

中欧骏盈货币市场基金2016年年度报告摘要

2016年12月31日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017年3月31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2017年3月29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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31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	8,150,150,968.74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	15,895.65份	8,150,135,073.09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	张志永
	联系电话	021-68609600	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

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年		2015年12月24日-2015年12月31日	
	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
本期已实现收益	375.53	150,053,106.10	6.21	81,966.99
本期利润	375.53	150,053,106.10	6.21	81,966.99
本期净值收益率	2.54%	2.79%	0.04%	0.04%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末	
期末基金资产净值	15,895.65	8,150,135,073.09	17,137.32	200,081,966.99
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金利润分配按日结转份额。

3、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金合同于2015年12月24日生效，故上年可比区间为2015年12月24日至2015年12月31日。

### 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
过去三个月	0.7030 %	0.0017 %	0.3403 %	0.0000 %	0.3627 %	0.0017 %

过去六个月	1.3534 %	0.0015 %	0.6805 %	0.0000 %	0.6729 %	0.0015 %
过去一年	2.5395 %	0.0012 %	1.3537 %	0.0000 %	1.1858 %	0.0012 %
自基金合同生效日起 至今	2.5766 %	0.0012 %	1.3833 %	0.0000 %	1.1933 %	0.0012 %

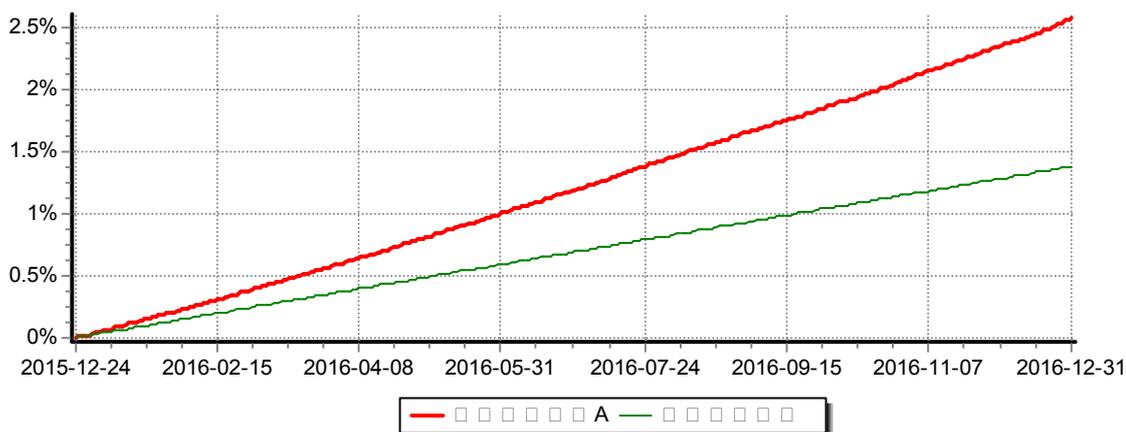
(2) 中欧骏盈货币B基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.7627 %	0.0017 %	0.3403 %	0.0000 %	0.4224 %	0.0017 %
过去六个月	1.4764 %	0.0015 %	0.6805 %	0.0000 %	0.7959 %	0.0015 %
过去一年	2.7894 %	0.0012 %	1.3537 %	0.0000 %	1.4357 %	0.0012 %
自基金合同生效日起 至今	2.8315 %	0.0012 %	1.3833 %	0.0000 %	1.4482 %	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12月31日)

