

中欧骏泰货币市场基金 更新招募说明书摘要

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

二〇二〇年六月

本基金经2016年11月24日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予中欧骏泰货币市场基金注册的批复》（证监许可[2016]2837号文）准予募集注册。本基金基金合同于2016年12月19日正式生效。

重要提示

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

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。

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金

销售业务资格的其他机构购买基金。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本基金本次更新招募说明书仅更新了收益分配相关内容，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

目 录

第一部分	基金管理人.....	5
第二部分	基金托管人.....	10
第三部分	相关服务机构.....	16
第四部分	基金的名称.....	21
第五部分	基金的类型.....	21
第六部分	基金的投资目标.....	21
第七部分	基金的投资范围.....	21
第八部分	基金的投资策略.....	22
第九部分	基金的业绩比较基准.....	23
第十部分	基金的风险收益特征.....	24
第十一部分	基金的投资组合报告.....	24
第十二部分	基金的业绩.....	31
第十三部分	基金费用与税收.....	32
第十四部分	对招募说明书更新部分的说明.....	34

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

- 1、名称：中欧基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层
- 3、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5层、上海市虹口区公平路18号8栋-嘉昱大厦7层
- 4、法定代表人：窦玉明
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、成立日期：2006年7月19日
- 7、批准设立机关：中国证监会
- 8、批准设立文号：证监基金字[2006]102号
- 9、存续期间：持续经营
- 10、电话：021-68609600
- 11、传真：021-33830351
- 12、联系人：袁维
- 13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：22000万元人民币
- 15、股权结构：

序号	股东名称	出资额 (人民币万元)	出资比例
1	Unione di Banche Italiane S.p.A.	5,500	25.0000%
2	国都证券股份有限公司	4,400	20.0000%
3	北京百骏投资有限公司	4,400	20.0000%
4	上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)	4,400	20.0000%
5	窦玉明	1,100	5.00000%
6	万盛基业投资有限责任公司	726	3.3000%
7	周玉雄	328.35	1.4925%
8	卢纯青	163.8340	0.7447%

9	于洁	163.8340	0.7447%
10	赵国英	163.8340	0.7447%
11	方伊	117.0180	0.5319%
12	关子阳	117.0180	0.5319%
13	卞玺云	92.4660	0.4203%
14	魏博	87.7580	0.3989%
15	郑苏丹	87.7580	0.3989%
16	曲径	87.7580	0.3989%
17	黎忆海	64.3720	0.2926%
合计		22,000	100%

二、主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

窦玉明先生，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA，中国籍。中欧基金管理有限公司董事长，上海盛立基金会理事会理事，国寿投资控股有限公司独立董事，天合光能股份有限公司董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

Marco D' Este 先生，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布雷西亚农业信贷银行（CAB）国际部总监，曾在意大利信贷银行（Credito Italiano，现名：联合信贷银行 Unicredit）圣雷莫分行、米兰分行、伦敦分行、纽约分行、东京分行（财务部负责人）及米兰总部工作。

朱鹏举先生，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司，国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理、投行业务董事及内核小组副组长。

刘建平先生，北京大学法学学士、法学硕士，美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院工商管理博士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北

京大学教师，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

David Youngson 先生，英国籍。现任 IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人、The Red Flag Group 非执行董事，英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员，中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰，伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

郭雳先生，中国籍。现任北京大学法学院教授、博士生导师，中欧基金管理有限公司独立董事。法学博士、应用经济学博士后，德国洪堡学者，中国银行法学研究会副会长。历任北京大学法学院讲师、副教授，美国康奈尔大学法学院客座教授等，毕业于北京大学、美国南美以美大学、哈佛大学法学院。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学经济学院世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事、贵阳银行股份有限公司独立董事、荣威国际集团股份有限公司独立董事、中国绿地博大绿泽集团有限公司独立董事、交银国际信托有限公司独立董事、上海袅之文学艺术创作有限公司执行董事。历任上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记，上海财经大学 MBA 学院院长兼书记，上海财经大学商学院书记兼副院长。

