

中欧骏泰货币市场基金2017年半年度报告

2017年06月30日

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

送出日期：2017年08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。本半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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月28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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 债券回购融资情况	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限	39
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 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	40
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	41
7.8 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	41
7.9 投资组合报告附注	41
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 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	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
10.2 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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44

10.5	基金改聘会计师事务所情况	44
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	44
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	44
10.9	其他重大事件	45
§11	影响投资者决策的其他重要信息	45
11.1	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	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	46
	无。	46
§12	备查文件目录	46
12.1	备查文件目录	46
12.2	存放地点	46
12.3	查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧骏泰货币市场基金
基金简称	中欧骏泰货币
基金主代码	004039
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年12月19日
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
报告期末基金份额总额	4,314,065,504.80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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	朱萍
	联系电话	021-68609600	021-61618888
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		021-68609700、	95528

	400-700-9700	
传真	021-33830351	021-63602540
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	上海市中山东一路12号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	上海市中山东一路12号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	窦玉明	高国富

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金半年度报告备置地点	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
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5层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日-2017年06月30日）
本期已实现收益	67,479,730.18
本期利润	67,479,730.18
本期净值收益率	2.1223%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年06月30日）
期末基金资产净值	4,314,065,504.80

期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017年06月30日）
累计净值收益率	2.2675%

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。

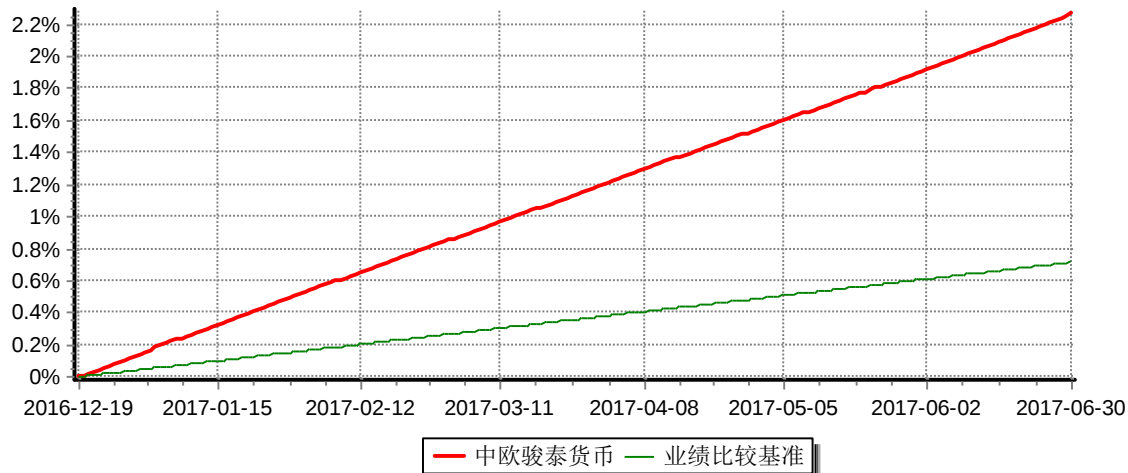
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.3672 %	0.0018 %	0.1110 %	0.0000 %	0.2562 %	0.0018 %
过去三个月	1.0572 %	0.0013 %	0.3366 %	0.0000 %	0.7206 %	0.0013 %
过去六个月	2.1223 %	0.0009 %	0.6695 %	0.0000 %	1.4528 %	0.0009 %
自基金合同生效日起至今	2.2675 %	0.0012 %	0.7174 %	0.0000 %	1.5501 %	0.0012 %

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

中欧骏泰货币市场基金
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12月19日-2017年06月30日)



注：本基金基金合同生效日期为2016年12月19日，自基金合同生效日起到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。

§ 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2017年6月30日，本基金管理人共管理57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		
黄华	资产配置总监、基金经理助理	2016年12月22日	2017年03月24日	8年	历任平安资产管理有限责任公司组合经理，中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理，中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责

					人。2016年11月10日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司基金经理助理。
黄华	资产配置总监、基金经理	2017年03月24日	—	8年	历任平安资产管理有限责任公司组合经理，中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理，中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责人。2016年11月10日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司基金经理助理。
蒋雯文	基金经理助理	2017年06月22日	—	8年	历任新际香港有限公司金属交易平台销售交易员，国元证券（香港）有限公司交易经理，平安资产管理有限责任公司债券交易员，前海开源基金投资经理助理。2016年11月17日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司交易员。
刘凌云	基金经理	2016年12月19日	2017年03月24日	10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05月01日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司基金经理助理。

