

中欧骏盈货币市场基金2017年半年度报告

2017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：2017年8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。

基金托管人兴业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

1.1 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.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	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的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§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.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 债券回购融资情况.....	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
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.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	39
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
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.....	40
7.9 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43

10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	44
10.9	其他重大事件	44
§11	影响投资者决策的其他重要信息	46
§12	备查文件目录	46
12.1	备查文件目录	46
12.2	存放地点	47
12.3	查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧骏盈货币市场基金	
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	473,738,362.43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	18,211.85份	473,720,150.58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 姓名	黎忆海	张志永

人	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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层	福州市湖东路154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	上海市江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		窦玉明	高建平

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号五层

§ 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日-2017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	329.49	124,333,489.19
本期利润	329.49	124,333,489.19
本期净值收益率	1.8208%	1.9429%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末基金资产净值	18,211.85	473,720,150.58
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
累计净值收益率	4.4444%	4.8295%

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	0.2580 %	0.0030 %	0.1110 %	0.0000 %	0.1470 %	0.0030 %
过去三个月	0.9519 %	0.0038 %	0.3366 %	0.0000 %	0.6153 %	0.0038 %
过去六个月	1.8208 %	0.0029 %	0.6695 %	0.0000 %	1.1513 %	0.0029 %
过去一年	3.1989 %	0.0027 %	1.3500 %	0.0000 %	1.8489 %	0.0027 %
自基金合同生效起至今	4.4444 %	0.0025 %	2.0527 %	0.0000 %	2.3917 %	0.0025 %

(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

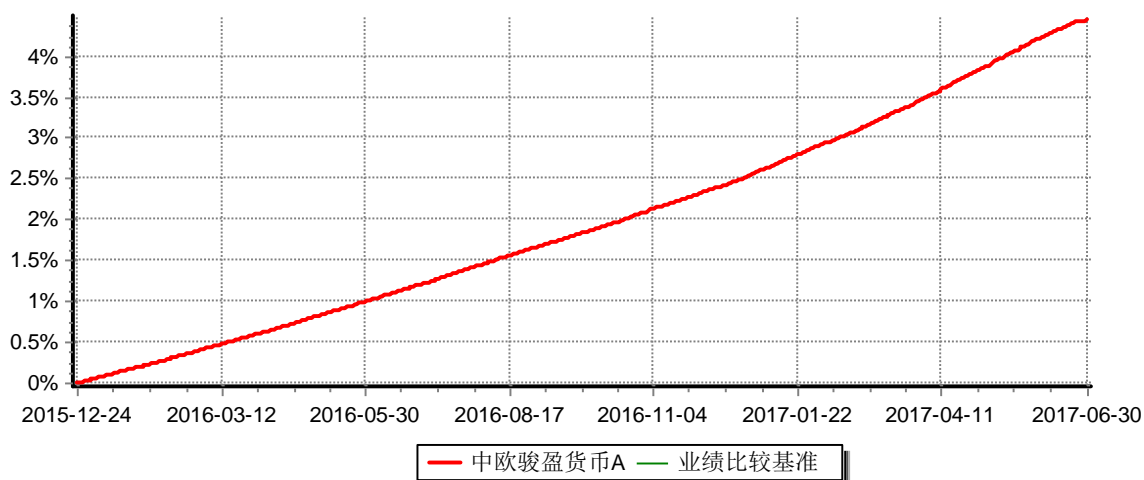
阶段(中欧骏盈货币B)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2781 %	0.0030 %	0.1110 %	0.0000 %	0.1671 %	0.0030 %
过去三个月	1.0121 %	0.0038 %	0.3366 %	0.0000 %	0.6755 %	0.0038 %
过去六个月	1.9429 %	0.0029 %	0.6695 %	0.0000 %	1.2734 %	0.0029 %
过去一年	3.4480 %	0.0027 %	1.3500 %	0.0000 %	2.0980 %	0.0027 %
自基金合同生效起至今	4.8295 %	0.0025 %	2.0527 %	0.0000 %	2.7768 %	0.0025 %

