

# 中欧基金管理有限公司中欧骏盈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：兴业银行股份有限公司

二零一七年八月

本基金经 2015 年 7 月 29 日中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）下发的《关于准予中欧骏盈货币市场基金注册的批复》（证监许可[2015]1826 号文）准予募集注册。本基金基金合同于 2015 年 12 月 24 日正式生效。（本基金由基金管理人修订原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》，并经 2017 年 6 月 28 日中欧骏盈货币市场基金基金份额持有人大会决议通过。自 2017 年 7 月 3 日起，由原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》修订而成的《中欧骏盈货币市场基金基金合同》生效，原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》同日起失效。关于本基金召开持有人大会的相关事项，可以参阅本基金持有人大会的相关召开公告、决议生效公告以及 2017 年 6 月 30 日发布的基金合同）

## 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和基金合同等信息披露文件，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。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 6 月 23 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目录

第一部分基金管理人	2
第二部分基金托管人	7
第三部分相关服务机构	10
第四部分基金的名称	12
第五部分基金的类型	12
第六部分基金的投资目标	12
第七部分基金的投资范围	13
第八部分基金的投资策略	13
第九部分基金的业绩比较基准	14
第十部分基金的风险收益特征	15

第十一部分基金的投资组合报告 15

第十二部分基金的业绩 20

第十三部分基金费用与税收 23

第十四部分对招募说明书更新部分的说明 26

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 号东方汇经大厦 5 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：竇玉明

5、组织形式：有限责任公司

6、设立时间：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：1.88 亿元人民币

15、股权结构：

意大利意联银行股份合作公司出资 6,580 万元人民币，占公司注册资本的 35%；

国都证券股份有限公司出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；

北京百骏投资有限公司出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；

上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；

万盛基业投资有限责任公司出资 940 万元人民币，占公司注册资本的 5%。

上述五个股东共出资 18,800 万元人民币。

二、主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

竇玉明先生，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。

MarcoDEste 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，联合信贷银行（Unicredit）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，意大利意联银行股份合作公司（UBI）机构银行业务部总监，并曾在 Credititaliano（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

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，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学助教、副科长，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。

DavidYoungson 先生，英国籍。现任 IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人，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，北京大学法学博士（国际经济法），美国哈佛大学法学硕士（国际金融法），美国南美以美大学法学硕士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院教授、院长助理，中欧基金管理有限公司独立董事。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。

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。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 SchulteRothLLP 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客户服务总监，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，中国籍。上海财经大学金融学硕士，16年以上基金从业经验。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、事业部负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，12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，中信基金管理有限责任公司研究员，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，16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，9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

刘德元先生，中国籍，武汉轻工大学（原武汉工业学院）物流管理专业学士，12年以上证券及基金从业经验。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（2015年10月22日起至2016年11月15日）、中欧琪丰灵活配置混合型证券投资基金（2015年11月27日起至2016年12月22日），现任中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理

（2015年8月20日起至至今）、中欧兴利债券型证券投资基金基金经理（2015年9月25日起至至今）、中欧强势多策略定期开放债券型证券投资基金基金经理（2015年11月10日起至至今）、中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金（2015年11月27日起至至今）、中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）（2015年12月2日起至至今）、中欧骏盈货币市场基金基金经理

（2015年12月24日起至至今）、中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理（2016年1月8日起至至今）、中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）基金经理（2016年2月16日起至至今）、中欧强盈定期开放债券型证券投资基金基金经理（2016年3月

25日起至至今）、中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金基金经理（2016年5月27日起至至今）、中欧强利债券型证券投资基金基金经理（2016年8月3日起至至今）、中欧瑾悠灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2016年9月19日起至至今）、

中欧强惠债券型证券投资基金基金经理（2016年10月20日起至至今）、中欧强裕债券型证券投资基金基金经理（2016年11月7日起至至今）、中欧强泽债券型证券投资基金基金经理（2017年2月24日起至至今）、中欧骏益货币市场基金基金经理

