中欧量化驱动混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月24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2018年10月23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2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧量化驱动混合
基金主代码	001980
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年06月16日
报告期末基金份额总额	106,106,895.36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	根据本基金的投资目标,投资理念和投资范围,采用技术资资产配置策略,固不断评估各类资产的风险收益特征,以调整投资组合中的大类资产配置,从变化的市场条件中获利,并强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
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,属于较高预期收益和较高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(2018年07月01日 - 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-6,153,989.42
2.本期利润	-11,238,565.74
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0912
4.期末基金资产净值	94,664,938.66
5.期末基金份额净值	0.8921

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。

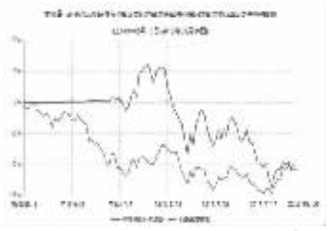
2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-11.48%	1.61%	-1.44%	1.09%	-10.04%	0.52%

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



注:本基金基金合同生效日期为2018年5月16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应当符合基金合同约定。

§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		
曲径	策略组负责人,基金经理	2018-06-16	-	11年	历任千禧年基金基金经理,中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015-04-01加入中欧基金管理有限公司

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

回顾2018年前三季度,A股市场经历了年初蓝筹带动的短暂行情后,进入了持续下跌调整。海外贸易摩擦产生的不确定性,叠加国内去杠杆大环境下投资者对经济动能的疑虑,使得资本市场对后市保有谨慎情绪;三季度美股处于相对高位,且美国经济逐步体现出对远期繁荣的不确定,我们认为美股大概率将在四季度或明年一季度发生调整,美国下跌将对所有新兴市场,包括A股都是较大挑战。另一方面,也看到国内货币政策逐步进入边际宽松,配合一系列政策,如深圳市国资委出资驰援上市公司的动作、证监会重组并购的鼓励性新规,都有利于权益市场在寻底的过程中逐步企稳;结合外部的不确定性和内部去杠杆的持续推进,我们认为股票市场大幅反弹的概率不大。在可见的未来,权益投资收益会主要来自于个股研究的Alpha而非市场趋势的Beta。

站在当前,我们维持年初的判断,即2016年底为始的蓝筹行情已经告一段落,即便经过三个季度的调整,估值仍不便宜,部分蓝筹的估值依然高于历史中枢,再叠加零售消费增速的回落,我们认为下半年机会较弱;同时,在房地产维持严调控和去杠杆持续的环境下,地产后周期产品增速也难为继。另一方面,以智能制造,计算机,5G通信为代表的成长股,经过一年多的调整,在盈利维持较高增速的情况下进入了估值合理的区间;同时在下半年宽货币宽信用的预期下,托底基建的上下游也可能产生投资机会。基金维持以创业板指锚定的行业配置,在上述较为看好行业上进行了超置。

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-11.48%,同期业绩比较基准收益率为-1.44%。

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	权益投资	79,660,180.33	83.49
	其中:股票	79,660,180.33	83.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	13,517,471.94	14.17
8	其他资产	2,230,487.08	2.34
9	合计	95,408,139.35	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	3,251,821.68	3.44
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,111,749.15	51.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,185,628.66	3.37
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,771,080.91	14.55
J	金融业	211,630.36	0.22
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,007,064.36	5.29
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	4,140,856.41	4.37
R	文化、体育和娱乐业	980,449.81	1.04
S	综合	-	-
	合计	79,660,180.33	84.16

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	300747	锐科激光	33,400	5,277,200.00	5.58
2	300203	聚光科技	174,200	4,323,644.00	4.57
3	300657	弘信电子	122,500	3,311,175.00	3.50
4	300498	温氏股份	140,044	3,251,821.68	3.44
5	300377	赢时胜	269,800	3,234,510.00	3.42
6	300196	长海股份	333,586	3,202,540.80	3.38
7	300413	芒果超媒	94,442	3,185,628.66	3.37
8	300347	泰格医药	57,025	3,063,544.16	3.24
9	300750	宁德时代	38,400	2,803,200.00	2.96
10	300284	苏交科	274,000	2,742,740.00	2.90

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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。

5.10.2 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

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,以套期保值为主要目的,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。

5.11 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	80,066.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,486.06
5	应收申购款	2,147,934.55
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,230,487.08

