
中欧骏泰货币市场基金

2019年第4季度报告

2019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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2020年01月18日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年10月01日起至2019年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中欧骏泰货币
基金主代码	004039
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年12月19日
报告期末基金份额总额	13,262,019,345.36份
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。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年10月01日 - 2019年12月31日）
1. 本期已实现收益	81,079,878.37
2. 本期利润	81,079,878.37
3. 期末基金资产净值	13,262,019,345.36

注：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。

3.2 基金净值表现

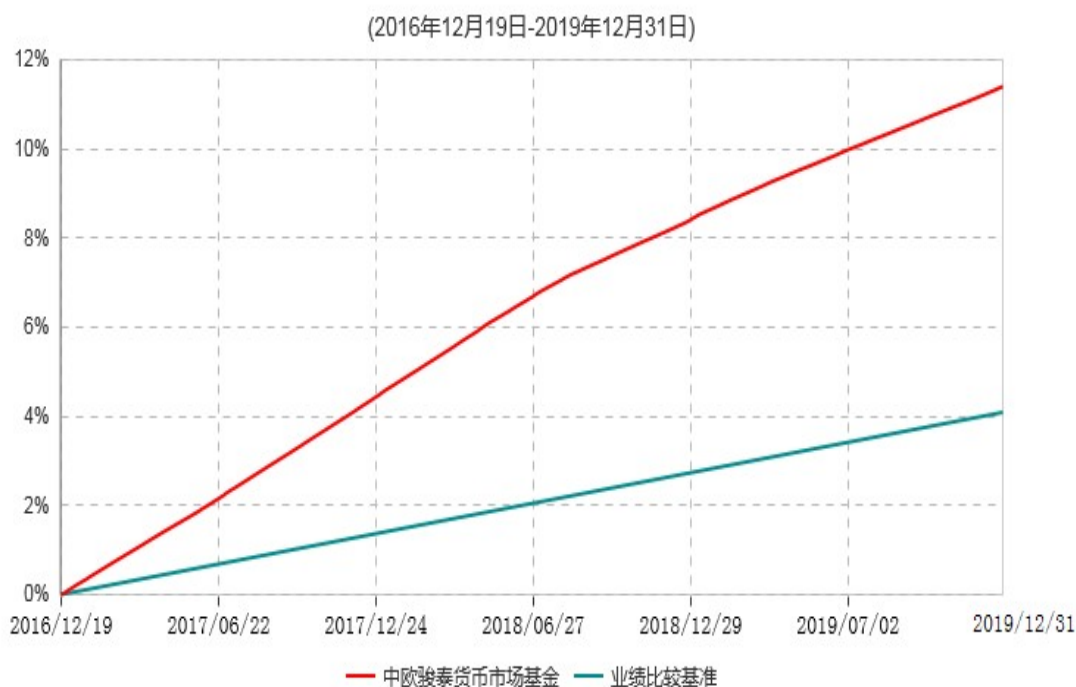
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率 ①	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	0.6565%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.3162%	0.0004%

注：本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 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

中欧骏泰货币市场基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
洪慧梅	基金经理	2019-08-16	-	12	历任平安资产管理有限责任公司债券交易员(2007.02-2009.04)，汇丰人寿保险股份有限公司债券交易主任(2009.05-2011.04)，浙商基金管理有限公司基金经理(2011.05-2016.03)，平安养老保险股份有限公司投资经理(2016.04-2019.06)。2019-07-01加入中欧

					基金管理有限公司
--	--	--	--	--	----------

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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年四季度，稳健的货币政策体现了逆周期调节的要求，金融服务实体经济的质量和效率逐步提升。经济仍然有较大下行压力，国际金融形势错综复杂。

货币市场方面，10月资金压力前松后紧，中下旬由于10月是缴税大月，导致资金利率上行突破3%，随后轻微回落，月底高位徘徊。存单市场收益率单边上行为明显，不少机构择机减仓，为年底腾出仓位，以及止损。11月5日，央行开展MLF操作4000亿元，中标利率为3.25%，较上期下降5个基点，MLF操作利率降息落地。随后货币市场资金重回宽松，存单收益率大幅下降，再也没有触碰之前高点。11月1年期LPR和5年期LPR报价分别随MLF价格变动下调5个基点，重申LPR和MLF挂钩，引导资金进入实体的重要性。央行于11月18日和12月18日分别下调7天和14天OMO利率5bp。12月中旬，央行共计投放6000亿14天OMO维护年底货币市场稳定。交易所市场也有大量跨年资金融出，整体来看跨年资金面非常宽松。

