

中欧骏泰货币市场基金

2021 年年度报告

2021 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

送出日期:2022 年 03 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3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。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 债券回购融资情况	49
8.3 基金投资组合平均剩余期限	49
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	51
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	52
8.8 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	52
8.9 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息	53

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
9.4 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.....	54
§10 开放式基金份额变动.....	54
§11 重大事件揭示.....	55
11.1 基金份额持有人大会决议.....	55
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
11.4 基金投资策略的改变.....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	57
11.9 其他重大事件.....	57
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
12.1 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.....	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§13 备查文件目录.....	60
13.1 备查文件目录.....	60
13.2 存放地点.....	60
13.3 查阅方式.....	60

§ 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	15,877,066,940.67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479号8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479号上海中心大厦8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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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479号8层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年	2019年
---------------	-------	-------	-------

本期已实现收益	357,411,766.49	266,838,294.58	360,006,924.61
本期利润	357,411,766.49	266,838,294.58	360,006,924.61
本期净值收益率	2.4157%	2.2956%	2.7409%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末基金资产净值	15,877,066,940.67	11,180,987,273.60	13,262,019,345.36
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
累计净值收益率	16.7338%	13.9804%	11.4225%

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

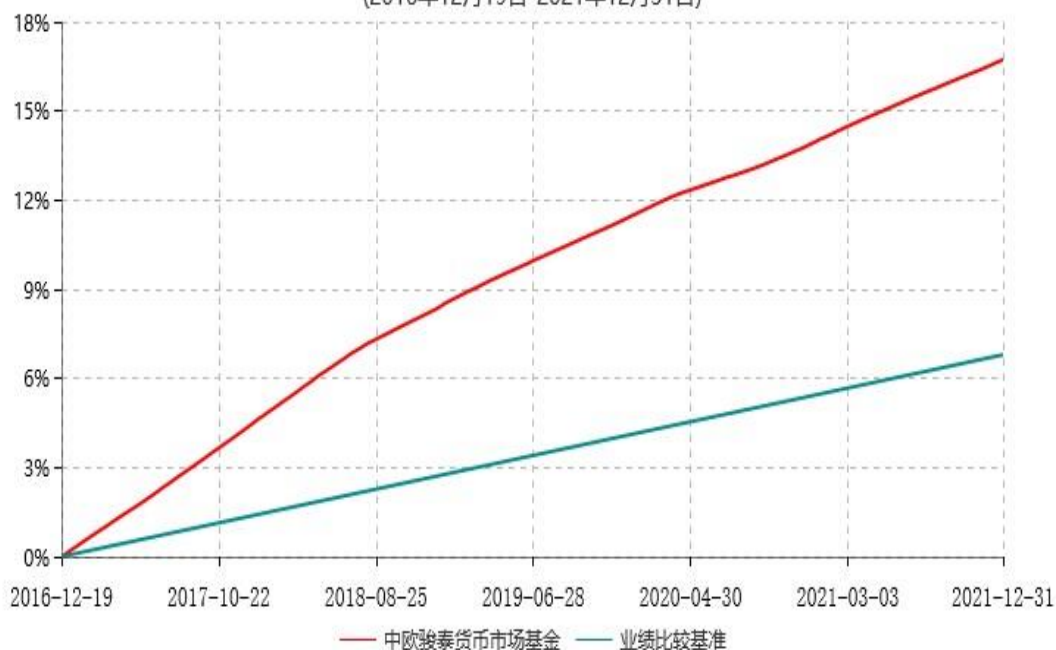
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5854%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.2451%	0.0007%
过去六个月	1.1595%	0.0008%	0.6805%	0.0000%	0.4790%	0.0008%
过去一年	2.4157%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	1.0657%	0.0008%
过去三年	7.6382%	0.0010%	4.0500%	0.0000%	3.5882%	0.0010%
过去五年	16.5680%	0.0024%	6.7500%	0.0000%	9.8180%	0.0024%

