

中欧骏盈货币市场基金2016年半年度报告摘要

2016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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2016年8月24日

§ 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中欧骏盈货币	
基金主代码	001787	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2015年12月24日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,635,847,703.05份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
下属分级基金的交易代码	001787	001788
报告期末下属分级基金的份 额总额	17,165.91份	6,635,830,537.14份

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责 人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
		张志永
		021-62677777-212004

	电子邮箱	liyihai@zofund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95561
传真		021-33830351	021-62159217

2.4 信息披露方式

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

§ 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日-2016年6月30日）	
	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
本期已实现收益	199.31	35,748,570.15
本期利润	199.31	35,748,570.15
本期净值收益率	1.17%	1.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末基金资产净值	17,165.91	6,635,830,537.14
期末基金份额净值	1.000	1.000

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

(1) 中欧骏盈货币A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(中欧骏盈货币A)	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	0.2044 %	0.0003 %	0.1110 %	0.0000 %	0.0934 %	0.0003 %
过去三个月	0.6116 %	0.0004 %	0.3366 %	0.0000 %	0.2750 %	0.0004 %
过去六个月	1.1702 %	0.0005 %	0.6732 %	0.0000 %	0.4970 %	0.0005 %
自基金合同生效日起至今	1.2069 %	0.0007 %	0.7027 %	0.0000 %	0.5042 %	0.0007 %

(2) 中欧骏盈货币B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

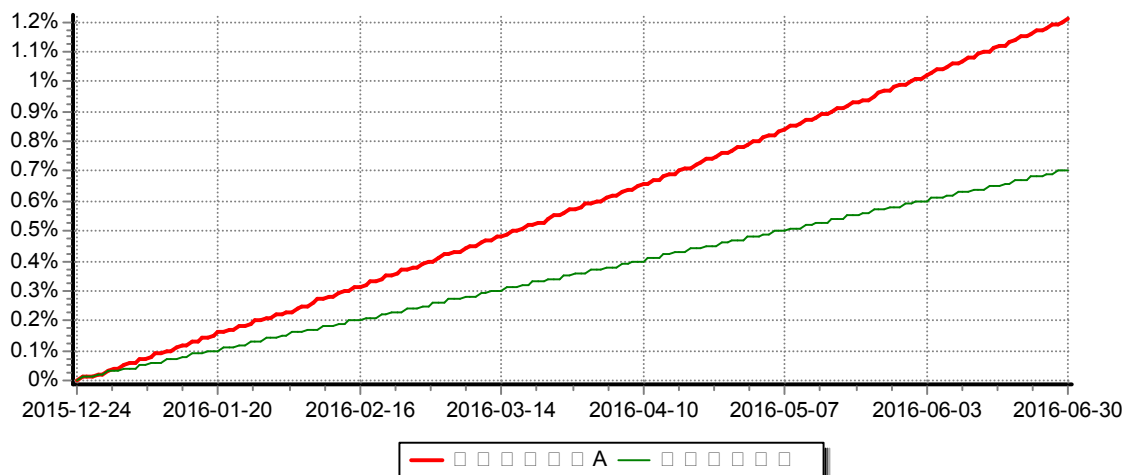
阶段(中欧骏盈货币B)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2245 %	0.0003 %	0.1110 %	0.0000 %	0.1135 %	0.0003 %
过去三个月	0.6734 %	0.0004 %	0.3366 %	0.0000 %	0.3368 %	0.0004 %
过去六个月	1.2939 %	0.0005 %	0.6732 %	0.0000 %	0.6207 %	0.0005 %
自基金合同生效日起至今	1.3354 %	0.0007 %	0.7027 %	0.0000 %	0.6327 %	0.0007 %

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

中欧骏盈货币A

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12月24日-2016年06月30日)

