

# 九泰日添金货币市场基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 年 10 月 27 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 2021 年 10 月 22 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 2021 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	190,688,104.07 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	178,332,637.18 份	12,355,466.89 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（2021年7月1日—2021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	809,295.06	59,696.38
2. 本期利润	809,295.06	59,696.38
3. 期末基金资产净值	178,332,637.18	12,355,466.89

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 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	0.4156%	0.0003%	0.3403%	0.0000%	0.0753%	0.0003%
过去六个月	0.8363%	0.0003%	0.6768%	0.0000%	0.1595%	0.0003%
过去一年	1.7772%	0.0007%	1.3491%	0.0000%	0.4281%	0.0007%
过去三年	5.9541%	0.0025%	4.0500%	0.0000%	1.9041%	0.0025%
过去五年	14.0200%	0.0045%	6.7491%	0.0000%	7.2709%	0.0045%
自基金合同生效起至今	16.6302%	0.0045%	7.8485%	0.0000%	8.7817%	0.0045%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

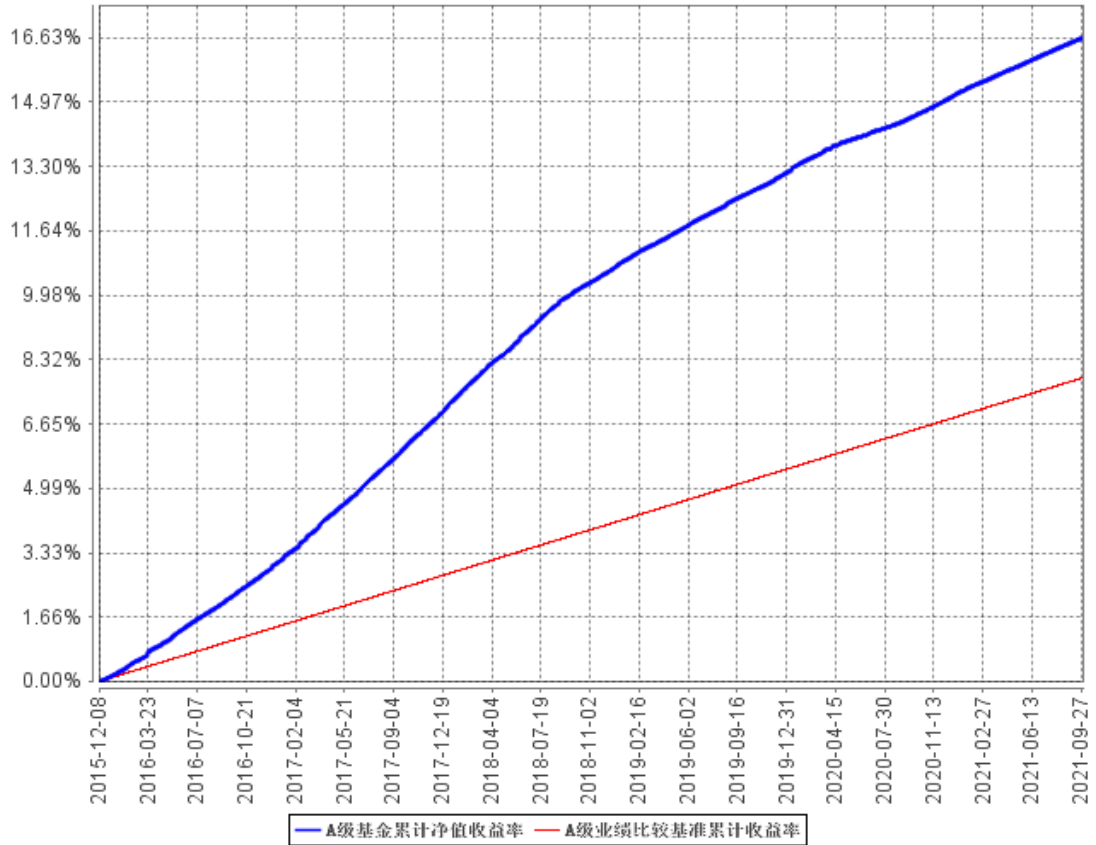
九泰日添金货币 B

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	0.4764%	0.0003%	0.3403%	0.0000%	0.1361%	0.0003%
过去六个月	0.9579%	0.0003%	0.6768%	0.0000%	0.2811%	0.0003%
过去一年	2.0212%	0.0007%	1.3491%	0.0000%	0.6721%	0.0007%
过去三年	6.7206%	0.0025%	4.0500%	0.0000%	2.6706%	0.0025%
过去五年	15.3975%	0.0045%	6.7491%	0.0000%	8.6484%	0.0045%
自基金合同生效起至今	18.2667%	0.0045%	7.8485%	0.0000%	10.4182%	0.0045%

