

# 中欧骏泰货币市场基金 2023 年第 2 季度报告

2023 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 21 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 2023 年 07 月 20 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 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 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	32,496,189,011.54 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			
下属分级基金的基金简称	中欧骏泰货币 A	中欧骏泰货币 B	中欧骏泰货币 C	中欧骏泰货币 D
下属分级基金的交易代码	016224	004039	017538	017539
报告期末下属分级基金的份额总额	24,110,546,049.77 份	8,336,480,243.29 份	493,449.23 份	48,669,269.25 份

## § 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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）			
	中欧骏泰货币 A	中欧骏泰货币 B	中欧骏泰货币 C	中欧骏泰货币 D
1. 本期已实现收益	112,323,732.60	56,943,353.77	2,076.10	122,162.51
2. 本期利润	112,323,732.60	56,943,353.77	2,076.10	122,162.51
3. 期末基金资产净值	24,110,546,049.77	8,336,480,243.29	493,449.23	48,669,269.25

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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

中欧骏泰货币 A

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	0.4768%	0.0015%	0.3366%	0.0000%	0.1402%	0.0015%
过去六个月	0.9348%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	0.2653%	0.0015%
自基金份额 运作日至今	1.6396%	0.0014%	1.2760%	0.0000%	0.3636%	0.0014%

注：本基金收益分配按日结转份额。

中欧骏泰货币 B

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	0.5368%	0.0015%	0.3366%	0.0000%	0.2002%	0.0015%
过去六个月	1.0541%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	0.3846%	0.0015%
过去一年	1.9712%	0.0014%	1.3500%	0.0000%	0.6212%	0.0014%
过去三年	6.7826%	0.0011%	4.0481%	0.0000%	2.7345%	0.0011%
过去五年	12.7439%	0.0014%	6.7500%	0.0000%	5.9939%	0.0014%
自基金合同 生效起至今	20.3521%	0.0025%	8.8174%	0.0000%	11.5347%	0.0025%

注：本基金收益分配按日结转份额。

中欧骏泰货币 C

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	0.4769%	0.0015%	0.3366%	0.0000%	0.1403%	0.0015%
过去六个月	0.9352%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	0.2657%	0.0015%
自基金份额 运作日至今	1.0669%	0.0015%	0.7693%	0.0000%	0.2976%	0.0015%

注：本基金收益分配按日结转份额。

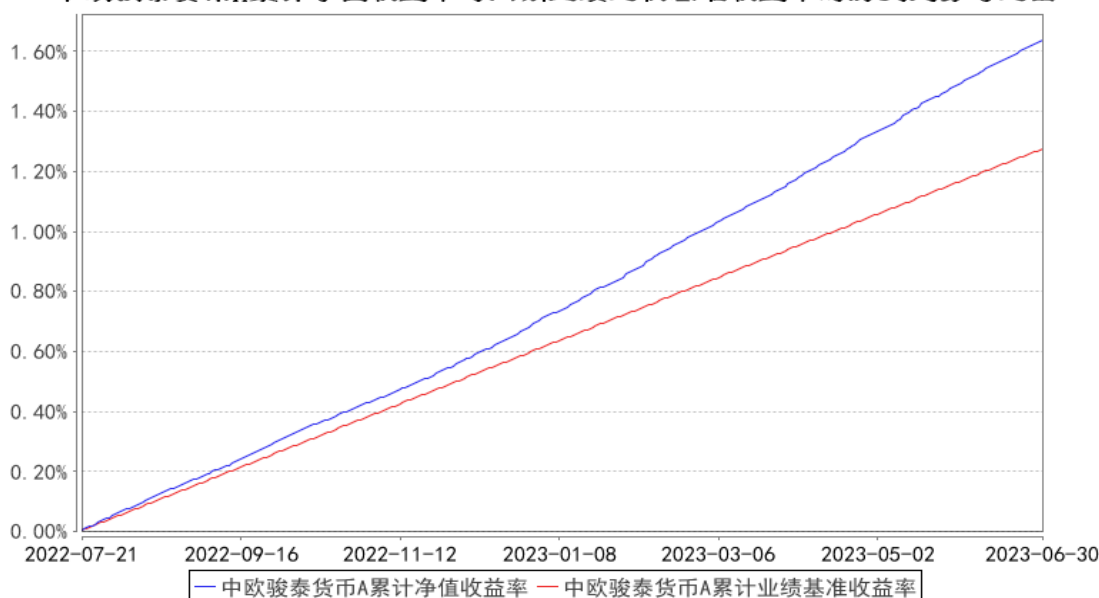
中欧骏泰货币 D

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	0.5369%	0.0015%	0.3366%	0.0000%	0.2003%	0.0015%
过去六个月	1.0538%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	0.3843%	0.0015%
自基金份额 运作日至今	1.2025%	0.0015%	0.7693%	0.0000%	0.4332%	0.0015%

