

中欧骏泰货币市场基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 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

送出日期:2021 年 08 月 31 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。本中期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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月30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2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 中期财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 债券回购融资情况	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限	39
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	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	41
7.8 期末按摊余成本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	42
7.9 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4 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	44
§9 开放式基金份额变动	44

§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	46
10.9 其他重大事件	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧骏泰货币市场基金
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
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
报告期末基金份额总额	11,711,045,437.51份
基金合同存续期	不定期

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
		胡波
		021-61618888
		hub5@spdb.com.cn

客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95528
传真	021-33830351	021-63602540
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路333号五层	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码	200120	200001
法定代表人	窦玉明	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

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5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
	(2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	186,637,311.32
本期利润	186,637,311.32
本期净值收益率	1.2418%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末基金资产净值	11,711,045,437.51
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
累计净值收益率	15.3958%

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。
2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。
3. 本基金利润分配按日结转份额。
4. 上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

阶段	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	0.2005%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.0895%	0.0007%
过去三个月	0.5990%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.2624%	0.0006%
过去六个月	1.2418%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	0.5723%	0.0006%
过去一年	2.3850%	0.0009%	1.3481%	0.0000%	1.0369%	0.0009%
过去三年	8.1009%	0.0012%	4.0500%	0.0000%	4.0509%	0.0012%
自基金合同生效起至今	15.3958%	0.0024%	6.1174%	0.0000%	9.2784%	0.0024%

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



§ 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有限公司、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以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至2021年6月30日，本基金管理人共管理96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	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
洪慧梅	基金经理	2019-08-16	-	14年	历任平安资产管理有限责任公司债券交易员，汇丰人寿保险股份有限公司债券交易主任，浙商基金管理有限公司基金经理，平安养老保险股份有限公司投资经理。2019/07/01加入中欧基金管理有限公司。
张东波	基金经理助理	2018-10-23	-	6年	历任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员，中山证券有限责任公司资管事业部投资主办助理。2017/09/28加入中欧基金管理有限公司，历任基金经理助理。

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。

3、根据公司安排，张东波自2021年8月4日起不再担任该基金的基金经理助理。

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

本报告期内，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。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易共有2次，为量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

上半年中国经济依旧领先全球复苏。一季度央行操作全口径略有回笼，投放MLF共8000亿，回笼MLF和TMLF分别为6000亿和2405亿。整体资金利率呈小幅上行趋势，但依旧围绕政策利率附近波动。1月上旬，由于年底的大量投放，资金面呈宽松状态，债券收益率窄幅波动，下旬受资金面收紧，短期利率大幅上升。二三月总体资金面较为宽松平稳，债券收益率在二月下旬达到高点后，振荡下行，波动较小。二季度总体资金面保持平稳，4月缴税大月平稳度过，季末受跨季影响，跨季资金价格有所上行，预计二季度整体DR007仍在2.2附近。二季度大部分时间央行维持每日净投放100亿的操作，6月24日，央行4个月来首次打破逆回购百亿元惯例，证明央行OMO投放量的灵活度较高和维稳资金面的决心。7月7日，国务院常务会议决定，针对大宗商品价格上涨对企业生产经营的影响，要在坚持不搞大水漫灌的基础上，保持货币政策稳定性、增强有效性，适时运用降准等货币政策工具，进一步加强金融对实体经济特别是中小微企业的支持，促进综合融资成本稳中有降，货币政策以稳为主，继续保持合理充裕。

本基金在报告期间，兼顾流动性、控制风险的同时，择机配置优质资产。以大行、国有股份制银行的存单存款为主。日常操作中，维持适度的久期，杠杆水平中性，在保障投资者的流动性管理需求的基础上，适当提高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金净值增长率为1.2418%，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

下半年，世界经济形势仍旧严峻。疫情，尤其是新冠病毒变异毒株德尔塔，对下半年的经济增长带来了不确定性。总体上看，中央仍旧强调“房住不炒”，楼市降温，消费上近一年来我国各项消费指标呈回暖态势，但尚未恢复至疫情前水平，其中人均收入改善，但较疫情前仍有不小差距；失业率下降，但结构不均衡；消费需求不断恢复但进度始终偏弱。出口增长放缓也是下半年经济增长承压的一个重要因素。

下半年债券市场随着供给的增加，叠加国外货币政策层面的影响，会对收益率下行带来阻碍。然而国内经济增长依然有压力，在未见明显好转之前，为经营困难的中小企业创造更好的发展环境，货币政策方面难言急转弯，合理充裕，相机抉择仍是主基调，这对债券收益率的下行有所支撑。密切关注供给情况，货币市场边际变化对债券市场带来的影响。

