

# 九泰日添金货币市场基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 25 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 2016 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	九泰日添金货币	
基金主代码	001842	
交易代码	001842	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 8 日	
报告期末基金份额总额	580,907,845.98 份	
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金根据对利率尤其是短期利率变动的预测，采用定性和定量分析的方法，构建稳健的投资组合。具体策略包括：类属配置策略、现金流管理策略、久期控制策略、银行存款投资策略。	
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期收益和风险低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	九泰日添金货币 A	九泰日添金货币 B
下属分级基金的交易代码	001842	001843
报告期末下属分级基金的份额总额	146,377,081.03 份	434,530,764.95 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（2016年7月1日—2016年9月30日）	
	九泰日添金货币 A	九泰日添金货币 B
1. 本期已实现收益	990,661.23	3,843,802.76
2. 本期利润	990,661.23	3,843,802.76
3. 期末基金资产净值	146,377,081.03	434,530,764.95

注：1、本基金收益分配是按日结转份额；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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

###### 九泰日添金货币 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	0.7271%	0.0028%	0.3393%	0.0000%	0.3878%	0.0028%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

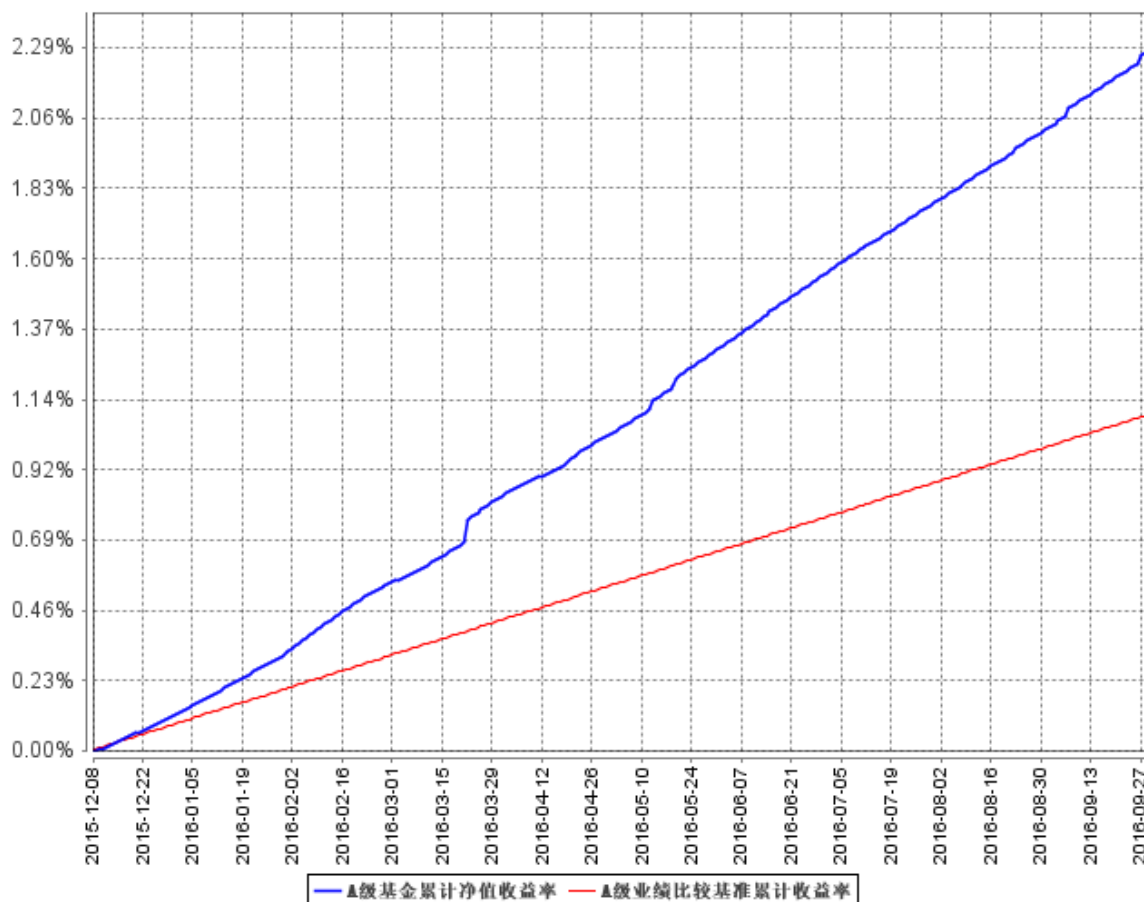
###### 九泰日添金货币 B

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	0.7879%	0.0028%	0.3393%	0.0000%	0.4486%	0.0028%

