

九泰日添金货币市场基金 2016 年第 1 季度报告

2016 年 3 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：2016 年 4 月 20 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 4 月 19 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 1 月 1 日起至 3 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	734,686,588.16 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	138,636,890.42 份	596,049,697.74 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1月1日—2016年3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	90,541.42	9,253,400.12
2. 本期利润	90,541.42	9,253,400.12
3. 期末基金资产净值	138,636,890.42	596,049,697.74

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	0.7048%	0.0068%	0.3357%	0.0000%	0.3691%	0.0068%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

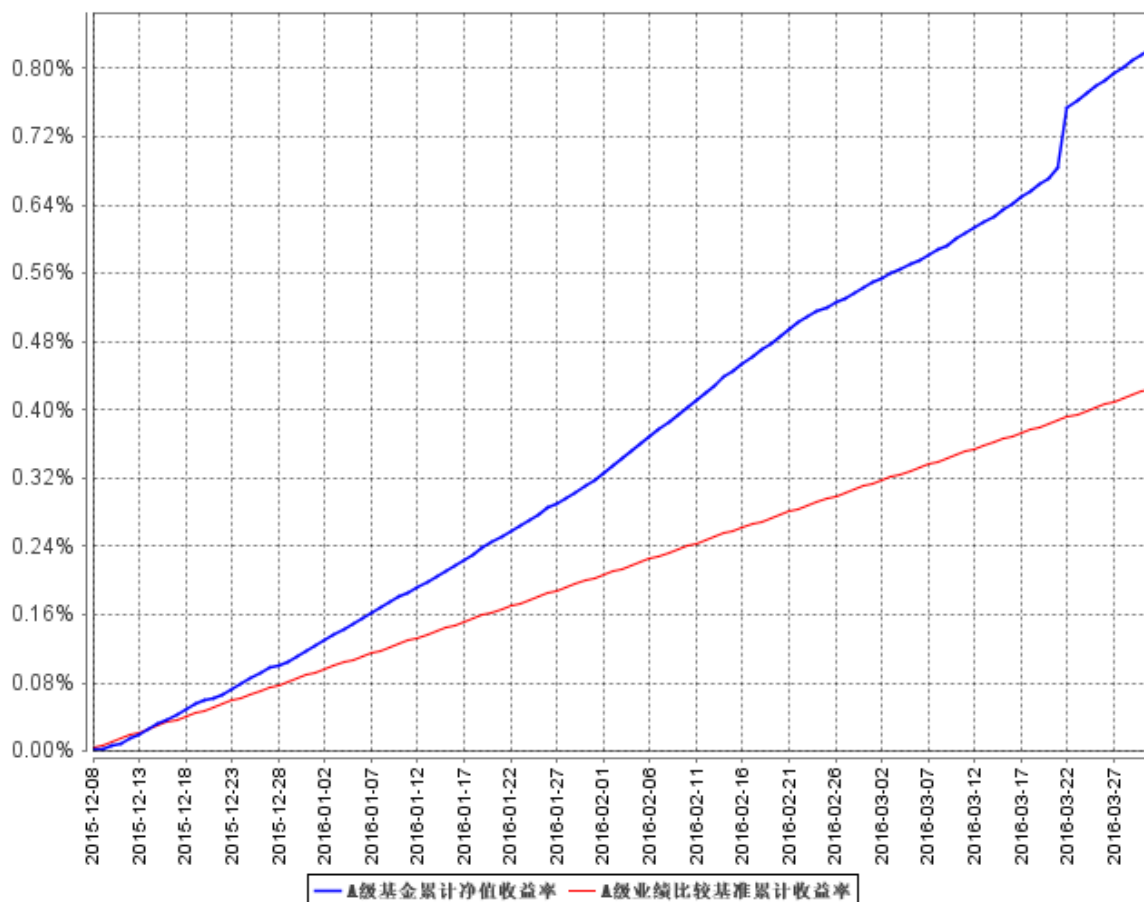
九泰日添金货币 B

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	0.7620%	0.0068%	0.3357%	0.0000%	0.4263%	0.0068%