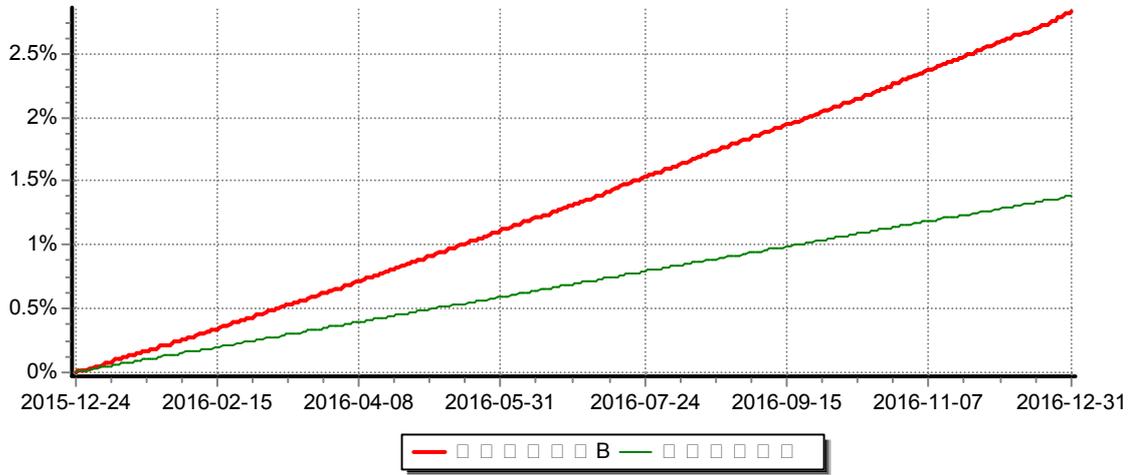


注：本基金基金合同生效日期为2015年12月24日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定。

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12月31日)



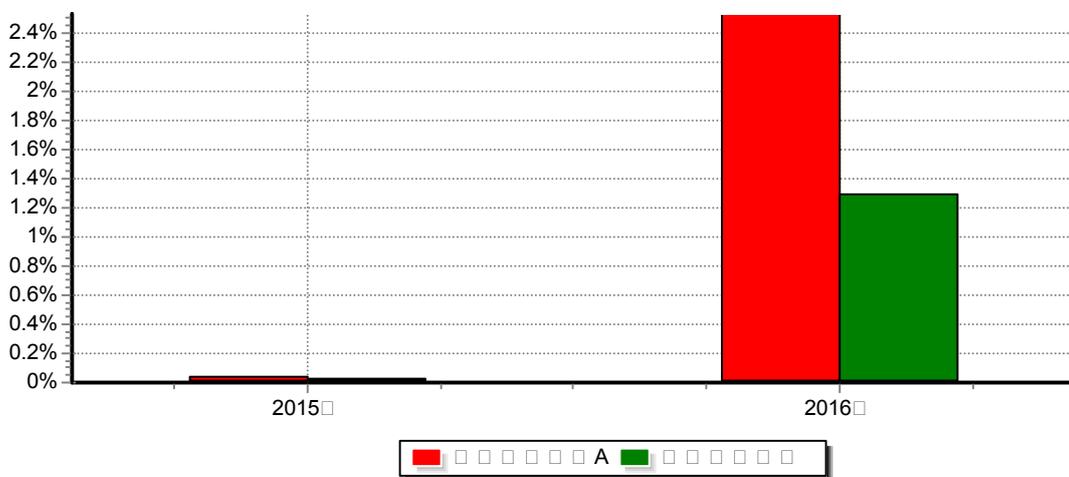
注：本基金基金合同生效日期为2015年12月24日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧骏盈货币市场基金

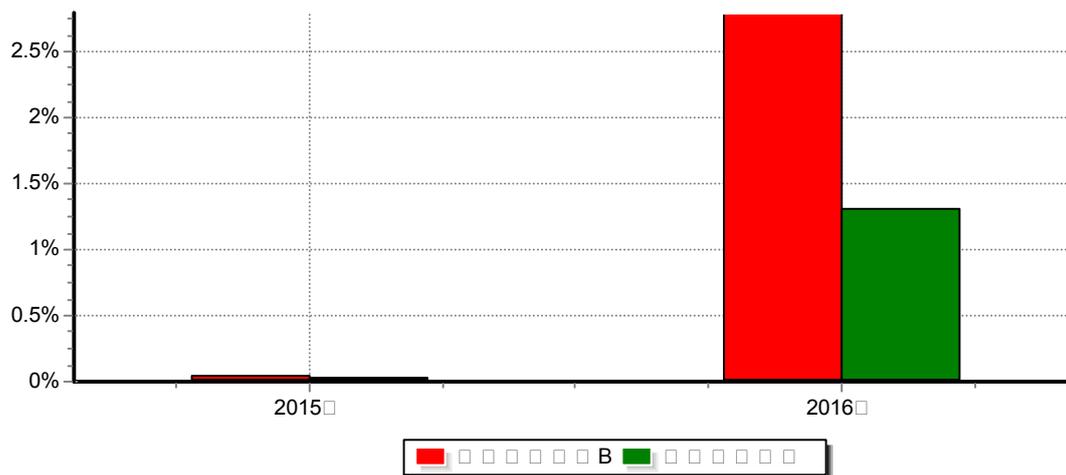
每年基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图

