宝发起式货币市场基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的中欧滚钱宝发起式货币市场基金(以下简称“中欧滚钱宝货币基金”)的财务报表，包括2015年12月31日的资产负债表、2015年06月12日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中欧滚钱宝货币基金的基金管理人中欧基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会

	会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述中欧滚钱宝货币基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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编制,公允反映了中欧滚钱宝货币基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 06 月 12 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰 俞伟敏
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2016-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧滚钱宝发起式货币市场基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	205,161,115.91
结算备付金		
存出保证金		—
交易性金融资产	7.4.7.2	140,359,644.34
其中：股票投资		—
基金投资		—
债券投资		140,359,644.34
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	4,859,105.11
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		350,379,865.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 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		33,599,749.60

应付证券清算款		—
应付赎回款		—
应付管理人报酬		75,656.53
应付托管费		13,510.11
应付销售服务费		67,550.46
应付交易费用	7.4.7.7	19,695.53
应交税费		—
应付利息		2,363.97
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	159,000.00
负债合计		33,937,526.20
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	316,442,339.16
未分配利润	7.4.7.10	—
所有者权益合计		316,442,339.16
负债和所有者权益总计		350,379,865.36

注：1.报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.000元，基金份额总额316,442,339.16份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2015年06月12日（基金合同生效日）至 2015年12月31日止期间。

3.本基金属于报告期内生效基金,故本报告中无对比数据。

7.2 利润表

会计主体：中欧滚钱宝发起式货币市场基金

本报告期：2015年06月12日-2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年06月12日-2015年12月31日
一、收入		5,068,988.13
1.利息收入		3,831,317.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,468,745.92
债券利息收入		362,571.73

资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		—
其他利息收入		—
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,237,670.48
其中:股票投资收益	7.4.7.12	—
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	1,237,670.48
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	—
股利收益	7.4.7.15	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	—
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	—
减:二、费用		1,137,874.26
1. 管理人报酬		352,403.76
2. 托管费		62,929.25
3. 销售服务费		314,646.20
4. 交易费用	7.4.7.18	—
5. 利息支出		175,659.97
其中:卖出回购金融资产支出		175,659.97
6. 其他费用	7.4.7.19	232,235.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3,931,113.87
减:所得税费用		—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,931,113.87
-------------------	--	--------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧滚钱宝发起式货币市场基金

本报告期：2015年06月12日-2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年06月12日-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）	40,000,000.00	—	40,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	3,931,113.87	3,931,113.87
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）	276,442,339.16	—	276,442,339.16
其中：1.基金申购款	773,152,839.02	—	773,152,839.02
2.基金赎回款	-496,710,499.86	—	-496,710,499.86
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）	—	-3,931,113.87	-3,931,113.87
五、期末所有者权益（基金净值）	316,442,339.16	—	316,442,339.16

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

管志斌

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

中欧滚钱宝发起式货币市场基金(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[2015]476号《关于准予中欧滚钱宝发起式货币市场基金注册的批复》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《中欧滚钱宝发起式货币市场基金 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币40,000,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第752号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧滚钱宝发起式货币市场基金 基金合同》于2015年06月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为40,000,000.00份基金份额,募集期间未产生利息。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称"民生银行")。

本基金为发起式基金。基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员认购金额不低于1,000万元,且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的工具包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款及大额存单、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。本基金投资业绩比较基准为: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2016年3月29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》、《中欧滚钱宝发起式货币市场基金 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2015年06月12日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间 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2015年12月31日的财务状况以及2015年06月12日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年06月12日 (基金合同生效日) 至2015年12月31日止期间 。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金承担的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允

价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异

较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额等级的基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并按基金份额面值1.00元分配后转入所有者权益，每日以红利再投资方式将当日收益结转至投资人基金账户。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	161,115.91
定期存款	205,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	—
存款期限1个月内	205,000,000.00
其他存款	—
合计	205,161,115.91

注：1、本报告期内本基金未发生定期存款提前支取的情况。

2、定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2015年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	—	—	—	—

	银行间市场	140,359,644.34	140,619,000.00	259,355.66	0.0820%
	合计	140,359,644.34	140,619,000.00	259,355.66	0.0820%