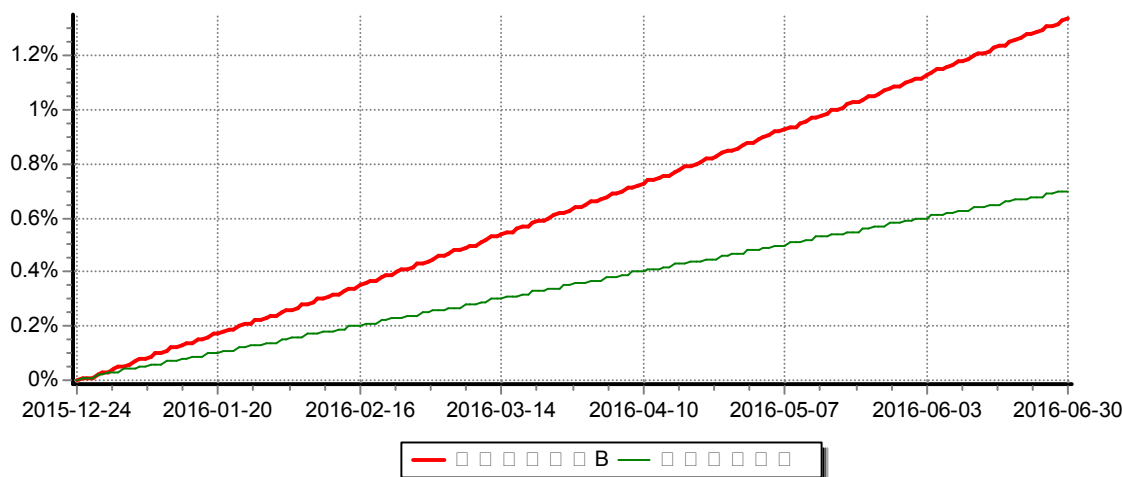


注：本基金基金合同生效日为2015年12月24日，自基金合同生效日至本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同约定。

中欧骏盈货币B

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12月24日-2016年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2015年12月24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，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同约定。

§ 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2016年6月30日，本基金管理人共管理40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		
刘德元	基金经理	2015年12月24日	—	11年	历任大公国际资信评估有限公司技术总监、阳光资产管理股份有限公司高级研究员。2015年6月加入中欧基金管理有限公司，曾任信用研究员，现任中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理，中欧兴利债券型证券投资基金基金经理，中欧瑾和灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中欧强势多策略定期开放债券型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，中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）基金经理，中欧骏盈货币市场基金基金经理，中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经

					理，中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）基金经理，中欧强盈定期开放债券型证券投资基金基金经理，中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

经济基本面从一季度小周期回升变为二季度景气度有所回落。正如“权威人士”的表态，经济预计将长期维持L型走势，但当下仍存在一定的下行压力。具体来看，固定资产投资增发乏力，基建投资维持高速增长，成为经济下行背景下政府托底经济的重要手段；地产销售受到一二线限购政策影响增速持续下滑，带动地产投资高位回落；工业增加值高位回落，工业企业盈利状况较一季度有小幅程度下滑，但较去年亏损情况大幅改善，说明今年以来供给侧改革的效果正在逐渐体现；信贷方面，一季度天量信贷投放告一段落，二季度信贷数据整体属于中性水平且主要由居民中长期贷款构成，说明企业的融资需求依旧不强。二季度通胀有所回落，随着蔬菜价格逐步下跌、猪肉价格涨幅收窄，CPI同比增速由2.3%下跌至1.9%，而PPI方面受益于工业品价格的回升，跌幅持续收窄，但同比依旧为负。报告期内，国际宏观风云巨变，英国意外脱欧这一“黑天鹅”事件加剧了全球金融资产波动，也影响了美联储加息进程，美国年内加息概率大大降低。

央行保持了稳健的货币政策，银行及非银机构在经历了一季度的MPA考核后，在二季度应对流动性方面都准备更加充分，再加上央行的MLF和公开市场操作的悉心呵护，整体二季度流动性无忧，资金面较为平稳。债券市场在二季度有所调整，同业存单的收益率经过调整之后后有所下行，具体来看1年期的AAA短融从一季度末的2.72%，上行30BP至最高点3.06%，之后缓慢回落，1年期的AA+短融从一季度末的2.92%上行40BP左右至最高点3.39%，之后小幅下行至3.28%。

报告期内，本基金主要投资于同业存款和存单，对短期债券进行了波段操作。组合整体流动性较好，期限搭配和杠杆维持适当水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类份额净值增长率为1.1702%，同期业绩比较基准收益率为0.6732%；B类份额净值增长率为1.2939%，同期业绩比较基准收益率为0.6732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们将维持前期操作，合理配置同业存款和存单以及其他品种，对短期债券进行波段操作。

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验。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A类份额持有人分配利润199.31元，向B类份额持有人分配利润35,748,570.15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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：中欧骏盈货币市场基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	13,694,978.72	200,017,131.11
结算备付金		—
存出保证金	—	—
交易性金融资产	7,603,463,488.80	—
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	6,987,632,156.16	—
资产支持证券投资	615,831,332.64	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	8,253,849.50	99,166.21
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	7,625,412,317.02	200,116,297.32