注：本基金收益分配按日结转份额。

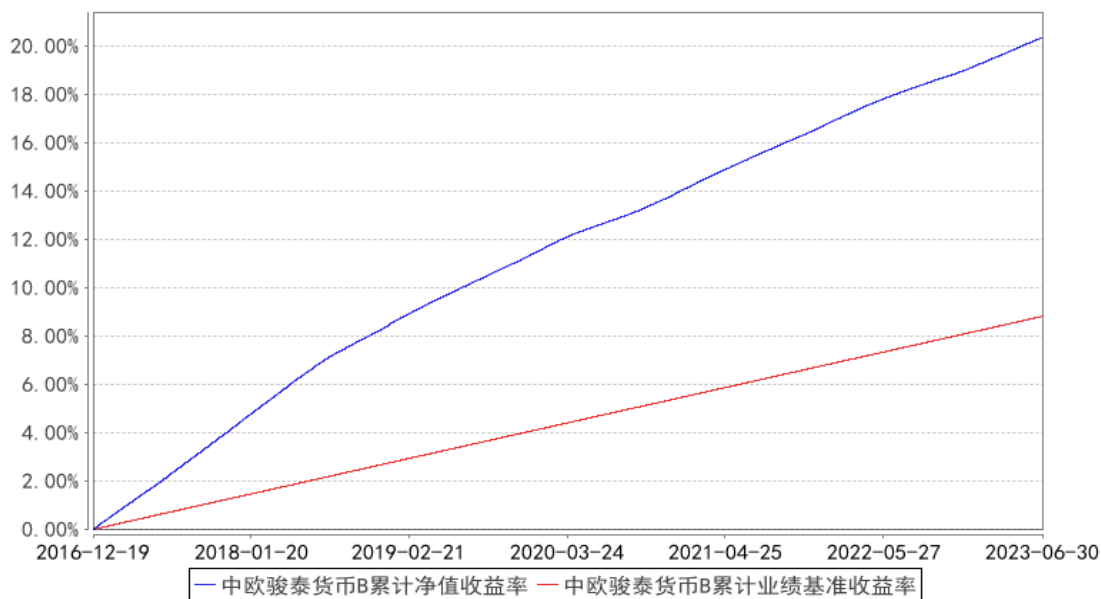
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧骏泰货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