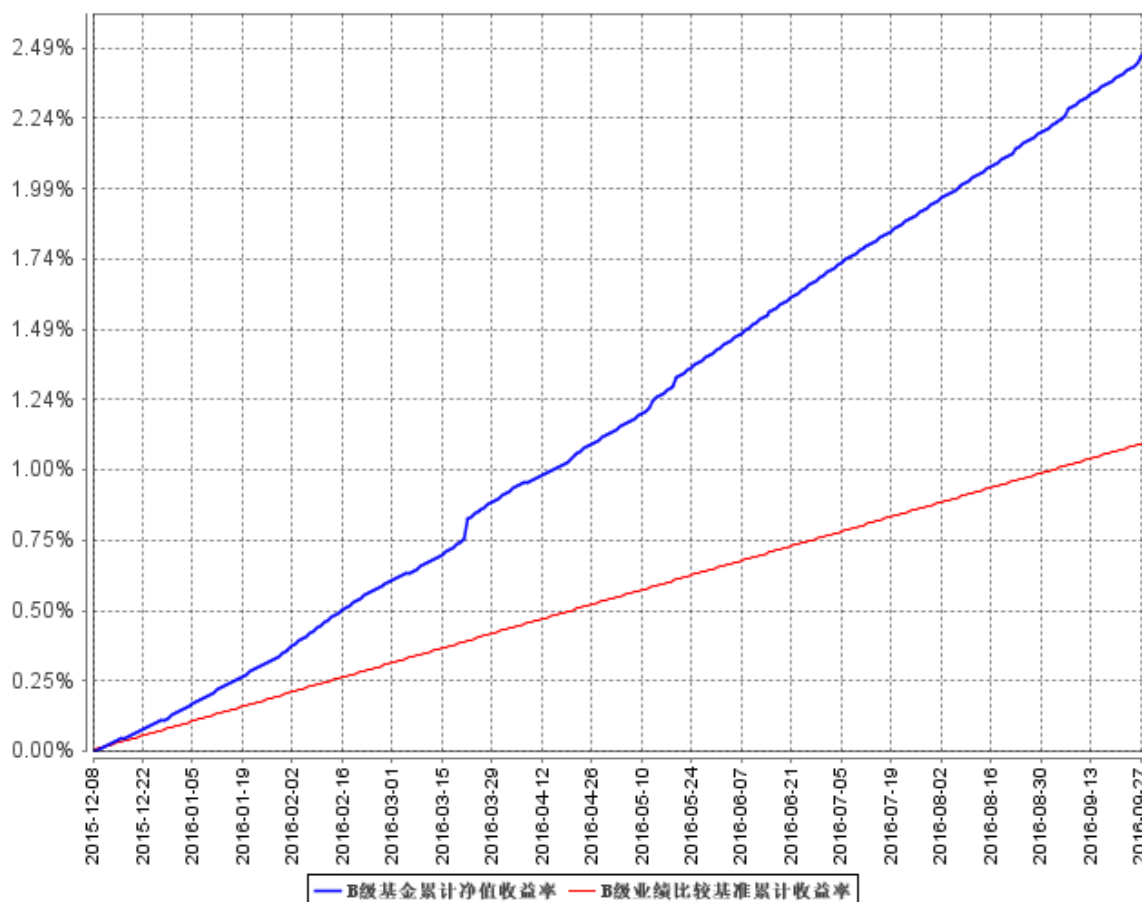
注：本基金收益分配是按日结转份额。

### 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

**A级基金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**



B级基金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：1. 本基金合同于 2015 年 12 月 8 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2. 根据基金合同的规定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求，截至本报告期末基金尚未完成建仓。

## §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		
王玥晰	基金经理	2015 年 12 月 8 日	-	8	经济系金融经济学硕士，中国籍，全国银行间同业拆解市场本币交易员。8 年证券从业经验，具有基金从业资格。历任诺安基金管理有限公司债券交易员，基金经理助理，诺安货币市场基金 A/B 基金经理（2013 年 7 月 31 日至 2015 年 1 月 6 日）。2015 年 6 月加入九泰基金管