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

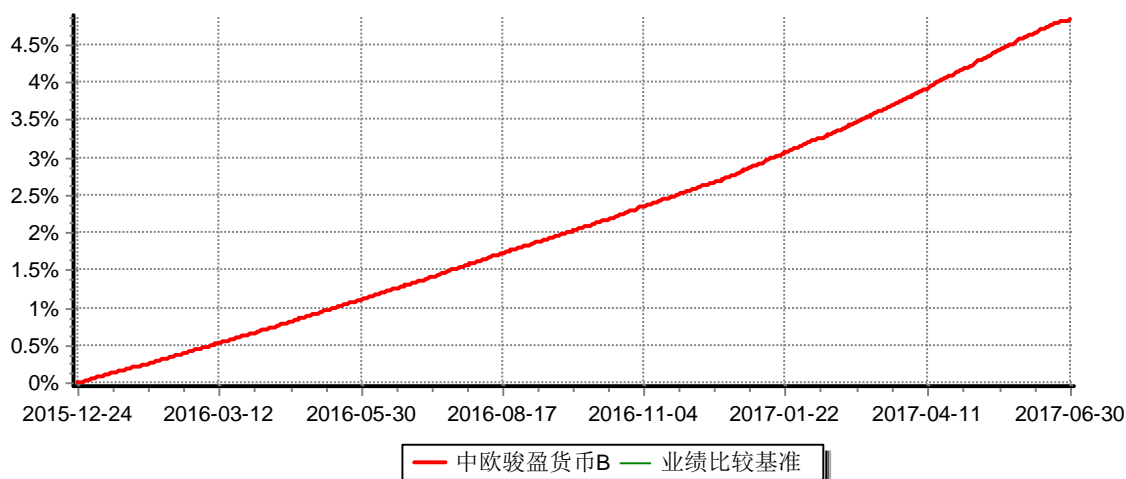
(2015年12月24日-2017年6月30日)



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-2017年6月30日)



§ 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		
刘德元	基金经理	2015年12月24日	2017年6月27日	12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23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信用研究员。

朱晨杰	基金经 理	2017年5月3 日	—	5年	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24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投资经理。
-----	----------	---------------	---	----	--

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

17年上半年经济表现强于2016年，在煤炭、钢铁供给侧改革的推进下，上游工业品的价格大幅抬升，产能过剩格局有效改善，上半年PPIRM累计同比8.7%、PPI累计同比6.6%，供给收缩带来的涨价预期，加大了补库存的力度，叠加发达国家经济回暖对出口的提振，我国经济有所反弹。上半年实际GDP累计同比增速为6.9%，名义GDP累计同比增速为11.4%，其中，工业表现尤其亮眼，上半年工业增加值累计同比增速为6.9%，高于去年同期增速6%；而在行政调控和金融监管的影响下，房地产业和金融业的增速有所放缓，经济整体呈现“脱虚向实”的局面。

今年4月上旬，银监会密集发文，针对银行业“三套利”、“三违反”、“四不当”、“十乱象”进行专项整治，同业业务、投资业务和理财业务成为治理的重点。4、5月央行也配合以“中性偏紧”的政策。期间，利率迅速大幅上行，一级债券发行受阻。而在6月，监管的力度边际减缓，银监会强调防范“处置风险的风险”，央行也有意维稳资金面。从成果上来看，银行理财规模和表内同业资产在上半年显著收缩，监管初见成效，但仍在进行中。