本基金在报告期间，兼顾流动性、控制风险的同时，择机配置跨年资产。以国股以及大型城商行的存单存款为主。日常操作中，利用稳定的负债优势，维持适度的久期，杠杆水平偏低，在保障投资者的流动性管理需求的基础上，适当提高收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金净值增长率为0.6565%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	6,583,177,107.45	47.30
	其中：债券	6,539,106,886.09	46.98
	资产支持证券	44,070,221.36	0.32
2	买入返售金融资产	3,674,579,751.88	26.40
	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	3,201,001,083.15	23.00
4	其他资产	458,747,258.72	3.30
5	合计	13,917,505,201.20	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	-	3.66
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	652,018,701.97	4.92
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

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。

5.3.2 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	28.54	4.92
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	4.74	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	35.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	0.61	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	32.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.48	4.92

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	710,916,641.25	5.36
	其中：政策性金融债	710,916,641.25	5.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,047,809,579.23	7.90
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,780,380,665.61	36.05
8	其他	-	-
9	合计	6,539,106,886.09	49.31
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 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

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	111911282	19平安银行CD282	5,000,000	496,731,594.12	3.75
2	170302	17进出02	2,100,000	210,390,125.34	1.59
3	190402	19农发02	2,000,000	199,944,947.86	1.51
4	011902196	19电网SCP007	2,000,000	199,363,264.29	1.50
5	111910117	19兴业银行CD117	2,000,000	198,835,384.31	1.50
6	111920208	19广发银行CD208	2,000,000	198,746,413.25	1.50
7	111911277	19平安银行CD277	2,000,000	198,721,394.06	1.50
8	111905207	19建设银行CD207	2,000,000	197,636,113.26	1.49
9	1119032	19农业银行CD	2,000,000	197,428,215	1.49

	02	202		. 35	
10	1119032 10	19农业银行CD 210	2, 000, 000	197, 295, 318 . 31	1. 49

5.7 “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	0.0368%
报告期内偏离度的最低值	-0.0003%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0085%

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%

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	138222	煦日03A1	300,000	30,000,000.00	0.23
2	1989319	19上和3A1_b c	500,000	14,070,221.36	0.11

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	38,704,555.22
4	应收申购款	420,042,703.50
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	458,747,258.72

5.9.4 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	12,744,658,226.68
报告期期间基金总申购份额	6,314,046,857.53
报告期期间基金总赎回份额	5,796,685,738.85
报告期期末基金份额总额	13,262,019,345.36

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2019-10-11	870,941.47	870,941.47	0
2	申赎	2019-10-15	130,000,000.00	130,000,000.00	0
3	申赎	2019-10-22	-10,006,910.14	-10,006,910.14	0
4	申赎	2019-11-07	100,000,000.00	100,000,000.00	0
5	申赎	2019-11-11	-100,177,441.82	-100,177,441.82	-
6	红利再投	2019-11-11	941,009.34	941,009.34	0
7	申赎	2019-11-21	-30,020,324.87	-30,020,324.87	0
8	申赎	2019-11-26	25,000,000.00	25,000,000.00	0
9	申赎	2019-11-28	-150,166,817.28	-150,166,817.28	-
10	申赎	2019-12-06	90,000,000.00	90,000,000.00	0

11	红利再投	2019-12-11	799,360.01	799,360.01	0
12	申赎	2019-12-19	-15,008,948.45	-15,008,948.45	0
13	申赎	2019-12-25	-30,031,245.04	-30,031,245.04	0
14	申赎	2019-12-30	-18,025,899.20	-18,025,899.20	0
15	申赎	2019-12-31	8,000,000.00	8,000,000.00	0
合计			2,173,724.02	2,173,724.02	

注：本基金管理人运用固有资金申赎（包含转换）本基金所适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定，上表中交易日期为2019年11月11日和2019年11月28日的适用费率均为固定费用1000元。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中欧骏泰货币市场基金相关批准文件
- 2、《中欧骏泰货币市场基金基金合同》
- 3、《中欧骏泰货币市场基金托管协议》
- 4、《中欧骏泰货币市场基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

9.3 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

2020年01月18日