（2017年3月21日起至至今）、中欧弘安一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（2017年4月7日起至至今）。（经公司管

理会议决议通过，同意刘德元先生不再担任中欧骏盈货币市场基金基金经理，公司已按相关法律法规要求报送中国证券投资基金业协会备案，自 2017 年 6 月 27 日正式生效，上述事项已于 2017 年 6 月 28 日进行了信息披露。）

朱晨杰先生，中国籍，法国北方高等商业学校金融市场专业硕士，4 年以上证券从业经验，具有基金从业资格。历任法国兴业银行投资银行部交易助理，海通证券股份有限公司债券融资部销售交易员，平安证券有限责任公司固定收益事业部交易员。

2016 年 3 月加入中欧基金管理有限公司，曾任投资经理，现任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧增强回报债券型证券投资基金（LOF）基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧兴利债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧强势多策略定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧强盈定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧强瑞多策略定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧强利债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧瑾悠灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧强裕债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧强泽债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 7 日起至今）、中欧骏盈货币市场基金基金经理（自 2017 年 5 月 3 日起至今）。

#### 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、副总经理顾伟、分管投资副总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、周玉雄、曲径、赵国英、曹名长、王健、王培、吴鹏飞组成。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）基金托管人情况

##### 1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

注册日期：1988 年 8 月 22 日

注册资本：人民币 207.74 亿元

托管部门联系人：刘峰

电话：021-62677777-212017

传真：021-62159217

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 190.52 亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持真诚服务，相伴成长的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2016 年末，兴业银行总资产达 6.09 万亿元，实现营业收入 1570.6 亿元，实现净利润 538.5 亿元。

在 2016 年英国《银行家》杂志全球银行 1000 强排名中，兴业银行按总资产排名第 33 位，按一级资本排名第 32 位；在 2016 年《财富》世界 500 强中，兴业银行排名第 195 位；在 2016 年《福布斯》全球上市企业 2000 强排名中，兴业银行位居第 59 位，稳居全球银行 50 强、全球上市企业 100 强、世界企业 500 强。品牌价值同步提升，根据英国《银行家》杂志联合世界知名品牌评估机构 BrandFinance 发布的 2017 全球银行品牌 500 强榜单，兴业银行排名第 21 位，大幅上升 15 位，品牌价值突破百亿美元达 105.67 亿美元，同比增长 63.70%。在国内外权威机构组织的评奖中，兴业银行连续六年蝉联中国银行业年度最具社会责任金融机构奖，并先后获得亚洲卓越商业银行、杰出中资银行奖、年度最佳股份制银行、卓越竞争力金融控股集团、卓越创新银行奖、年度优秀绿色金融机构、最佳责任企业等多项殊荣。

##### 2、主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理

处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

### 3、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截止 2017 年 3 月 31 日，兴业银行已托管开放式基金 173 只，托管基金财产规模 5442.02 亿元

#### （二）基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

##### 2、内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行风险管理部、法律与合规部、审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

- （1）全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。
- （2）独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。
- （3）相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。
- （4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。
- （5）防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。
- （6）有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。
- （7）审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照内控优先的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。
- （8）责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

##### 4、内部控制制度及措施

- （1）制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。
- （2）建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。
- （3）风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。
- （4）相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。
- （5）人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。
- （6）应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国

证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

### 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 号东方汇经大厦 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

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

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

联系人：黄静

电话：010-84183389

传真：010-64482090

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，并另行公告。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，并另行公告。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 号东方汇经大厦 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

总经理：刘建平

成立日期：2006 年 7 月 19 日

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：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：许康玮、俞伟敏

#### 第四部分基金的名称

中欧骏盈货币市场基金

#### 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、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。

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。（本基金由基金管理人修订原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》，并经 2017 年 6 月 28 日中欧骏盈货币市场基金份额持有人大会决议通过。

自 2017 年 7 月 3 日起，由原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》修订而成的《中欧骏盈货币市场基金基金合同》生效，原