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	32.43
应收定期存款利息	2,831,286.87
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	2,027,785.81
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	4,859,105.11

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
----	--------------------

交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	19,695.53
合计	19,695.53

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
预提信息披露费	150,000.00
银行间账户维护费	4,500.00
上清所账户维护费	4,500.00
合计	159,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年06月12日-2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	40,000,000.00	40,000,000.00
本期申购	773,152,839.02	773,152,839.02
本期赎回（以“-”号填列）	-496,710,499.86	-496,710,499.86
本期末	316,442,339.16	316,442,339.16

1. 申购含红利再投份额。

2. 本基金自2015年6月9日至2015年6月9日止期间进行公开发售，共募集有效净认购资金40,000,000.00元。根据《中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金合同》《中欧滚钱宝发起式货币市场基金招募说明书》《中欧滚钱宝发起式货币市场基金份额发售公告》的规定，募集期间内未产生利息，无利息折算份额情况。募集期内，基金管理人中欧基金管理有限公司使用固有资金人民币40,000,000.00元认购本基金，折合为40,000,000.00份基金份额，占本基金份额总额百分比为100.00%。。

3. 根据《中欧滚钱宝发起式货币市场基金 基金合同》及《中欧滚钱宝发起式货币市场基金 招募说明书》的相关规定，本基金于2015年06月12日（基金合同生效日）至2015

年06月14日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自2015年06月15日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	3,931,113.87	—	3,931,113.87
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-3,931,113.87	—	-3,931,113.87
本期末	—	—	—

注：本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每日以红利再投资方式支付累计收益，即按份额面值1.00元转为基金份额。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2015年06月12日-2015年12月31日)
活期存款利息收入	11,724.06
定期存款利息收入	3,451,656.86
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	—
其他	5,365.00
合计	3,468,745.92

7.4.7.12 股票投资收益

无余额。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 (2015年06月12日-2015年12月31日)
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	1,237,670.48
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—
合计	1,237,670.48

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2015年06月12日-2015年12月31日)
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	260,540,145.36
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	251,186,954.58
减：应收利息总额	8,115,520.30
买卖债券差价收入	1,237,670.48

7.4.7.14 衍生工具收益

无余额。

7.4.7.15 股利收益

无余额。

7.4.7.16 公允价值变动收益

无余额。

7.4.7.17 其他收入

无余额。

7.4.7.18 交易费用

无余额。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年06月12日-2015年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	150,000.00
银行费用	8,635.08
账户维护费	13,500.00
其他	100.00
合计	232,235.08

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	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：1、本报告期内，经中欧基金管理有限公司（以下简称“公司”）2015年股东会决议通过，并经中国证券监督管理委员会批准（批准文号：证监许可【2015】1135号），公司自然人股东窦玉明、刘建平、许欣、周蔚文、陆文俊将其合计持有的20%公司股权全部转让给上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）。此次股权转让完成之后，公司注册资本保持不变，仍为188,000,000元，公司股权结构调整为：意大利意联银行股份合作公司出资65,800,000元人民币，占公司注册资本的35%；国都证券股份有限公司出资37,600,000元人民币，占公司注册资本的20%；北京百骏投资有限公司出资37,600,000元人民币，占公司注册资本的20%；上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)出资37,600,000元人民币，占公司注册资本的20%；万盛基业投资有限责任公司出资9,400,000元人民币，占公司注册资本的5%。上述事项的工商变更登记手续已办理完毕，并已于2015年7月18日在指定媒介进行了信息披露。

2、本报告期内，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中欧基金管理有限公司设立子公司的批复》（证监许可[2015]1628号），中欧基金管理有限公司获准设立子公司钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司，业务范围为证券投资基金销售业务以及中国证监会许可的其他业务。钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司注册地为上海市，注册资本人民币2000万元。上述事项的工商变更登记手续已办理完毕，并已于2015年8月20日在指定媒体进行了信息披露。

3、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年06月12日-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	352,403.76

其中：支付销售机构的客户维护费

—

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.28%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：

日基金管理费=前一日基金资产净值 X 0.28% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年06月12日-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	62,929.25

注：支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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 X 0.05% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2015年06月12日-2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中欧基金管理有限公司	314,646.20
合计	314,646.20