负债和所有者权益	本期末 2016年6月30日	上年度末 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	987,447,838.82	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	1,086,591.14	7,673.19
应付托管费	271,647.76	1,918.31
应付销售服务费	54,332.99	384.47
应付交易费用	61,876.58	—
应交税费	—	—
应付利息	478,751.54	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	163,575.14	7,217.04
负债合计	989,564,613.97	17,193.01
所有者权益:		
实收基金	6,635,847,703.05	200,099,104.31
未分配利润	—	—
所有者权益合计	6,635,847,703.05	200,099,104.31
负债和所有者权益总计	7,625,412,317.02	200,116,297.32

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.000元，基金份额总额6,635,847,703.05份，其中A类基金份额总额17,165.91份，B类基金份额总额6,635,830,537.14份。

6.2 利润表

会计主体：中欧骏盈货币市场基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期2016年1月1日-2016年6月30日
-----	------------------------

一、收入	42,775,222.35
1. 利息收入	42,777,609.82
其中：存款利息收入	1,518,408.41
债券利息收入	38,118,854.37
资产支持证券利息收入	3,072,493.48
买入返售金融资产收入	67,853.56
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,387.47
其中：股票投资收益	—
基金投资收益	—
债券投资收益	—
资产支持证券投资收益	-2,387.47
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	—
股利收益	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—
减：二、费用	7,026,452.89
1. 管理人报酬	2,623,813.34
2. 托管费	655,953.27
3. 销售服务费	131,211.62
4. 交易费用	—
5. 利息支出	3,446,848.51
其中：卖出回购金融资产支	3,446,848.51

出	
6. 其他费用	168,626.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	35,748,769.46
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	35,748,769.46

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。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧骏盈货币市场基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日-2016年6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)	200,099,104.31	—	200,099,104.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	35,748,769.46	35,748,769.46
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）	6,435,748,598.74	—	6,435,748,598.74
其中：1. 基金申购款	6,435,748,769.46	—	6,435,748,769.46
2. 基金赎回款	-170.72	—	-170.72
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）	—	-35,748,769.46	-35,748,769.46
五、期末所有者权益（基金净值）	6,635,847,703.05	—	6,635,847,703.05

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

中欧骏盈货币市场基金(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]1826号《关于核准中欧骏盈货币市场基金募集的批复》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《中欧骏盈货币市场基金合同》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200,017,131.11元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2015)第1462号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中欧骏盈货币市场基金合同》于2015年12月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,017,131.11份基金份额,其中中欧骏盈货币A的基金份额总额为17,131.11份,中欧骏盈货币B的基金份额总额为200,000,000.00份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金根据投资者持有本基金的份额数量不同,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成A类和B类两类基金份额;并根据投资者基金账户所持有份额数量是否不低于500万份进行不同类别基金份额的判断和处理,其中不低于500万份的为B类份额,低于500万份的为A类份额。两类基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧骏盈货币市场基金合同》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、通知存款、一年以内(含一年)的银行存款和大额存单、剩余期限在397天以内(含397天)的债券和中期票据、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、短期融资券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持类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2016年8月24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日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧骏盈货币市场基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监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2016年半年度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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日半年度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。本期财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

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。

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。

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，以及因类别调整而引起的A、B类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

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

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。

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[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[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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
兴业银行股份有限公司 (“兴业银行”)	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 债券交易

无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

无。

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,623,813.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	—

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0.20%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 × 0.20% / 当年天数。

2、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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	655,953.27

注：1、支付基金托管人 兴业银行 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2015年12月24日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.3 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 2016年1月1日-2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B	合计
中欧基金	19.69	131,189.78	131,209.47
国都证券	2.15	—	2.15
合计	21.84	131,189.78	131,211.62

注：1、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。A类基金份额约定的销售服务费年费率为0.25%，B类基金份额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：

对应级别日销售服务费=前一日对应级别基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

2、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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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 2016年6月30日		上年度末 2015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
B类	兴业银行股份有 限公司	6,635,830,537 .14	100.00%	200,081,966.9 9	100.00%

6.4.8.5 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2016年1月1日-2016年6月30日	
	期末 余额	当期 存款利息收入
兴业银行	13,694,978.72	253,448.45

注：1、本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

2、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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2016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987,447,838.82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
111608120	16中信 CD120	2016-07-04	99.77	2,100,000. 00	209,526,684.2 2
140201	14国开 01	2016-07-05	101.62	700,000.00	71,134,142.97
090410	09农发 10	2016-07-05	99.97	1,250,000. 00	124,960,376.2 9
111613042	16浙商 CD042	2016-07-01	99.89	1,000,000. 00	99,888,878.88
111621031	16渤海 银行 CD031	2016-07-06	98.99	3,000,000. 00	296,960,598.4 8
120223	12国开 23	2016-07-06	99.48	2,050,000. 00	203,930,584.4 2
合计				10,100,000 .00	1,006,401,265 .26

