

中欧骏泰货币市场基金更新招募说明书摘要

(2017年第1号)

中国人民大学注册会计师专业学士,9年以上证券及基金从业经验,历任毕马威会计师事务所助理审计经理,银华基金管理有限公司投资管理部副总监,中欧基金管理有限公司风控总监。

4. 本基金基金经理

(1) 现任基金经理

黄华先生,中欧骏泰货币市场基金基金经理,中国籍,上海财经大学产业经济学专业硕士,8年以上证券从业经验,具有基金从业资格。历任平安资产管理有限责任公司组合经理,中国平安集团投资管理中心资产负债部组合经理,中国平安财产保险股份有限公司组合投资管理团队负责人。2016年11月加入中欧基金管理有限公司,现任资产配置总监,中欧货币市场基金基金经理(自2017年3月24日起至今)、中欧骏发货币市场基金基金经理(自2017年3月24日起至今)、中欧康裕混合型证券投资基金基金经理(自2017年4月5日起至今)、中欧双利债券型证券投资基金基金经理(自2017年4月5日起至今)、中欧弘安一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2017年4月19日起至今)、中欧骏益货币市场基金基金经理(自2017年6月27日起至今)。

(2) 历任基金经理

刘波女士,于2016年12月19日起至2017年3月24日期间担任中欧骏泰货币市场基金基金经理。

5. 基金管理人投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构,由总经理刘建平、副总经理魏伟、分管投资部总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、周玉雄、曲经、赵国英、曹长庚、王健、吴培、吴鹏飞组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主任。

6. 上述人员之间均不存在亲属关系。

第二部分 基金托管人

(一) 基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司,基本信息如下:

名称:上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市中山路12号

办公地址:上海市中山路12号

法定代表人:高国富

成立时间:1992年10月19日

经营范围:经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准,公司主营业务主要包括:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理结算;办理票据贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券,同业拆借;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保险箱业务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外汇兑换;国际结算;国内外汇拆借;外汇票据的承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;结汇、售汇;及代理买卖股票以外的外币有价证券;自营外汇买卖;代客外汇买卖;资信调查、咨询、见证业务;离岸银行业务;证券投资基金托管业务;全国社会保障基金托管业务;经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式:股份有限公司

注册资本:216.18亿元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105号

联系人:朱萍

联系电话:(021)61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务,是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快增长,各项经营指标在股份制商业银行中处于领先水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部,2005年更名为资产托管部,2013年更名为资产托管及养老金业务部,2016年进行组织架构优化调整,并更名为资产托管部,目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心(含合肥分中心)五个职能处室。

目前,上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权投资托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品,形成完备的产品体系,可满足多领域客户、境内外的资产托管需求。

(二) 主要人员情况

高国富,男,1966年出生,研究生学历,博士学位,高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发(控股)公司总经理;上海外高桥保税区管委会副主任;上海万国证券公司总裁;上海外高桥保税区主任;上海市城市建设投资开发总公司总经理,中国太平洋保险(集团)股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员,上海交通大学国际工商学院理事会顾问、国际顾问委员会委员,上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

(三) 基金托管业务经营情况

截止2017年6月30日,上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为2456.43亿元,比去年末增长33.45%。托管证券投资基金共一百一十六只,分别为国泰金牛行业精选基金、国泰货币基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优享企业基金、国联安货币基金、银华永泰债券型基金、长信信用保本基金(LOP)、华富保本混合型证券投资基金、中海安鑫保本基金、博时安丰18个月基金(LOP)、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、中信建投稳信债券基金、华富恒开分级债券基金、汇添富广聚宝货币基金、工银目标收益一年定期开放基金、北信瑞丰定投资债基金、国联安稳健配置基金、国寿安保稳益纯债型基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、博时广利纯债基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、国联安鑫富混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华REITs封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳定回报基金、国寿安保稳健回报基金、国联安成长基金、金鹰改革红利基金、易方达裕利回报债券基金、国联安鑫利基金、国联安鑫悦基金、天弘裕利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、国联安安稳保本基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、华富诚鑫灵活配置基金、富安达长盈保本基金、中信建投稳益保本基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信信发债券基金、博时广安纯债基金、国泰添益混合基金、鑫元得利债券型基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛定期开放基金、华富元鑫灵活配置基金、东方红战略沪深成长基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银华信信混合基金、鹏华兴锐定期开放基金、汇添富保本混合基金、景顺长城瑞盛利债券基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈18个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银华君耀灵活配置混合基金、广发一年定开债券基金、国联安鑫盛混合基金、汇安嘉汇纯债债券基金、鹏华普泰债券基金、南方宜利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴裕华安债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、国泰聚利达灵活配置混合基金、国联安鑫利混合基金、易方达瑞程混合基金、华福富富一年定开债券基金、中欧骏发货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安鑫源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫源债券基金、鑫元纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、工银瑞信瑞盈半年定开债券基金、国泰南利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安丰泰灵活配置混合基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证500指数基金、南方利定开债券基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰6个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、银华稳利灵活配置混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达富瑞灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金。