中欧骏盈货币A



注：本基金合同生效日为2015年12月24日，2015年度数据为2015年12月24日至2015年12月31日数据。

中欧骏盈货币B



注：本基金合同生效日为2015年12月24日，2015年度数据为2015年12月24日至2015年12月31日数据。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

中欧骏盈货币A

单位：人民币元

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2016年	375.53	—	—	375.53	
2015年	6.21	—	—	6.21	
合计	381.74	—	—	381.74	

中欧骏盈货币B

单位：人民币元

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2016年	150,053,106.10	—	—	150,053,106.10	
2015年	81,966.99	—	—	81,966.99	
合计	150,135,073.09	—	—	150,135,073.09	

## § 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12月31日，本基金管理人共管理50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、中欧瑾和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，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、中欧强利债券型证券投资基金基金经理、中欧瑾悠灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中欧强惠债券型证券投资基金基金经理、中欧强裕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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规，公司制订了《公平交易管理办法》以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。在投资决策方面，基金经理共享研究报告、投研体系职权划明确且互不干预、各基金持仓及交易信息等均能有效隔离；在交易执行方面，以系统控制和人工审阅相结合的方式，严控反向交易和同向交易；另外，中央交易室在交易执行过程中对公平交易实施一线监控，监察稽核部也会就投资交易行为进行分析和评估，定期进行公平交易的内部审计工作。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。在公平交易稽核审计过程中，针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况，我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析，并与基金经理进行了沟通确认，从最终结果看，造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、股价波动等不可控因素，基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在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

回顾16年全年，经济整体运行平稳，全年GDP增速6.7%，年度增长目标，政策则从稳增长转向防风险和促改革。具体来看，上半年经济基本面开年延续了15年底的下行惯性，一季度后期随着信贷放量、基建发力、大宗商品上涨带动部分行业企业盈利状况改善以及房地产销售拉动投资回升，基本面一度呈现了“小阳春”的局面；二、三季度经济基本面景气度回落，但整体呈现弱势平稳的状况，地产走弱、生产改善，但民间投资和制造业依旧低迷；四季度受益于年初以来工业品涨价，工业企业经营盈利情况普遍较好，四季度工业增加值较为平稳，生产端较旺。全年来看，全年消费稳定仍是托底经济的中流砥柱，进出口出现好转；虽然基建投资和地产投资逐渐回落，但民间投资和制造业投资有所反弹，整体固定资产投资增速四季度仍然保持在较高水平；房地产投资短期拐点已现，但实际开工和投资情况好于预期，难以见到地产投资断崖式下跌对固定资产投资带来明显拖累；且在供给侧改革的发力下，企业利润改善也推升了制造业投资的低位反弹。海外方面，美国进入加息周期也正式迎来“特朗普经济时代”，欧洲日本逐渐退出货币宽松刺激，全球流动性拐点大概率已经到来。

回顾央行的16年的货币政策，政策基调从稳增长转向防风险和促改革。自2016年2月29日降准之后，央行再没有明显的宽松措施，更多地通过公开市场操作补充流动性，从宽松转向中性；2016年8月底，重启14天逆回购，随后又重启28天逆回购，加大MLF操作力度，锁短放长，拉长期限，提高资金成本，相当于隐性加息，标志着货币政策从中性转向偏紧；2017年初更是央行正式上调MLF、逆回购和SLF利率，标志着短端和长端利率已经全面上调，进一步表明央行去杠杆和防范金融资产价格泡沫的决心。

债券市场方面，受到2016年经济基本面整体偏弱的影响，CPI较低但PPI由负转正并快速上升，货币政策前松后紧，债市总体呈震荡格局。年初在MLF利率下调、降准预期等带动下资金面较为宽松，叠加股市熔断机制抑制风险偏好上升，债券收益率持续下行，信用债一级发行极其火爆。春节后，受信贷集中投放，CPI阶段性走高和央行MPA考核趋严影响，收益率快速上行，之后在国企、央企信用违约事件集中爆发的影响下信用利差快速走扩，市场出现流动性恐慌，情绪跌至冰点；五月初营改增补丁政策的推出助力金融债表现，随后在信贷需求下滑、房贷高增但难以成为持续支撑社会融资需求走高的背景下，“资产荒”局面有所加剧，债券收益率重新下行至年初低点；四季度在经济基本面回暖背景下，央行加大了去杠杆的力度，公开市场持续收短放长的操作抬升了资金整体成本，叠加美国大选后全球通胀预期升温，债券收益率快速上行。