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，按月支付给中欧基金，再由中欧基金计算并支付给各基金销售机构。基金份额约定的销售服务费年费率为0.25%。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 X 约定年费率 / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2015年06月12日-2015年12月 31日	上年度可比期间
----	-----------------------------------	---------

基金合同生效日(2015年06月12日)持有的基金份额	40,000,000.00	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	262,931,778.31	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	210,000,000.00	—
报告期末持有的基金份额	92,931,778.31	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	29.37%	—

7.4.10.4.2 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
无。

7.4.10.5 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 2015年06月12日-2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	161,115.91	11,724.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明
无。

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金**

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
3,931,113.87	—	—	3,931,113.87	

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**
无。**7.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.2.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2015年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额33,599,749.60元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
041558061	15魏桥 铝电 CP001	2016-01-04	100.45	136000	13,661,212.06
041552032	15大榭 开发 CP001	2016-01-04	100.28	100000	10,028,053.98
041564066	15科伦 CP001	2016-01-04	100.23	100000	10,022,675.11
合计				336,000.00	33,711,941.15

7.4.12.2.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年12月31日
A-1	100,366,423.89
A-1以下	—
未评级	39,993,220.45
合计	140,359,644.34

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.未评级债券为剩余期限在一年以内的政策性金融债及未有三方机构评级的短期融资券。3.债券投资以净价列示。

7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于2015年12月31日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2015 年12月31日	6个月以 内	6个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	205,161,115.91	—	—	—	—	205,161,115.91
交易性金融资产	60,101,760.45	80,257,883.89	—	—	—	140,359,644.34
应收利息	—	—	—	—	4,859,105.11	4,859,105.11
资产总计	265,262,876.36	80,257,883.89	—	—	4,859,105.11	350,379,865.36
负债						
卖出回购金融资产款	33,599,749.60	—	—	—	—	33,599,749.60
应付管理人报酬	—	—	—	—	75,656.53	75,656.53
应付托管费	—	—	—	—	13,510.11	13,510.11
应付销售服	—	—	—	—	67,550.46	67,550.46

务费						
应付交易费用	—	—	—	—	19,695.53	19,695.53
应付利息	—	—	—	—	2,363.97	2,363.97
其他负债	—	—	—	—	159,000.00	159,000.00
负债总计	33,599,749.60	—	—	—	337,776.60	33,937,526.20
利率敏感度缺口	231,663,126.76	80,257,883.89	—	—	4,521,328.51	316,442,339.16

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2015年12月31日 上年度末 2014年12月31日
假设	1.市场利率下降25个基点	18.57
假设	2.市场利率上升25个基点	-18.50

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

7.4.14 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2015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140,359,644.34元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015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。

(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	140,359,644.34	40.06
	其中：债券	140,359,644.34	40.06
	资产支持证券	—	—

2	买入返售金融资产	—	—
	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	205,161,115.91	58.55
4	其他各项资产	4,859,105.11	1.39
5	合计	350,379,865.36	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	11.85	
	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	33,599,749.60	10.62
	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	90
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	6

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。

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	64.83	10.62
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—180天	18.99	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)—397天（含）	25.36	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		109.19	10.62

8.4 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	19,994,909.45	6.32
	其中：政策性金融债	19,994,909.45	6.32
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	120,364,734.89	38.04
6	中期票据	—	—
7	同业存单	—	—

8	其他	—	—
9	合计	140,359,644.34	44.36
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。

8.5 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	041560046	15津钢管CP001	200,000.00	20,108,540.00	6.35
2	041558061	15魏桥铝电CP001	200,000.00	20,090,017.74	6.35
3	041576005	15西安浐灞CP001	200,000.00	20,057,173.28	6.34
4	011599540	15阳泉SCP003	200,000.00	19,998,311.00	6.32
5	150413	15农发13	200,000.00	19,994,909.45	6.32
6	041561025	15温现代CP001	100,000.00	10,031,278.15	3.17
7	041562048	15南浦口CP001	100,000.00	10,028,685.63	3.17
8	041552032	15大榭开发CP001	100,000.00	10,028,053.98	3.17
9	041564066	15科伦CP001	100,000.00	10,022,675.11	3.17