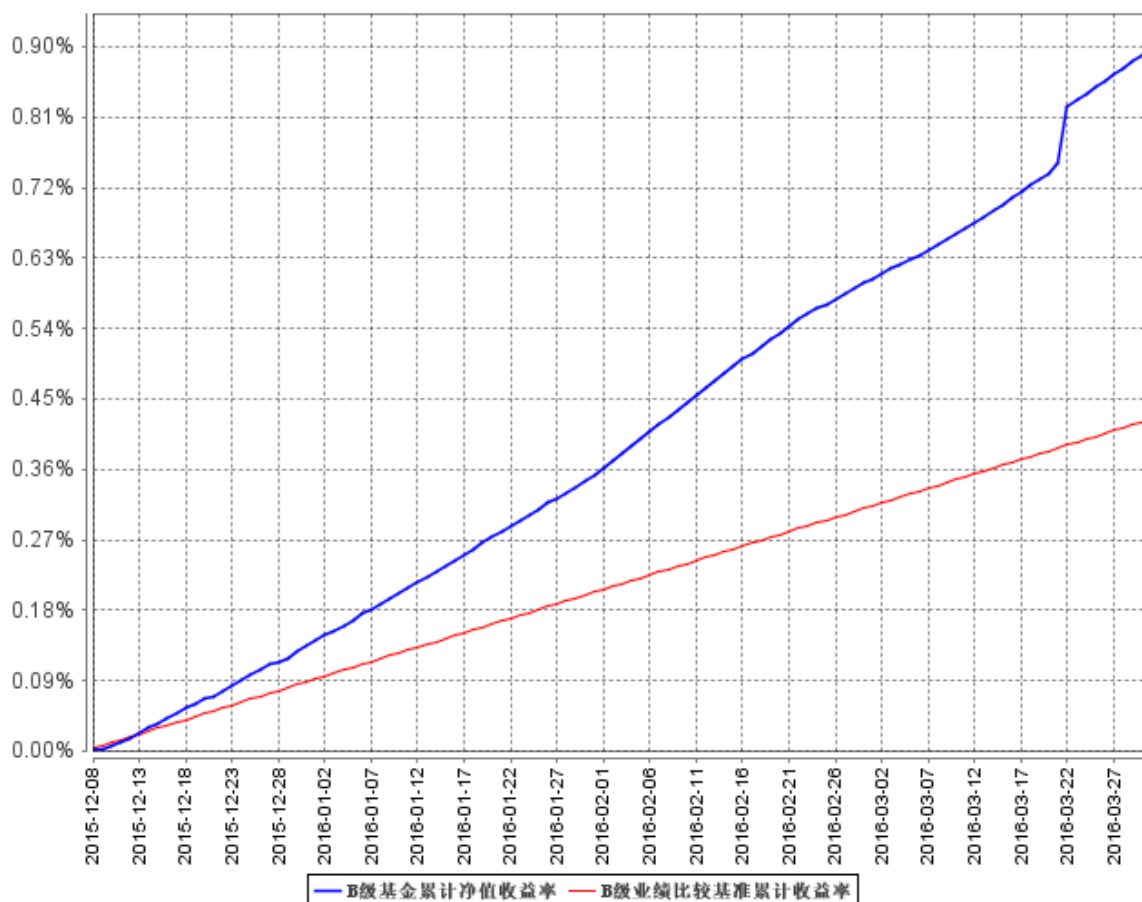
注：本基金收益分配是按日结转份额。

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，全国银行间同业拆借市场本币交易员。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》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，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。

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（债券回购、股指期货除外）。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

进入一季度，稳增长是宏观调控的重点，财政发力，信贷扩张，工业企业利润结束数月的下滑态势，市场对经济企稳的预期转好。受到猪周期、春节因素以及恶劣天气导致运输成本和蔬菜价格上涨的影响，CPI 走高。市场资金面整体保持平稳宽松，受到 MPA 考核规则的影响，季末的资金面有所收紧。基本面因素和资金面因素，叠加监管层调查债市委外杠杆消息的影响，债券收益率在本季度末出现调整。做为“现金管理工具”，日添金货币市场基金始终把产品的流动性管理放在首位。本季度，日添金货币市场基金的流动性没有出现异常，满足了投资者正常的申购、赎回要求及多次大额赎回申请。九泰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，使资产具有较强的流动性。九泰日添金货币市场基金注重资产的安全性，兼顾内外部评级数据，严控信用风险。产品在报告期内取得正收益，超越业绩比较基准。

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 0.7048%，业绩比较基准收益率为 0.3357%；本报告期

基金份额净值 B 类增长率为 0.7620%，业绩比较基准收益率为 0.3357%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	189,889,915.48	25.8300
	其中：债券	189,889,915.48	25.8300
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	383,501,935.25	52.1700
	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	152,180,609.35	20.7000
4	其他资产	9,519,541.41	1.3000
5	合计	735,092,001.49	100.0000

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	0.6300	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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	71

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

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	77.0000	-
	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)-180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	21.7600	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	98.7600	-

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	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	129,844,371.80	17.6700
	其中：政策性金融债	129,844,371.80	17.6700
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,045,543.68	8.1700
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	189,889,915.48	25.8500
10	剩余存续期超过 397 天的浮	-	-

	动利率债券		
--	-------	--	--

5.5 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	160401	16 农发 01	500,000	49,955,054.95	6.8000
2	160204	16 国开 04	500,000	49,881,600.28	6.7900
3	041669002	16 新兴 CP001	300,000	30,034,835.73	4.0900
4	041651014	16 西矿股 CP001	300,000	30,010,707.95	4.0800
5	150206	15 国开 06	300,000	30,007,716.57	4.0800

注：本基金本报告期末仅持有 5 只债券。

5.6 “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	0.0993%
报告期内偏离度的最低值	-0.0005%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0277%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

本报告期内本基金未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期限超过 397 天的浮动利率债券，不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日资产净值 20%的情况。

5.8.3

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。

5.8.4 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	2,280,802.98
4	应收申购款	7,238,738.43
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,519,541.41

5.8.5 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	153,383.19	2,853,448,059.04
报告期期间基金总申购份额	208,220,377.41	1,232,374,504.33
报告期期间基金总赎回份额	69,736,870.18	3,489,772,865.63
报告期期末基金份额总额	138,636,890.42	596,049,697.74

§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

本报告期没有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 4 月 20 日