中欧纯债添利分级债券型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:中欧基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2019 年 07 月 19 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。
基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 7 月 18 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 2019 年 04 月 01 日起至 2019 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧纯债添利分级债券
场内简称	中欧添利
基金主代码	166021
基金运作方式	契约型,添利 A 在添利 B 的每个封闭运作期内每满半年开放一次,接受申购与赎回申请;添利 B 根据基金合同的约定定期开放,接受申购与赎回申请,其余时间封闭运作。本基金在添利 A 的两个封闭运作期之间设置过渡期,办理添利 A 与添利 B 的赎回、折算以及申购等事宜,基金合同生效,在本基金符合法律法规和深交所规定的上市条件的情况下,本基金添利 B 份额申请上市与交易。
基金合同生效日	2013年11月28日
报告期末基金份额总额	1,565,241,240.97 份
投资目标	在严格控制风险的基础上,为投资者谋求稳健的投资收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测,采取信用策略、久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等,在严格的风险控制基础上,力求实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合 在价 指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低预期风险、预期收益特征的基金品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	中欧纯债添利分级债券 A / 中欧纯债添利分级债券 B
下属分级基金场内简称	中欧添 A / 中欧添 B
下属分级基金的交易代码	166022 / 150159
报告期末下属分级基金的份额总额	17,952,996.88 份 / 1,547,288,244.09 份
下属分级基金的风险收益特征	添利 A 将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期长益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。 / 添利 B 将表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

§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 (2019 年 04 月 01 日 - 2019 年 06 月 30 日)
1.本期已实现收益	20,179,816.39
2.本期利润	9,818,039.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0063
4.期末基金资产净值	1,712,665,542.61
5.期末基金份额净值	1.094

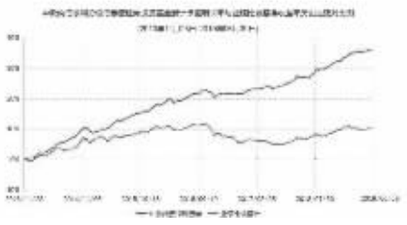
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.59%	0.05%	-0.24%	0.06%	0.83%	-0.01%

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



3.3 其他指标

单位:人民币元

其他指标	报告期末 (2019 年 06 月 30 日)
添利 A 与添利 B 基金份额配比	0.035:3
期末添利 A 份额参与净值	1.003
期末添利 A 份额累计参与净值	1.215
期末添利 B 份额参与净值	1.095
期末添利 B 份额累计参与净值	1.430
添利 A 的预计年收益率	3.40%

§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		
王家柱	基金经理	2018-09-21	-	5	历任工银瑞信基金管理有限公司信用评级研究员 2011.07-2016.11 ;2016-12-05 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遵规守信情况的说明

本报告期内,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 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金份额净值增长率为 0.59%,同期业绩比较基准收益率为 -0.24%。

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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,070,805,785.00	93.19
	其中:债券	1,938,267,785.00	87.22
	资产支持证券	132,538,000.00	5.96
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	49,960,314.94	2.25
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	43,799,578.33	1.97
8	其他资产	57,638,960.59	2.59
9	合计	2,222,204,638.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	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	108,978,000.00	6.36
	其中:政策性金融债	108,978,000.00	6.36
4	企业债券	1,362,398,688.40	79.55
5	企业短期融资券	70,500,000.00	4.12
6	中期票据	374,354,000.00	21.88
7	可转债(可交换债)	21,637,096.60	1.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,938,267,785.00	113.17

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101655022	16沪铜MTN002	700,000	70,441,000.00	4.11
2	122333	14国宝债	661,010	66,484,385.80	3.88
3	122323	14凯旋债	640,000	64,268,800.00	3.75
4	143670	18中煤 03	600,000	61,752,000.00	3.61
5	143671	18信安 01	600,000	59,910,000.00	3.50

5.6 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139302	招融 01A1	500,000	50,000,000.00	2.92
2	139284	联易融 08	360,000	36,000,000.00	2.10
3	139303	万科 30A1	120,000	12,000,000.00	0.70
4	156441	金保 01 优	100,000	10,000,000.00	0.58
5	156676	金保 02 优	90,000	9,000,000.00	0.53
6	139285	招融 6 优 1	80,000	8,000,000.00	0.47
7	156199	PR起售 A1	200,000	7,538,000.00	0.44

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	92,554.26
2	应收证券清算款	10,276,242.10
3	应收股利	-
4	应收利息	47,270,164.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	57,638,960.59

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110041	蒙电转债	3,359,205.00	0.20
2	110042	航电转债	2,330,828.80	0.14
3	128047	光电转债	971,208.00	0.06
4	110045	海澜转债	189,619.20	0.01
5	110031	航信转债	107,160.00	0.01
6	128016	顺昌转债	15,918.00	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 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

	中欧纯债添利分级债券 A	中欧纯债添利分级债券 B
报告期期初基金份额总额	21,348,050.82	1,547,288,244.09
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	3,756,976.41	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	361,922.47	0.00
报告期期末基金份额总额	17,952,996.88	1,547,288,244.09