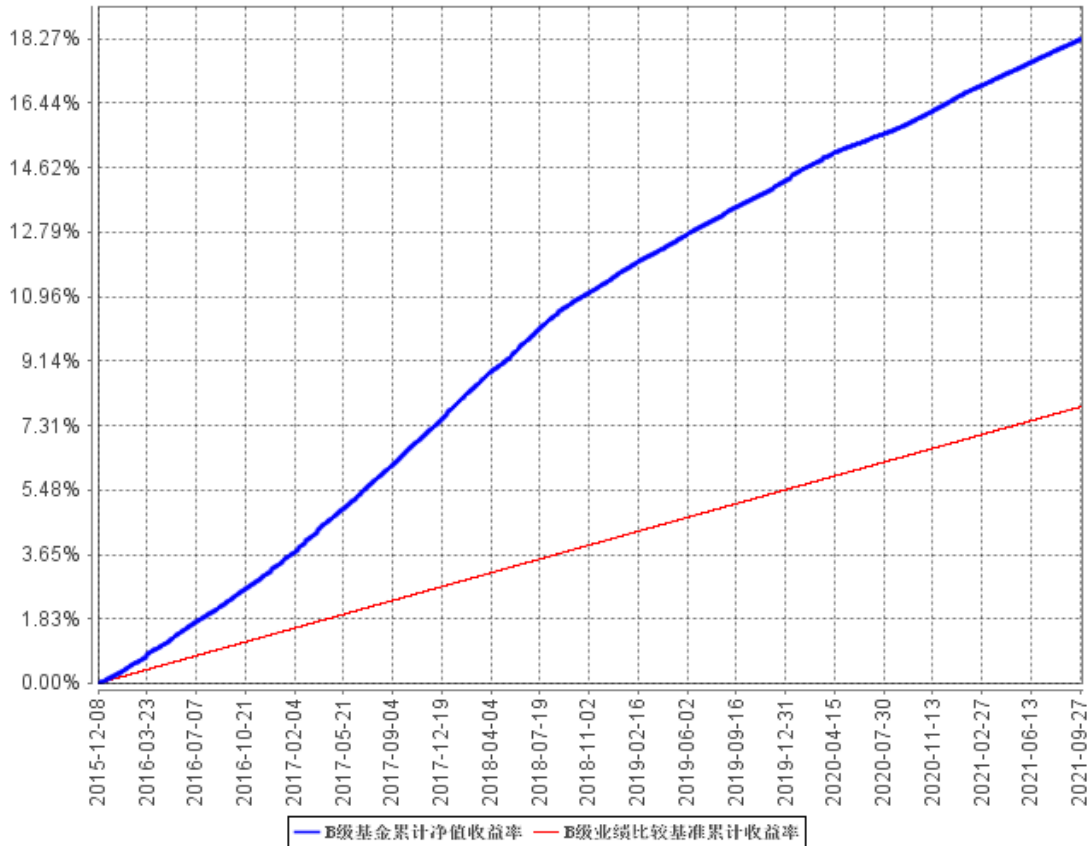
注：本基金收益分配是按日结转份额。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长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，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束已满一年。

2. 根据基金合同的约定，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		
刘勇	基金经理、绝对收益部副总经理	2018 年 11 月 26 日	-	11	北京大学金融数学系学士、硕士，中国籍，具有基金从业资格，11 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)、九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金(2018年10月31日至2020年10月29日)、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2020年10月29日)的基金经理。现任绝对收益部副总经理,九泰日添金货币市场基金(2018年11月26日至今)、九泰久嘉纯债3个月定期开放债券型证券投资基金(2020年8月21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，另一方面让所投资品种的到期时间较为分散。本基金的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。本基金严控信用风险，以利率债和存单为主要投资品种。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 类份额净值增长率为 0.4156%，本报告期本基金 B 类份额净值增长率为 0.4764%，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	119,860,804.61	60.77
	其中：债券	119,860,804.61	60.77
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	76,431,474.65	38.75
	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	404,474.13	0.21
4	其他资产	551,479.98	0.28
5	合计	197,248,233.37	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	1.81	
	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	6,299,870.55	3.30
	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	73
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	82.19	3.30
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	20.96	-
	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	-	-



	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	103.15	3.30

#### 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	20,023,150.65	10.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	99,837,653.96	52.36
8	其他	-	-
9	合计	119,860,804.61	62.86
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	200015	20 付息国债 15	200,000	20,023,150.65	10.50
2	112009443	20 浦发银行 CD443	200,000	19,975,469.87	10.48
3	112113137	21 浙商银行 CD137	200,000	19,971,578.35	10.47
4	112070616	20 徽商银行 CD102	200,000	19,962,678.21	10.47
5	112008248	20 中信银行 CD248	100,000	9,991,364.80	5.24
6	112013094	20 浙商银行 CD094	100,000	9,984,877.01	5.24
7	112106020	21 交通银行 CD020	100,000	9,976,082.44	5.23
8	112115223	21 民生银行	100,000	9,975,603.28	5.23

		CD223			
--	--	-------	--	--	--

注：本基金本报告期末仅持有上述 8 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0416%
报告期内偏离度的最低值	-0.0124%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0200%

#### 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 报告期末按摊余成本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中，中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司和交通银行股份有限公司在本报告编制日前一年内出现被监管部门处罚的情形：