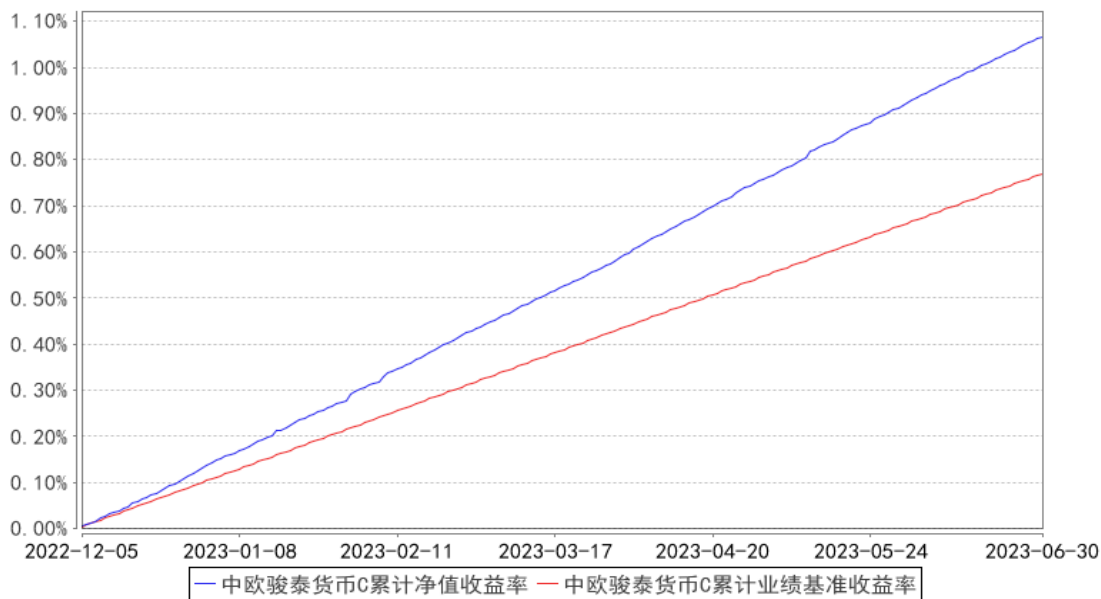


注：本基金于 2022 年 7 月 20 日新增 A 类份额，图示日期为 2022 年 7 月 21 日至 2023 年 06 月 30 日。

中欧骏泰货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

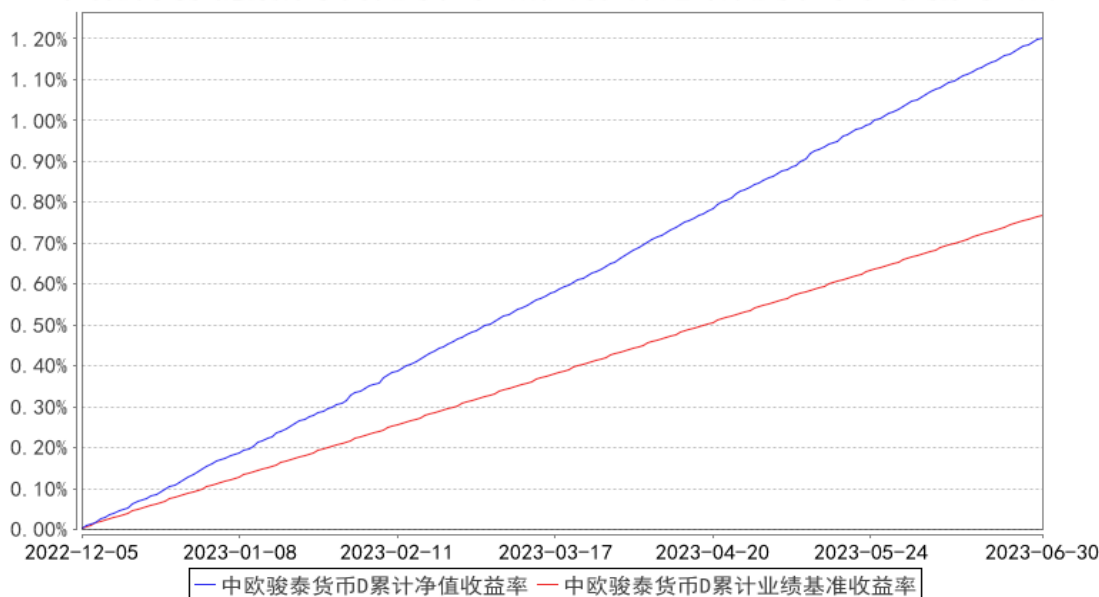


中欧骏泰货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2022 年 12 月 2 日新增 C 类份额，图示日期为 2022 年 12 月 5 日至 2023 年 06 月 30 日。

中欧骏泰货币D累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2022 年 12 月 2 日新增 D 类份额，图示日期为 2022 年 12 月 5 日至 2023 年 06 月 30 日。

## § 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		
张东波	基金经理	2021-08-04	-	8 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

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 43 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾二季度，债券市场走出了一波行情，尤其是短端收益率，在二季度加速下行。国内经济修复受阻，房地产小阳春短暂出现后，销售再度转弱。经济同比受益于去年的低基数表现尚可，但环比显示经济疲软，社融也在 5 月结束了年初以来持续同比多增的趋势，首次转为同比少增。货币政策基调不变，合理充裕，为经济企稳保驾护航，虽然市场杠杆较高，并且由宽货币向宽信用传导受阻，但目前并没有收紧货币政策的基础，央行在 6 月份降息，资金面整体易松难紧。

4 月，降准资金释放和财政支出为资金市场投放了较为充足的流动性，资金面较为宽松，中旬 MLF 超量续作 2000 亿，整体税期对资金面扰动不大。月末央行 OMO 的呵护力度不减，资金面宽松跨月，短端收益率持续下行。

5 月，资金面持续宽松，资金中枢比上个月明显回落，7 天与隔夜利差进一步扩大，隔夜加权的均值低于 1.5%，宽松的资金面在税期和月末都没有明显改变，存单收益率继续下行。