(四) 基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为:确保经营活动中严格遵守国家有关法律、法规和监管部门监管规则和内部规章制度,形成守法经营、规范运作的经营思想,确保经营活动的稳健运行,保证基金资产的安全和完整,确保业务活动信息的真实、准确、完整,保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为:总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门,指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行运营管理部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管理控制工作。总行资产托管部下设内控管理处,内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构,并配备专职内

控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施:本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的全流程,执行、监督全过程,渗透到各业务流程和各操作环节,覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点,各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括:培育员工树立内控优先、制度先行、全局化风险控制的管理理念,营造浓厚的内控文化氛围,使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度,明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范,业务数据备份和保管等在内的各项业务管理制度;建立严格完善的资产隔离和资产保管制度,托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算;对各类突发事件或故障,建立完备有效的应急预案,定期组织灾备演练,建立重大事项报告制度;在基金运作办公区域建立健全安全监控系统,利用录音、录像等技术手段实现风险控制;定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控,通过专项/全面审计等措施实施业务监督,排查风险隐患。

(五) 托管人对管理人运用基金进行监督的方法和程序

1. 监督依据

我行根据与管理人有关政策法规,以及基金合同、托管协议

等进行监督。监督依据具体包括:

- (1)《中华人民共和国证券法》;
- (2)《中华人民共和国证券投资基金法》;
- (3)《公开募集证券投资基金运作管理办法》;
- (4)《证券投资基金销售管理办法》;
- (5)《基金合同》、《托管协议》;
- (6)法律、法规、政策的其他规定。

2. 监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定,对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督,并及时提示基金管理人违规风险。

3. 监督方法

(1)资产托管部设置核算监督岗位,配备相应的业务人员,在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责,规范基金运作,维护基金份额持有人的合法权益,不受任何外界力量的干预;

(2)在日常运作中,凡量化的监督指标,由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督,实现系统的自动跟踪和预警;

(3)对非量化指标,投资指令、管理人提供的各种报表和报告等,采取人工监督的方式。

4. 监督结果的处理方式

(1)基金托管人对基金管理人的投资运作违规操作,采取定期和不定定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金违规周报等,不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等;

(2)若基金托管人发现基金管理人违规违法操作,以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人,指明违规事项,明确纠正期限。在规定期限内基金管理人再对基金管理人违规事项进行复查,如果基金管理人对违规事项未予纠正,基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时,基金托管人应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正;

(3)针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查,应及时提供有关情况资料。

第三部分 相关服务机构

一、基金销售机构

1. 直销机构

名称:中欧基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层

办公地址:上海市虹口区公平路18号8楼-嘉昱大厦7层

法定代表人:王莹明

联系人:袁姝

客服电话:021-68609602

传真:021-68609601

客服热线:021-68609700,400-700-9700(免长途话费)

网址:www.zofund.com

2. 其他销售机构

名称:中欧证券股份有限公司

住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦A座

办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦A座

联系人:杨敏

电话:010-84183333

传真:010-84183311

客服热线:400-818-8118

网址:www.guodu.com

基金管理人可以根据情况变化,增加或者减少销售机构,并另行公告。销售机构可以根据情况变化,增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异,具体请咨询各销售机构。

二、登记机构

名称:中欧基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层

办公地址:上海市虹口区公平路18号8楼-嘉昱大厦7层

法定代表人:王莹明

电话:021-68609600

传真:021-68609601

联系人:杨敏

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

经办律师:黎明、陆奇

电话:021-31258666

传真:021-31258600

联系人:陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

电话:021-23238189

联系人:俞伟敏

经办注册会计师:许康玮、俞伟敏

第四部分 基金名称

中欧骏泰货币市场基金

第五部分 基金的类型

契约型 开放式

第六部分 基金的投资目标

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确定收益。

第七部分 基金的投资范围

本基金投资于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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略