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总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。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

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利润分配情况”。

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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中欧骏泰货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对中欧骏泰货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中欧骏泰货币市场基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,448,389,158.93	2,904,783,576.55
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	6,072,277,985.51	5,089,989,654.13
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,072,277,985.51	5,089,989,654.13
资产支持证券投资		-	-
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	3,590,214,545.32	4,062,965,154.45
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	37,706,260.99	26,656,594.18
应收股利		-	-
应收申购款		52,849,463.86	39,414.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,201,437,414.61	12,084,434,393.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		1,485,969,171.03	900,228,149.87
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,091.93	47,007.36
应付管理人报酬		2,961,375.00	2,174,278.74
应付托管费		616,953.16	452,974.79
应付销售服务费		123,390.64	90,594.95
应付交易费用	6.4.7.7	231,517.25	187,336.70
应交税费		140,382.53	55,882.15
应付利息		215,253.01	71,885.17

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	132,842.55	139,009.99
负债合计		1,490,391,977.10	903,447,119.72
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	11,711,045,437.51	11,180,987,273.60
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		11,711,045,437.51	11,180,987,273.60
负债和所有者权益总计		13,201,437,414.61	12,084,434,393.32

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值为人民币1.0000元，基金份额总额11,711,045,437.51份。

6.2 利润表

会计主体：中欧骏泰货币市场基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		210,913,645.01	176,932,327.46
1. 利息收入		206,803,056.95	174,803,554.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	58,907,322.23	52,425,123.03
债券利息收入		95,107,195.14	83,369,066.62
资产支持证券利息 收入		-	900,511.17
买入返售金融资产 收入		52,788,539.58	38,108,853.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		4,110,588.06	2,128,772.69

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	4,110,588.06	2,128,871.73
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-99.04
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		24,276,333.69	27,746,401.14
1. 管理人报酬		18,088,043.30	15,708,516.72
2. 托管费		3,768,342.36	3,272,607.61
3. 销售服务费		753,668.41	654,521.51
4. 交易费用	6.4.7.18	-27,570.00	202.34
5. 利息支出		1,427,947.35	7,844,692.38
其中：卖出回购金融资产 支出		1,427,947.35	7,844,692.38
6. 税金及附加		74,912.41	68,114.07
7. 其他费用	6.4.7.19	190,989.86	197,746.51
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		186,637,311.32	149,185,926.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		186,637,311.32	149,185,926.32

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧骏泰货币市场基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021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)	11,180,987,273.60	-	11,180,987,273.60
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	186,637,311.32	186,637,311.32
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)	530,058,163.91	-	530,058,163.91
其中：1. 基金申购款	25,000,548,001.35	-	25,000,548,001.35
2. 基金赎回款	-24,470,489,837.4 4	-	-24,470,489,837.44
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)	-	-186,637,311.32	-186,637,311.32
五、期末所有者权益 (基金净值)	11,711,045,437.51	-	11,711,045,437.51
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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)	13,262,019,345.36	-	13,262,019,345.36
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	149,185,926.32	149,185,926.32
三、本期基金份额交	373,766,439.08	-	373,766,439.08

易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	13,227,990,271.02	-	13,227,990,271.02
2. 基金赎回款	-12,854,223,831.94	-	-12,854,223,831.94
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)	-	-149,185,926.32	-149,185,926.32
五、期末所有者权益(基金净值)	13,635,785,784.44	-	13,635,785,784.44

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

中欧骏泰货币市场基金（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[2016]2837号《关于准予中欧骏泰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《中欧骏泰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人民币1,000,139,028.05元，经向中国证监会备案，《中欧骏泰货币市场基金基金合同》于2016年12月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,000,139,028.05份基金份额，其中包含认购资金利息折合135,000.05份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧骏泰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、期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金

融企业债务融资工具、资产支持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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2021年06月30日的财务状况以及2021年度中期的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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。

2. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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
	2021年06月30日
活期存款	3,389,158.93
定期存款	3,445,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	700,000,000.00
存款期限3个月以上	2,745,000,000.00
其他存款	-
合计	3,448,389,158.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2021年06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	6,072,277,985.51	6,075,737,000.00	3,459,014.49	0.0295
	合计	6,072,277,985.51	6,075,737,000.00	3,459,014.49	0.0295
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6,072,277,985.51	6,075,737,000.00	3,459,014.49	0.0295