2. 基金管理人监事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司监事会主席，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事长，中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券股份有限公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，上海源泰律师事务所合伙人，中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。

陆正芳女士，监事，现任中欧基金管理有限公司交易总监，中国籍，上海财经大学证券期货系学士。历任申银万国证券股份有限公司中华路营业部经纪人。

李琛女士，监事，现任中欧基金管理有限公司理财规划总监，中国籍，同济

大学计算机应用专业学士。历任大连证券上海番禺路营业部系统管理员，大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

3. 基金管理人高级管理人员

窦玉明先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

顾伟先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司策略组负责人，中国籍。上海财经大学金融学硕士，18年以上证券及基金从业经验。历任平安集团投资管理中心债券部研究员、研究主管，平安资产管理有限责任公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理。

卢纯青女士，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司研究总监、策略组负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，14年以上基金从业经验。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

许欣先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，18年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

卞玺云女士，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学注册会计师专业学士，11年以上证券及基金从业经验。历任毕马威会计师事务所助理审计经理，银华基金管理有限公司投资管理部副总监，中欧基金管理有限公司风控总监。

4. 本基金基金经理

(1) 现任基金经理

姓名	洪慧梅	性别	女
国籍	中国	毕业院校及专业	同济大学金融
其他公司历任	平安资产管理有限责任公司债券交易员（2007.02-2009.04）， 汇丰人寿保险股份有限公司债券交易主任（2009.05-2011.04）， 浙商基金管理有限公司基金经理（2011.05-2016.03），平安养		

	老保险股份有限公司投资经理（2016.04-2019.06）		
本公司历任	无		
本公司现任	基金经理		
本基金经理所管理基金具体情况	产品名称	起任日期	离任日期
1	中欧盈和5年定期开放债券型证券投资基金	2019年08月16日	
2	中欧骏泰货币市场基金	2019年08月16日	
3	中欧货币市场基金	2019年08月16日	
4	中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF)	2019年08月16日	
5	中欧天禧纯债债券型证券投资基金	2019年08月16日	
6	中欧鼎利债券型证券投资基金	2019年10月10日	

(2) 历任基金经理

基金经理	起任日期	离任日期
黄华	2017年03月24日	2018年09月28日
刘凌云	2016年12月19日	2017年03月24日
蒋雯文	2018年01月30日	2019年08月23日

5. 基金管理人投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理刘建平，副总经理兼策略组负责人顾伟，副总经理兼研究总监、策略组负责人卢纯青，策略组负责人周蔚文、陆文俊、周玉雄、刁羽、黄华、陈岚、赵国英、曲径、曹名长、王培、王健，信用评估部总监张明，风险管理部总监孙自刚，中央交易

室总监陆正芳组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主席。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

（一）基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发

展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部，2005年更名为资产托管部，2013年更名为资产托管与养老金业务部，2016年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

（二）主要人员情况

高国富，男，1956年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发（控股）公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国太平洋保险（集团）股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理，上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建，男，1968年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员，国际业务部、工商信贷处科长，资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部党支部书记、资产托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截止2019年6月30日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为

4260.70 亿元，比去年末增加 1.13%。托管证券投资基金共一百五十四只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、博时安丰 18 个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、景顺长城中证 500 指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港

深精选混合基金、万家天添宝货币基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、嘉实中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、中海信息产业精选混合型证券投资基金、民

生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、中信建投景和中短债债券型证券投资基金、工银瑞信添慧债券型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、汇添富中债1-3年农发行债券指数证券投资基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金、大成中债3-5年国开行债券指数基金等。

（四）基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急预案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，

排查风险隐患。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- （1）《中华人民共和国证券法》；
- （2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
- （3）《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
- （4）《证券投资基金销售管理办法》
- （5）《基金合同》、《基金托管协议》；
- （6）法律、法规、政策的其他规定。

