九泰日添金货币市场基金
2019 年第 4 季度报告

2019 年 12 月 31 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：2020 年 1 月 21 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 2020 年 1 月 17 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 2019 年 10 月 1 日起至 12 月 31 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	401,989,766.98 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。投资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、同业存单投资策略、资产支持证券投资策略等。	
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	194,840,930.53 份	207,148,836.45 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（ 2019 年 10 月 1 日 － 2019 年 12 月 31 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	1,059,991.82	1,325,278.48
2. 本期利润	1,059,991.82	1,325,278.48
3. 期末基金资产净值	194,840,930.53	207,148,836.45

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

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	0.5100%	0.0024%	0.3403%	0.0000%	0.1697%	0.0024%

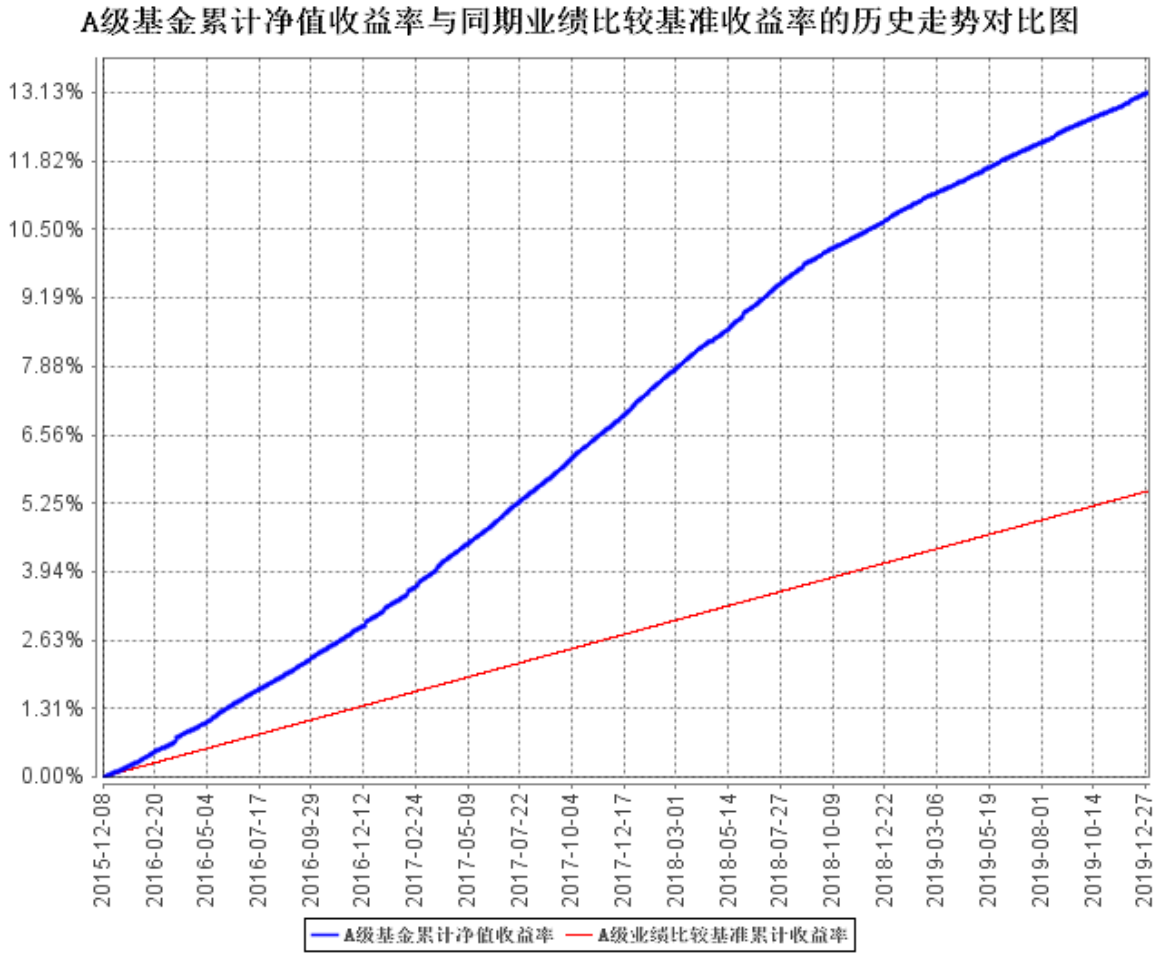
注：本基金收益分配是按日结转份额。

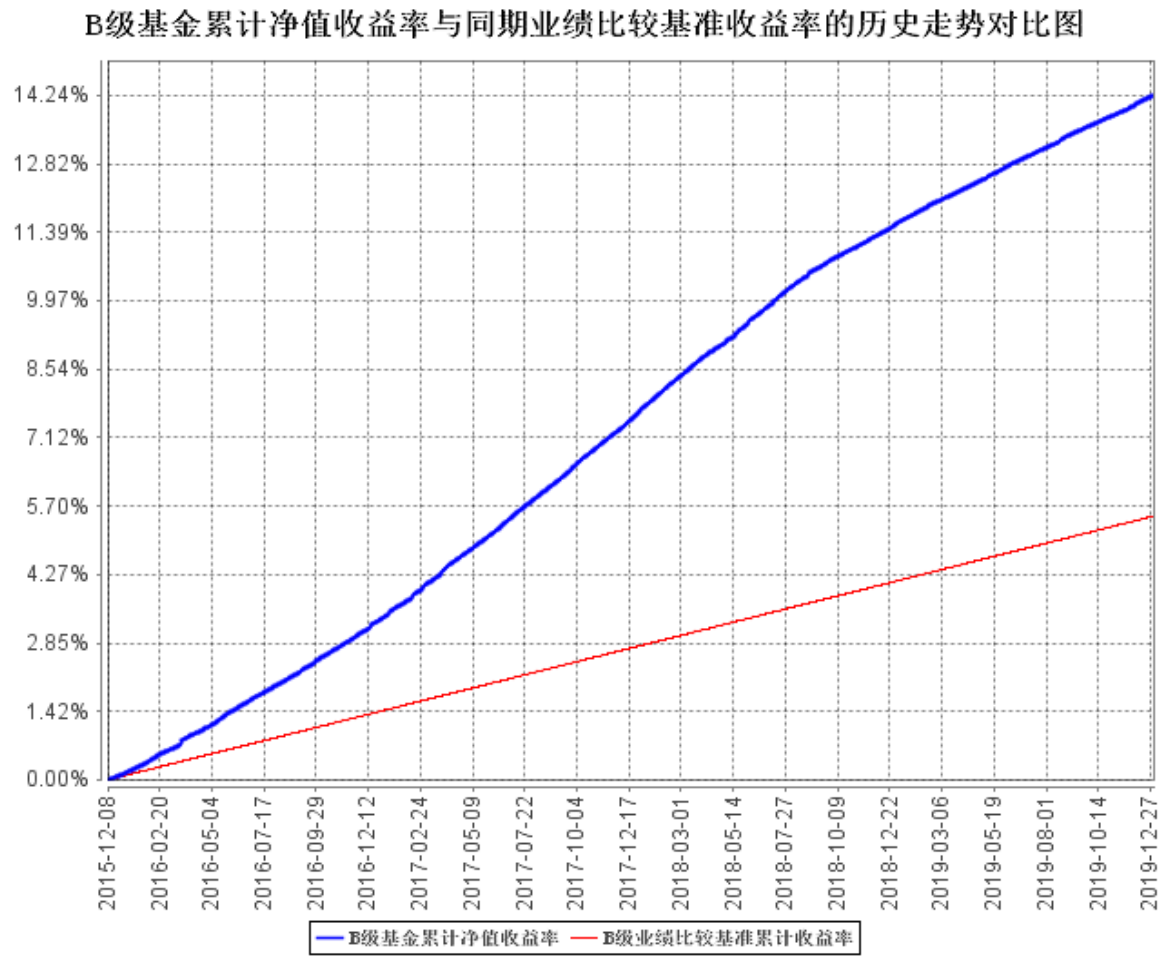
九泰日添金货币 B

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	0.5710%	0.0024%	0.3403%	0.0000%	0.2307%	0.0024%

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





注：1. 本基金合同于 2015 年 12 月 8 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束已满一年。

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，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
刘勇	基金经理、绝对收益部副总经理	2018 年 11 月 26 日	-	9	北京大学金融数学系学士、硕士，中国籍，具有基金从业资格，9 年证券从业经验。历任博时基金固定收益部研究员、博时基金固定收益部基金经理助理。2015 年 5 月加入九泰基金管理有限公司，曾任九

					泰久鑫债券型证券投资基金（2018 年 11 月 26 日至 2019 年 3 月 22 日）的基金经理，现任绝对收益部副总经理，九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（2018 年 10 月 31 日至今）、九泰日添金货币市场基金（2018 年 11 月 26 日至今）、九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金（原九泰久稳保本混合型证券投资基金，2018 年 11 月 26 日至今）的基金经理。

