中欧骏盈货币市场基金

2017年第三季度报告

2017年09月30日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2017年10月26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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧骏盈货币	
基金主代码	001787	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2015年12月24日	
报告期末基金份额总额	478,331,361.90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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
下属分级基金的交易代码	001787	001788
报告期末下属分级基金的份额总额	20,617.79份	478,310,744.11份

注：本基金于2017年6月12日至2017年6月26日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2017年6月28日表决通过了《关于修改中欧骏盈货币市场基金基金合同有关事项的议案》，相关修订和更新后的文件于决议生效公告日的下一工作日生效，即2017年7月3日起生效。

§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（2017年07月01日-2017年09月30日）	
	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
1.本期已实现收益	185.42	4,590,593.53
2.本期利润	185.42	4,590,593.53
3.期末基金资产净值	20,617.79	478,310,744.11

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 本报告期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

1、中欧骏盈货币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	0.9091%	0.0018%	0.3403%	0.0000%	0.5688%	0.0018%

注：本基金收益分配按日结转份额。

2、中欧骏盈货币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	0.9691%	0.0018%	0.3403%	0.0000%	0.6288%	0.0018%

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

中欧骏盈货币A

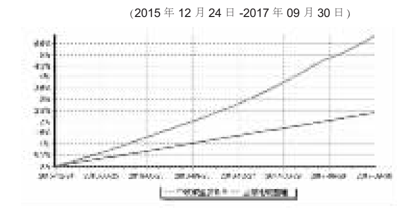
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年12月24日-2017年09月30日）

中欧骏盈货币B

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年12月24日-2017年09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		
朱晨杰	基金经理	2017年05月03日	–	5年	历任法国兴业银行投资银行部交易助理，海通证券股份有限公司债券融资部销售交易员，平安证券有限责任公司固定收益事业部交易员。2016年3月24日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司投资经理

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。

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

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，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价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%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债券市场受到基本面和资金面两方面的作用，走出窄幅震荡的行情。

一方面，7、8月经济基本面数据不及预期，叠加大宗商品（黑色系为主）在9月持续走弱，市场对未来需求的悲观预期有所放大。债市对基本面的有利因素反映积极，表现为在8月14日和9月14日出经济数据后，国债收益率都有较大幅度的下行，并且在9月，国债收益率和南华工业品指数相关性极高。

另一方面，资金面对债市构成制约，数次造成收益率的反弹。6月在央行维持跨季资金面平稳的背景下，机构杠杆率有所回升，信用债收益率有明显下行。而8月在央行有意收紧的操作下，资金面紧张程度大超预期，8月中下旬国债收益率有所上行、信用利差走阔。9月1日，证监会公布公募基金流动性管理新规，除了限制定制货币基金、规范货币基金投资标的之外，也要求货币基金逆回购质押物资质与投资范围一致，该政策限制了专户、私募类账户的融资能力。9月底跨季资金面异常紧张，非银机构融资难度加大亦有对新规变化应对不足的因素。

报告期内，本基金主要投资于短融、同业存款和同业存单，对短期债券进行了波段操作。组合整体流动性较好，期限搭配和杠杆维持适当水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类份额净值收益率为0.9091%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%；B类份额净值收益率为0.9691%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	275,173,630.58	49.62
	其中：债券	275,173,630.58	49.62
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	85,493,448.24	15.42
	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	191,845,006.01	34.59
4	其他资产	2,062,104.76	0.37
5	合计	554,574,189.59	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	–	3.19
	其中：买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	75,759,646.36	15.84
	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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	7

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	36.24	15.84
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天（含）—60天	38.99	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天（含）—90天	2.09	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天（含）—120天	–	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天（含）—397天（含）	38.19	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	115.51	15.84

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

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	29,950,424.88	6.26
	其中：政策性金融债	29,950,424.88	6.26
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	42,403,855.41	8.86
6	中期票据	–	–
7	同业存单	202,819,350.29	42.40
8	其他	–	–
9	合计	275,173,630.58	57.53
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