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	153,196,256.75
报告期期间基金总申购份额	44,106,169.10
减:报告期期间基金总赎回份额	91,195,530.49
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	106,106,895.36

注:本基金自2018年2月14日至2018年5月11日止期间公开发售,共募集有效净认购资金244,603,768.62元。根据《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同/招募说明书/基金份额发售公告》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入29,443.35元,在本基金成立后,折算为29,443.35份基金份额,划入基金份额持有人账户。

§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 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	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		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	2018年2月24日至2018年8月20日	0.00	39,107,394.70	21,530,842.93		17,576,551.77	16.57%
产品持有风险								
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,可能出现集中甚至引爆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:申购份额含红利再投份额、转换入份额,赎回份额含转换出份额。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中欧量化驱动混合型证券投资基金相关批准文件
2、《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》
3、《中欧量化驱动混合型证券投资基金托管协议》
4、《中欧量化驱动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

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
2018年10月24日

中欧骏泰货币市场基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月24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2018年10月23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2018年07月01日起至2018年09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	004029
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	11,848,539,737.44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,追求超越银行活期存款的稳定收益。
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,通过对期限结构、利率品种、信用品种、流动性品种的配置,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债券型基金、混合型基金和股票型基金。
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(2018年07月01日 - 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	72,117,620.46
2.本期利润	72,117,620.46
3.期末基金资产净值	11,848,539,737.44

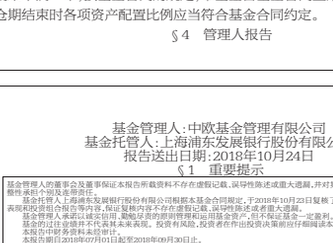
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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	0.8312%	0.0013%	0.3403%	0.0000%	0.4909%	0.0013%

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



§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	策略组负责人,基金经理	2017-03-24	2018-09-28	10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配置小组组长,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。2016-11-10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
蒋雯文	基金经理	2018-01-30	-	7年	历任新际香港有限公司销售交易员,平安资产管理有限责任公司债券交易员,前海开源基金投资经理助理。2016-11-17加入中欧基金管理有限公司,历任中欧基金管理有限公司交易员、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

三季度国内经济整体平稳,但仍然面临下行压力。预期三季度GDP同比6.6%,前值6.7%。供需双弱的局面仍然持续。供给方面,PMI分项中的生产、库存均回落。居民、企业的投资意愿持续低迷。宽信用的政策指向明显,但是路径仍待疏通。房地产投资增速继续回落,多地出现土地流拍,政府出台的一系列政策都加强了房地产开发商对于回款的现金流需求,供给方面,居民由于举债买房,杠杆高企,对于消费有明显的挤出效应,"房子是用来住的",因此政府不希望再走放水刺激房地产的老路。基建方面,政府正在加大基建投资,鼓励发行地方债,也是钢铁、水泥、煤炭成为需求端少有的改善科目的原因之一。需求方面持续低迷,41城房地产销量增速9月转负,国庆黄金周期间,零售、旅游、电影票房等收入增速也是全线下滑。三季度汽车销量大概率为负增长,今年汽车销量增速的放缓从6月开始,另外,去年6到8月4.9%、5.1%、6.2%的同期增速会给今年三季度的数据造成更大的冲击。国际方面,贸易战持续升温,世界银行已经因此调低了全球经济增速的预期。

三季度资金面仍然持续宽松,货币政策维持合理充裕。央行再次降准,其中一部分置换到期MLF,拉长资金期限,以维持资金面的长期稳定。宽信用逐步确立,但路径仍然有待疏通,鼓励银行买更低评级的信用债等等措施效果仍不够明显。

货币债券市场方面,宽货币的环境下,除特殊时点的些许波动外,整体来看银行间市场流动性充裕。一年期限的AAA银行存单收益率下行了40-50bp。

本基金在兼顾流性、控制风险的同时,以提高收益为主要目标,适当运用杠杆,重 点配置存款和存单。基金在日常操作中维持中等剩余期限,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, 基金份额净值收益率为0.1171%, 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	5,671,886,982.56	44.48
	其中:债券	5,667,076,982.56	44.44
	资产支持证券	4,810,000.00	0.04
2	买入返售金融资产	4,589,564,484.34	35.99
	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	2,470,899,206.32	19.38
4	其他资产	20,017,389.23	0.16
5	合计	12,752,368,062.45	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	5.39
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	900,107,889.84	7.60
	其中:买断式回购融资	-	-