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。

4.3.2 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 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

2017年上半年银行间市场资金面整体呈现趋紧的状态，验证了央行反复强调的2017年货币政策要保持稳健中性的基调。今年货币政策变化的背景，一是货币政策与国内经济增长的关系，总体来看今年的复苏比预期的稍微要长一点，从PMI数据来看，国内保持在荣枯线以上，且二季度经济数据持续好于预期，从生产端来看，工业增加值二季度保持平稳，粗钢产量增速和耗煤量同比增长也保持在偏高水平。从需求端来看，投资增速二季度和一季度相比略有放缓，但整个上半年仍然好于去年下半年。地产投资表现强劲；制造业经历了长期的去产能之后，投资增速低位回升；基建投资增速虽有下滑，但仍然维持在高位。这些都体现了中国经济韧性强，年内调整空间有限，通胀也不会制约

货币政策的空间。

2017年上半年，货币基金在兼顾流动性、控制风险的同时，以提高收益为主要目标，在月末、季末和缴税、缴准等关键时间点加大配置力度，重点配置存款和存单，并适度拉长剩余期限。基金在日常操作中维持偏低杠杆水平，中等偏低的剩余期限。在保持收益率稳定的同时为投资者提供了较高的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为2.1223%，同期业绩比较基准增长率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年货币政策的重心依然在防控金融风险方面，货币政策和金融监管难以出现方向性改变。而从外部环境看，当前美元走弱并不等于全球流动性的改善，欧元走强是美元走弱的重要因素，全球货币政策转趋保守，美国货币政策即将进入加息与缩表并行阶段，美国10年期国债收益率有重回2.40%迹象。外部流动性不存在根本性改善的条件。

在债券市场运行方面，市场聚焦在货币政策和金融去杠杆监管政策的发展上。上半年债券市场收益率先上后下，略有抬升。短期限收益和存单收益在6月中旬期到达了收益顶点。从公开市场的操作变化上来，我们已经看到持续多日的连续暂停公开市场，或者放量但依然保持净回笼，这与过完净投放的局势呈鲜明对比。这些都代表货币政策变化的结果，长久以来，债券市场流动性状况对央行主动投放的节奏与力度依赖性很高，所以可以判断资金市呈现结构性和波段性的冲高会继续是2017年下半年银行间市场的常态。

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，且每日进行支付。报告期内本基金向份额持有人分配利润67,479,730.18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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中欧骏泰货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对中欧骏泰货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管

理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧骏泰货币市场基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,030,328,543.33	1,000,228,028.41
结算备付金			—
存出保证金		2,759.41	—
交易性金融资产	6.4.7.2	1,483,608,130.24	—
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		1,483,608,130.24	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,060,422,965.37	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	20,981,657.10	1,443,712.86
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		4,595,344,055.45	1,001,671,741.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日

负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		279,999,260.00	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		794,461.43	78,748.57
应付托管费		165,512.80	16,405.96
应付销售服务费		33,102.57	3,281.19
应付交易费用	6.4.7.7	31,465.57	—
应交税费		—	—
应付利息		83,696.70	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	171,051.58	11,693.11
负债合计		281,278,550.65	110,128.83
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,314,065,504.80	1,001,561,612.44
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		4,314,065,504.80	1,001,561,612.44
负债和所有者权益总计		4,595,344,055.45	1,001,671,741.27

注：1. 报告截止日2017年6月30日，中欧骏泰基金份额净值1.0000元，中欧骏泰基金份额总额4,314,065,504.80份。

2. 本基金合同于2016年12月19日生效，故无上年度可比期间数据，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧骏泰货币市场基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2017年01月01日-2017年06月30日
一、收入		73,691,889.40

1. 利息收入		73,751,926.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,225,180.26
债券利息收入		15,449,958.53
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		22,076,787.84
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-60,037.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	—
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	-60,037.23
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	—
减：二、费用		6,212,159.22
1. 管理人报酬		3,809,662.86
2. 托管费		793,679.70
3. 销售服务费		158,735.97
4. 交易费用	6.4.7.18	—
5. 利息支出		1,249,782.18
其中：卖出回购金融资产支出		1,249,782.18