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情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金份额的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	2019年4月1日至2019年6月30日	499,999,000.00	0.00	0.00		499,999,000.00	31.94%
产品持有风险								
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况,在市场情况突变的情况下,可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险,本基金管理人将对申购赎回进行密切关注,并在基金合同允许范围内采取措施进行严格的管理,降低流动性风险,保护中小投资者利益。								

注:申购份额含红利再投份额、转换入份额,赎回份额含转换出份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》

3、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金托管协议》

4、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金招募说明书》

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

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 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
2019 年 07 月 19 日

中欧货币市场基金

2019 第二季度 报告

2019年6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:2019 年 07 月 19 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 2019 年 7 月 18 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 2019 年 04 月 01 日起至 2019 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧货币
场内简称	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	4,963,597,092.05 份
投资目标	在力争基金资产安全性和较高收益性的基础上,追求超越金融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
下属分级基金场内简称	中欧货 A / 中欧货 B / - / -
下属分级基金的交易代码	166014 / 166015 / 302747 / 302748
报告期末下属分级基金的份额总额	43,955,304.17 份 / 4,846,293,938.89 份 / 3,037,384.92 份 / 70,310,464.07 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(2019 年 04 月 01 日 - 2019 年 06 月 30 日)			
	中欧货币 A	中欧货币 B	中欧货币 C	中欧货币 D
1.本期已实现收益	235,341.69	32,260,609.33	19,004.69	737,135.15
2.本期利润	235,341.69	32,260,609.33	19,004.69	737,135.15
3.期末基金资产净值	43,955,304.17	4,846,293,938.89	3,037,384.92	70,310,464.07

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;本期末基金资产净值指基金本期期末可供分配的利润。

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

中欧货币 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	0.5157%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.1791%	0.0005%

注:本基金收益分配按日结转份额。

中欧货币 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	0.5760%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.2394%	0.0005%

注:本基金收益分配按日结转份额。

中欧货币 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	0.5126%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.1760%	0.0005%

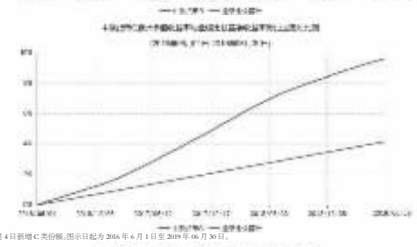
注:本基金收益分配按日结转份额。

中欧货币 D 净值表现

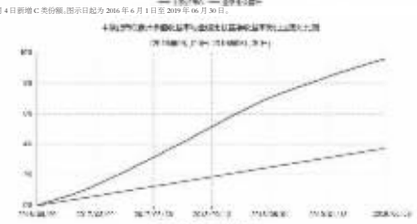
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5759%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.2393%	0.0005%

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:本基金于 2016 年 5 月 4 日新增 C 类份额,图示日起为 2016 年 6 月 1 日至 2019 年 06 月 30 日。



注:本基金于 2016 年 5 月 4 日新增 D 类份额,图示日期为 2016 年 9 月 20 日至 2019 年 06 月 30 日。

3.4 管理人报告

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		
蒋雯文	基金经理	2018-01-30	-	7	历任纽约香港有限公司销售交易员 D009.06-2011.07),平安资产管理有限责任公司债券交易员 2011.09-2016.05),前海开源基金投资经理助理 2016.09-2016.10 ;2016-11-17 加入中欧基金管理有限公司,历任交易员、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 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

4.3.2 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运作分析

19 年二季度,宏观环境方面,国内经济依然存在较大下行压力,经济托底甚至复苏比较依赖中央维出的刺激政策,然而猪肉价格等 CPI 重要组成因子价格持续走高,有很多投资者担心会出现滞涨的情况,国外方面,贸易战决烈反复,仍旧为一项不确定因素,全球各国家进入降息周期,由于我国经济具有相对独立自主的能力,因此我国要不要降息并不完全取决于其他国家是否已经进入降息周期,但全球经济增长的放缓对我国的贸易势必有一定的影响。

货币市场方面,宏观环境方面,国内经济依然存在较大下行压力,经济托底甚至复苏比较依赖中央维出的刺激政策,然而猪肉价格等 CPI 重要组成因子价格持续走高,有很多投资者担心会出现滞涨的情况,国外方面,贸易战决烈反复,仍旧为一项不确定因素,全球各国家进入降息周期,由于我国经济具有相对独立自主的能力,因此我国要不要降息并不完全取决于其他国家是否已经进入降息周期,但全球经济增长的放缓对我国的贸易势必有一定的影响。

本基金采用短久期加权杠杆的方式运作,既能的止资金利率突然走高的风险,又能在流动性充裕的情况下赚取一定的收益,在金融市场风险不断爆发,监管趋严的情况下,回归货币基金本源,将安全和流动性安全放在第一位,审慎运作。

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 0.5157%,同期业绩比较基准收益率为 0.3366%;B 类份额净值收益率为 0.5760%,同期业绩比较基准收益率为 0.3366%;C 类份额净值收益率为 0.5126%,同期业绩比较基准收益率为 0.3366%;D 类份额净值收益率为 0.5759%,同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