注：上表中，附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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111791652	17杭州银行CD042	900,000	89,530,578.90	18.72
2	111711410	17平安银行CD410	550,000	53,854,106.77	11.26
3	111714263	17江苏银行CD263	350,000	33,916,147.53	7.09
4	170207	17国开07	300,000	29,950,424.88	6.26
5	011758069	17杭金投SCP007	275,000	27,446,164.31	5.74
6	111785014	17重庆农村商行CD171	230,000	22,537,693.00	4.71
7	011762057	17北部湾投SCP002	150,000	14,957,691.10	3.13
8	111717191	17光大银行CD191	30,000	2,980,824.09	0.62

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	0.0174%
报告期内偏离度的最低值	-0.0588%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0127%

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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1.000元。

5.9.2

本基金投资的前十大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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	2,041,660.12
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	20,444.64
7	其他	–
8	合计	2,062,104.76

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

	中欧骏盈货币A	中欧骏盈货币B
报告期期初基金份额总额	18,211.85	473,720,150.58
报告期期间基金总申购份额	3,317.59	4,590,593.53
报告期期间基金总赎回份额	911.65	–
报告期期末基金份额总额	20,617.79	478,310,744.11

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

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年7月1日至2017年9月30日	473,720,150.58	4590593.53	0	478310744.11	100%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

注：1、申购份额包含红利再投资份额。

2、截止本报告期末，上表中的单一投资者持有本基金的比例为99.9957%，上表展示的比例系四舍五入后的结果。

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、中欧骏盈货币市场基金相关批准文件

2、《中欧骏盈货币市场基金基金合同》

3、《中欧骏盈货币市场基金托管协议》

4、《中欧骏盈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报纸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、基金托管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

二〇一七年十月二十六日

中欧骏泰货币市场基金

2017年第三季度报告

2017年09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：2017年10月26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2017年10月24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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧骏泰货币
交易代码	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	5,187,195,343.73
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

§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（2017年07月01日-2017年09月30日）
1.本期已实现收益	55,733,652.86
2.本期利润	55,733,652.86
3.期末基金资产净值	5,187,195,343.73

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 本报告期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

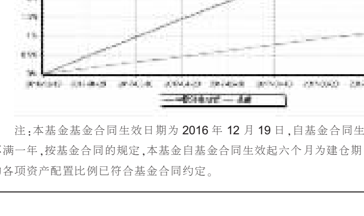
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0967%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.7564%	0.0005%

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-2017年09月30日）



注：本基金基金合同生效日期为2016年12月19日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已符合基金合同约定。

§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		
黄华	资产配置总监、基金经理	2017年03月24日		9年	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10日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司基金经理助理

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。

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

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，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价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%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度经济数据持续好于预期，9月官方制造业PMI为52.4，创五年多最高水平，比8月上升0.7个百分点，指向制造业景气回暖，且需求、生产、价格、库存全线上升。而然9月财新中国制造业PMI录得51.0，不及预期，低于8月0.6个百分点，终结此前连续三个月的上升趋势。显示制造业扩张速度继续放缓，以及中观行业中终端需求放缓、工业生产好坏参半，均意味着制造业回升的基础并不牢固。

从生产端来看，9月中旬重点钢企产量增速再降至4.3%，上中旬产量增速5.2%，较8月的9.8%明显下滑。而国节前一周钢价回落，高炉开工率跌幅扩大至-5.6%，也都指向9月粗钢产销增势低迷。而9月全国制造业PMI创12年5月以来新高，加之环保限产影响延续，令假期后钢价再度冲高。地产需求显弱，9月44城地产销量同比增速继续回落至-33%，其中18个三四线城市销量增速同比降至-14%，创14年以来新低，预示9月全国地产销量增速或继续下滑。9月百城土地成交仍高位持平，同比增速回升至20%左右，预示全国土地购置平稳，对未来短期地产投资形成支撑。此外，库存方面，9月十大城市商品房存销比回升至10.1个月，处历年同期偏高水平。

在债券市场运行方面，市场聚焦在货币政策和金融去杠杆监管政策的发展上。无论是央行货币政策、公开市场操作、市场资金面走势，都仍然以"稳"字为核心，"不松不紧"为主基调。一方面，9月30日央行公布"定向将准"政策，反映出央行对于货币政策的维稳态度，货币政策不存在进一步收紧的可能性；另一方面，由于棚改、基建投资等对经济的支撑作用，使得经济下行压力并不明显，货币政策也不存在"大水漫灌"的可能性。因此，在"稳健中性"的总基调下，央行通过预调微调与预期管理来调控资金面，维持稳定资金局面。