6. 其他费用	6.4.7.19	200,298.51
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		67,479,730.18
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		67,479,730.18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧骏泰货币市场基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日-2017年06月30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)	1,001,561,612.44	—	1,001,561,612.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	67,479,730.18	67,479,730.18
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)	3,312,503,892.36	—	3,312,503,892.36
其中：1. 基金申购款	5,307,774,774.01	—	5,307,774,774.01
2. 基金赎回款	-1,995,270,881.65	—	-1,995,270,881.65
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）	—	-67,479,730.18	-67,479,730.18
五、期末所有者权益（基金净值）	4,314,065,504.80	—	4,314,065,504.80

注：本基金合同于2015年12月24日生效，故无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧骏泰货币市场基金(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[2016]2837号《关于准予中欧骏泰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《中欧骏泰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1,000,139,028.05元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1688号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧骏泰货币市场基金基金合同》于2016年12月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,000,139,028.05份基金份额,其中包含认购资金利息折合135,000.05份基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦东发展银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧骏泰货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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。本基金的业绩比较基准为:同期7天通知存款税后利率。

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8月29日批准报出。

6.4.2 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》、《中欧骏泰货币市场基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年半年度的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2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为2017年1月1日至2017年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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、买入返售金融资产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。本基金持有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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每一类别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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	5,328,543.33
定期存款	2,025,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	1,015,000,000.00
其中：存款期限3个月以上	1,010,000,000.00
其中：存款期限1个月内	—
其他存款	—
合计	2,030,328,543.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017年06月30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	1,483,608,130.24	1,484,883,000.00	1,274,869.76	0.0296
	合计	1,483,608,130.24	1,484,883,000.00	1,274,869.76	0.0296

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日
----	----------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	683,512,000.00	—
银行间市场	376,910,965.37	—
合计	1,060,422,965.37	—

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应收活期存款利息	3,157.57
应收定期存款利息	11,729,958.32
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	4,975,696.95
应收买入返售证券利息	4,272,843.06
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	1.20
合计	20,981,657.10

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所交易应付佣金	—
银行间交易应付交易费用	31,465.57
合计	31,465.57

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
----	-----------------

应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提信息披露费	110,315.64
预提审计费	51,322.70
预提上市费	—
账户维护费	9,413.24
合计	171,051.58

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,001,561,612.44	1,001,561,612.44
本期申购	5,307,774,774.01	5,307,774,774.01
本期赎回	-1,995,270,881.65	-1,995,270,881.65
期末数	4,314,065,504.80	4,314,065,504.80

1、申购含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

2、本基金自2016年12月12日至2016年12月15日止期间公开发售，共募集有效净认购资金1,000,004,028.00元。根据《中欧骏泰货币市场基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入135,000.05元在本基金成立后，折算为135,000.05份基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 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
上年度末	—	—	—
本期利润	67,479,730.18	—	67,479,730.18
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	-67,479,730.18	—	-67,479,730.18
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。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日-2017年06月30日
活期存款利息收入	215,623.49
定期存款利息收入	36,009,352.86
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	185.11
其他	18.80
合计	36,225,180.26

6.4.7.12 股票投资收益

无余额。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 (2017年01月01日-2017年06月30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	-60,037.23
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	-60,037.23

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2017年01月01日-2017年06月30日)
----	---------------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,611,342,112.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,600,535,000.00
减：应收利息总额	10,867,149.38
买卖债券差价收入	-60,037.23

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无余额。

6.4.7.14 衍生工具收益

无余额。

6.4.7.15 股利收益

无余额。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无余额。

6.4.7.17 其他收入

无余额。

6.4.7.18 交易费用

无余额。

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日-2017年06月30日
审计费用	47,883.55
信息披露费	102,061.68
其他	200.00
帐户维护费	16,913.24
汇划手续费	33,240.04

合计	200,298.51
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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
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、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4. 10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

6.4. 10.2 关联方报酬

6.4. 10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日-2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,809,662.86
其中：支付销售机构的客户维护费	5.14

注1、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0.24%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 × 0.24% / 当年天数。

2、本基金合同于2016年12月19日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4. 10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日-2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	793,679.70

注：1、支付基金托管人 浦发银行 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 × 0.05% / 当年天数。

2、本基金合同于2016年12月19日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 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2017年01月01日-2017年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中欧基金	158,734.93
国都证券	1.04

合计	158,735.97
----	------------

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。本基金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：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

2、本基金合同于2016年12月19日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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2017年01月01日-2017年06月30日
基金合同生效日(2016年12月19日)持有的基金份额	—
报告期初持有的基金份额	—
报告期间申购/买入总份额	242,684,594.02
报告期间因拆分变动份额	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—
报告期末持有的基金份额	242,684,594.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.63%