债券市场走势震荡，一季度收益率曲线整体向上平移。开年经济数据的平稳以及通胀预期升温令收益率曲线先呈现熊市增陡，步入3月后，资金面紧张程度增强，短端利率快速抬升，收益率曲线随后呈现熊市变平；3月受到资金紧张的影响，短端收益抬升，目前收益率曲线的平坦化明显。二季度前两个月债券市场发生了剧烈调整，在到监管引发的流动性冲击和经济相对悲观的预期下，4月初到5月底利率债1年期上行68BP而10年上行30BP，收益率曲线呈现熊平态势，利率债期限利差不断压缩至历史低级水平。信用债收益率曲线则整体上行，信用利差走阔，中低等级总长久期信用债流动性骤减，一级信用债融资也持续负增，发行利率也随之大幅抬升。之后监管态度缓和、央行维稳资金面，市场情绪得以修复，6月份开始随着资金面平稳、同业存单发行收益率回落，债券市场大幅回暖，利率债中5-10年下行20BP左右，期限利差进一步压缩，信用债市场也得到极大的修复，成交活跃，3-5年估值下行30-40BP，曲线形态也更加平坦。

报告期内，本基金主要投资于短融、同业存款和同业存单，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1.8208%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；B类份额净值增长率为1.9429%，同期业绩比较基准收益率为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

7月银行自查结束、金融工作会议召开，这些事件都会带来政策面的冲击，但是，基本面（经济增长和物价水平）将逐渐成为主导债券市场的因素。从近期的数据来看，基建投资增速已经回落，地产投资虽然保持韧性，但在地产调控高压政策的限制下，投资拐点已经显现。因此，经济增长下行的压力正在不断加大。但同时我们预计经济回落的速度会比较慢。首先全球经济依然处于复苏态势，尤其是近期欧洲经济复苏整体比较强劲，由此带动的国内净出口增速的回升，对内需下降有所对冲；第二，制造业方面，从实际利率变化看制造业投资大概滞后于实际利率8个月以上，3季度前制造业投资还会保持恢复性增长；房地产方面，由于房地产销售增速仍在高位，投资增速在3季度前会保持稳中有降的趋势。总体来看，下半年的经济增速虽有所回落，但是三季度仍然难以见到基本面快速下滑的情况，到了四季度经济下行压力可能会略有呈现，因此货币政策的放开仍然需要耐心。

在基本面缓慢下行及货币政策保持中性的背景下，我们坚持下半年震荡慢牛的观点，资金面及政策面的预期差会造成收益率的波动，同时也创造交易的机会。

展望下半年，本基金将继续做好期限匹配，主要投资于收益率较高的短融、同业存款和同业存单，维持适当的杠杆水平，并对短期债券进行波段操作以提高组合的收益。

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A类份额持有人分配利润329.49元，向B类份额持有人分配利润124,333,489.19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：2017年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	13,198,275.20	1,874,494.58
结算备付金			—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	358,036,570.11	6,076,855,302.09
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		358,036,570.11	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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	99,400,469.10	2,449,896,614.83
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	4,098,778.71	24,060,872.12
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		474,734,093.12	8,552,687,283.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6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		—	399,829,200.25
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—

应付管理人报酬		511,246.63	1,378,580.85
应付托管费		127,811.69	344,645.24
应付销售服务费		25,565.99	68,931.50
应付交易费用	6.4.7.7	34,555.59	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	6.4.7.8	296,550.79	336,621.11
负债合计		995,730.69	402,536,314.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	473,738,362.43	8,150,150,968.74
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		473,738,362.43	8,150,150,968.74
负债和所有者权益总计		474,734,093.12	8,552,687,283.62

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.000元，基金份额总额473,738,362.43份，其中A类基金份额总额18,211.85份，B类基金份额总额473,720,150.58份。

6.2 利润表

会计主体：中欧骏盈货币市场基金

本报告期：2017年1月1日-2017年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年1月1日 -2017年6月30日	上年度可比期间2016 年01月01日-2016年06 月30日
一、收入		133,195,078.36	42,775,222.35
1.利息收入		133,701,547.73	42,777,609.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,152,329.23	1,518,408.41
债券利息收入		110,099,375.50	38,118,854.37
资产支持证券利息收 入		1,223,004.00	3,072,493.48