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。

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 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	3,590,214,545.32	-
合计	3,590,214,545.32	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	996.82
应收定期存款利息	15,210,086.58
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	20,734,410.95
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,760,766.64
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

应收出借证券利息	-
其他	-
合计	37,706,260.99

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06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	231,517.25
合计	231,517.25

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	64,464.96
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	8,853.84
应付转出补差费	16.38
合计	132,842.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,180,987,273.60	11,180,987,273.60
本期申购	25,000,548,001.35	25,000,548,001.35
本期赎回（以“-”号填列）	-24,470,489,837.44	-24,470,489,837.44
本期末	11,711,045,437.51	11,711,045,437.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

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	186,637,311.32	-	186,637,311.32
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	-186,637,311.32	-	-186,637,311.32
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	52,534.55
定期存款利息收入	58,833,099.80
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	21,687.88
其他	-
合计	58,907,322.23

6.4.7.12 股票投资收益

无。

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 2021年01月01日至2021年06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	4,110,588.06
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	4,110,588.06

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 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	14,466,331,766.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	14,402,131,609.35
减：应收利息总额	60,089,569.11
买卖债券差价收入	4,110,588.06

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	-27,570.00
合计	-27,570.00

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	64,464.96
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	53,063.69
账户维护费	13,353.84
其他	600.00
合计	190,989.86

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本报告期内，未发生重大关联方关系变化的情况。

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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	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。

6.4.10 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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,088,043.30	15,708,516.72
其中：支付销售机构的客户维护费	730,011.92	213,337.97

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.24%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.24\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,768,342.36	3,272,607.61

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下：

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

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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 2021年01月01日至2021年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

中欧基金	646,787.58
合计	646,787.58
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中欧基金	629,545.00
合计	629,545.00

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.01%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径将资金支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,199,147,415.76	409,088,354.81
报告期间申购/买入总份额	2,243,064,213.64	756,465,864.66
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,714,332,649.12	908,774,967.10
报告期末持有的基金份额	727,878,980.28	256,779,252.37
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.22%	1.88%

注：

- 1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。
- 2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 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 2021年06月30日		上年度末 2020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
上海中欧财富基金销售有限公司	96,384,056.24	0.82%	5,857,628.54	0.05%

注：本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	3,389,158.93	52,534.55	391,722,302.54	7,173,730.92

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率/约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金

单位：人民币元

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	本期利润 分配合计	备注
186,637,311.32	-	-	186,637,311.32	-

注：资产负债表日之后，半年度报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项(附注：6.4.8.2)

6.4.12 期末（2021年06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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末2021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1,485,969,171.03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
110258	11国开58	2021-07-01	100.70	500,000	50,348,083.50
112015570	20民生银行CD570	2021-07-01	98.68	2,000,000	197,358,227.94
112104009	21中国银行CDO09	2021-07-02	98.90	2,000,000	197,799,086.57
112104011	21中国银行CDO11	2021-07-02	98.96	174,000	17,218,676.39
112106063	21交通银行CDO63	2021-07-01	98.87	111,000	10,975,058.13
112106063	21交通银行CDO63	2021-07-02	98.87	667,000	65,949,223.16
112107032	21招商银行CDO32	2021-07-02	98.88	500,000	49,442,378.65
112108018	21中信银行CDO18	2021-07-02	99.06	600,000	59,437,462.98
112115096	21民生银行CDO96	2021-07-01	99.35	2,000,000	198,709,155.31
112117041	21光大银行CDO41	2021-07-01	98.89	1,000,000	98,888,237.11
112117066	21光大银行CDO66	2021-07-01	97.97	444,000	43,500,581.97
112117066	21光大银行CDO66	2021-07-02	97.97	300,000	29,392,285.12
190309	19进出09	2021-07-01	100.31	2,000,000	200,611,152.95
200216	20国开16	2021-07-01	100.11	594,000	59,467,645.88
200309	20进出09	2021-07-01	100.05	500,000	50,022,950.36
200314	20进出14	2021-07-01	100.14	500,000	50,071,334.27

200409	20农发09	2021-07-01	100.12	200,000	20,023,589.83
210201	21国开01	2021-07-01	100.00	2,000,000	199,996,966.04
合计				16,090,000	1,599,212,096.16

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	200,012,326.75	0.00
A-1以下	-	-
未评级	2,290,198,776.15	988,489,272.62
合计	2,490,211,102.90	988,489,272.62