注：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。表中的任职日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本基金投资上注重流动性管理，一方面注意所投资品种自身的流动性，另一方面分散投资品种的到期时间。本基金本报告期流动性没有出现异常，满足了投资者正常的申购和赎回申请。本基金把保证资产的安全性放在首位，综合考虑外部评级和内部评级，严控信用风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期九泰日添金货币 A 的基金份额净值收益率为 0.5100%，本报告期九泰日添金货币 B 的基金份额净值收益率为 0.5710%，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	固定收益投资	390,401,240.76	92.48
	其中：债券	390,401,240.76	92.48
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	28,800,283.20	6.82
	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	75,579.73	0.02
4	其他资产	2,866,330.08	0.68
5	合计	422,143,433.77	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	4.13	
	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	19,739,850.39	4.91
	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基金资产净值的 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	21
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

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	66.87	4.91
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	37.20	-
	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	0.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.30	4.91

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	29,918,492.35	7.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	942,990.89	0.23
	其中：政策性金融债	942,990.89	0.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	140,000,208.10	34.83
6	中期票据	-	-
7	同业存单	219,539,549.42	54.61
8	其他	-	-
9	合计	390,401,240.76	97.12
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	111917001	19 光大银行 CD001	500,000	49,965,365.27	12.43
2	111916299	19 上海银行 CD299	500,000	49,960,376.93	12.43
3	111921378	19 渤海银行 CD378	500,000	49,870,297.08	12.41
4	111991319	19 宁波银行 CD035	500,000	49,817,256.27	12.39
5	071900116	19 光大证券 CP006BC	300,000	30,000,021.74	7.46
6	071900113	19 广发证券 CP006	300,000	30,000,020.07	7.46
7	071900114	19 东北证券 CP007	300,000	30,000,015.41	7.46
8	071900112	19 浙商证券 CP004	300,000	30,000,014.90	7.46
9	199947	19 贴现国债 47	300,000	29,918,492.35	7.44
10	071900117	19 天风证券 CP004	200,000	20,000,135.98	4.98

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	0.0647%
报告期内偏离度的最低值	0.0152%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0299%

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 基金计价方法说明

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体之一广发证券股份有限公司在本报告期编制日前一年内出现被监管部门处罚的情形：2019 年 8 月 5 日，广发证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会《关于对广发证券股份有限公司采取限制业务活动措施的决定》（中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书〔2019〕31 号），具体为：一是对广发控股（香港）有限公司（以下简称广发控股香港或者香港子公司）风险管控缺失，包括对香港子公司新业务风险管控不足，风控系统未实现对香港子公司风险数据的全覆盖，对香港子公司风控要求执行情况的监督检查力度不够等；二是对广发控股香港合规管理存在缺陷，对香港子公司合规管理有效性缺乏监督；三是对广发控股香港内部管控不足，包括财务、组织架构管控不力等；四是作为数据报送的责任主体，未做好广发控股香港月度数据统计工作，向中国证监会报送的数据不准确。采取行政监管措施为：采取限制增加场外衍生品业务规模 6 个月、限制增加新业务种类 6 个月的行政监管措施。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，其他九名证券发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、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	753,997.90
4	应收申购款	2,112,332.18
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,866,330.08

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	246,520,386.16	232,462,625.86
报告期期间基金总申购份额	135,526,987.34	36,822,091.24
报告期期间基金总赎回份额	187,206,442.97	62,135,880.65
报告期期末基金份额总额	194,840,930.53	207,148,836.45

注：申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含因份额升降级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

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
产品	1	20191001 至 20191231	205,412,891.58	1,171,669.60	0.00	206,584,561.18	51.39%
产品特有风险							
1、出现巨额赎回的风险 该机构投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。在单个基金份额持有人的赎回申请超过基金总份额 30%以上的情形下，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期办理。其他投资者的小额赎回申请也可能面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。 2、基金规模过小导致基金合同终止的风险 根据基金合同的约定，基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，本基金合同终止，无须召开基金份额持有人大会。机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5,000 万元情形，届时本基金存在基金合同终止的风险。						

注：上述投资者的申购份额为本报告期内收益分配中红利再投资份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金募集的文件；

2、基金合同；

3、托管协议；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、基金托管人业务资格批件、营业执照；

6、中国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

2020 年 1 月 21 日