买入返售金融资产收入		13,226,839.00	67,853.56
其他利息收入		—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)		-506,469.37	-2,387.47
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	-498,442.25	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-8,027.12	-2,387.47
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		8,861,259.68	7,026,452.89
1. 管理人报酬		6,432,991.65	2,623,813.34
2. 托管费		1,608,247.92	655,953.27
3. 销售服务费		321,671.39	131,211.62
4. 交易费用	6.4.7.18	—	—
5. 利息支出		289,852.88	3,446,848.51
其中: 卖出回购金融资产支出		289,852.88	3,446,848.51
6. 其他费用	6.4.7.19	208,495.84	168,626.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		124,333,818.68	35,748,769.46
减: 所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		124,333,818.68	35,748,769.46

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：2017年1月1日-2017年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日-2017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)	8,150,150,968.74	—	8,150,150,968.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	124,333,818.68	124,333,818.68
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)	-7,676,412,606.31	—	-7,676,412,606.31
其中：1.基金申购款	124,336,647.83	—	124,336,647.83
2.基金赎回款	-7,800,749,254.14	—	-7,800,749,254.14
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)	—	-124,333,818.68	-124,333,818.68
五、期末所有者权益(基金净值)	473,738,362.43	—	473,738,362.43
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日-2016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)	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

“-”号填列)			
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

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]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2017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 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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6月30日
活期存款	13,198,275.20
合计	13,198,275.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017年6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	358,036,570.11	357,729,000.00	-307,570.11	-0.0649%
	合计	358,036,570.11	357,729,000.00	-307,570.11	-0.0649%

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6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	99,400,469.10	—
合计	99,400,469.10	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	285,916.96
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	3,796,808.22
应收买入返售证券利息	16,053.53
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	4,098,778.71

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6月30日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	34,555.59
合计	34,555.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6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	222,955.90

其他应付	2,753.98
预提审计费	61,987.07
账户维护费	8,853.84
合计	296,550.79

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 中欧骏盈货币A

金额单位：人民币元

项目(A级)	本期2017年1月1日-2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,895.65	15,895.65
本期申购	3,158.64	3,158.64
本期赎回（以“-”号填列）	-842.44	-842.44
本期末	18,211.85	18,211.85

6.4.7.9.2 中欧骏盈货币B

金额单位：人民币元

项目(B级)	本期2017年1月1日-2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,150,135,073.09	8,150,135,073.09
本期申购	124,333,489.19	124,333,489.19
本期赎回（以“-”号填列）	-7,800,748,411.70	-7,800,748,411.70
本期末	473,720,150.58	473,720,150.58

注：申购份额含红利再投、转入和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含转出和因份额升降级导致强制调减份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 中欧骏盈货币A

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	329.49	—	329.49

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	-329.49	—	-329.49
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。

6.4.7.10.2 中欧骏盈货币B

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	124,333,489.19	—	124,333,489.19
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	-124,333,489.19	—	-124,333,489.19
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1月1日-2017年6月30日
活期存款利息收入	555,935.64
定期存款利息收入	8,596,388.89
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	—
其他	4.70
合计	9,152,329.23

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1月1日-2017年6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	-498,442.25
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	-498,442.25

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1月1日-2017年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	12,824,917,432.41
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	12,794,000,000.00
减：应收利息总额	31,415,874.66
买卖债券差价收入	-498,442.25

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日-2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	437,397,111.81

减：卖出资产支持证券成本总额	434,735,670.00
减：应收利息总额	2,669,468.93
资产支持证券投资收益	-8,027.12

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。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2017年1月1日-2017年6月30日
审计费用	61,987.07
信息披露费	102,955.90
其他	11,000.00
帐户维护费	17,853.84
汇划手续费	14,699.03
合计	208,495.84

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

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须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
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

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 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 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1月1日-2017年6	上年度可比期间2016年01月
----	--------------------	-----------------

