

中欧骏泰货币市场基金更新招募说明书摘要

(2018年修订)

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
二〇一八年八月

姓名	职务	性别	女
国籍	中国	毕业于院校及专业	香港中文大学财务学专业
其他公司任职	新加坡香港有限公司销售及交易员,平安资产管理有限责任公司债券交易员,前海开源基金投资理财助理		
本公司历任	中欧基金管理有限公司交易员、基金投资理财助理		
本公司现任	基金运营		
本基金经理所管理基金具体情况	产品名称	起始日期	离任日期
1	中欧骏泰货币配置混合型证券投资基金	2018年01月30日	
2	中欧双利债券型证券投资基金	2018年01月30日	
3	中欧骏泰货币市场基金	2018年01月30日	
4	中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金	2018年01月30日	
5	中欧可转换债券型证券投资基金	2018年01月30日	
7	中欧钱袋宝发起式货币市场基金	2018年01月30日	
8	中欧双利货币市场基金	2018年01月30日	
9	中欧骏泰货币市场基金	2018年01月30日	
10	中欧弘安一年定期开放债券型证券投资基金	2018年01月30日	
11	中欧弘安一年定期开放债券型证券投资基金	2018年01月30日	
12	中欧骏信货币型证券投资基金	2018年02月13日	
13	中欧安时定期开放债券型发起式证券投资基金	2018年06月28日	

(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稽核,规范基金运作,维护基金持有人的合法权益,不受任何外界力量的干预;

(2) 在日常运作中,凡量化的监督稽核,由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督,实现系统的自动监察和稽核;

(3) 对于非量化指标,投资指令、管理人提供的各种报告和报告,采取人工监督的方法。

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监督结果,采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告,定期报告包括基金监控周报等。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。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行检查,如果基金管理人对该违规事项未予纠正,基金托管人应及时向中国证监会报告,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和资料。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

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7层
办公地址:上海市虹口区公平路18号8层-嘉昱大厦7层
法定代表人:裘玉明
联系人:董雅
电话:021-68609602
传真:021-68609601
客服热线:021-68609700,400-700-9700(免长途费)
网址:www.zofund.com

2. 其他销售机构

(1)名称:大连银行股份有限公司
住所:辽宁省大连市中山区中山路88号
办公地址:辽宁省大连市中山区中一路688号
法定代表人:董志勇
联系人:陈维
电话:0411-82311936
传真:0411-82311733
客服电话:74006640099
网址:www.bankofdl.com

(2)名称:国都证券股份有限公司
住所:北京市东城区东直门南大街3号国都投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国都投资大厦9层10层
法定代表人:王少华
联系人:黄静
电话:010-84183899
传真:010-64482000
客服热线:400-818-8118
网址:www.guodu.com

(3)名称:中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场二期北座
办公地址:广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦,北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
联系人:侯艳红
电话:010-60836030/0755-23835383
传真:010-60836031/0755-23835525
客服热线:95558
网址:www.citics.com

(4)名称:中信证券(山东)有限责任公司
住所:青岛市市南区东海西路222号青岛国际金融中心1号楼20层
办公地址:青岛市市南区东海西路222号青岛国际金融中心1号楼20层
法定代表人:杨长振
联系人:吴忠超
电话:0632-85022313
传真:0632-8502277
网址:www.zxwt.com.cn

(5)名称:中国期货有限公司
住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1306室、14层
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1306室、14层
法定代表人:张松
联系人:洪城
电话:0755-22963931
客户服务热线:400-900-8826
网址:www.citics.com

基金管理人可以根据实际情况增加或者减少销售机构,并另行公告。销售机构可以根据实际情况增加或者减少其销售网点,并另行公告,各销售机构均可提供网上交易服务,所有销售机构均须具备销售资格,具体资格请各销售机构。

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7层
办公地址:上海市虹口区公平路18号8层-嘉昱大厦7层
法定代表人:裘玉明
联系人:董雅
电话:021-68609600
传真:021-68609601

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:黎明
经办律师:黎明、陆奇
电话:021-31358666
传真:021-31358600

四、审计会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京东城区东长安街1号东方广场东塔楼17层01-12室
办公地址:北京东城区东长安街1号东方广场东塔楼17层01-12室 执行事务合伙人:吴建宁
电话:010-58135300
传真:010-58182898