三季度债券市场收益率先下后上，震荡走势。2017年三季度，本基金在兼顾流动性、控制风险的同时，以提高收益为主要目标，在月末、季末和缴税、缴准等关键时间点加大配置力度，重点配置存款和存单。基金在日常操作中维持偏低杠杆水平，中等剩余期限。在保持收益率稳定的同时为投资者提供了较高的流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金净值增长率为1.0967%，同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	2,308,457,785.16	42.43
	其中：债券	2,308,457,785.16	42.43
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	935,850,000.00	17.20
	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	2,172,481,024.89	39.93
4	其他资产	23,686,630.96	0.44
5	合计	5,440,475,441.01	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	–	6.77
	其中：买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	251,599,302.60	4.85
	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	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

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	20.09	4.85
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天（含）—60天	30.13	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天（含）—90天	24.25	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天（含）—120天	8.99	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天（含）—397天（含）	20.95	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	104.41	4.85

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

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	280,040,163.39	5.40
	其中：政策性金融债	280,040,163.39	5.40
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	2,028,417,621.77	39.10
8	其他	–	–
9	合计	2,308,457,785.16	44.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

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

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	111711365	17平安银行CD365	2,000,000	198,803,839.52	3.83
2	111717195	17光大银行CD195	2,000,000	198,601,055.33	3.83
3	150201	15国开01	1,300,000	130,108,755.25	2.51
4	111780873	17赣州银行CD190	1,000,000	99,889,729.07	1.93
5	111709334	17浦发银行CD334	1,000,000	99,473,886.09	1.92
6	111718343	17华夏银行CD343	1,000,000	99,171,338.63	1.91
7	111799723	17贵阳银行CD074	1,000,000	98,990,418.17	1.91
8	111715192	17民生银行CD192(总价)	1,000,000	98,972,177.55	1.91
9	111780871	17杭州银行CD132(总价)	1,000,000	98,789,647.98	1.90
10	111710351	17兴业银行CD351(总价)	1,000,000	98,765,956.59	1.90

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	0.0425%
报告期内偏离度的最低值	-0.0175%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0195%

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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1.000元。

5.9.2 本基金投资的前十大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

金额单位：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	23,686,630.96
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	23,686,630.96

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

报告期期初基金份额总额	4,314,065,504.80
报告期期间基金总申购份额	1,989,899,297.19
减：报告期期间基金总赎回份额	1,116,769,458.26
报告期期末基金份额总额	5,187,195,343.73

注：总申购份额含红利再投份额。

§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	申购	2017年07月06日	40,000,000.00	40,000,000.00	–
2	红利再投	2017年07月11日	885,362.31	885,362.31	–
3	申购	2017年07月14日	10,000,000.00	10,000,000.00	–
4	申购	2017年08月08日	35,000,000.00	35,000,000.00	–
5	红利再投	2017年08月11日	1,095,684.69	1,095,684.69	–
6	红利再投	2017年09月11日	1,201,690.56	1,201,690.56	–
7	申购	2017年09月11日	10,000,000.00	10,000,000.00	–
8	申购	2017年09月12日	10,000,000.00	10,000,000.00	–
9	申购	2017年09月13日	10,000,000.00	10,000,000.00	–
10	申购	2017年09月14日	5,000,000.00	5,000,000.00	–
合计			123,182,737.56	123,182,737.56	

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年7月1日至2017年7月6日	915413439.56	1002098864		9254344282	17.84%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

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报纸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、基金托管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

2017年10月26日

中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2017年10月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧达安混合
基金主代码	004283
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年3月3日
报告期末基金份额总额	679,993,845.47份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金管理人将运用多策略进行债券资产组合投资，根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置。在确定组合久期基础上进行组合期限配置形态的调整，通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析，"自上而下"在各类债券资产类别之间进行类属配置，"自下而上"进行个券选择。在市场收益率以及个券收益率变化过程中，灵活运用骑乘策略、套息策略、利差策略等增强组合收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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（2017年7月1日-2017年9月30日）
1.本期已实现收益	17,919,756.18
2.本期利润	10,609,514.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0156
4.期末基金资产净值	708,080,458.33
5.期末基金份额净值	1.0413