					0%	4%
自基金合同生效起至今	16.7338%	0.0024%	6.7980%	0.0000%	9.9358%	0.0024%

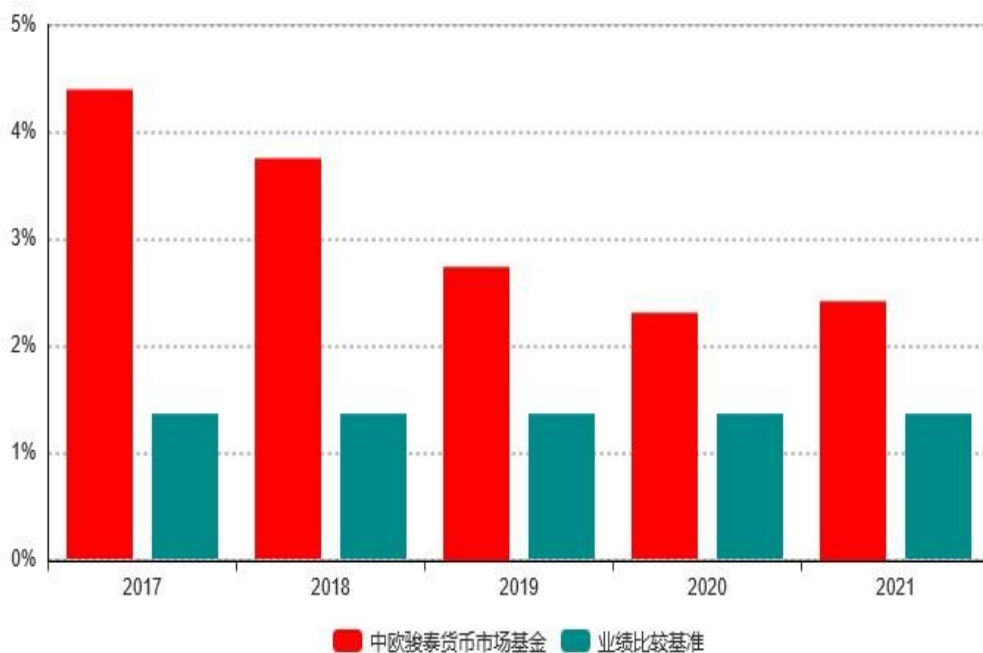
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

(2016年12月19日-2021年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2021年	357,411,76 6.49	-	-	357,411,76 6.49	-
2020年	266,838,29 4.58	-	-	266,838,29 4.58	-
2019年	360,006,92 4.61	-	-	360,006,92 4.61	-
合计	984,256,98 5.68	-	-	984,256,98 5.68	-

§ 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、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12月31日，本基金管理人共管理106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		
张东波	基金经理	2021-08-04	-	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。
洪慧梅	基金经理	2019-08-16	2021-10-11	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	2021-08-04	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。
--	--	--	--	--	---------------------------

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

4.3.2 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相关法规及制度等规定，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。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占优比、溢价率等进行综合分析，来判断是否存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，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。

4.3.3 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32次，为量化组合因投资策略需要发生的反向交易，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

2021年债券市场整体为震荡慢牛行情，基本面修复整体呈现“前高后低”的特征，PPI持续走高，经济整体承压，还未从疫情中完全恢复，疫情仍然遵从“动态清零”原则，对市场影响逐渐钝化。货币政策方面，维持适度宽松，助力经济恢复和宽信用更好的传导。二季度之后资金面维持平稳，三季度后降准落地，宽松加码，流动性充裕为全年的行情打下了基础。

受经济下行压力影响，对地产的政策逐步放松。伴随房地产企业违约的出现，政策上也对之前过于严格的监管进行纠偏，但房地产是否已彻底出清仍有待观察，谨防风险仍是第一要务。

2021年7月和12月两次降准各0.5个百分点，共释放长期资金2.2万亿元。除年初资金面短暂紧张时点以外，今年资金面在央行灵活精准调控下，持续处于平稳状态，降准没有带来资金价格回到疫情初始的低位，同时，通胀上行没有成为制约货币政策的因素，银行间流动性合理充裕，DR007围绕政策利率中枢2.20%上下波动。

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2.4157%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，宽信用诉求强烈，房地产政策趋松，货币政策需要积极配合，银行间流动性稳中偏宽松，但受美国加息预期影响，宽松窗口变小，最宽松的时间或已过去。国内通胀仍处于可控区间，目前通胀对于货币政策的约束有限，要注意观察后续大宗商