本基金根据对主动性投资策略的预测,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。

1. 利率预期与目标剩余期限管理策略

通过对宏观经济指标、资金市场供求状况等因素的跟踪分析,预测政府对宏观经济政策取向和资金市场供求变化趋势,以此作为预期短期金融工具配置的依据。

根据对宏观经济和短期资金市场的利率走势,来确定投资组合的平均剩余到期期限。具体而言,在预计市场利率上升时,适当缩短投资组合的平均期限;在预计利率下降时,适当延长投资组合的平均期限。

2. 类属配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例;再通过评估各类型资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

3. 个券选择策略

在个券选择上,本基金通过定性定量方法,综合分析收益率曲线、流动性、信用风险,评估个券投资价值,发掘出具备相对优势的个券。

4. 回购策略

1) 息差放大策略:该策略是利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式是利用买入公司债券进行正回购,再利用回购融入资金购买收益率较高债券品种,如此循环至回购期结束卖出债券偿还所融入资金,在进行回购放大操作时,基金管理人将严格遵守相关法律法规关于债券正回购的有关规定。

2) 逆回购策略:基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会,通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。

5. 收益率曲线策略

本基金将根据债券市场收益率曲线以及隐含的即期收益率和远期利率提供的价值判断基础,结合对资金面的分析,匹配各期限的回购与债券品种的到期日,实现现金流的有效管理。

6. 现金流管理策略

本基金作为现金管理工具,具有较高的流动性要求,本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测,通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金流,在保持充分流动性的基础上争取较高收益。

7. 资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构,将信贷资产支持证券托受托机构,由受托机构向投资机构发行,以该资产所产生的现金流支付其收益的证券。本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的变化跟踪、分析资产支持证券的发行条款,预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为同期7天通知存款税后利率。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期7天通知存款税后利率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更有利的、更为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩比较基准时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费;

2. 基金托管人的托管费;

3. 销售服务费;

4. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

5. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、仲裁费和诉讼费;

6. 基金份额持有人大会费用;

7. 基金的证券交易费用;

8. 基金的银行汇划费用;

9. 基金的相关账户的开户及维护费用;

10. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

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:

$H = E \times 0.24\%$ = 当日基金资产净值

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2. 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.05\%$ = 当日基金资产净值

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

3. 基金销售服务费

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:

$H = E \times 0.01\%$ = 当日基金资产净值

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。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

四、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1. 基金管理人及基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3. 基金合同生效前的相关费用;

4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税法法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定,并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的经营活动活动,对本基金管理人于2016年12月刊登的《中欧骏泰货币市场基金招募说明书》进行了更新,主要更新内容包括:

(一)“重要提示”部分

增加了“本更新招募说明书所载内容截止日为2017年6月18日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2017年3月31日(财务数据未经审计)”的描述。

(二)“第三部分 基金管理人”部分

更新了基金管理人董事会成员、监事会成员、公司高级管理人员、本基金基金经理和公司投资决策委员会成员的信息。

(三)“第四部分 基金托管人”部分

更新了基金托管人的相关信息。

(四)“第五部分 相关服务机构”部分

更新了会计师事务所的相关信息。

(五)“第六部分 基金的募集”部分

1. 增加了基金的募集信息。

2. 删除了涉及及募集期的描述。

(六)“第七部分 基金合同的生效”部分

1. 增加了基金合同生效日期的描述。

2. 删除了涉及基金合同生效和募集失败的相关描述。

(七)“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分

1. 增加了基金开放申购、赎回的日期。

2. 更新了拒绝或暂停申购的相关情形。

(八)“第九部分 基金的投资”部分

增加了“十、基金投资组合报告”的内容,数据截至2017年3月31日。

(九)“第十部分 基金的业绩”部分

增加了整体的信息,包括“本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较”和“基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”,数据截至2017年3月31日。

(十)“第十二部分 其他应披露事项”部分

更新了自2016年12月19日至2017年6月18日刊登于(中国证券报)、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

以下为本基金管理人自2016年12月19日至2017年6月18日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号 公告事项 披露日期