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.所述基金业绩指标不包括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 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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.52%	0.14%	0.33%	0.06%	1.19%	0.08%

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

中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017年03月03日-2017年09月30日）

注：本基金基金合同生效日期为2017年3月3日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同规定。

§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		
尹诚庸	基金经理	2017年3月3日	–	6年	历任招商证券股份有限公司固定收益总部研究员、投资经理。2014年12月8日加入中欧基金管理有限公司，历任中欧基金管理有限公司基金经理助理兼研究员

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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价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%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度外围环境的波动加大，经济基本面以外的不确定性因素增多。7月的市场仍然延续了6月的流动性预期修复趋势，风险偏好提升。但是从8月初开始，美国总统与朝鲜国家领导人的嘴炮不断升温，期间伴随朝鲜间或进行的核试验、导弹试射和隔空喊话，导致全球市场的避险情绪升温，主要发达经济体的股市发生调整，债券收益率回落。随着时间的推移，朝美关系波动的负面因素逐步被市场消化，且爆发战争的极端可能被市场排除，VIX指数渐渐平复。避险因素随之消退。进入9月，美联储正式宣布启动缩表，加之美国就业数据的强劲，重新推升全球的风险偏好，美股重拾上升通道，美债收益率在12月加息预期升温的情绪下大幅反弹。

国内的增长端数据终于出现了筑顶迹象。在不断加码的限购、限贷政策压制下，一、二线为代表的龙头城市房地产销售数据不断走弱，甚至给"金九银十"抹上了一丝灰暗。但是由于一、二线城市的新房销售和投资占比并不高，三、四线城市的销售在棚改货币化的支撑下仍然较为坚挺，因此需求端的下滑斜率并不陡峭，稳中有降。固定资产投资同比增速持续跌入个位数区间，同时信贷投放数据又一直强韧。

供给侧改革和环保严查的推进则进一步超出市场的想象。新疆、内蒙、山东和河南地区的电解铝违规产能去化计划和执行力度都超出了前期的市场一致预期，实质上导致采暖季限产之后全球将出现约7月份的电解铝短缺。7月环保部颁布的固废进口禁令发布后，国内美废原料供应短缺，以美废作为主要原料的包装、文化纸品价格发生了持续、大幅的上涨。前期受到供给侧改革影响较小的化工、印染、有色等行业，普遍存在中小厂商的环保和排污问题，这部分产能纷纷在三季度的环保督查中出现了供给端收缩。这就导致黑色系价格走稳回调之后，涨价潮蔓延到有色、化工等其它品类。

总体来看，三季度的供给端仍然受到压制，需求端仅仅小幅走弱，导致整个经济的产出缺口仍然维持，大部分产品的价格上涨压力并没有明显缓解。但是，以房地产投资为代表的需求端边际走弱，导致各工业品品类之间的分化开始出现。最明显的就是投资直接相关的黑色系价格大幅走弱，库存开始明显累积，而其他品类工业品仍能保持较为坚挺的价格走势。

在不温不火的经济环境下，货币政策相对二季度有明显的收紧，政策重心重新偏向去杠杆方面。央行在公开市场净投放的天数和金额均明显减少。DR007均值显著抬高。但是在季末的时点，远期定向降准政策突然出台，给未来的政策走向带来变数。政策出现在了一个市场预期外的时点，远期落地执行的时间也异于常规。我们认为，目前去杠杆任务尚未结束，需求端的筑顶也很平缓，外需尚且稳定，信贷数据始终维持在较强区间，没有见到货币政策完全转向的必要。但是，9月相互悖离的官方与财新PMI也许可以帮助我们一窥定向降准出台的背景。也就是供给侧改革和债转股解决了国企债务问题，却始终无法触及民营部门以及中小企业（本质上是一块硬币的两面）疲软的结构性问题。并且这一轮上游相对寡头竞争的行业价格上涨之后，遍布下游的中小企业生存状态一定意义上更加困难了。从这个角度来说，国务院常务会议的喊话落点即在此。央行的反应说明去杠杆仍然在路上，但是边际上已经走平，而不再是愈发收紧。"水无常形"。流动性投放的方式或许可以是结构性的，最终对于货币市场造成的影响却一定是全局性的。我们认为，实际上不太可能精确测算出定向降准的具体数额，也没有必要纠结于这个数字，需要关注的是政策出台所表现出来的决策层在货币政策的方向上发生的微妙变化。货币政策的边际走向似乎已经微调到有利于市场的一边。