品的价格走势和向下游传导情况。预判上半年流动性大概率仍保持宽松，下半年需要观察宽信用的效果。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2021年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后第一时间通过电子邮件向相关部门和员工传达了有关内容。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读；同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、风险案例研讨、员工合规测试等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2021年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年共制订或修订制度流程55项，内容涵盖投资研究、合规管理、信息技术、反洗钱等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2021年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第61362990_B02号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧骏泰货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中欧骏泰货币市场基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的中欧骏泰货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中欧骏泰货币市场基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧骏泰货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中欧骏泰货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此

	<p>过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估中欧骏泰货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督中欧骏泰货币市场基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价管理层选用会计政策的恰当</p>

	性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对中欧骏泰货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中欧骏泰货币市场基金不能持续经营。(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈露、张亚旋
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2022-03-30

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,154,438,311.61	2,904,783,576.55

结算备付金		-	-
存出保证金		8,879.43	-
交易性金融资产	7.4.7.2	8,607,351,840.15	5,089,989,654.13
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,607,351,840.15	5,089,989,654.13
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	4,834,208,651.30	4,062,965,154.45
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	20,024,319.56	26,656,594.18
应收股利		-	-
应收申购款		111,002.27	39,414.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		17,616,143,004.32	12,084,434,393.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,734,816,232.59	900,228,149.87
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		22,078.17	47,007.36
应付管理人报酬		2,876,703.51	2,174,278.74
应付托管费		599,313.27	452,974.79
应付销售服务费		119,862.65	90,594.95
应付交易费用	7.4.7.7	261,155.21	187,336.70

应交税费		85,064.09	55,882.15
应付利息		156,634.30	71,885.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	139,019.86	139,009.99
负债合计		1,739,076,063.65	903,447,119.72
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	15,877,066,940.67	11,180,987,273.60
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		15,877,066,940.67	11,180,987,273.60
负债和所有者权益总计		17,616,143,004.32	12,084,434,393.32

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值为人民币1.0000元，基金份额总额15,877,066,940.67份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
一、收入		408,599,062.89	314,213,398.25
1. 利息收入		401,437,606.40	312,795,051.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	103,590,523.41	95,452,133.64
债券利息收入		191,707,095.23	143,458,832.88
资产支持证券利息收入		-	1,013,634.39
买入返售金融资产收入		106,139,987.76	72,870,451.05
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,161,456.49	1,416,383.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	7,161,456.49	1,416,482.09
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-99.04
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	1,963.24
减：二、费用		51,187,296.40	47,375,103.67
1. 管理人报酬		36,028,416.33	28,413,500.94
2. 托管费		7,505,920.08	5,919,479.40
3. 销售服务费		1,501,183.97	1,183,895.87
4. 交易费用	7.4.7.18	-21,320.00	202.34
5. 利息支出		5,621,426.30	11,368,496.60
其中：卖出回购金融资产 支出		5,621,426.30	11,368,496.60
6. 税金及附加		148,455.33	94,479.52
7. 其他费用	7.4.7.19	403,214.39	395,049.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		357,411,766.49	266,838,294.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		357,411,766.49	266,838,294.58

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	357,411,766.49	357,411,766.49
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)	4,696,079,667.07	-	4,696,079,667.07
其中：1. 基金申购款	53,437,937,976.51	-	53,437,937,976.51
2. 基金赎回款	-48,741,858,309.44	-	-48,741,858,309.44
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)	-	-357,411,766.49	-357,411,766.49
五、期末所有者权益(基金净值)	15,877,066,940.67	-	15,877,066,940.67
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权	13,262,019,345.36	-	13,262,019,345.36

益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	266,838,294.58	266,838,294.58
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)	-2,081,032,071.76	-	-2,081,032,071.76
其中: 1. 基金申购款	27,071,498,089.38	-	27,071,498,089.38
2. 基金赎回款	-29,152,530,161.14	-	-29,152,530,161.14
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)	-	-266,838,294.58	-266,838,294.58
五、期末所有者权益(基金净值)	11,180,987,273.60	-	11,180,987,273.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中欧骏泰货币市场基金(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。