2、监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

3、监督方法

（1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

（2）在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

（3）对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

4、监督结果的处理方式

（1）基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

（2）若基金托管人发现基金管理人违法违规操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人未予纠正，

基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

（3）针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1. 直销机构

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：窦玉明

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

网址：www.zofund.com

2. 其他销售机构

1) 名称：阳光人寿保险股份有限公司

住所：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

客服热线：95510

网址：<http://fund.sinosig.com>

2) 名称：国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

3) 名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

客服热线：400-888-8108

网址：www.csc108.com

4) 名称：中国银河证券股份有限公司

住所：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层

办公地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座2至6层

法定代表人：陈共炎

客服热线：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

5) 名称：申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

客服热线：95523

网址：www.swhysc.com

6) 名称：申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：李琦

客服热线：400-800-0562

网址：www.hysec.com

7) 名称：安信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路安联大厦

法定代表人：王连志

客服热线：4008-001-001

网址：www.essences.com.cn

8) 名称：中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦；北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服热线：95558

网址：www.citics.com

9) 名称：中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：姜晓林

客服热线：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

10) 名称：中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客户热线：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

11) 名称：上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济
发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

12) 名称：上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座（北楼）25 层

法定代表人：其实

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

13) 名称：浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：凌顺平

客服热线：400-877-3772

网址：www.5ifund.com

14) 名称：北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座京东集团总部

法定代表人：江卉

客服热线：4000988511/ 4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

15) 名称：嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15

单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

客服热线：400-021-8850

网址：<https://www.harvestwm.cn/>

16) 名称：大连银行股份有限公司

住所：辽宁省大连市中山区中山路 88 号

办公地址：辽宁省大连市中山区中山路 88 号

法定代表人：陈占维

客服热线：4006640099

网址：www.bankofdl.com

17) 名称：南京苏宁基金销售有限公司

住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客服热线：95177

网址：www.snjijin.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点，并在基金管理人网站公示。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

二、登记机构

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 5 层

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋-嘉昱大厦 7 层

法定代表人：竇玉明

电话：021-68609600

传真：021-68609601

联系人：杨毅

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

经办律师：黎明、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、印艳萍

第四部分 基金的名称

中欧骏泰货币市场基金

第五部分 基金的类型

契约型 开放式

第六部分 基金的投资目标

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。

第七部分 基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略

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。

1、利率预期与目标剩余期限管理策略

通过对宏观经济指标、资金市场供求状况等因素的跟踪分析，预测政府宏观经济政策取向和资金市场供求变化趋势，以此为依据预测金融市场利率变化趋势。

根据对宏观经济和短期资金市场的利率走势，来确定投资组合的平均剩余到期期限。具体而言，在预计市场利率上升时，适当缩短投资品种的平均期限；在预计利率下降时，适当延长投资品种的平均期限。

2、类属配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

3、个券选择策略

在个券选择上，本基金通过定性定量方法，综合分析收益率曲线、流动性、信用风险，评估个券投资价值，发掘出具备相对价值的个券。

4、回购策略

1) 息差放大策略：该策略是指利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式是利用买入债券进行正回购，再利用回购融入资金购买收益率较高债券品种，如此循环至回购期结束

卖出债券偿还所融入资金。在进行回购放大操作时，基金管理人将严格遵守相关法律法规关于债券正回购的有关规定。

2) 逆回购策略：基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。

5、收益率曲线策略

本基金将根据债券市场收益率曲线以及隐含的即期收益率和远期利率提供的价值判断基础，结合对资金面的分析，匹配各期限的回购与债券品种的到期日，实现现金流的有效管理。

6、现金流管理策略

本基金作为现金管理工具，具有较高的流动性要求，本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。

7、资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构，将信贷资产信托给受托机构，由受托机构向投资机构发行，以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为同期7天通知存款税后利率。

根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款税后利率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩比较基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时

公告，而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

第十一部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人根据基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2019 年第 1 季度报告，所载数据截至 2019 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	7,315,970,484.79	48.59
	其中：债券	7,315,970,484.79	48.59
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,683,612,425.46	24.46
	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	4,005,945,585.05	26.60
4	其他资产	51,746,011.07	0.34
5	合计	15,057,274,506.37	100.00