本基金的关联方中欧基金管理有限公司申购本基金的费率为0，符合本基金招募说明书的相关规定。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例

钱滚滚财富	65653277.47	1.52%	0	—
-------	-------------	-------	---	---

注：本基金的关联方钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司申购本基金的费率为0，符合本基金招募说明书的相关规定。

6.4. 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2017年01月01日-2017年06月30日	
	期末 存款余额	当期 存款利息收入
上海浦东发展 银行	5,328,543.33	1,729,512.37

6.4. 10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4. 10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4. 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
67,479,730.18	—	—	67,479,730.18	

6.4.12 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4. 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。

6.4. 12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4. 12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4. 12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30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 279,999,260.00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
120233	12国开33	2017-07-03	100.05	700000	70,037,036.54
150417	15农发17	2017-07-03	100.02	200000	20,003,798.39
150207	15国开07	2017-07-03	100.41	400000	40,164,164.37
140440	14农发40	2017-07-03	100.11	600000	60,063,268.72
179917	17贴现国债17	2017-07-03	99.87	100000	9,987,496.08
111717121	17光大银行CD121	2017-07-03	99.07	890000	88,171,211.25
合计				2,890,000.00	288,426,975.35

6.4. 12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1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 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	—	—
A-1以下	—	—
未评级	1,293,339,862.22	—
合计	1,293,339,862.22	—

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以内的国债及未有三方机构评级的短期融资券。3. 债券投资以成本价列示。

6.4.13.2.2按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2017年06月30日	2016年12月31日
AAA	—	—
AAA以下	—	—
未评级	190,268,268.02	—
合计	190,268,268.02	—

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以上的政策性金融债。3. 债券投资以成本价列示。

6.4.13.3 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制的投资品种比例等。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的证券不得超过该证券的10%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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2017年6月30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同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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017年06月 30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	2,030,328,543.33	—	—	—	—	2,030,328,543.33
存出保证金	2,759.41	—	—	—	—	2,759.41
交易性金融资产	1,346,906,771.64	136,701,358.60	—	—	—	1,483,608,130.24
买入返售金融资产	1,060,422,965.37	—	—	—	—	1,060,422,965.37
应收利息	—	—	—	—	20,981,657.10	20,981,657.10
资产总计	4,437,661,039.75	136,701,358.60	—	—	20,981,657.10	4,595,344,055.45
负债						
卖出回购金融资产款	279,999,260.00	—	—	—	—	279,999,260.00
应付管理人报酬	—	—	—	—	794,461.43	794,461.43
应付托管费	—	—	—	—	165,512.80	165,512.80

应付销售服务费	—	—	—	—	33,102.57	33,102.57
应付交易费用	—	—	—	—	31,465.57	31,465.57
应付利息	—	—	—	—	83,696.70	83,696.70
其他负债	—	—	—	—	171,051.58	171,051.58
负债总计	279,999,260.00	—	—	—	1,279,290.65	281,278,550.65
利率敏感度缺口	4,157,661,779.75	136,701,358.60	—	—	19,702,366.45	4,314,065,504.80
上年度末 2016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	1,000,228,028.41	—	—	—	—	1,000,228,028.41
应收利息	—	—	—	—	1,443,712.86	1,443,712.86
资产总计	1,000,228,028.41	—	—	—	1,443,712.86	1,001,671,741.27
负债						
应付管理人报酬	—	—	—	—	78,748.57	78,748.57
应付托管费	—	—	—	—	16,405.96	16,405.96
应付销售服务费	—	—	—	—	3,281.19	3,281.19
其他负债	—	—	—	—	11,693.11	11,693.11
负债总计	—	—	—	—	110,128.	110,128.