7.4.2 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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

本基金的金融资产于初始确认时分类为交易性金融资产及贷款和应收款项。本基金持有的交易性金融资产主要包括债券投资等。

本基金的金融负债于初始确认时分类为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

（2）回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以使用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金持有的金融工具的估值方法具体如下：

（1） 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

（2） 债券投资

本基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

（3） 回购协议

1) 本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

2) 本基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

（4） 其他

1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

3) 如有新增事项, 按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利, 且该种法定权利现在是可执行的, 同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外, 金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示, 不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款, 按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入, 并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失, 列入利息收入减项, 存款利息收入以净额列示。另外, 根据中国证监会令第120号《货币市场基金监督管理办法》的规定, 如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形, 基金管理人应当使用风险准备金予以弥补, 风险准备金不足的, 应当使用自有资金予以弥补;

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本, 每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额, 扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认, 在证券实际持有期内逐日计提;

(4) 买入返售金融资产收入, 按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率), 在回购期内逐日计提;

(5) 债券投资收益/损失于卖出债券成交日确认, 并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账;

(6) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认, 并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 其他收入 在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.10 基金的收益分配政策

- (1) 本基金每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- (3) “每日分配、按日支付”。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，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；
- (4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
- (5) 本基金每日对当天实现的收益进行收益结转，如投资者的累计未结转收益为正，则为基金份额持有人增加相应的基金份额；如投资者的累计未结转收益为负，则为基金份额持有人缩减相应的基金份额，当投资人赎回基金份额时，将按比例从赎回款中扣除，剩余部分缩减投资人的基金份额；如投资者的累计未结转收益等于零时，基金份额持有人的基金份额保持不变；
- (6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；
- (7) 在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；
- (8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	4,438,311.61	4,783,576.55
定期存款	4,150,000,000.00	2,900,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-	200,000,000.00
存款期限1-3个月	100,000,000.00	-
存款期限3个月以上	4,050,000,000.00	2,700,000,000.00
其他存款	-	-
合计	4,154,438,311.61	2,904,783,576.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31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	8,607,351,840.15	8,613,010,000.00	5,658,159.85	0.0356
	合计	8,607,351,840.15	8,613,010,000.00	5,658,159.85	0.0356
资产支持证券		-	-	-	-

合计		8,607,351,840. 15	8,613,010,000. 00	5,658,159.8 5	0.0356
项目		上年度末 2020年12月31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	5,089,989,654. 13	5,098,035,000. 00	8,045,345.8 7	0.0720
	合计	5,089,989,654. 13	5,098,035,000. 00	8,045,345.8 7	0.0720
资产支持证券		-	-	-	-
合计		5,089,989,654. 13	5,098,035,000. 00	8,045,345.8 7	0.0720

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	4,834,208,651.30	-
合计	4,834,208,651.30	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	200,000,000.00	-
银行间市场	3,862,965,154.45	-
合计	4,062,965,154.45	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券
无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	18,268.94	6,164.25
应收定期存款利息	11,603,348.98	9,470,806.22
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	6,932,195.06	15,692,329.17
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	1,470,502.18	1,487,294.54
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	4.40	-
合计	20,024,319.56	26,656,594.18

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-

银行间市场应付交易费用	261,155.21	187,336.70
合计	261,155.21	187,336.70

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	130,000.00	130,000.00
预提费用-账户维护费	9,000.00	9,000.00
应付转出补差费	19.86	9.99
合计	139,019.86	139,009.99

7.4.7.9 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12月31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	53,437,937,976.51	53,437,937,976.51
本期赎回（以“-”号填列）	-48,741,858,309.44	-48,741,858,309.44
本期末	15,877,066,940.67	15,877,066,940.67

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	357,411,766.49	-	357,411,766.49
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	-357,411,766.49	-	-357,411,766.49
本期末	-	-	-

7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	97,324.74	2,142,532.76
定期存款利息收入	103,471,445.53	93,137,125.78
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	21,687.88	171,278.10
其他	65.26	1,197.00
合计	103,590,523.41	95,452,133.64