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	-	4.57
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	1,391,998,204.00	10.19
	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%。

3、基金投资组合平均剩余期限

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	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

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。

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	39.39	10.19
	其中：剩余存续期超过 397	-	-

	天的浮动利率债		
2	30天(含)—60天	3.79	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	47.90	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	5.37	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	13.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		109.85	10.19

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、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	119,732,934.43	0.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	600,275,283.59	4.39
	其中：政策性金融债	600,275,283.59	4.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	同业存单	6,595,962,266.77	48.29
8	其他	-	-
9	合计	7,315,970,484.79	53.56
10	剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	-	-

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	160415	16 农发 15	3,100,000	310,114,970.28	2.27
2	11192003 9	19 广发银行 CD039	3,000,000	298,166,705.99	2.18
3	11190803 9	19 中信银行 CD039	3,000,000	298,153,219.08	2.18
4	11190704 0	19 招商银行 CD040	3,000,000	298,153,219.08	2.18
5	11190301 1	19 农业银行 CD011	3,000,000	298,153,219.08	2.18
6	11188517 9	18 哈尔滨银行 CD156	3,000,000	295,800,078.60	2.17
7	11199427 1	19 天津银行 CD035	3,000,000	295,640,501.22	2.16
8	11181415 9	18 江苏银行 CD159	2,000,000	199,251,004.37	1.46
9	11191809 4	19 华夏银行 CD094	2,000,000	198,905,792.91	1.46
10	11180519 1	18 建设银行 CD191	2,000,000	198,861,366.66	1.46

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	0.0737%
报告期内偏离度的最低值	0.0270%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0519%

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%

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。

8、投资组合报告附注

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。

8.2 本基金投资的 19 招商银行 CD040 的发行主体招商银行股份有限公司于 2018 年 2 月 12 日受到中国银监会的处罚（银监罚决字〔2018〕1 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）违规批量转让以个人

为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。共罚款 6573.024 万元。

本基金投资的 19 中信银行 CD039 的发行主体中信银行股份有限公司于 2018 年 11 月 19 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〕14 号），主要违法事实包括：（一）理财资金违规缴纳土地款；（二）自有资金融资违规缴纳土地款；（三）为非保本理财产品提供保本承诺；（四）本行信贷资金为理财产品提供融资；（五）收益权转让业务违规提供信用担保；（六）项目投资审核严重缺位，共罚款 2280 万元。

本基金投资的 18 民生银行 CD448 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〕5 号），主要违法事实包括：贷款业务严重违反审慎经营原则。共罚款 200 万元；并于 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〕8 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）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本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）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为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 江苏银行 CD159 的发行主体江苏银行股份有限公司于 2019 年 1 月 25 日受到江苏银保监局的处罚（苏银保监罚决字〔2019〕11 号、12 号、13 号），主要违法事实包括：公司员工陈俊青和徐志贤对江苏银行股份有限公司理财投资非标资产未严格比照自营贷款管理，对授信资金未按约定用途使用监督不力行为分别负管理责任和经办责任；公司未按业务实质准确计量风险资产，理财

产品之间未能实现相分离，理财投资非标资产未严格比照自营贷款管理，对授信资金未按约定用途使用监督不力。共罚款 100 万元。

本基金投资的 19 天津银行 CD03518 的发行主体天津银行股份有限公司于 2019 年 2 月 1 日受到天津银保监局的处罚（津银保监罚决字（2019）1 号），主要违法事实包括：（一）未按业务实质准确计量风险、计提资本与拨备；（二）未严格落实同业业务专营改革要求；（三）为未取得相关批准文件的项目提供授信；（四）违规开展土地储备融资业务；（五）授信资金违规向企业增资扩股；（六）同业业务违规接受政府确认函；（七）同业授信资金回流购买本行理财；（八）自营业务与代客业务未严格分离；（九）面向一般个人客户销售的理财产品违规投资权益类资产；（十）同业理财产品误导销售；（十一）同业理财产品投向未持续披露；（十二）与未在同业业务交易对手名单内的客户开展业务。共罚款 660 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视为，认为上述处罚不会对 18 民生银行 CD448（111815448. IB）、19 中信银行 CD039（111908039. IB）、19 招商银行 CD040（111907040. IB）、19 天津银行 CD03（111994271. IB）和 18 江苏银行 CD159（111814159. 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。其余五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。