中欧骏泰货币市场基金

二、基金份额的类别

三、基金份额的类别

四、基金份额的类别

五、基金份额的类别

六、基金份额的类别

七、基金份额的类别

八、基金份额的类别

九、基金份额的类别

十、基金份额的类别

十一、基金份额的类别

十二、基金份额的类别

十三、基金份额的类别

十四、基金份额的类别

十五、基金份额的类别

十六、基金份额的类别

十七、基金份额的类别

十八、基金份额的类别

十九、基金份额的类别

二十、基金份额的类别

二十一、基金份额的类别

二十二、基金份额的类别

二十三、基金份额的类别

二十四、基金份额的类别

二十五、基金份额的类别

二十六、基金份额的类别

二十七、基金份额的类别

二十八、基金份额的类别

二十九、基金份额的类别

三十、基金份额的类别

三十一、基金份额的类别

三十二、基金份额的类别

三十三、基金份额的类别

三十四、基金份额的类别

三十五、基金份额的类别

三十六、基金份额的类别

三十七、基金份额的类别

三十八、基金份额的类别

三十九、基金份额的类别

四十、基金份额的类别

四十一、基金份额的类别

四十二、基金份额的类别

四十三、基金份额的类别

四十四、基金份额的类别

四十五、基金份额的类别

四十六、基金份额的类别

四十七、基金份额的类别

四十八、基金份额的类别

四十九、基金份额的类别

五十、基金份额的类别

五十一、基金份额的类别

五十二、基金份额的类别

五十三、基金份额的类别

五十四、基金份额的类别

五十五、基金份额的类别

五十六、基金份额的类别

五十七、基金份额的类别

五十八、基金份额的类别

五十九、基金份额的类别

六十、基金份额的类别

六十一、基金份额的类别

六十二、基金份额的类别

六十三、基金份额的类别

六十四、基金份额的类别

六十五、基金份额的类别

六十六、基金份额的类别

六十七、基金份额的类别

六十八、基金份额的类别

六十九、基金份额的类别

七十、基金份额的类别

七十一、基金份额的类别

七十二、基金份额的类别

七十三、基金份额的类别

七十四、基金份额的类别

七十五、基金份额的类别

七十六、基金份额的类别

七十七、基金份额的类别

七十八、基金份额的类别

七十九、基金份额的类别

八十、基金份额的类别

八十一、基金份额的类别

八十二、基金份额的类别

八十三、基金份额的类别

八十四、基金份额的类别

八十五、基金份额的类别

八十六、基金份额的类别

八十七、基金份额的类别

八十八、基金份额的类别

八十九、基金份额的类别

九十、基金份额的类别

九十一、基金份额的类别

九十二、基金份额的类别

九十三、基金份额的类别

九十四、基金份额的类别

九十五、基金份额的类别

九十六、基金份额的类别

九十七、基金份额的类别

九十八、基金份额的类别

九十九、基金份额的类别

一百、基金份额的类别

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。

第十一部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定,复核了本报告投资组合报告,保证本报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告投资组合报告所载数据取自本基金2018年第1季度报告,所载数据截至2018年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	2,209,209,091.97	33.78
	其中:债券	2,209,209,091.97	33.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,276,976,526.46	19.53
	其中:买断式回购买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	3,017,525,540.82	46.14
4	其他资产	36,381,856.77	0.56
5	合计	6,540,073,023.02	100.00

2. 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	3.12
2	报告期末债券回购融资余额	639,433,526.17	10.84
3	其中:买断式回购融资	-	-

报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期末前两个交易日融资金额余额占基金净值的简单平均比例。

债券正回购的资金余额占基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金市场基金债券正回购资金余额未超过资产净值的20%。

3. 基金投资组合平均剩余期限

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	62
基金合同规定投资组合平均剩余期限最高值	40
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	42

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期末货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布情况

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	69.92	10.84
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
2	30天(含)-60天	22.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
3	60天(含)-90天	16.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
4	90天(含)-120天	3.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
5	120天(含)-397天(含)	7.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
合计		110.26	10.84

4. 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明

本报告期末货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过240天。

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	国债	20,002,828.39	0.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	319,763,110.76	5.42
	其中:政策性金融债	319,763,110.76	5.42
4	企业短期融资券	-	-
5	企业中期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,899,463,362.66	31.69
8	其他	-	-
9	合计	2,209,209,091.97	37.45
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