整个7-8月间，由于经济增长的基本面仍然强劲，未见到任何筑顶的迹象，因此我们判断债券市场机会不大，套息仍是主要策略。主要趁资金面宽松的环境，主动降低了债券组合杠杆。并维持组合久期不变，在发生调整的时机择机买入静态收益率较高的高等级国企信用债券。进入8月下旬之后，资金面开始过渡到跨季模式，信用债收益率有所上行，大量2年左右高等级国企信用债收益率进入合意区间，因此我们开始在控制杠杆的前提下逐步增加该类资产的配置。进入9月，一季度末配置的大量存款和存单开始到期。与此同时，各类增长数据相继发布之后，经济增长缓步筑顶的迹象初现端倪。虽然此时的现金类资产收益率同样诱人，但是我们认为债券类资产的配置价值正在恢复，因此我们开始通过加杠杆的方式，在一级投标和二级交易上加快资产配置，并在长端主动增加了利率品的配置，以期通过哑铃型配置拉长组合久期。

权益方面，由于对企业盈利和流动性预期均较为乐观，因此我们基本保持了较高的仓位。行业上主要是金融股+周期股+消费股。在8月之后，我们降低了黑色系周期股的持仓，主要保留了有色、建材、化工等相关度较弱、产品价格维持上涨的细分行业。但是周期股的总体表现不佳，因此三季度的权益仓位总体贡献一般。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为1.52%，同期业绩比较基准增长率为0.33%。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	权益投资	117,809,999.87	13.96
	其中：股票	117,809,999.87	13.96
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	468,624,523.80	55.51
	其中：债券	468,624,523.80	55.51
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	39,000,000.00	4.62
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	205,011,867.35	24.29
8	其他资产	13,727,486.63	1.63
9	合计	844,173,877.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	5,966,430.00	0.84
C	制造业	61,650,920.43	8.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,819,736.00	0.54
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	4,078,803.45	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	8,054,859.91	1.14
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	–
J	金融业	31,080,674.91	4.39
K	房地产业	2,994,582.70	0.42
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	31,224.45	–
S	综合	–	–
	合计	117,809,999.87	16.64

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601988	中国银行	1,365,300	5,625,036.00	0.79
2	601600	中国铝业	738,500	5,590,445.00	0.79
3	601288	农业银行	1,424,537	5,441,731.34	0.77
4	601006	大秦铁路	569,600	4,984,000.00	0.70
5	600276	恒瑞医药	68,800	4,123,184.00	0.58
6	002087	新野纺织	685,000	4,116,850.00	0.58
7	601607	上海医药	170,700	4,052,418.00	0.57
8	600036	招商银行	152,551	3,897,678.05	0.55
9	601939	建设银行	557,400	3,885,078.00	0.55
10	600886	国投电力	520,400	3,819,736.00	0.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（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	29,730,000.00	4.20
	其中：政策性金融债	29,730,000.00	4.20
4	企业债券	309,241,755.60	43.67
5	企业短期融资券	40,125,000.00	5.67
6	中期票据	89,010,000.00	12.57
7	可转债(可交换债)	517,768.20	0.07
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	468,624,523.80	66.18

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	122067	11南钢债	383,000	38,315,320.00	5.41
2	1282349	12中煤MTN1	300,000	30,183,000.00	4.26
3	011760080	17冀水泥SCP001	300,000	30,087,000.00	4.25
4	170206	17国开06	300,000	29,730,000.00	4.20
5	136026	15蒙阜丰	300,000	29,514,000.00	4.17

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	115,202.01
2	应收证券清算款	1,055,235.80
3	应收股利	–
4	应收利息	12,557,048.82
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	13,727,486.63

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601600	中国铝业	5,590,445.00	0.79	停牌

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	679,993,845.47
报告期期间基金总申购份额	–
减：报告期期间基金总赎回份额	–
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–
报告期期末基金份额总额	679,993,845.47

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情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金相关批准文件

2、《中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》

3、《中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》

4、《中欧达安一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》

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报纸上公开披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人的住所。

8.3 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

二〇一七年十月二十六日