					83	83
利率敏感度	1,000,22				1,333,58	1,001,56
缺口	8,028.41	—	—	—	4.03	1,612.44

6.4.13.4.1.2 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	上年度末
	利率下降25BP	97.02	—
	利率上升25BP	-96.67	—

注：本基金合同于2016年12月19日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

2017年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016年12月31日：同）。

6.4.14 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2017年06月30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1,483,608,130.24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

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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2017年06月30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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金

融商品转让；(3)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§7 投资组合报告

7.1 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	1,483,608,130.24	32.29
	其中：债券	1,483,608,130.24	32.29
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	1,060,422,965.37	23.08
	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	2,030,328,543.33	44.18
4	其他资产	20,984,416.51	0.46
5	合计	4,595,344,055.45	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	—	2.08
	其中：买断式回购融资	—	—
2	报告期末债券回购融资余额	279,999,260.00	6.49
	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

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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

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。

7.3.2 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	50.20	6.49
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	23.94	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	16.36	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	4.59	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天（含）	10.95	—
	其中：剩余存续期超过397天	—	—

	的浮动利率债		
	合计	106.04	6.49

7.4 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。

7.5 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	29,962,488.25	0.69
2	央行票据	—	—
3	金融债券	190,268,268.02	4.41
	其中：政策性金融债	190,268,268.02	4.41
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	29,995,112.57	0.70
6	中期票据	—	—
7	同业存单	1,233,382,261.40	28.59
8	其他	—	—
9	合计	1,483,608,130.24	34.39
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。

7.6 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	111615194	16民生CD194	1,000,000	99,415,559.81	2.30
2	111710259	17兴业银行CD259	1,000,000	99,247,969.86	2.30

3	1117171 21	17光大银行 CD121	1,000,000	99,068,776.69	2.30
4	1117151 92	17民生银行 CD192	1,000,000	97,803,235.08	2.27
5	1117997 23	17贵阳银行 CD074	1,000,000	97,765,906.96	2.27
6	1117803 74	17广东南粤银 行CD092	1,000,000	96,537,194.23	2.24
7	120233	12国开33	700,000	70,037,036.54	1.62
8	140440	14农发40	600,000	60,063,268.72	1.39
9	1117977 12	17广州农村商 业银行CD085	500,000	49,706,748.64	1.15
10	1117978 31	17广州农村商 业银行CD088	500,000	49,700,251.52	1.15

7.7 “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	—
报告期内偏离度的最高值	0.0390%
报告期内偏离度的最低值	-0.0166%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0055%

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%。

7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.000元。

7.9.2 本基金投资的前十大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。

7.9.3 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	2,759.41
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	20,981,657.10
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	20,984,416.51

7.9.4 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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

495	8,715,283.85	4,311,226,904.27	99.93%	2,838,600.53	0.07%
-----	--------------	------------------	--------	--------------	-------

8.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	2,525,964.12	0.06%

8.3 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、基金投资和研究人员负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月19日)基金份额总额	1,000,139,028.05
本报告期期初基金份额总额	1,001,561,612.44
本报告期基金总申购份额	5,307,774,774.01
减：本报告期基金总赎回份额	1,995,270,881.65
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	4,314,065,504.80

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2017年3月30日发布公告，顾伟先生自2017年3月30日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务。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上海证监局报告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 基金改聘会计师事务所情况

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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

10.7 本期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	债券成交金额	债券交易占当期成交总额的比例	债券回购成交金额	债券回购交易占当期成交总额的比例	权证交易成交金额	权证交易占当期成交总额的比例	应支付券商的佣金	应支付券商的佣金占当期佣金总量的比例	备注说明
中信证券	1	20,852,458.00	100.00	450,000.00	100.00	—	—	—	—	
广发证券	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。

10.8 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

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于旗下基金2016年12月31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	2017-01-01
2	中欧骏泰货币市场基金暂停申购、转换转入公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-23
3	中欧骏泰货币市场基金暂停大额申购、转换转入公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-24
4	中欧骏泰货币市场基金恢复大额申购、转换转入业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-07
5	中欧基金管理有限公司关于调整个人投资者开户证件类型的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-11
6	中欧基金管理有限公司北京分公司办公地址变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-22
7	中欧骏泰货币市场基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-25
8	中欧骏泰货币市场基金暂停申购、转换转入公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-28
9	中欧基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-30
10	中欧骏泰货币市场基金2017年1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-21
11	中欧骏泰货币市场基金暂停申购、转换转入公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-23

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过20%的时间区间					
机构	1	2017年2月13日至2017年4月5日	0	833,507,588.45	400,000,000.00	433,507,588.45	10.07%
机构	2	2017年1月1日至2017年6月30日	550074250.00	665,339,189.56	300,000,000.00	915,413,439.56	21.27%
产品特有风险							
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审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中欧骏泰货币市场基金相关批准文件
- 2、《中欧骏泰货币市场基金基金合同》
- 3、《中欧骏泰货币市场基金托管协议》
- 4、《中欧骏泰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

2017-08-29