	月30日	01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,432,991.65	2,623,813.34
其中：应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。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2017年1月1日-2017年6月30日	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,608,247.92	655,953.27

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。

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1月1日-2017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	20.64	321,648.66	321,669.30
国都证券	2.09	—	2.09
兴业银行	—	—	—
合计	22.73	321,648.66	321,671.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06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
兴业银行	—	—	—
合计	21.84	131,189.78	131,211.62

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。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。

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

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

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6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
B类	兴业银行股份有 限公司	473720150.58	100.00%	6635830537.14	100.00%

注：本基金关联方兴业银行股份有限公司申购/赎回本基金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。

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1月1日-2017年6月30日		上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日	
	期末	当期	期末	当期

	余额	利息收入	余额	利息收入
兴业银行活期存款	13,198,275.20	9,152,324.53	13,694,978.72	253,448.45

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/约定利率计息。

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

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金(A级)	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
329.49	—	—	329.49	
已按再投资形式转实收基金(B级)	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
124,333,489.19	—	—	124,333,489.19	

6.4.12 期末（2017年6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

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 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同责任，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6月30日	上年度末 2016年12月31日

A-1	—	128,694,512.44
A-1以下	—	—
未评级	358,036,570.11	5,219,614,621.99
合计	358,036,570.11	5,348,309,134.43

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政策性金融债及一年以内的CD。3. 债券投资以成本价列示。

6.4.13.2 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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	—	—
AAA以下	—	—
未评级	—	274,645,846.16
合计	—	274,645,846.16

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 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%。本基金所持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。

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

单位：人民币元

本期末2017年6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	13,198,275.20	—	—	—	—	13,198,275.20
交易性金融资产	298,193,673.20	59,842,896.91	—	—	—	358,036,570.11
买入返售金融资产	99,400,469.10	—	—	—	—	99,400,469.10
应收利息	—	—	—	—	4,098,778.71	4,098,778.71
资产总计	410,792,417.50	59,842,896.91	—	—	4,098,778.71	474,734,093.12

负债						
应付管理人报酬	—	—	—	—	511,246.63	511,246.63
应付托管费	—	—	—	—	127,811.69	127,811.69
应付销售服务费	—	—	—	—	25,565.99	25,565.99
应付交易费用	—	—	—	—	34,555.59	34,555.59
其他负债	—	—	—	—	296,550.79	296,550.79
负债总计	—	—	—	—	995,730.69	995,730.69
利率敏感度缺口	410,792,417.50	59,842,896.91	—	—	3,103,048.02	473,738,362.43
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	1,874,494.58	—	—	—	—	1,874,494.58
交易性金融资产	5,560,915,448.04	515,939,854.05	—	—	—	6,076,855,302.09
买入返售金融资产	2,449,896,614.83	—	—	—	—	2,449,896,614.83
应收利息	—	—	—	—	24,060,872.12	24,060,872.12
资产总计	8,012,686,557.45	515,939,854.05	—	—	24,060,872.12	8,552,687,283.62
负债						
卖出回购金融资产款	399,829,200.25	—	—	—	—	399,829,200.25
应付管理人	—	—	—	—	1,378,580.85	1,378,580.85

报酬						
应付托管费	—	—	—	—	344,645.24	344,645.24
应付销售服务费	—	—	—	—	68,931.50	68,931.50
应付交易费用	—	—	—	—	77,646.18	77,646.18
应付利息	—	—	—	—	500,689.75	500,689.75
其他负债	—	—	—	—	336,621.11	336,621.11
负债总计	399,829,200.25	—	—	—	2,707,114.63	402,536,314.88
利率敏感度缺口	7,612,857,357.20	515,939,854.05	—	—	21,353,757.49	8,150,150,968.74

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	市场利率下降25个基点	24.00	306.35
	市场利率上升25个基点	-23.92	-305.31