6 月 13 日，央行将公开市场 7 天逆回购利率从 2.0% 下调至 1.9%，15 日 MLF 利率也下调 10bp 至 2.65%。此次降息略超市场预期，降息后，债券收益率整体快速下行，1 年大行股份制存单最低下行至 2.25%，10 年期国债 230012 最低下行至 2.60%。快速下行后收益率出现一些程度的反弹，短端市场也受跨季、跨半年末的负债赎回影响，并且 6 月最后一周，虽央行连续净投放 OMO，维护跨季资金面，但银行和非银流动性分层，非银机构跨季资金昂贵，存单收益率上行幅度较大，最后两天，跨季规模基本稳定之后，收益率转下，市场普遍预期跨季之后资金面重回宽松。

本基金在报告期间，兼顾流动性、控制风险的同时，择机配置优质资产。以大行、国有股份制银行、大型城农商的存单存款为主，以优质 AAA 信用债配置为辅。日常操作中，维持适度的久期，杠杆水平中性，时刻关注负债端情况变化，在保障投资者的流动性管理需求的基础上，努力

提高收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 0.4768%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%；基金 B 类份额净值增长率为 0.5368%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%；基金 C 类份额净值增长率为 0.4769%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%；基金 D 类份额净值增长率为 0.5369%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

#### 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	25,041,458,643.12	68.04
	其中：债券	25,041,458,643.12	68.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,032,282,623.62	8.24
	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	8,724,264,114.43	23.71
4	其他资产	3,699,718.53	0.01
5	合计	36,801,705,099.70	100.00

#### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额		3.83
	其中：买断式回购融资		-
2	报告期末债券回购融资余额	4,290,577,075.53	13.20
	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%。



### 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	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

#### 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	26.13	13.20
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	17.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	50.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	112.99	13.20

#### 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	2,033,234,132.67	6.26
	其中：政策性金融债	1,785,561,259.77	5.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,290,280,286.60	7.05
6	中期票据	52,682,485.21	0.16
7	同业存单	20,665,261,738.64	63.59
8	其他	-	-

9	合计	25,041,458,643.12	77.06
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。

### 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	220211	22 国开 11	12,100,000	1,229,269,272.66	3.78
2	112381453	23 北京农商银行 CD152	5,000,000	497,559,326.87	1.53
3	112214193	22 江苏银行 CD193	5,000,000	495,455,345.39	1.52
4	112313112	23 浙商银行 CD112	5,000,000	495,240,450.55	1.52
5	112381499	23 杭州银行 CD156	5,000,000	494,739,857.07	1.52
6	112381632	23 江西银行 CD138	5,000,000	494,518,436.14	1.52
7	112381909	23 宁波银行 CD128	5,000,000	494,455,879.28	1.52
8	112381998	23 宁波银行 CD130	5,000,000	491,240,278.09	1.51
9	112204032	22 中国银行 CD032	4,000,000	398,532,966.53	1.23
10	112322015	23 邮储银行 CD015	4,000,000	396,384,656.83	1.22

### 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	0.0414%
报告期内偏离度的最低值	-0.0007%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0225%

#### 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。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1

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中，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到银保监会、中国银行保险监督管理委员会重庆监管局的处罚。江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行的处罚。宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到宁波银保监局的处罚。北京农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京银保监局、北京市顺义区水务局的处罚。江西银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行南昌中心支行的处罚。

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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,284.26
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	3,694,434.27
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	3,699,718.53

### 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

项目	中欧骏泰货币 A	中欧骏泰货币 B	中欧骏泰货币 C	中欧骏泰货币 D
报告期期初基	13,552,970,345.92	11,470,856,154.25	355,281.02	592,554.10

基金份额总额				
报告期间基金总申购份额	159,362,658,089.60	9,047,427,912.68	263,849.87	118,021,781.08
报告期间基金总赎回份额	148,805,082,385.75	12,181,803,823.64	125,681.66	69,945,065.93
报告期末基金份额总额	24,110,546,049.77	8,336,480,243.29	493,449.23	48,669,269.25

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	2023-04-03	26.88	26.88	0.0000
2	红利再投	2023-04-03	29.88	29.88	0.0000
3	红利再投	2023-04-03	1,319.68	1,319.68	0.0000
4	红利再投	2023-04-04	9.36	9.36	0.0000
5	红利再投	2023-04-04	10.36	10.36	0.0000
6	红利再投	2023-04-04	457.50	457.50	0.0000
7	红利再投	2023-04-06	18.26	18.26	0.0000
8	红利再投	2023-04-06	20.26	20.26	0.0000
9	红利再投	2023-04-06	895.05	895.05	0.0000
10	红利再投	2023-04-07	8.54	8.54	0.0000
11	红利再投	2023-04-07	9.54	9.54	0.0000