					理有限公司担任基金经理。
--	--	--	--	--	--------------

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度的规定。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的季度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的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 5%的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度，房地产进一步升温，居民房地产按揭贷款对信贷数据贡献较大；但实体经济的正常融资需求依旧严重不足，经济先行指标不甚乐观。全球货币政策风向微调，开始反思负利率；国内宽松的货币政策对实体经济的刺激有限，市场对宽松货币政策的预期有所改变。央行重启 14 天逆回购，货币市场流动性预期收紧；跨季资金面紧张，利率上行。受到长期获利回吐的影响，长端利率品种出现一定幅度的回调，但信用利差持续下行。九泰日添金货币市场基金做为“现金管理工具”，始终把资产的流动性放在首位。本季度，日添金货币市场基金的流动性未出现异常，满足了投资者正常的申购、赎回要求及大额赎回申请。日添金货币市场基金灵活运用债券回购和银行存款等货币市场工具，使组合具有较强的流动性。九泰日添金货币市场基金注重资产的安全性，在参考外部评级数据的基础上，进行严谨的内部评级筛选，严格把控信用风险。日添金货币市场基金在报告期内取得了正收益，远超业绩比较基准。

预计四季度，在经济基本面的影响下，债市仍存在一定投资机会。九泰日添金货币市场基金将继续密切关注经济基本面和政策面的变化以及资金面的动向，判断债券收益率走势，把握投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值 A 类增长率为 0.7271%，业绩比较基准收益率为 0.3393%；本报告期基金份额净值 B 类增长率为 0.7879%，业绩比较基准收益率为 0.3393%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	199,998,180.65	33.59
	其中：债券	199,998,180.65	33.59
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	390,001,825.00	65.50
	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	1,329,099.08	0.22
4	其他资产	4,051,358.83	0.68
5	合计	595,380,463.56	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.43	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	13,999,859.00	2.41
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本报告期内，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基

金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

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	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

### 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，本货币市场基金未发生投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 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	74.26	2.41
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	-	-
	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)	27.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.79	2.41

## 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，本货币市场基金未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。



### 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	40,035,864.26	6.89
	其中：政策性金融债	40,035,864.26	6.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	159,962,316.39	27.54
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	199,998,180.65	34.43
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序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	110417	11 农发 17	400,000	40,035,864.26	6.89
2	041673003	16 中信重工 CP001	300,000	29,990,995.11	5.16
3	041659015	16 义乌国资 CP002	300,000	29,974,814.03	5.16
4	041655006	16 泰华信 CP001	200,000	20,026,112.47	3.45
5	041657003	16 渝保税 CP001	200,000	19,991,191.48	3.44
6	041662029	16 无锡建投 CP001	200,000	19,989,403.58	3.44
7	041676003	16 杭州城建 CP002	200,000	19,988,831.61	3.44
8	041656009	16 泉州国资 CP001	100,000	10,007,112.61	1.72
9	041651033	16 粤航运 CP001	100,000	9,993,855.50	1.72

注：本基金本报告期末仅持有 9 只债券。

### 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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1205%

报告期内偏离度的最低值	0.0370%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0801%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内，本货币市场基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内，本货币市场基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 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

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

### 5.9.2

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### 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	4,050,558.50
4	应收申购款	800.00
5	其他应收款	0.33
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,051,358.83

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰日添金货币 A	九泰日添金货币 B
报告期期初基金份额总额	152,727,076.28	322,986,751.46
报告期期间基金总申购份额	336,360,047.56	612,361,212.98
报告期期间基金总赎回份额	342,710,042.81	500,817,199.49
报告期期末基金份额总额	146,377,081.03	434,530,764.95

注：A 类和 B 类总申购份额含因份额升降级等原因导致的强制调增份额，总赎回份额含因份额升降级等原因导致的强制调减份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，我公司根据《货币市场基金监督管理办法》（证监会令第 120 号）、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、北京证监局《关于修改货币市场基金合同有关问题的通知》，修改了《九泰日添金货币市场基金基金合同》。同时，根据《基金合同》修改的内容对《九泰日添金货币市场基金托管协议》、《九泰日添金货币市场基金招募说明书》涉及的相关内容进行了修订。具体内容详见我公司官网于 2016 年 9 月 2 日发布的《关于九泰日添金货币市场基金修改基金合同的公告》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予九泰日添金货币市场基金募集注册的文件
- 2、《九泰日添金货币市场基金基金合同》
- 3、《九泰日添金货币市场基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、证监会要求的其他文件

### 9.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金

管理人处。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

九泰基金管理有限公司  
2016 年 10 月 25 日