全年来看，前三季度基本保持了较为稳健的中性操作策略，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。四季度，市场资金面趋紧，流动性告急，组合一方面降低了杠杆，做好了流动性管理，期限搭配和杠杆维持适当水平；另外一方面，加强合规监管指标的管理，在市场剧烈调整中，较好的保证了组合满足各项监管指标的要求。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金A类份额净值增长率为2.5395%，同期业绩比较基准增长率为1.3537%；B类份额净值增长率为2.7894%，同期业绩比较基准率为1.3537%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，补库存等短期因素仍在支撑短期经济，特朗普效应依旧存在，未来一季度名义GDP可能继续上行；在政治局尚未调整工作重点之前，去杠杆的仍然是主要工作，货币政策放松概率低；委外等客户机构化现象依旧会放大市场波动。在去杠杆的大环境下，债券市场难有较大的机会，所以再策略上整体保持较为谨慎的策略，以短久期债券作为超配的主要品种，并辅以利率债作为增加弹性久期的部分，不过在交易的过程仍需要保持谨慎。后续随着逐渐进入开工旺季，微观数据有望一定程度上好转，再加上供给侧改革的发力，会给部分产业带来改善的机会，地产一、二线目前库存较低，未来补库存的需求仍在，也会拉动一定的开工需求。且进入二季度后，美联储的加息预期抬头，也给债券市场带来一定的风险。

总的来看，判断未来债券市场会是一个震荡行情，缺少大幅上行或者下行的趋势性机会，因此在操作上，将保持谨慎的投资思路，一方面做好流动性管理，做好期限匹配，另外一方面，挖掘收益相对较高的短期债券、存单等，提高组合的收益。

#### 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375.53元，向B类份额持有人分配利润150,053,106.10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 审计报告**

本报告期基金年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

### **§ 7 年度财务报表**

#### **7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	1,874,494.58	200,017,131.11
结算备付金	—	—
存出保证金	—	—
交易性金融资产	6,076,855,302.09	—
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	5,622,954,980.59	—
资产支持证券投资	453,900,321.50	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	2,449,896,614.83	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	24,060,872.12	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	8,552,687,283.62	200,116,297.32
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2016年12月31日</b>	<b>上年度末</b> <b>2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
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	399,829,200.25	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	1,378,580.85	7,673.19

应付托管费	344,645.24	1,918.31
应付销售服务费	68,931.50	384.47
应付交易费用	77,646.18	—
应交税费	—	—
应付利息	500,689.75	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	336,621.11	7,217.04
负债合计	402,536,314.88	17,193.01
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	8,150,150,968.74	200,099,104.31
未分配利润	—	—
所有者权益合计	8,150,150,968.74	200,099,104.31
负债和所有者权益总计	8,552,687,283.62	200,116,297.32

注：1. 报告截止日2016年12月31日，中欧骏盈货币市场基金份额净值1.00元，基金份额总额8,150,150,968.74份，其中A类份额15,895.65份，B类份额8,150,135,073.09份(2015年12月31日：中欧骏盈货币市场基金份额净值1.00元，基金份额总额200,099,104.31份，其中A类份额17,137.32份，B类份额200,081,966.99份)。

2. 本财务报表的实际编制期间为2016年度和2015年12月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

## 7.2 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日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年12月24日(基 金合同生效日)至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>	173,429,889.34	99,166.21
1. 利息收入	171,586,079.45	99,166.21
其中：存款利息收入	1,782,418.19	99,166.21
债券利息收入	138,430,100.18	—
资产支持证券利息收 入	15,043,428.05	—
买入返售金融资产收	16,330,133.03	—

入		
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,829,974.26	—
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	964,651.38	—
资产支持证券投资 收益	865,322.88	—
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）	13,835.63	—
<b>减：二、费用</b>	<b>23,376,407.71</b>	<b>17,193.01</b>
1. 管理人报酬	10,449,273.53	7,673.19
2. 托管费	2,612,318.38	1,918.31
3. 销售服务费	522,500.82	384.47
4. 交易费用	—	—
5. 利息支出	9,411,976.65	—
其中：卖出回购金融资产支出	9,411,976.65	—
6. 其他费用	380,338.33	7,217.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>150,053,481.63</b>	<b>81,973.20</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>150,053,481.63</b>	<b>81,973.20</b>