12	红利再投	2023-04-07	421.28	421.28	0.0000
13	红利再投	2023-04-10	24.80	24.80	0.0000
14	红利再投	2023-04-10	27.81	27.81	0.0000
15	红利再投	2023-04-10	1,228.35	1,228.35	0.0000
16	红利再投	2023-04-11	7.58	7.58	0.0000
17	红利再投	2023-04-11	8.59	8.59	0.0000
18	红利再投	2023-04-11	379.56	379.56	0.0000
19	红利再投	2023-04-12	7.62	7.62	0.0000
20	红利再投	2023-04-12	8.63	8.63	0.0000
21	红利再投	2023-04-12	380.98	380.98	0.0000
22	红利再投	2023-04-13	10.18	10.18	0.0000
23	红利再投	2023-04-13	11.11	11.11	0.0000
24	红利再投	2023-04-13	490.86	490.86	0.0000
25	红利再投	2023-04-14	7.53	7.53	0.0000
26	红利再投	2023-04-14	8.53	8.53	0.0000
27	红利再投	2023-04-14	377.05	377.05	0.0000
28	红利再投	2023-04-17	22.48	22.48	0.0000
29	红利再投	2023-04-17	25.48	25.48	0.0000
30	红利再投	2023-04-17	1,125.72	1,125.72	0.0000
31	红利再投	2023-04-18	7.36	7.36	0.0000
32	红利再投	2023-04-18	8.34	8.34	0.0000
33	红利再投	2023-04-18	368.58	368.58	0.0000
34	红利再投	2023-04-19	7.37	7.37	0.0000
35	红利再投	2023-04-19	8.37	8.37	0.0000
36	红利再投	2023-04-19	369.94	369.94	0.0000
37	红利再投	2023-04-20	9.05	9.05	0.0000
38	红利再投	2023-04-20	10.08	10.08	0.0000
39	红利再投	2023-04-20	444.98	444.98	0.0000

40	红利再投	2023-04-21	9.08	9.08	0.0000
41	红利再投	2023-04-21	10.09	10.09	0.0000
42	红利再投	2023-04-21	445.72	445.72	0.0000
43	红利再投	2023-04-24	25.22	25.22	0.0000
44	红利再投	2023-04-24	28.23	28.23	0.0000
45	红利再投	2023-04-24	1,247.12	1,247.12	0.0000
46	红利再投	2023-04-25	7.77	7.77	0.0000
47	红利再投	2023-04-25	8.77	8.77	0.0000
48	红利再投	2023-04-25	387.51	387.51	0.0000
49	红利再投	2023-04-26	11.90	11.90	0.0000
50	红利再投	2023-04-26	12.94	12.94	0.0000
51	红利再投	2023-04-26	570.04	570.04	0.0000
52	红利再投	2023-04-27	9.05	9.05	0.0000
53	红利再投	2023-04-27	10.07	10.07	0.0000
54	红利再投	2023-04-27	444.09	444.09	0.0000
55	红利再投	2023-04-28	7.58	7.58	0.0000
56	红利再投	2023-04-28	8.58	8.58	0.0000
57	红利再投	2023-04-28	378.49	378.49	0.0000
58	红利再投	2023-05-04	42.23	42.23	0.0000
59	红利再投	2023-05-04	48.23	48.23	0.0000
60	红利再投	2023-05-04	2,129.93	2,129.93	0.0000
61	红利再投	2023-05-05	6.71	6.71	0.0000
62	红利再投	2023-05-05	7.72	7.72	0.0000
63	红利再投	2023-05-05	340.73	340.73	0.0000
64	红利再投	2023-05-08	22.63	22.63	0.0000
65	红利再投	2023-05-08	25.64	25.64	0.0000
66	红利再投	2023-05-08	1,132.49	1,132.49	0.0000
67	红利再投	2023-05-09	6.40	6.40	0.0000