8.3 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	51,701,021.87
4	应收申购款	44,989.20
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	51,746,011.07

8.4 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。

第十二部分 基金的业绩

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。

本基金合同生效日 2016 年 12 月 19 日，基金业绩截止日 2019 年 3 月 31 日。

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
2016.12.19-2016.12.31	0.1422%	0.0031%	0.0480%	0.0000%	0.0942%	0.0031%
2017.1.1-2017.12.31	4.3880%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	3.0380%	0.0008%
2018.1.1-2018.12.31	3.7437%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	2.3937%	0.0018%
2019.1.1-2019.3.31	0.7401%	0.0008%	0.3329%	0.0000%	0.4072%	0.0008%
2016.12.19-2019.3.31	9.2527%	0.0018%	3.0808%	0.0000%	6.1719%	0.0018%

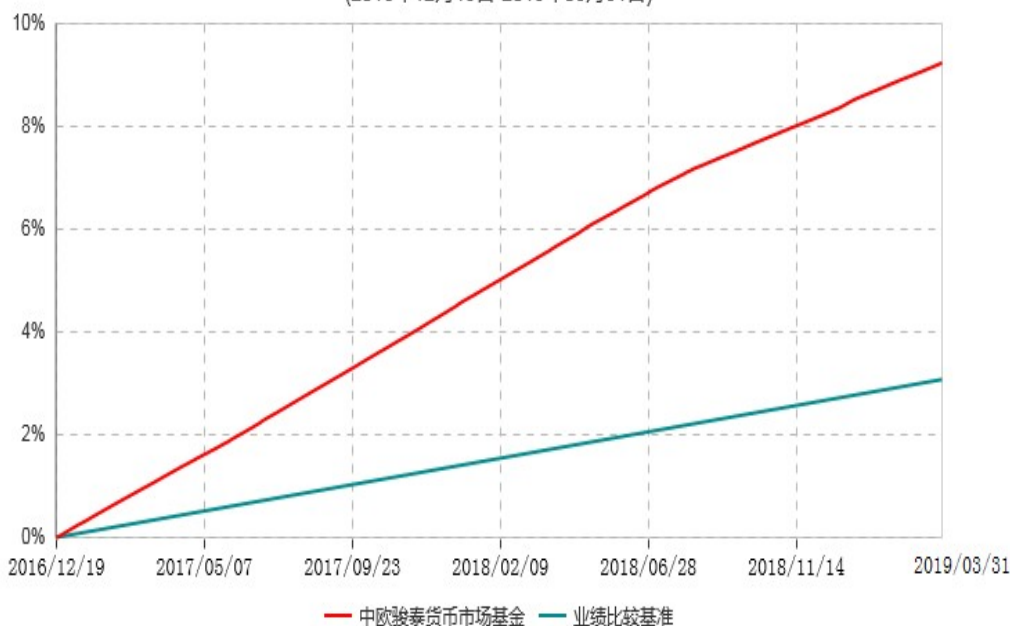
数据来源：中欧基金

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

第十三部分 基金的

中欧骏泰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

(2016年12月19日-2019年03月31日)



费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.24% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.24 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3. 基金销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径将资金支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自

动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

（一）更新了“第十六部分 基金的收益与分配”部分中的相关内容。

更新了收益分配原则，即将本基金的收益支付方式由“每日分配，按月支付”调整为“每日分配、按日支付”，并对基金合同中有关基金收益分配原则等内容进行相应修订。

中欧基金管理有限公司

2020 年 6 月 2 日