### 7.3 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日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）		150,053,481.63	150,053,481.63
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）	7,950,051,864.43	—	7,950,051,864.43
其中：1. 基金申购款	7,950,063,481.63	—	7,950,063,481.63
2. 基金赎回款	-11,617.20	—	-11,617.20
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）	—	150,053,481.63	-150,053,481.63
五、期末所有者权益（基金净值）	8,150,150,968.74	—	8,150,150,968.74
项 目	上年度可比期间2015年12月24日(基金合同生效日)至 2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	200,017,131.11	—	200,017,131.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	81,973.20	81,973.20
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）	81,973.20	—	81,973.20
其中：1. 基金申购款	81,973.20	—	81,973.20
2. 基金赎回款	—	—	—
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）	—	-81,973.20	-81,973.20

五、期末所有者权益（基金净值）	200,099,104.31	—	200,099,104.31
-----------------	----------------	---	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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]第1826号《关于准予中欧骏盈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《中欧骏盈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200,017,131.11元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第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,无认购资金利息折份额,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(以下简称“兴业银行”)。

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)的银行存款和大量存单、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。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3月31日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》

、《中欧骏盈货币市场基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度和2015年12月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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2016年12月31日和2015年12月31日的财务状况以及2016年度和2015年12月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2016年度和2015年12月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证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。本基金承担的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行

后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

为了避免投资组合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投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

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

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

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

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认

列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，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。

#### **7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量**

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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

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

#### **7.4.4.9 费用的确认和计量**

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

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

#### **7.4.4.10 基金的收益分配政策**

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。

#### **7.4.4.11 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证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和资产支持证券品种，根据中国证监会证

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.8.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.8.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间2015年12月 24日(基金合同生效日)至 2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,449,273.53	7,673.19
其中：支付销售机构	—	—

的客户维护费		
--------	--	--

注：支付基金管理人中欧基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.20%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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间2015年12月
	2016年1月1日至2016年12月31日	24日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,612,318.38	1,918.31

注：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。

#### 7.4.8.2.3 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日至2016年12月31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
国都证券股份有限公司	3.99	—	3.99
兴业银行股份有限公司	—	—	—
中欧基金管理有限公司	32.56	522,464.27	522,496.83
合计	36.55	522,464.27	522,500.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年12月24日（基金合同生效日）至2015年12月31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
国都证券股份有限公司	0.16	—	0.16
兴业银行股份有限公司	—	—	—

中欧基金管理有限公司	0.80	383.51	384.31
合计	0.96	383.51	384.47

注：本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，对于由B类降级为A类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级确认日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.01%，对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级确认日起享受B类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$H = E \times \text{该类基金份额的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
兴业银行股份有限公司	—	—	799,200, 000.00	51,373.6 6	—	—
上年度可比期间 2015年12月24日至2015年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
兴业银行股份有限公司	—	—	—	—	—	—

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

##### 7.4.8.4.2 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：人民币元

关联方名称		本期末 2016年12月31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
中欧 骏盈 货币 B	兴业银行股份 有限公司	8,150,135,073 .09	100.00%	200,081,966.9 9	100.00%

注：本基金关联方兴业银行股份有限公司申购本基金B类份额的费率均为0，符合本基金招募说明书的相关规定。

#### 7.4.8.5 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日至2016年12月31日		上年度可比期间2015年12月24日 (基金合同生效日)至2015年 12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,874,494.58	517,036.13	11,017,131.11	39,741.16

注：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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额399,829,200.25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
120223	12国开23	2017-01-04	99.79	2000000	199,580,977.60
160414	16农发14	2017-01-04	100.01	870000	87,009,658.31
160419	16农发19	2017-01-04	99.86	1600000	159,778,945.16
合计				4,470,000.00	446,369,581.07

#### 7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 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12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为6,066,253,434.57元，属于第三层次的余额为10,601,867.52元，无属于第一层次的余额(2015年12月31日：本基金未持有以公允价值计量的金融工具)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

第三层次资产变动如下：

交易性金融资产  
资产支持证券投资

2015年12月31日

-

购买	157,801,397.52
出售	-147,199,530.00
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
2016年12月31日	<u>10,601,867.52</u>

2016年12月31日仍持有的资产计入2016年度损益的未实现利得或损失的变动  
——公允价值变动损益

---

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

	2016年12月 31日公允价值	估值技术	名称	不可观察输入值	
				范围 /加权 平均值	与公允价 值之间的 关系
交易性金融资产——				4.90%	
		现金流量		-	
资产支持证券投资	10,601,867.52	折现法	折现率	5.30%	负相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具  
于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具  
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	6,076,855,302.09	71.05
	其中：债券	5,622,954,980.59	65.74
	资产支持证券	453,900,321.50	5.31
2	买入返售金融资产	2,449,896,614.83	28.64
	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	1,874,494.58	0.02
4	其他各项资产	24,060,872.12	0.28
5	合计	8,552,687,283.62	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.71	
	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	399,829,200.25	4.91
	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%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	78
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
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。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	57.28	4.91
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	1.54	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	20.30	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	4.55	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	20.98	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	104.65	4.91