68	红利再投	2023-05-09	7.40	7.40	0.0000
69	红利再投	2023-05-09	326.99	326.99	0.0000
70	红利再投	2023-05-10	10.89	10.89	0.0000
71	红利再投	2023-05-10	11.89	11.89	0.0000
72	红利再投	2023-05-10	525.57	525.57	0.0000
73	红利再投	2023-05-11	7.86	7.86	0.0000
74	红利再投	2023-05-11	8.86	8.86	0.0000
75	红利再投	2023-05-11	391.31	391.31	0.0000
76	红利再投	2023-05-12	21.31	21.31	0.0000
77	红利再投	2023-05-12	22.30	22.30	0.0000
78	红利再投	2023-05-12	985.28	985.28	0.0000
79	红利再投	2023-05-15	21.12	21.12	0.0000
80	红利再投	2023-05-15	24.14	24.14	0.0000
81	红利再投	2023-05-15	1,066.31	1,066.31	0.0000
82	红利再投	2023-05-16	7.03	7.03	0.0000
83	红利再投	2023-05-16	7.90	7.90	0.0000
84	红利再投	2023-05-16	348.68	348.68	0.0000
85	红利再投	2023-05-17	5.25	5.25	0.0000
86	红利再投	2023-05-17	6.24	6.24	0.0000
87	红利再投	2023-05-17	275.28	275.28	0.0000
88	红利再投	2023-05-18	5.08	5.08	0.0000
89	红利再投	2023-05-18	5.98	5.98	0.0000
90	红利再投	2023-05-18	264.28	264.28	0.0000
91	红利再投	2023-05-19	16.80	16.80	0.0000
92	红利再投	2023-05-19	17.80	17.80	0.0000
93	红利再投	2023-05-19	786.20	786.20	0.0000
94	红利再投	2023-05-22	20.15	20.15	0.0000
95	红利再投	2023-05-22	23.16	23.16	0.0000

96	红利再投	2023-05-22	1,023.24	1,023.24	0.0000
97	红利再投	2023-05-23	8.09	8.09	0.0000
98	红利再投	2023-05-23	9.10	9.10	0.0000
99	红利再投	2023-05-23	401.90	401.90	0.0000
100	红利再投	2023-05-24	4.65	4.65	0.0000
101	红利再投	2023-05-24	5.68	5.68	0.0000
102	红利再投	2023-05-24	250.81	250.81	0.0000
103	红利再投	2023-05-25	3.81	3.81	0.0000
104	红利再投	2023-05-25	4.81	4.81	0.0000
105	红利再投	2023-05-25	212.37	212.37	0.0000
106	红利再投	2023-05-26	14.72	14.72	0.0000
107	红利再投	2023-05-26	15.75	15.75	0.0000
108	红利再投	2023-05-26	695.71	695.71	0.0000
109	红利再投	2023-05-29	21.26	21.26	0.0000
110	红利再投	2023-05-29	24.28	24.28	0.0000
111	红利再投	2023-05-29	1,072.74	1,072.74	0.0000
112	红利再投	2023-05-30	7.07	7.07	0.0000
113	红利再投	2023-05-30	8.08	8.08	0.0000
114	红利再投	2023-05-30	357.04	357.04	0.0000
115	红利再投	2023-05-31	7.13	7.13	0.0000
116	红利再投	2023-05-31	8.17	8.17	0.0000
117	红利再投	2023-05-31	360.95	360.95	0.0000
118	红利再投	2023-06-01	7.29	7.29	0.0000
119	红利再投	2023-06-01	8.29	8.29	0.0000
120	红利再投	2023-06-01	366.30	366.30	0.0000
121	红利再投	2023-06-02	10.31	10.31	0.0000
122	红利再投	2023-06-02	11.31	11.31	0.0000
123	红利再投	2023-06-02	499.57	499.57	0.0000



124	红利再投	2023-06-05	22.59	22.59	0.0000
125	红利再投	2023-06-05	25.61	25.61	0.0000
126	红利再投	2023-06-05	1,131.19	1,131.19	0.0000
127	红利再投	2023-06-06	7.57	7.57	0.0000
128	红利再投	2023-06-06	8.58	8.58	0.0000
129	红利再投	2023-06-06	378.90	378.90	0.0000
130	红利再投	2023-06-07	7.96	7.96	0.0000
131	红利再投	2023-06-07	8.97	8.97	0.0000
132	红利再投	2023-06-07	396.31	396.31	0.0000
133	红利再投	2023-06-08	7.88	7.88	0.0000
134	红利再投	2023-06-08	8.91	8.91	0.0000
135	红利再投	2023-06-08	393.54	393.54	0.0000
136	红利再投	2023-06-09	8.02	8.02	0.0000
137	红利再投	2023-06-09	9.01	9.01	0.0000
138	红利再投	2023-06-09	397.95	397.95	0.0000
139	红利再投	2023-06-12	21.43	21.43	0.0000
140	红利再投	2023-06-12	24.45	24.45	0.0000
141	红利再投	2023-06-12	1,080.12	1,080.12	0.0000
142	红利再投	2023-06-13	7.15	7.15	0.0000
143	红利再投	2023-06-13	8.15	8.15	0.0000
144	红利再投	2023-06-13	360.10	360.10	0.0000
145	红利再投	2023-06-14	7.20	7.20	0.0000
146	红利再投	2023-06-14	8.21	8.21	0.0000
147	红利再投	2023-06-14	362.78	362.78	0.0000
148	红利再投	2023-06-15	7.63	7.63	0.0000
149	红利再投	2023-06-15	8.64	8.64	0.0000
150	红利再投	2023-06-15	381.41	381.41	0.0000
151	红利再投	2023-06-16	7.24	7.24	0.0000