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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2016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7,445,394,435.34元，属于第三层次的余额为158,069,053.46元，无属于第一层次的余额。

(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2016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) 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。

§ 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	7,603,463,488.80	99.71

	其中：债券	6,987,632,156.16	91.64
	资产支持证券	615,831,332.64	8.08
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	13,694,978.72	0.18
4	其他各项资产	8,253,849.50	0.11
5	合计	7,625,412,317.02	100.00

7.2 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	5.72	
	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	987,447,838.82	14.88
	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	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
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。

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	42.71	14.88
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	57.64	—
	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)—120天	1.97	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	12.46	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	114.78	14.88

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期限未超过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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	400,025,103.68	6.03
	其中：政策性金融债	400,025,103.68	6.03

4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	89,877,420.07	1.35
6	中期票据	—	—
7	同业存单	6,497,729,632.41	97.92
8	其他	—	—
9	合计	6,987,632,156.16	105.30
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	111612021	16北京银行CD021	7,000,000	697,154,698.40	10.51
2	111609080	16浦发CD080	6,400,000	637,395,450.51	9.61
3	111618075	16华夏CD075	5,000,000	498,877,466.65	7.52
4	111608121	16中信CD121	5,000,000	498,676,303.61	7.51
5	111618100	16华夏CD100	5,000,000	497,937,972.98	7.50
6	111608150	16中信CD150	4,000,000	398,417,599.86	6.00
7	111617025	16光大CD025	3,900,000	388,411,622.92	5.85
8	111615063	16民生CD063	3,600,000	359,404,629.05	5.42
9	111692610	16重庆农村商行CD031	3,000,000	299,563,890.28	4.51

10	1116160 81	16上海银行 CD081	3,000,000	299,364,491.4 7	4.51
----	---------------	-----------------	-----------	--------------------	------

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	0.0295%
报告期内偏离度的最低值	-0.0283%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0062%

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	1589233	15开元6A2	3,100,000	310,130,426.5 9	4.67
2	1689098	16招金1A2	600,000	60,005,360.61	0.90
3	1689038	16睿程1A2	670,000	58,440,735.24	0.88
4	123750	融和1优3	532,000	53,224,292.28	0.80
5	123982	15庆热01	365,000	36,667,275.97	0.55
6	1689086	16永生1A1	300,000	29,185,756.74	0.44
7	123836	建租一A4	171,000	17,113,139.70	0.26
8	123724	福能融03	142,000	14,232,531.85	0.21
9	123890	赣小贷A1	100,000	10,007,561.56	0.15
10	123879	杭公金02	100,000	10,003,899.32	0.15

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。

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	应收证券清算款	—
3	应收利息	8,253,849.50
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	8,253,849.50

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

份额 级别	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	持有 份额	占总份 额

				比例		比例
中欧骏盈货币A	297	57.80	10.00	0.06%	17,155.91	99.94%
中欧骏盈货币B	1	6,635,830,537.14	6,635,830,537.14	100.00%	—	—
合计	298	22,267,945.31	6,635,830,547.14	100.00%	17,155.91	0.00%

注：截止本报告期末，本基金个人投资者持有本基金的比例为0.0003%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中欧骏盈货币A	14,845.18	86.48%
	中欧骏盈货币B	0.00	0.00%
	合计	14,845.18	0.00%

注：截止本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金的比例为0.0002%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

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	份额级别	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	中欧骏盈货币A	0~10
	中欧骏盈货币B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧骏盈货币A	0
	中欧骏盈货币B	0

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
基金合同生效日(2015年12月24日) 基金份额总额	17,131.81	200,008,197.94
本报告期期初基金份额总额	17,137.32	200,081,966.99
本报告期基金总申购份额	199.31	6,435,748,570.15
减：本报告期基金总赎回份额	170.72	—
本报告期期末基金份额总额	17,165.91	6,635,830,537.14

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。

§ 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2016年5月7日发布公告，卞玺云女士自2016年5月7日起担任中欧基金管理有限公司督察长职务。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中国证监会和上海证监局报告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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

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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

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

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
申银万国	1	159,610,519.58	100.00%	—	—	—	—	—	—	—
中银国际	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—
齐鲁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—
西部证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国都证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—

国金 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 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2015年新增。

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。

中欧基金管理有限公司

二〇一六年八月二十四日