#### 8.4 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。

#### 8.5 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	540,436,558.92	6.63
	其中：政策性金融债	540,436,558.92	6.63
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	814,293,481.17	9.99
6	中期票据	—	—
7	同业存单	4,268,224,940.50	52.37
8	其他	—	—
9	合计	5,622,954,980.59	68.99
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

#### 8.6 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	111612159	16北京银行CD159	11,000,000	1,092,700,683.79	13.41
2	111616126	16上海银行CD126	5,000,000	499,836,123.57	6.13
3	111613097	16浙商CD097	5,000,000	499,799,940.03	6.13
4	111695672	16杭州银行CD100	4,000,000	399,233,505.47	4.90
5	111680731	16富邦华一银行CD034	3,000,000	292,727,987.72	3.59

6	1116809 94	16中原银行 CD167	3,000,000	292,713,384.5 8	3.59
7	1116969 37	16宁波银行 CD186	2,500,000	248,828,884.8 3	3.05
8	120223	12国开23	2,050,000	204,570,502.0 4	2.51
9	1116071 06	16招行CD106	2,000,000	199,919,931.1 1	2.45
10	1116191 04	16恒丰银行 CD104	2,000,000	199,794,862.1 3	2.45

### 8.7 “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	0.1357
报告期内偏离度的最低值	-0.2017
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0401

#### 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%。

### 8.8 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	1689179	16开元2A2	4,000,000.00	387,293,728.0 6	4.75
2	1689086	16永生1A1	300,000.00	25,529,544.77	0.31
3	1689038	16睿程1A2	670,000.00	15,396,377.84	0.19

4	1589160	15平银1A2	1,200,000.00	15,078,803.31	0.19
5	123836	PR一A4	171,000.00	8,101,207.76	0.10
6	123978	PR德润A2	90,000.00	2,500,659.76	0.03

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

### 8.9.2

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。

### 8.9.3 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	24,060,872.12
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	24,060,872.12

### 8.9.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 比例	持有 份额	占总份 额 比例
中欧骏 盈货币A	272	58.44	10,017.11	63.02%	5,878.54	36.98%
中欧骏 盈货币B	1	8,150,135, 073.09	8,150,135, 073.09	100.00%	—	—
合计	273	29,854,032 .85	8,150,145, 090.20	100.00%	5,878.54	0.00%

注：截止本报告期末，本基金机构投资者持有本基金的份额占基金总份额的比例为99.999928%，个人投资者持有本基金的份额占基金总份额的比例为0.000072%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

## 9.2 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
基金管理人所有从业人员持 有本基金	中欧骏盈货币A	3,757.52	23.64%
	中欧骏盈货币B	—	—
	合计	3,757.52	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份额占基金总份额的比例为0.000046%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	中欧骏盈货	0

式基金	币A	
	中欧骏盈货 币B	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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	10,375.53	7,950,053,106.10
减：本报告期基金总赎回份额	11,617.20	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	15,895.65	8,150,135,073.09

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于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。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为85,000.00元人民币。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	—	—	159,610,519.58	100.00%	34,200,000.00	69.51%	—	—	
国都证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	
银河证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	
海通证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	
招商证	1	—	—	—	—	15,000,	30.4	—	—	

券						000.00	9%			
国信证 券	1	—	—		—	—	—		—	
中金公 司	1	—	—		—	—	—		—	
广发证 券	2	—	—		—	—	—		—	
华泰证 券	2	—	—		—	—	—		—	
中信证 券	1	—	—		—	—	—		—	
齐鲁证 券	1	—	—		—	—	—		—	
中银国 际	1	—	—		—	—	—		—	
中信建 投	2	—	—		—	—	—		—	
长城证 券	1	—	—		—	—	—		—	
光大证 券	1	—	—		—	—	—		—	
国金证 券	1	—	—		—	—	—		—	
瑞银证 券	1	—	—		—	—	—		—	
长江证 券	1	—	—		—	—	—		—	
西部证 券	1	—	—		—	—	—		—	
东方证 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。

#### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况。

中欧基金管理有限公司  
二〇一七年三月三十一日