《中欧骏盈货币市场基金基金合同》同日起失效。关于本基金召开持有人大会的相关事项，可以参阅本基金持有人大会的相关召开公告、决议生效公告以及 2017 年 6 月 30 日发布的基金合同）

#### 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。

#### 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 2017 年第 1 季度报告，所载数据截至 2017 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

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 6,036,627,525.95 83.56

其中：债券 6,036,627,525.95 83.56

资产支持证券 — —

2 买入返售金融资产 508,088,838.99 7.03

其中：买断式回购的买入返售金融资产 53,190,036.64 0.74

3 银行存款和结算备付金合计 651,318,512.22 9.02

4 其他资产 28,544,900.15 0.40

5 合计 7,224,579,777.31 100.00

#### 2 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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 — 0.40

其中：买断式回购融资 — —

2 报告期末债券回购融资余额 — —

其中：买断式回购融资 — —

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%。

### 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 81

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 99

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 56

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 20.70 --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 -- --

2 30 天(含)0 浮动天 16.74 --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 -- --

3 60 天(含)0 浮动天 20.57 --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 -- --

4 90 天(含)0 浮动天 20.31 --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 -- --

5 120 天(含)20 动天(含) 21.33 --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 -- --

合计 99.65 --

#### 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

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 535,350,926.19 7.41

其中：政策性金融债 535,350,926.19 7.41

4 企业债券 -- --

5 企业短期融资券 916,513,033.53 12.69

6 中期票据 -- --

7 同业存单 4,584,763,566.23 63.48

8 其他 -- --

9 合计 6,036,627,525.95 83.58

10 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 -- --

注：上表中，附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。

### 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

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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 111609501 16 浦发 CD501 9,200,000 910,724,538.61 12.61  
2 111604011 16 中行 CD011 4,450,000 438,000,406.83 6.06  
3 111617184 16 光大 CD184 3,700,000 364,055,454.10 5.04  
4 160419 16 农发 19 3,250,000 324,463,859.50 4.49  
5 111609500 16 浦发 CD500 3,000,000 297,437,715.08 4.12  
6 111680731 16 富邦华一银行 CD034 3,000,000 297,283,944.49 4.12  
7 111680994 16 中原银行 CD167 3,000,000 297,153,291.15 4.11  
8 111707017 17 招商银行 CD017 3,000,000 296,428,004.81 4.10  
9 011698604 16 中建材 SCP009 2,500,000 249,050,497.81 3.45  
10 120223 12 国开 23 2,050,000 204,886,940.27 2.84

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 0.0991%

报告期内偏离度的最低值 -0.0147%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0451%

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 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。

9 投资组合报告附注

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。

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。

9.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 一

2 应收证券清算款 一

3 应收利息 28,544,900.15

4 应收申购款

5 其他应收款 一

6 待摊费用 一

7 其他 一

8 合计 28,544,900.15

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。

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 2015 年 12 月 24 日，基金业绩截止日 2017 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

中欧骏盈货币 A

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2015.12.24-2015.12.31 0.0362% 0.0017% 0.0296% 0.0000% 0.0066% 0.0017%

2016.1.1-2016.12.31 2.5395% 0.0012% 1.3537% 0.0000% 1.1858% 0.0012%

2017.1.1-2017.3.31 0.8608% 0.0016% 0.3329% 0.0000% 0.5279% 0.0016%

2015.12.24-2017.3.31 3.4596% 0.0017% 1.7162% 0.0000% 1.7434% 0.0017%

中欧骏盈货币 B

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2015.12.24-2015.12.31 0.0410% 0.0017% 0.0296% 0.0000% 0.0114% 0.0017%

2016.1.1-2016.12.31 2.7894% 0.0012% 1.3537% 0.0000% 1.4357% 0.0012%

2017.1.1-2017.3.31 0.9215% 0.0016% 0.3329% 0.0000% 0.5886% 0.0016%

2015.12.24-2017.3.31 3.7791% 0.0017% 1.7162% 0.0000% 2.0629% 0.0017%

#### 2. 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧骏盈货币 A

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

(2015 年 12 月 24 日-2017 年 3 月 31 日)