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31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	7,161,456.49	1,416,482.09
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	7,161,456.49	1,416,482.09

7.4.7.13.2 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12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	32,547,809,184.56	22,987,897,439.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	32,408,509,412.11	22,877,097,605.27
减：应收利息总额	132,138,315.96	109,383,351.78
买卖债券差价收入	7,161,456.49	1,416,482.09

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	142,953,584.63
减：卖出资产支持证券成本总额	-	142,070,099.04
减：应收利息总额	-	883,584.63
资产支持证券投资收益	-	-99.04

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

无。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	1,963.24
合计	-	1,963.24

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	-21,320.00	202.34
合计	-21,320.00	202.34

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	130,000.00	130,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	120,964.39	107,849.00
账户维护费	31,500.00	36,000.00

其他	750.00	1,200.00
合计	403,214.39	395,049.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”）	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a（“意大利意联银行”）	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海睦亿合伙”）	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司（“中欧盛世资管”）	基金管理人的全资子公司
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
中欧基金国际有限公司（“中欧国际”）	基金管理人的全资子公司

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、经中国证券监督管理委员会批准，公司原股东北京百骏投资有限公司将其持有的公司 20%股权转让给自然人股东窦玉明先生，本次股权变更的工商变更登记手续已于 2021年7月27日办理完毕。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	36,028,416.33	28,413,500.94
其中：支付销售机构的客户维护费	1,288,536.82	381,761.39

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,505,920.08	5,919,479.40

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。

7.4.10.2.3 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12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国都证券	0.65
中欧基金	1,313,665.94
合计	1,313,666.59
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12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中欧基金	1,138,060.07
合计	1,138,060.07

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31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	3,760,070,512.64	1,922,847,283.77
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	3,310,368,073.56	1,132,788,222.82
报告期末持有的基金份额	1,648,849,854.84	1,199,147,415.76
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.39%	10.72%

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。

7.4.10.5.2 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12月31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
上海浦东发展银行股份有限公司	400,086,995.62	2.52%	0.00	0.0000%
上海中欧财富基金销售有限公司	204,111,157.61	1.29%	5,857,628.54	0.05%
中欧盛世资产管理(上海)有限公司	25,038,648.49	0.16%	0.00	0.0000%

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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	404,438,311.61	2,833,464.05	4,783,576.55	11,372,588.35

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有500,000张上海浦东发展银行股份有限公司发行的同业存单，成本总额为人民币50,000,000.00元，估值总额为人民币49,737,206.25元，占基金资产净值的比例为0.31%（于2020年12月31日，本基金未持有上海浦东发展银行股份有限公司发行的同业存单）。

7.4.11 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
357,411,766.49	-	-	357,411,766.49	-

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,734,816,232.59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
012103549	21南航股SCP027	2022-01-04	100.07	958,000	95,869,445.54

012103933	21电网SCP024	2022-01-04	99.95	873,000	87,260,648.12
012105011	21沪电力SCP018	2022-01-04	99.96	108,000	10,795,200.57
012105241	21电网SCP027	2022-01-04	99.91	2,000,000	199,821,956.57
112105035	21建设银行CD035	2022-01-04	99.54	1,857,000	184,852,472.51
112105108	21建设银行CD108	2022-01-04	98.98	1,500,000	148,464,765.64
112108050	21中信银行CD050	2022-01-04	99.47	1,000,000	99,466,812.91
112110357	21兴业银行CD357	2022-01-04	98.93	577,000	57,082,860.98
112111120	21平安银行CD120	2022-01-04	99.19	1,000,000	99,194,937.70
112115396	21民生银行CD396	2022-01-04	99.37	1,382,000	137,332,618.03
112118331	21华夏银行CD331	2022-01-04	98.71	2,000,000	197,427,519.31
112121377	21渤海银行CD377	2022-01-04	97.95	500,000	48,976,899.92
112121439	21渤海银行CD439	2022-01-04	98.92	1,333,000	131,857,689.94
112121460	21渤海银行CD460	2022-01-04	98.79	1,559,000	154,010,828.87
112121475	21渤海银行CD475	2022-01-04	98.70	1,000,000	98,698,259.23
219962	21贴现国债62	2022-01-04	99.49	1,386,000	137,895,170.68
合计				19,033,000	1,889,008,086.52