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未有三方评级的政策性金融债、超短期融资债券。3. 债券投资以成本价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	3,281,089,447.68	788,782,780.62
A-1以下	0.00	2,791,232,928.09
未评级	0.00	0.00
合计	3,281,089,447.68	3,580,015,708.71

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的主体评级。2. 债券投资以成本价列示。3. A-1为AAA，A-1以下为AAA以下。

6.4.13.2.4 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	上年度末
--------	-----	------

	2021年06月30日	2020年12月31日
AAA	-	0.00
AAA以下	-	0.00
未评级	300,977,434.93	521,484,672.80
合计	300,977,434.93	521,484,672.80

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上未有三方评级的政策性金融债。3. 债券投资以成本价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的同业存单。

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制的投资品种比例等。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%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2021年6月30日，本基金所承担的对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量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款及信用状况良好的固定收益类资产,其中银行存款主要为活期存款及可无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款,固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行的上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低,未对组合流动性造成重大影响,附注6.4.12披露的流通受限资产外,本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

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。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大,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 2021年06 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	3,248,389,158.93	200,000,000.00	-	-	-	3,448,389,158.93
交易性金融资产	5,058,090,505.33	1,014,187,480.18	-	-	-	6,072,277,985.51
买入返售金融资产	3,590,214,545.32	-	-	-	-	3,590,214,545.32
应收利息	-	-	-	-	37,706,260.99	37,706,260.99
应收申购款	-	-	-	-	52,849,463.86	52,849,463.86
资产总计	11,896,694,209.58	1,214,187,480.18	-	-	90,555,724.85	13,201,437,414.61
负债						
卖出回购金融资产款	1,485,969,171.03	-	-	-	-	1,485,969,171.03
应付赎回款	-	-	-	-	1,091.93	1,091.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,961,375.00	2,961,375.00
应付托管费	-	-	-	-	616,953.16	616,953.16
应付销售	-	-	-	-	123,390.64	123,390.64

服务费						
应付交易费用	-	-	-	-	231,517.25	231,517.25
应交税费	-	-	-	-	140,382.53	140,382.53
应付利息	-	-	-	-	215,253.01	215,253.01
其他负债	-	-	-	-	132,842.55	132,842.55
负债总计	1,485,969,171.03	-	-	-	4,422,806.07	1,490,391,977.10
利率敏感度缺口	10,410,725,038.55	1,214,187,480.18	-	-	86,132,918.78	11,711,045,437.51
上年度末 2020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	2,904,783,576.55	-	-	-	-	2,904,783,576.55
交易性金融资产	4,992,201,955.46	97,787,698.67	-	-	-	5,089,989,654.13
买入返售金融资产	4,062,965,154.45	-	-	-	-	4,062,965,154.45
应收利息	-	-	-	-	26,656,594.18	26,656,594.18
应收申购款	-	-	-	-	39,414.01	39,414.01
资产总计	11,959,950,686.46	97,787,698.67	-	-	26,696,008.19	12,084,434,393.32
负债						
卖出回购金融资产款	900,228,149.87	-	-	-	-	900,228,149.87
应付赎回款	-	-	-	-	47,007.36	47,007.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,174,278.74	2,174,278.74
应付托管费	-	-	-	-	452,974.79	452,974.79
应付销售服务费	-	-	-	-	90,594.95	90,594.95
应付交易费用	-	-	-	-	187,336.70	187,336.70
应交税费	-	-	-	-	55,882.15	55,882.15
应付利息	-	-	-	-	71,885.17	71,885.17
其他负债	-	-	-	-	139,009.99	139,009.99
负债总计	900,228,149.87	-	-	-	3,218,969.85	903,447,119.72
利率敏感度缺口	11,059,722,536.59	97,787,698.67	-	-	23,477,038.34	11,180,987,273.60

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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：人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日

利率下降25BP	5,145,453.27	4,255,838.28
利率上升25BP	-5,126,788.51	-4,241,069.26

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于2021年06月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为0.00%（2020年12月31日：0.00%），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（2020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

1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

1.2 以公允价值计量的金融工具

1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021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一层次的余额为0.00元，属于第二层次的余额为6,072,277,985.51元，第三层次的余额为0.00元（2020年12月31日：属于第一层的余额为0.00元，属于第二层次的余额为5,089,989,654.13元，属于第三层次的余额为0.00元）。

1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的交易性金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。

1.2.3 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金持有的交易性金融资产第三层次公允价值本期未发生变动。