一、2021 年 2 月 5 日，中国人民银行对中信银行股份有限公司作出了行政处罚（银罚字（2021）1 号），主要内容为：1、未按规定履行客户身份识别义务；2、未按规定保存客户身份资料和交易记录；3、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4、与身份不明的客户进行交易。中国人民银行对该银行罚款人民币 2890 万元。

二、2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对中国民生银行股份有限公司作出了行政处罚（银保监罚决字〔2021〕26 号），主要内容为：1、监管发现问题屡查屡犯；2、检查发现问题整改不到位；3、对责任人员的责任认定和问责不到位；4、内部制度管理不足，个别制度与监管要求冲突；5、配合现场检查不力；6、信息系统管控有效性不足；7、未向监管部门真实反映业务数据；8、未严格执行理财投资合作机构名单制管理；9、理财业务整改转型不符合监管要求；10、违规调整理财产品收益；11、理财产品收益兑付不合规；12、违规调节理财业务利润；13、使用内部账户截留理财产品浮动管理费收入和承接风险资产；14、理财产品间相互交易资产调节收益；15、理财产品未实现账实相符、单独托管；16、理财产品投资清单未反映真实情况，合格投资者认定不审慎；17、开放式公募理财产品投资杠杆水平超标；18、公募理财产品持有单只证券市值比例超标；19、开放式公募理财产品流动性资产持有比例不达标；20、理财产品信息登记不规范；21、理财产品信息披露不规范；22、理财产品托管不尽职；23、违规开展委托资产管理业务；24、同业业务未实行专营部门制；25、同业业务交易对手管理不健全；26、同业业务统一授信管理不到位；27、违规将转贴现票据转为投资资产，未真实反映票据规模；28、会计核算不规范；29、发行虚假结构性存款产品；30、未对信贷资产收益权转让业务对应资产计提资本；31、委托贷款委托人资质审查不审慎。中国银行保险监督管理委员会对该银行罚款人民币 11450 万元。

三、2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对上海浦东发展银行股份有限公司作出了行政处罚（银保监罚决字〔2021〕27 号），主要内容为：1、监管发现的问题屡查屡犯；2、配合现场检查不力；3、内部控制制度修订不及时；4、信息系统管控有效性不足；5、未向监管部门真实反映业务数据；6、净值型理财产品估值方法使用不准确；7、未严格执行理财投资合作机构名单制管理；8、理财产品相互交易调节收益；9、使用理财资金偿还本行贷款；10、理财产品发行审批管理不到位；11、权益类理财产品投资非权益类资产超比例；12、公募理财产品持有单只证券市值超比例；13、投资集合资金信托计划人数超限；14、面向非机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券；15、出具与事实不符的理财产品投资清单；16、私募理财产品销售文件未约定投资者冷静期；17、投资者投资私募理财产品金额不符合监管要求；18、理财产品资产配置与产品说明书约定不符；19、理财产品信息披露不合规；20、理财产品信息登记不规范；21、理财业务流动性风险管理不审慎；22、理财投资股票类业务管理不审慎；23、同业存款记入其他企业存款核算；24、同业投资投后检查流于形式；25、风险加权资产计量不准确；26、为无衍生品交易资格的机构发行结构性存款提供通道；27、结构性存款未实际嵌入金融衍生品；28、未落实委托贷款专户管理要求；29、借助通道违规发放委托贷款，承担实质性风险；30、委托贷款投

向不合规；31、违规向委托贷款借款人收取手续费。中国银行保险监督管理委员会对该银行罚款人民币 6920 万元。

四、2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司作出了行政处罚（银保监罚决字〔2021〕28 号），主要内容为：1、理财业务和同业业务制度不健全；2、理财业务数据与事实不符；3、部分理财业务发展与监管导向不符；4、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资；5、理财资金违规投向土地储备项目；6、理财产品相互交易调节收益；7、面向机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券；8、公募理财产品投资单只证券超限额；9、理财资金违规投向交易所上市交易的股票；10、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位；11、私募理财产品销售文件未约定冷静期；12、开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求；13、理财产品信息登记不及时；14、理财产品信息披露不合规；15、同业业务交易对手名单调整不及时；16、将同业存款纳入一般性存款核算；17、同业账户管理不规范；18、违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足；19、结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为；20、未严格审查委托贷款资金来源；21、违规向委托贷款借款人收取手续费；22、利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表；23、监管检查发现问题屡查屡犯。中国银行保险监督管理委员会对该银行罚款人民币 4100 万元。

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，其余前十大持有证券的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	551,479.98
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	551,479.98

### 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	201,016,098.66	12,798,986.03
报告期期间基金总申购份额	192,272,979.50	60,099.30
报告期期间基金总赎回份额	214,956,440.98	503,618.44
报告期期末基金份额总额	178,332,637.18	12,355,466.89

注：总申购份额含红利再投和转换入而增加的份额，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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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，也可在本基金管理人的网站进行查阅，网址为 [www.jtamc.com](http://www.jtamc.com)。

九泰基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日