数据来源：中欧基金 Wind

中欧骏盈货币 B

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

(2015 年 12 月 24 日-2017 年 3 月 31 日)

注：本基金基金合同生效日期为 2015 年 12 月 24 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应当符合基金合同的规定。

数据来源：中欧基金 Wind

### 第十三部分基金的费用与税收

#### 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 0.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \times \text{当年天数}$$

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管理费划款指令，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基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。(本基金由基金管理人修订原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》，并经2017年6月28日中欧骏盈货币市场基金基金份额持有人大会决议通过。自2017年7月3日起，由原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》修订而成的《中欧骏盈货币市场基金基金合同》生效，原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》同日起失效。关于本基金召开持有人大会的相关事项，可以参阅本基金持有人大会的相关召开公告、决议生效公告以及2017年6月30日发布的基金合同)

## 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：

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

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托管费划款指令，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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、基金销售服务费

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：

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

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。

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、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

基金管理人与基金托管人协商一致调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等费率，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

## 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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，对本基金管理人于2017年2月刊登的《中欧骏盈货币市场基金更新招募说明书（第2017年第1号）》进行了更新，主要更新内容如下：(本基金由基金管理人修订原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》，并经2017年6月28日中欧骏盈货币市

场基金基金份额持有人大会决议通过。自 2017 年 7 月 3 日起，由原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》修订而成的《中欧骏盈货币市场基金基金合同》生效，原《中欧骏盈货币市场基金基金合同》同日起失效。关于本基金召开持有人大会的相关事项，可以参阅本基金持有人大会的相关召开公告、决议生效公告以及 2017 年 6 月 30 日发布的基金合同)

(一) 重要提示部分

更新了本更新招募说明书所载内容截止日为 2017 年 6 月 23 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。的描述。

(二) 第三部分基金管理人部分

更新了基金管理人的董事会成员、监事会成员、高级管理人员、本基金基金经理、投资决策委员会成员的相关信息。

(三) 第四部分基金托管人部分

更新了托管人的相关信息。

(四) 第五部分相关服务机构部分

更新了会计师事务所的相关信息。

(五) 第八部分基金份额的申购与赎回部分

更新了拒绝或暂停申购的相关情形。

(六) 第九部分基金的投资部分

更新了十、基金投资组合报告，数据截至 2017 年 3 月 31 日。

(七) 第十部分基金的业绩部分

更新了整章的信息，包括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和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，数据截至 2017 年 3 月 31 日。

(八) 第二十二部分其他应披露事项部分

更新了自 2016 年 12 月 24 日至 2017 年 6 月 23 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

以下为本基金管理人自 2016 年 12 月 24 日至 2017 年 6 月 23 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号 公告事项 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 2017-01-01
- 2 中欧骏盈货币市场基金 2016 年第 4 季度报告 2017-01-20
- 3 中欧骏盈货币市场基金暂停申购、转换转入公告 2017-01-23
- 4 中欧骏盈货币市场基金更新招募说明书（2017 年第 1 号） 2017-02-06
- 5 中欧骏盈货币市场基金更新招募说明书摘要（2017 年第 1 号） 2017-02-06
- 6 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 2017-02-11
- 7 中欧基金管理有限公司北京分公司办公地址变更公告 2017-02-22
- 8 中欧骏盈货币市场基金暂停申购、转换转入公告 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 2017-03-30
- 10 中欧骏盈货币市场基金 2016 年年度报告 2017-03-31
- 11 中欧骏盈货币市场基金 2016 年年度报告摘要 2017-03-31
- 12 中欧骏盈货币市场基金 2017 年 1 季度报告 2017-04-21
- 13 中欧骏盈货币市场基金基金经理变更公告 2017-05-03
- 14 中欧骏盈货币市场基金暂停申购、转换转入公告 2017-05-23
- 15 中欧基金管理有限公司关于以通讯方式召开中欧骏盈货币市场基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告 2017-06-01

中欧基金管理有限公司

2017 年 8 月 7 日