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。本基金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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	-	-
未评级	1,797,193,547.37	988,489,272.62
合计	1,797,193,547.37	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国债、政策性金融债、超短期融资债券。3. 债券投资以成本价列示。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	6,810,158,292.78	3,580,015,708.71
A-1以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	6,810,158,292.78	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。

7.4.13.2.4 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA以下	0.00	0.00
未评级	0.00	521,484,672.80
合计	0.00	521,484,672.80

本期末基金未持有长期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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10%。除附注7.4.12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12月31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约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。

7.4.13.3.1 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提前支取的银行存款，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7.4.12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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	3,554,438,311.61	600,000,000.00	-	-	-	4,154,438,311.61
存出保证金	8,879.43	-	-	-	-	8,879.43
交易性金融资产	8,312,734,564.72	294,617,275.43	-	-	-	8,607,351,840.15
买入返售金融资产	4,834,208,651.30	-	-	-	-	4,834,208,651.30
应收利息	-	-	-	-	20,024,319.56	20,024,319.56
应收申购款	-	-	-	-	111,002.27	111,002.27
资产总计	16,701,390,407.06	894,617,275.43	-	-	20,135,321.83	17,616,143,004.32
负债						
卖出回购金融资产款	1,734,816,232.59	-	-	-	-	1,734,816,232.59
应付赎回款	-	-	-	-	22,078.17	22,078.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,876,703.51	2,876,703.51
应付托管费	-	-	-	-	599,313.27	599,313.27
应付销售服务费	-	-	-	-	119,862.65	119,862.65
应付交易费用	-	-	-	-	261,155.21	261,155.21
应交税费	-	-	-	-	85,064.09	85,064.09
应付利息	-	-	-	-	156,634.30	156,634.30
其他负债	-	-	-	-	139,019.86	139,019.86
负债总计	1,734,816,232.59	-	-	-	4,259,831.06	1,739,076,063.65
利率敏感度缺口	14,966,574,174.47	894,617,275.43	-	-	15,875,490.77	15,877,066,940.67
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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	利率下降25BP	6,731,395.01	4,255,838.28
	利率上升25BP	-6,708,550.55	-4,241,069.26

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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固定收益品种，因此无重大市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于2021年12月31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)。

7.4.14 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12月31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8,607,351,840.15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 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具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,本基金无需要说明的承诺事项。

3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

除上述事项外,截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

4 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月30日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	8,607,351,840.15	48.86
	其中：债券	8,607,351,840.15	48.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,834,208,651.30	27.44
	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	4,154,438,311.61	23.58
4	其他各项资产	20,144,201.26	0.11
5	合计	17,616,143,004.32	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.77	
	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	1,734,816,232.59	10.93
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	88

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	30.66	10.93
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.83	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	37.78	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	10.89	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	28.66	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.83	10.93

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	587,423,803.95	3.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,038,680.16	1.45
	其中：政策性金融债	230,038,680.16	1.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	979,731,063.26	6.17
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,810,158,292.78	42.89
8	其他	-	-
9	合计	8,607,351,840.15	54.21
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	112115396	21民生银行CD396	7,000,000	695,606,603.62	4.38
2	112120299	21广发银行CD299	4,000,000	394,855,038.67	2.49
3	219962	21贴现国债62	2,900,000	288,525,248.89	1.82
4	210206	21国开06	2,000,000	200,038,149.91	1.26
5	012103933	21电网SCP024	2,000,000	199,909,846.78	1.26
6	012105241	21电网SCP027	2,000,000	199,821,956.57	1.26

7	219960	21贴现国债60	2,000,000	199,204,361.4 2	1.25
8	112104014	21中国银行CD0 14	2,000,000	199,099,614.9 3	1.25
9	112105035	21建设银行CD0 35	2,000,000	199,087,207.8 7	1.25
10	112111275	21平安银行CD2 75	2,000,000	198,754,219.2 8	1.25

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	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	0.0331%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%

8.8 期末按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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.0000元。