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

于2017年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资(2016年12月31日，同)，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358,036,570.11元，无属于第一层次和第三层次的余额（2016年12月31日：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）。

(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（2016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) 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	358,036,570.11	75.42
	其中：债券	358,036,570.11	75.42
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	99,400,469.10	20.94
	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	13,198,275.20	2.78
4	其他各项资产	4,098,778.71	0.86

5	合计	474,734,093.12	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	0.23	
	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	—	—
	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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	130
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期
1	2017-06-29	130	巨额赎回	1

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	57.53	—

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	8.40	—
	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	2.08	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天（含）	31.33	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	99.34	—

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	209,787,714.17	44.28
	其中：政策性金融债	209,787,714.17	44.28
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	同业存单	148,248,855.94	31.29
8	其他	—	—

9	合计	358,036,570.11	75.58
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	160419	16农发19	1,500,000	149,944,817.26	31.65
2	111680684	16包商银行CD073	900,000	88,586,695.79	18.70
3	170204	17国开04	600,000	59,842,896.91	12.63
4	111604011	16中行CD011	400,000	39,810,198.42	8.40
5	111790270	17上海农商银行CD012	100,000	9,986,903.58	2.11
6	111790407	17苏州银行CD003	100,000	9,865,058.15	2.08

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。

7.7 “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	0.1011%
报告期内偏离度的最低值	-0.1013%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0490%

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	4,098,778.71
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	4,098,778.71

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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧骏盈货币A	400	45.53	10,199.89	56.01%	8,011.96	43.99%
中欧骏盈货币B	1	473,720,150.58	473,720,150.58	100.00%	—	—
合计	401	1,181,392.43	473,730,350.47	100.00%	8,011.96	0.00%

注：截止本报告期末，本基金机构投资者持有本基金的比例为99.9983%，个人投资者持有本基金的比例为0.0017%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

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	5,864.18	32.20%
	中欧骏盈货币B	—	—
	合计	5,864.18	—

注：截至本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金份额的合计比例为0.0012%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

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、基金投资和研发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	0~10
	中欧骏盈货币B	0
	合计	0~10

§ 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	15,895.65	8,150,135,073.09
本报告期基金总申购份额	3,158.64	124,333,489.19
减：本报告期基金总赎回份额	842.44	7,800,748,411.70
本报告期期末基金份额总额	18,211.85	473,720,150.58

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

本基金于2017年6月12日至2017年6月26日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2017年6月28日表决通过了《关于修改中欧骏盈货币市场基金基金合同有关事项的议案》，相关修订和更新后的文件于决议生效公告日的下一工作日生效，即2017年7月3日起生效。故不予在此份报告内进行详细披露。

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

证券											
国金证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	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，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

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	法定披露方式	法定披露日期
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	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-01

	值、基金份额净值和基金份额累计净值公告		
2	中欧骏盈货币市场基金2016年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-20
3	中欧骏盈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
4	中欧骏盈货币市场基金更新招募说明书（2017年第1号）	中国证监会指定报刊及网站	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）	中国证监会指定报刊及网站	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	中国证监会指定报刊及网站	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	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-22
8	中欧骏盈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	中欧骏盈货币市场基金2016年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-31
11	中欧骏盈货币市场基金2016年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-31
12	中欧骏盈货币市场基金2017年1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-21
13	中欧骏盈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	2017-05-03
14	中欧骏盈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
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	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-01

16	中欧骏盈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	2017-06-28
17	中欧基金管理有限公司关于中欧骏盈货币市场基金基金份额持有人大会决议生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-30
18	中欧骏盈货币市场基金基金合同（修订）	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-30
19	中欧骏盈货币市场基金托管协议（修订）	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-30

§ 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超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日至2017年6月30日	8,150,135,073.09	124,333,489.19	7,800,748,411.70	473,720,150.58	100.00%

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。

注：截止本报告期末，上表中的单一投资者持有本基金的比例为99.9962%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

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

二〇一七年八月二十九日