152	红利再投	2023-06-16	8.25	8.25	0.0000
153	红利再投	2023-06-16	364.54	364.54	0.0000
154	红利再投	2023-06-19	21.07	21.07	0.0000
155	红利再投	2023-06-19	24.08	24.08	0.0000
156	红利再投	2023-06-19	1,063.65	1,063.65	0.0000
157	红利再投	2023-06-20	7.15	7.15	0.0000
158	红利再投	2023-06-20	8.16	8.16	0.0000
159	红利再投	2023-06-20	360.48	360.48	0.0000
160	红利再投	2023-06-21	7.82	7.82	0.0000
161	红利再投	2023-06-21	8.85	8.85	0.0000
162	红利再投	2023-06-21	390.63	390.63	0.0000
163	红利再投	2023-06-26	37.66	37.66	0.0000
164	红利再投	2023-06-26	42.71	42.71	0.0000
165	红利再投	2023-06-26	1,886.98	1,886.98	0.0000
166	红利再投	2023-06-27	7.25	7.25	0.0000
167	红利再投	2023-06-27	8.26	8.26	0.0000
168	红利再投	2023-06-27	364.92	364.92	0.0000
169	红利再投	2023-06-28	7.37	7.37	0.0000
170	红利再投	2023-06-28	8.37	8.37	0.0000
171	红利再投	2023-06-28	369.87	369.87	0.0000
172	红利再投	2023-06-29	7.56	7.56	0.0000
173	红利再投	2023-06-29	8.58	8.58	0.0000
174	红利再投	2023-06-29	378.66	378.66	0.0000
175	红利再投	2023-06-30	7.78	7.78	0.0000
176	红利再投	2023-06-30	8.80	8.80	0.0000
177	红利再投	2023-06-30	388.25	388.25	0.0000
178	红利再投	2023-04-03	10.33	10.33	0.00
179	红利再投	2023-04-03	8.34	8.34	0.00

180	红利再投	2023-04-03	8.34	8.34	0.00
181	红利再投	2023-04-04	9.40	9.40	0.00
182	红利再投	2023-04-06	9.23	9.23	0.00
183	红利再投	2023-04-06	9.12	9.12	0.00
184	红利再投	2023-04-07	8.58	8.58	0.00
185	红利再投	2023-04-10	9.70	9.70	0.00
186	红利再投	2023-04-10	7.62	7.62	0.00
187	红利再投	2023-04-10	7.62	7.62	0.00
188	红利再投	2023-04-11	7.63	7.63	0.00
189	红利再投	2023-04-12	7.66	7.66	0.00
190	红利再投	2023-04-13	10.16	10.16	0.00
191	红利再投	2023-04-14	7.57	7.57	0.00
192	红利再投	2023-04-17	7.78	7.78	0.00
193	红利再投	2023-04-17	7.42	7.42	0.00
194	红利再投	2023-04-17	7.42	7.42	0.00
195	红利再投	2023-04-18	7.38	7.38	0.00
196	红利再投	2023-04-19	7.40	7.40	0.00
197	红利再投	2023-04-20	9.12	9.12	0.00
198	红利再投	2023-04-21	9.14	9.14	0.00
199	红利再投	2023-04-24	10.82	10.82	0.00
200	红利再投	2023-04-24	7.27	7.27	0.00
201	红利再投	2023-04-24	7.27	7.27	0.00
202	红利再投	2023-04-25	7.81	7.81	0.00
203	红利再投	2023-04-26	11.97	11.97	0.00
204	红利再投	2023-04-27	9.24	9.24	0.00
205	红利再投	2023-04-28	7.82	7.82	0.00
206	红利再投	2023-05-04	7.38	7.38	0.00
207	红利再投	2023-05-04	7.05	7.05	0.00