8.9.2 本基金投资的21平安银行CD275的发行主体平安银行股份有限公司于2021-05-28受到云南银保监局的云银保监罚决字〔2021〕34号，于2021-09-29受到国家外汇管理局

深圳市分局的深外管检[2021]40号。罚没合计398.58万元人民币。本基金投资的21建设银行CD035的发行主体中国建设银行股份有限公司于2021-08-13受到央行的银罚字(2021)22号。罚没合计388.00万元人民币。本基金投资的21民生银行CD396的发行主体中国民生银行股份有限公司于2021-07-13受到银保监会的银保监罚决字(2021)26号。罚没合计11450.00万元人民币。本基金投资的21中国银行CD014的发行主体中国银行股份有限公司于2021-05-17受到银保监会的银保监罚决字(2021)11号。罚没合计8761.35万元人民币。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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,879.43
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,024,319.56
4	应收申购款	111,002.27
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,144,201.26

8.9.4 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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	持有份额	占总份

			额比例		额比例
1,381	11,496,789.96	15,831,417,979.06	99.71%	45,648,961.61	0.29%

9.2 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	1,648,849,854.84	10.39%
2	银行类机构	707,467,349.80	4.46%
3	券商类机构	638,684,132.35	4.02%
4	银行类机构	530,772,337.23	3.34%
5	券商类机构	518,628,764.71	3.27%
6	银行类机构	500,498,227.76	3.15%
7	银行类机构	500,304,899.30	3.15%
8	信托类机构	500,108,744.52	3.15%
9	银行类机构	410,246,311.06	2.58%
10	银行类机构	409,984,657.97	2.58%

9.3 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	650,764.98	0.00%

注：截止本报告期末，基金管理人的从业人员持有本基金的实际比例为0.0041%，上表展示的比例均系四舍五入后的结果。

9.4 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、基金投资和研究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

§ 10 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	53,437,937,976.51
减：本报告期基金总赎回份额	48,741,858,309.44
本报告期期末基金份额总额	15,877,066,940.67

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2017年12月30日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为130,000.00元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		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	-	-	-	-	-
国都证券	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，本基金新增租用国都证券上海交易单元。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-

国都证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	121,024,26 5.78	100.0 0%	2,346,000,0 00.00	100.0 0%	-	-	-	-

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，本基金新增租用国都证券上海交易单元。

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况。

11.9 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	中欧基金管理有限公司旗下 部分基金2020年第四季度报 告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
4	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
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	中国证监会指定媒介	2021-02-22

	代销渠道大额申购等交易限额的公告		
6	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
7	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
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
9	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
10	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
11	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
12	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
13	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-07-21
14	中欧骏泰货币市场基金2021年第二季度报告	中国证监会指定媒介	2021-07-21
15	中欧骏泰货币市场基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2021-08-05
16	中欧骏泰货币市场基金更新招募说明书（2021年8月）	中国证监会指定媒介	2021-08-09
17	中欧骏泰货币市场基金基金	中国证监会指定媒介	2021-08-09

	产品资料概要更新		
18	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
19	中欧骏泰货币市场基金2021年中期报告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
20	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	2021-09-14
21	中欧基金管理有限公司办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2021-09-17
22	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	2021-09-27
23	中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定媒介	2021-09-30
24	中欧骏泰货币市场基金资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021-09-30
25	中欧骏泰货币市场基金基金经理变更公告	中国证监会指定媒介	2021-10-12
26	中欧骏泰货币市场基金更新招募说明书（2021年10月）	中国证监会指定媒介	2021-10-14
27	中欧骏泰货币市场基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021-10-14
28	中欧骏泰货币市场基金更新招募说明书（2021年10月）	中国证监会指定媒介	2021-10-22
29	中欧骏泰货币市场基金2021年第三季度报告	中国证监会指定媒介	2021-10-27
30	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-10-27
31	中欧骏泰货币市场基金暂停代销渠道大额申购、转换转	中国证监会指定媒介	2021-12-03

	入、定期定额投资业务公告		
32	中欧骏泰货币市场基金恢复大额申购、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	2021-12-14
33	中欧骏泰货币市场基金暂停代销渠道大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会指定媒介	2021-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所。

13.3 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
二〇二二年三月三十一日