6. 报告期末按摊余成本法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	111816033	18民生银行CD003	2,000,000	189,305,935.35	3.38
2	111892636	18南京银行CD002	1,500,000	159,624,190.48	2.84
3	187701	18国债附息01	2,000,000	194,876,147.22	3.51
4	111898002	18平安银行CD006	1,000,000	99,606,967.80	1.69
5	111890032	18交通银行CD002	1,000,000	99,680,260.12	1.69
6	111821034	18浦发银行CD004	1,000,000	99,525,571.94	1.69
7	111816071	18上海银行CD001	1,000,000	99,122,962.10	1.68
8	111770886	17晋商银行CD191	1,000,000	99,068,376.05	1.68
9	111715486	17民生银行CD486	1,000,000	98,916,164.19	1.68
10	111890168	18上海农商银行CD008	1,000,000	98,869,286.80	1.67

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	偏离度
报告期内偏离度的绝对值在0.2%(含)-0.5%的频次	0.0599%
报告期内偏离度的最高值	0.0076%
报告期内偏离度的最低值	0.0047%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0185%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.2%情况说明

本基金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

本基金报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8. 本基金投资组合报告附注

8.1 本基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率确定利息并计提折旧,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日红头资金份额资产净值维持在1.0000元。

8.2 本基金投资有18京银行CD032(11892636.1B),其发行主体南京银行于2017年6月22日收到江苏银监局行政处罚【苏银监罚决字【2017】17号】,南京银行在行政处罚生效期间超过监管规定,被处罚26万元;南京银行行于2018年1月3日收到江苏银监局行政处罚【苏银监罚决字【2018】1号】,银行行政处罚,南京银行镇江分行违法办理理财业务,严重违法违规经营,被处以人民币2320万元。在上述公告公布前,本基金管理人对该公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对18京银行CD032(B111892636)的投资价值或实质性负面影响,因此本基金管理人对该上市公司的投资价值未发生重大改变。其余九只证券的发行人本报告期均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。

8.3 投资组合构成

序号	名称	金额(元)	公允价值	公允价值	公允价值	公允价值	公允价值	公允价值	公允价值
1	存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-
2	应收证券清算款	84,193.77	-	-	-	-	-	-	-
3	应收利息	36,250,506.08	-	-	-	-	-	-	-
4	应收申购款	26,757.92	-	-	-	-	-	-	-
5	其他应收款	-	-	-	-	-	-	-	-
6	其他	-	-	-	-	-	-	-	-
7	合计	36,381,856.77	-	-	-	-	-	-	-

8.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

与报告内容无存在差异。

第十二部分 基金业绩

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财产,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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金自生效日2016年12月19日,基金业绩截止日2018年3月31日。

1. 本报告投资业绩评价基准为与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净收益率①	业绩比较基准收益率②	跟踪误差收益率③	①-③	②-③
2016.12.19-2016.12.31	0.1422%	0.001%	0.0480%	0.0000%	0.0943%
2017.1.1-2017.12.31	4.2800%	0.0008%	1.5300%	0.0000%	3.0380%
2018.1.1-2018.3.31	1.0613%	0.0005%	0.3200%	0.0000%	0.7294%
合计	5.6660%	0.0009%	1.7300%	0.0000%	3.9152%

数据来源:中欧基金

注:本基金合同生效日期为2016年12月19日,按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起6个月为建仓期,建仓期满后本基金的各项资产配置比例已符合基金合同的约定。

第十三部分 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;

(二) 历任基金经理

刘奕文 2016年12月19日 2017年03月24日

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高级投资决策机构,由总经理刘建平、副总经理魏琦、副总经理郑晓刚、基金经理卢卢、信用评估负责人张明、风险控制负责人孙、策略负责人周蔚文、魏文斌、刁羽、黄华、周维雄、赵国辉、曲径、曹长吉、王健、王培增等组成。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

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,基本情况如下:

名称:上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市中山东一路12号

办公地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:高国富

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,公司主营业务为:吸收公众存款;发放贷款;中期和长期股权投资;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;提供保险箱的承租及保管;外汇存款;外汇汇款;外汇兑换;国际结算;同业外汇拆借;外汇票据的承兑和贴现;外汇贷款;外汇担保;结汇、售汇;买卖和代理买卖外汇以外的外币支付业务;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:2935.52亿元人民币

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]106号

联系人:朱丹

联系电话:(021)61618888

上海浦东发展银行于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银行之一。经过二十年的稳健经营和创新发展,各项业务不断发展

一直保持快速增长,各项业务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,200