208	红利再投	2023-05-04	7.05	7.05	0.00
209	红利再投	2023-05-04	7.05	7.05	0.00
210	红利再投	2023-05-04	7.05	7.05	0.00
211	红利再投	2023-05-04	7.05	7.05	0.00
212	红利再投	2023-05-05	6.82	6.82	0.00
213	红利再投	2023-05-08	9.52	9.52	0.00
214	红利再投	2023-05-08	6.53	6.53	0.00
215	红利再投	2023-05-08	6.53	6.53	0.00
216	红利再投	2023-05-09	6.39	6.39	0.00
217	红利再投	2023-05-10	10.87	10.87	0.00
218	红利再投	2023-05-11	7.87	7.87	0.00
219	红利再投	2023-05-12	21.39	21.39	0.00
220	红利再投	2023-05-15	7.09	7.09	0.00
221	红利再投	2023-05-15	7.07	7.07	0.00
222	红利再投	2023-05-15	7.07	7.07	0.00
223	红利再投	2023-05-16	7.28	7.28	0.00
224	红利再投	2023-05-17	5.70	5.70	0.00
225	红利再投	2023-05-18	5.13	5.13	0.00
226	红利再投	2023-05-19	16.89	16.89	0.00
227	红利再投	2023-05-22	7.17	7.17	0.00
228	红利再投	2023-05-22	6.54	6.54	0.00
229	红利再投	2023-05-22	6.54	6.54	0.00
230	红利再投	2023-05-23	8.07	8.07	0.00
231	红利再投	2023-05-24	4.38	4.38	0.00
232	红利再投	2023-05-25	3.78	3.78	0.00
233	红利再投	2023-05-26	14.75	14.75	0.00
234	红利再投	2023-05-29	7.06	7.06	0.00
235	红利再投	2023-05-29	7.13	7.13	0.00

236	红利再投	2023-05-29	7.13	7.13	0.00
237	红利再投	2023-05-30	7.08	7.08	0.00
238	红利再投	2023-05-31	7.14	7.14	0.00
239	红利再投	2023-06-01	7.31	7.31	0.00
240	红利再投	2023-06-02	10.34	10.34	0.00
241	红利再投	2023-06-05	8.17	8.17	0.00
242	红利再投	2023-06-05	7.26	7.26	0.00
243	红利再投	2023-06-05	7.26	7.26	0.00
244	红利再投	2023-06-06	7.61	7.61	0.00
245	红利再投	2023-06-07	7.98	7.98	0.00
246	红利再投	2023-06-08	7.94	7.94	0.00
247	红利再投	2023-06-09	8.04	8.04	0.00
248	红利再投	2023-06-12	7.27	7.27	0.00
249	红利再投	2023-06-12	7.14	7.14	0.00
250	红利再投	2023-06-12	7.14	7.14	0.00
251	红利再投	2023-06-13	7.18	7.18	0.00
252	红利再投	2023-06-14	7.23	7.23	0.00
253	红利再投	2023-06-15	7.66	7.66	0.00
254	红利再投	2023-06-16	7.28	7.28	0.00
255	红利再投	2023-06-19	7.06	7.06	0.00
256	红利再投	2023-06-19	7.06	7.06	0.00
257	红利再投	2023-06-19	7.06	7.06	0.00
258	红利再投	2023-06-20	7.19	7.19	0.00
259	红利再投	2023-06-21	7.86	7.86	0.00
260	红利再投	2023-06-26	7.33	7.33	0.00
261	红利再投	2023-06-26	7.36	7.36	0.00
262	红利再投	2023-06-26	7.36	7.36	0.00
263	红利再投	2023-06-26	7.36	7.36	0.00

264	红利再投	2023-06-26	8.48	8.48	0.00
265	红利再投	2023-06-27	7.29	7.29	0.00
266	红利再投	2023-06-28	7.39	7.39	0.00
267	红利再投	2023-06-29	7.60	7.60	0.00
268	红利再投	2023-06-30	7.82	7.82	0.00
合计			38,262.91	38,262.91	

注：1、买入/申购总份额含红利再投、转换入份额，卖出/赎回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。

## § 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媒介上公开披露的各项公告

### 9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 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  
2023 年 7 月 21 日