2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重要承诺事项。

3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

4 财务报表的批准

本财务报表已于2021年8月30日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	6,072,277,985.51	46.00
	其中：债券	6,072,277,985.51	46.00
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,590,214,545.32	27.20
	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	3,448,389,158.93	26.12
4	其他各项资产	90,555,724.85	0.69
5	合计	13,201,437,414.61	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.08	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例

			(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,485,969,171.03	12.69
	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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

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	40.50	12.69
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	8.53	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	13.86	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	14.25	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
5	120天(含)—397天(含)	34.81	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	111.95	12.69

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	681,160,604.60	5.82
	其中：政策性金融债	681,160,604.60	5.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,110,027,933.23	18.02
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,281,089,447.68	28.02
8	其他	-	-
9	合计	6,072,277,985.51	51.85
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	012101281	21中石化SCP005	2,500,000	249,981,964.64	2.13
2	190309	19进出09	2,000,000	200,611,152.95	1.71
3	012100849	21粤能源SCP001	2,000,000	200,070,089.73	1.71
4	012100725	21中油股SCP001	2,000,000	200,057,669.20	1.71
5	210201	21国开01	2,000,000	199,996,966.04	1.71
6	012101877	21邮政SCP008	2,000,000	199,979,304.09	1.71
7	112118034	21华夏银行CD034	2,000,000	199,118,540.49	1.70
8	112115096	21民生银行CD096	2,000,000	198,709,155.31	1.70
9	112104009	21中国银行CD009	2,000,000	197,799,086.57	1.69
10	112104019	21中国银行CD019	2,000,000	197,486,900.61	1.69

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0826%
报告期内偏离度的最低值	-0.0180%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0385%

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 期末按摊余成本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1.0000元。

7.9.2 本基金投资的21华夏银行CD034(总价)的发行主体华夏银行股份有限公司于2020-10-20受到国家外汇管理局北京外汇管理部的京汇罚(2020)28号，于2021-05-17受到中国银行保险监督管理委员会的银保监罚决字(2021)19号。罚款合计9930万元。本基金投资的21民生银行CD096(总价)、20民生银行CD570(总价)的发行主体中国民生银行股份有限公司于2020-07-14受到银保监罚决字(2020)43号，于2020-11-26受到国家外汇管理局北京外汇管理部的京汇罚(2020)44号。罚没合计11054万元。本基金投资的21中国银行CD009(总价)、21中国银行CD019(总价)的发行主体中国银行股份有限公司于2020-12-01受到银保监罚决字(2020)60号，于2021-05-17受到银保监罚决字(2021)11号。罚没合计13811万元人民币。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有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	37,706,260.99
4	应收申购款	52,849,463.86
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	90,555,724.85

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

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
1,849	6,333,718.46	11,684,931,435.26	99.78%	26,114,002.25	0.22%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	基金类机构	727,878,980.28	6.22%
2	银行类机构	524,692,589.30	4.48%
3	银行类机构	514,170,128.84	4.39%
4	券商类机构	512,688,115.70	4.38%
5	券商类机构	511,767,786.20	4.37%
6	银行类机构	505,463,531.91	4.32%
7	券商类机构	432,761,868.82	3.70%
8	银行类机构	422,251,258.93	3.61%
9	银行类机构	407,085,377.93	3.48%
10	银行类机构	405,547,132.08	3.46%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	870,516.14	0.01%

8.4 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月19日)基金份额总额	1,000,139,028.05
本报告期期初基金份额总额	11,180,987,273.60
本报告期基金总申购份额	25,000,548,001.35
减：本报告期基金总赎回份额	24,470,489,837.44
本报告期期末基金份额总额	11,711,045,437.51

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**

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未发生重大的人事变动。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

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

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 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	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，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	2,346,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	中欧骏泰货币市场基金暂停代销渠道大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-13
2	中欧骏泰货币市场基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
3	中欧骏泰货币市场基金暂停代销渠道申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-02-05
4	中欧基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2021-02-22

	中欧骏泰货币市场基金调整代销渠道大额申购等交易限额的公告		
5	中欧基金管理有限公司关于中欧骏泰货币市场基金调整代销渠道大额申购等交易限额的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-30
6	中欧骏泰货币市场基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
7	中欧基金管理有限公司关于中欧骏泰货币市场基金调整代销渠道大额申购等交易限额的公告	中国证监会指定媒介	2021-04-08
8	中欧骏泰货币市场基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
9	中欧骏泰货币市场基金暂停代销渠道申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-04-27

§ 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

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。

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媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的住所。

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及基金托管人的住所免费查阅。

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
二〇二一年八月三十一日