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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

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	53.19	7.60
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	4.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	6.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	4.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	39.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	107.46	7.60

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	299,391,873.06	2.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	320,697,820.04	2.71
	其中:政策性金融债	320,697,820.04	2.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,046,987,289.47	42.60
8	其他	-	-
9	合计	5,667,076,982.56	47.83
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

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	111809215	18浦发银行CD215	3,000,000	299,613,443.63	2.53
2	111809332	18厦门国际银行CD032	3,000,000	296,069,924.12	2.50
3	111821131	18渤海银行CD131	2,400,000	239,793,549.63	2.02
4	111895276	18宁波银行CD068	2,000,000	199,810,891.32	1.69
5	111882296	18广州农村商业银行CD068	2,000,000	199,716,789.47	1.69
6	111813128	18浙商银行CD128	2,000,000	199,545,442.57	1.68
7	111892636	18南京银行CD032	2,000,000	198,714,923.73	1.68
8	111806199	18交通银行CD199	2,000,000	197,264,612.95	1.66
9	111803138	18农业银行CD138	2,000,000	197,215,598.86	1.66
10	111808224	18中信银行CD224	2,000,000	196,992,425.35	1.66

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	0.1448%
报告期内偏离度的最低值	0.0069%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0035%

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889112	18上和1A1	200,000	4,810,000.00	0.04

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 "本基金投资有18南京银行CD032(111892636.IB),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】7号),南京银行因其独立董事任职时间超过监管规定,被处罚款25万元;南京银行镇江分行于2018年1月9日收到江苏银监局行政处罚(苏银监罚决字【2018】1号),根据行政处罚书,南京银行镇江分行违法违规办理票据业务,严重违反审慎经营规则,被处以罚款人民币3230万元。

在上述公告公布后,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南京银行CD032(111892636.IB)的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对该上市公司的投资判断未发生改变。其余九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。"

5.9.3 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	19,893,264.16
4	应收申购款	124,125.07
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	20,017,389.23

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	4,906,477,193.89
报告期期间基金总申购份额	8,964,279,677.72
报告期期间基金总赎回份额	2,012,217,134.17
报告期期末基金份额总额	11,848,539,737.44

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	申赎	2018-09-27	-15,019,793.43	-15,019,793.43	0.0000
2	申赎	2018-09-19	-10,006,421.09	-10,006,421.09	0.0000
3	红利发放	2018-09-11	442,904.91	442,904.91	0.0000
4	申赎	2018-09-07	70,000,000.00	70,000,000.00	0.0000
5	申赎	2018-08-28	10,000,000.00	10,000,000.00	0.0000
6	红利发放	2018-08-13	534,915.27	534,915.27	0.0000
7	申赎	2018-08-10	5,000,000.00	5,000,000.00	0.0000
8	申赎	2018-08-02	-5,009,224.17	-5,009,224.17	-
9	申赎	2018-07-24	15,000,000.00	15,000,000.00	0.0000
10	申赎	2018-07-18	-10,006,742.11	-10,006,742.11	-
11	申赎	2018-07-13	-50,009,951.02	-50,009,951.02	0.0000
12	红利发放	2018-07-11	602,072.36	602,072.36	0.0000
13	申赎	2018-07-04	50,000,000.00	50,000,000.00	0.0000
合计			61,528,760.72	61,528,760.72	

注:本基金管理人运用固有资金申赎(包含转换)本基金所适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定,上表中交易日期为2018年7月18日和2018年8月2日的适用费率均为固定费用1000元。

§8 备查文件目录

8.1 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

8.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

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
2018年10月24日

中欧骏益货币市场基金

2018年第三季度报告

2018年第3季度报告
2018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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中欧骏益货币
基金主代码	004213
基金运作方式	契约型,开放式
基金合同生效日	2017年03月21日
报告期末基金份额总额	132,845,49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,追求超越银行活期存款的稳定收益。
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,通过对期限结构、利率品种、信用品种、流动性品种的配置,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	中国建设银行股份有限公司

§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(2018年07月01日 - 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	155.44
2.本期利润	155.44
3.期末基金资产净值	132