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	1,697,581,851.40	34.18
	其中:债券	1,670,499,700.55	33.64
	资产支持证券	27,082,150.85	0.55
2	买入返售金融资产	1,760,339,280.52	35.45
	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	1,501,119,226.64	30.23
4	其他资产	6,862,913.39	0.14
5	合计	4,965,903,271.95	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	-	1.00
	其中:买断式回购融资	-	-
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	49
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	14

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类比例

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		52.81	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		-	-
2	30(不含)-60天		5.02	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		-	-
3	60(不含)-90天		27.57	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		-	-
4	90(不含)-120天		6.01	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		-	-
5	120(不含)-397 天(含)		8.49	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		-	-
	合计		99.91	-

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	179,660,858.11	3.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,023,243.81	1.61
	其中:政策性金融债	80,023,243.81	1.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,002,466.60	1.41
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,340,813,132.03	27.01
8	其他	-	-
9	合计	1,670,499,700.55	33.66
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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	111916163	19工商银行CD163	2,000,000	199,673,779.00	4.02
2	111821165	18交行银行CD165	2,000,000	199,428,788.37	4.02
3	111903072	19交行银行CD072	2,000,000	197,357,786.30	3.98
4	111909175	19浦发银行CD175	1,500,000	149,108,889.79	3.00
5	111903076	19交行银行CD076	1,000,000	99,838,193.47	2.01
6	111915018	19民生银行CD018	1,000,000	99,187,518.43	2.00
7	111806235	18工商银行CD235	1,000,000	99,153,014.33	2.00
8	111810598	18兴业银行CD598	1,000,000	98,712,133.50	1.99
9	199913	19农发债 13	700,000	70,000,000.00	1.41
10	180209	18国开 09	600,000	60,015,877.90	1.21

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	0.0401%
报告期内偏离度的最低值	-0.0158%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0108%

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1989094	19上和2A1	500,000	26,461,853.72	0.53
2	1989013	19上和1A1	1,000,000	620,297.13	0.01

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。

本基金通过每日交纳基金份额资产净值等待收 1.00 元。

5.9.2 本基金投资的 19 民生银行 CD018 的发行主体中国民生银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚(银保监银罚决字[2018]15 号),主要违法事实包括:贷款业务严重违反审慎经营规则,共罚款 200 万元;且于 2018 年 11 月 9 日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚(银保监银罚决字[2018]38 号),主要违法事实包括:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)同业投资违规原受托人;(三)理财业务风险管理失控;(四)未行理财产品之间风险隔离不到位;(五)个人理财资金违规投资;(六)理财代理未明示、增信未落证和口提供本方用;(七)分非保本理财产品提供保本承诺;共罚款 3160 万元。

本基金投资的 18 交通银行 CD235 的发行主体交通银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚(银保监银罚决字[2018]12 号),主要违法事实包括:(一)不良信贷资产表内外转让、理财资金投资不良信贷资产收益权;(二)本息彩调差并使用自有资金垫付本息风险资产;(三)授信管理不到位,内控管理存在严重漏洞;(四)理财资金曾给保险资管业通道增本行存款规模;(五)违规向上地媒体机构提供融资;(六)信贷资金违规承接本行表外理财资产;(七)理财资金违规投资用日资本金;(八)部分理财产品信息披露不合格;共罚款 690 万元;且于 2018 年 11 月 9 日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚(银保监银罚决字[2018]13 号),主要违法事实包括:(一)开展快款快贷业务信贷资产不合规;(二)开展快款快贷业务风险管理不到位,共罚款 30 万元;于 2018 年 10 月 18 日受到上海保监局的处罚(沪保监罚[2018]46 号),主要违法事实包括:(一)数据真实性不到位;(二)内控收入隐瞒与合同有关的重要信息,共罚款 56 万元。

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分析,认为上述处罚不会对 18 交通银行 CD235(111806235.IB)、19 民生银行 CD018(111915018.IB)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,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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,821,313.39
4	应收申购款	41,600.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	6,862,913.39

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

	中欧货币 A	中欧货币 B	中欧货币 C	中欧货币 D
报告期期初基金份额总额	47,808,812.25	4,653,041,650.95	4,572,427.82	387,729,737.91
报告期期间基金总申购份额	7,823,926.40	3,846,782,628.63	11,965,155.74	120,500,627.05
报告期期间基金总赎回份额	11,677,434.48	3,653,530,340.69	13,500,198.64	437,919,900.89
报告期期末基金份额总额	43,955,304.17	4,846,293,938.89	3,037,384.92	70,310,464.07

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情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金份额的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	2019年4月1日至2019年6月30日	1,417,948,577.07	8,219,514.53	0.00		1,426,168,091.60	28.73%
产品持有风险								
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况,在市场情况突变的情况下,可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险,本基金管理人将对申购赎回进行密切关注,并在基金合同允许范围内采取措施进行严格的管理,降低流动性风险,保护中小投资者利益。								

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