8.6 “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	—
报告期内偏离度的最高值	0.2245%

报告期内偏离度的最低值	0.0132%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0961%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2

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。

8.8.3

本基金投资的15科伦CP001的发行主体四川科伦药业股份有限公司于2015年4月22日收到中国证券监督管理委员会四川监管局下发的《中国证券监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书》（编号：[2015]1号），科伦药业未按规定披露在2012、2013年发生的关联交易行为，违反了《证券法》第六十三条、六十六条和六十七条的有关规定，构成了《证券法》第一百九十三条第一款所述“未按照规定披露信息，或者所披露的信息有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏”和该条第二款所述“未按照规定报送有关报告，或者报送的报告有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏”的违法行为。依据《证券法》第一百九十三条的规定，四川证监局决定：1. 对科伦药业给予警告，并处60万元罚款；2. 对刘革新给予警告，并处30万元罚款；3. 对程志鹏、潘慧、刘思川、冯伟、熊鹰给予警告，并处20万元罚款；4. 对张强、刘洪给予警告，并处5万元罚款；5. 对赵力宾、高冬、罗孝银、于明德、武敏给予警告，并处3万元罚款；6. 对张腾文给予警告。

在上述公告公布后，本基金管理人对该公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对15科伦CP001的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。

本基金投资的前十名证券中的其余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。

8.8.4 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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	4,859,105.11
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	4,859,105.11

8.8.5 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。

§ 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

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
13,479	23,476.69	97,933,207.00	30.95%	218,509,132.16	69.05%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	13,538,685.41	4.28%

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	92,931,778.31	29.37%	10,000,000.00	3.16%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	92,931,778.31	29.37%	10,000,000.00	3.16%	三年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年06月12日)基金份额总额	40,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	773,152,839.02
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	496,710,499.86
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	316,442,339.16

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本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2015年6月20日发布公告，卢纯青女士自2015年6月18日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务，周蔚文先生不再担任副总经理一职。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。

本报告期内，黄桦先生自2015年12月31日起不再担任中欧基金管理有限公司督察长职务，基金管理人于2016年1月5日发布公告，并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 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本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

本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60,000.00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

本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	股票交易		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	占当期股票成交总额比例	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	
国金证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	

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、本报告期内所有交易单元均为本报告期新增。

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。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧滚钱宝发起式货币市场基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-04
2	中欧滚钱宝发起式货币市场基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-04
3	中欧滚钱宝发起式货币市场基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-04
4	中欧滚钱宝货发起式币市场基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-04
5	中欧滚钱宝货发起式币市场基金基金合同摘要	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-04
6	中欧基金管理有限公司关于中欧滚钱宝发起式货币市场基金仅通	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-09

	过直销柜台募集的公告		
7	中欧基金管理有限公司关于中欧滚钱宝发起式货币市场基金提前结束募集时间的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-09
8	中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-13
9	中欧滚钱宝发起式货币市场基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-13
10	中欧基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-06-20
11	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2015年6月30日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-07-01
12	中欧基金管理有限公司关于网上直销系统开通通联支付渠道并实施费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-07-28
13	中欧基金管理有限公司办公地址变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-09-25
14	中欧基金管理有限公司关于中欧滚钱宝发起式货币市场基金暂停直销柜台申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-10-13
15	中欧滚钱宝发起式货币市场基金2015年第3季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2015-10-24
16	中欧基金管理有限公司关于通过旗下理财交易及客户服务平台申购旗下基金费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-10-30
17	中欧基金管理有限公司关于开通网上直销货币基金快速赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-10-30
18	中欧基金管理有限公司关于旗下理财交易及客户服务平台上线的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-10-30

19	中欧基金管理有限公司关于中欧滚钱宝发起式货币市场基金恢复直销柜台日常申购业务并在直销中心暂停大额申购的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-11-26
20	中欧基金管理有限公司关于对通过旗下理财交易及客户服务平台申购旗下部分基金开展费率优惠活动的补充公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-12-01
21	中欧基金管理有限公司关于网上直销通联支付通道新增支持银行卡并实施费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-12-02
22	中欧基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后旗下基金开放时间调整的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2015-12-31

§ 12 备查文件目录

12.1 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报纸上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 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、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
二〇一六年三月二十九日