

九泰日添金货币市场基金 2016 年年度报告摘要

2016 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

送出日期：2017 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	九泰日添金货币	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	336,136,195.18 份	
基金合同存续期	不定期	
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	255,917,807.18 份	80,218,388.00 份

2.2 基金产品说明

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。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		九泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢海波	田青
	联系电话	010-52601690	(010)67595096
	电子邮箱	xiehaibo@jtamc.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-628-0606	95533
传真		010-66067330	(010)66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jtamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年		2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	九泰日添金货币 A	九泰日添金货币 B	九泰日添金货币 A	九泰日添金货币 B
本期已实现收益	3,393,169.87	18,579,632.04	298.04	660,054.05
本期利润	3,393,169.87	18,579,632.04	298.04	660,054.05
本期净值收益率	2.9771%	3.2211%	0.1182%	0.1339%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
期末基金资产净值	255,917,807.18	80,218,388.00	153,383.19	2,853,448,059.04
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末	
累计净值收益率	3.0988%	3.3593%	0.1182%	0.1339%

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、本基金基金合同于 2015 年 12 月 8 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.7914%	0.0061%	0.3393%	0.0000%	0.4521%	0.0061%

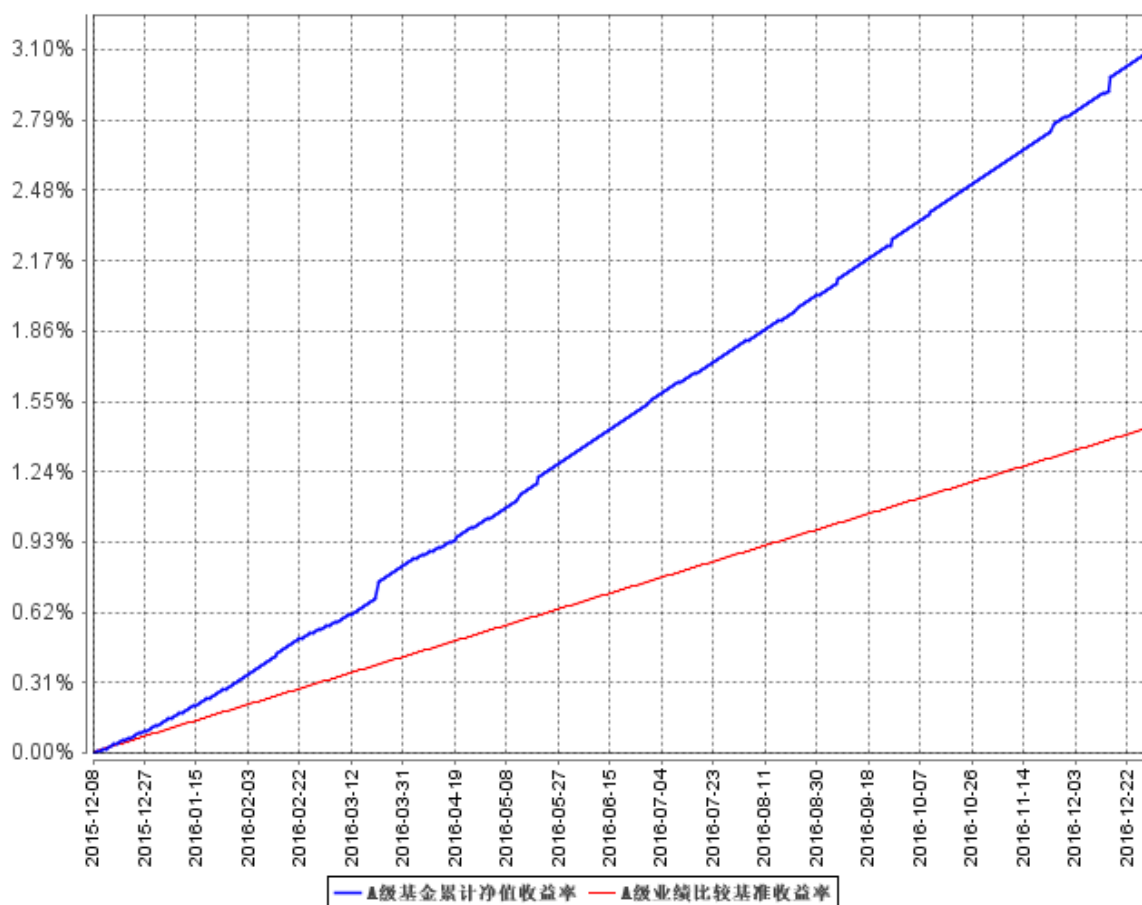
过去六个月	1.5243%	0.0047%	0.6787%	0.0000%	0.8456%	0.0047%
过去一年	2.9771%	0.0050%	1.3500%	0.0000%	1.6271%	0.0050%
自基金合同生效起至今	3.0988%	0.0049%	1.4388%	0.0000%	1.6600%	0.0049%

九泰日添金货币 B

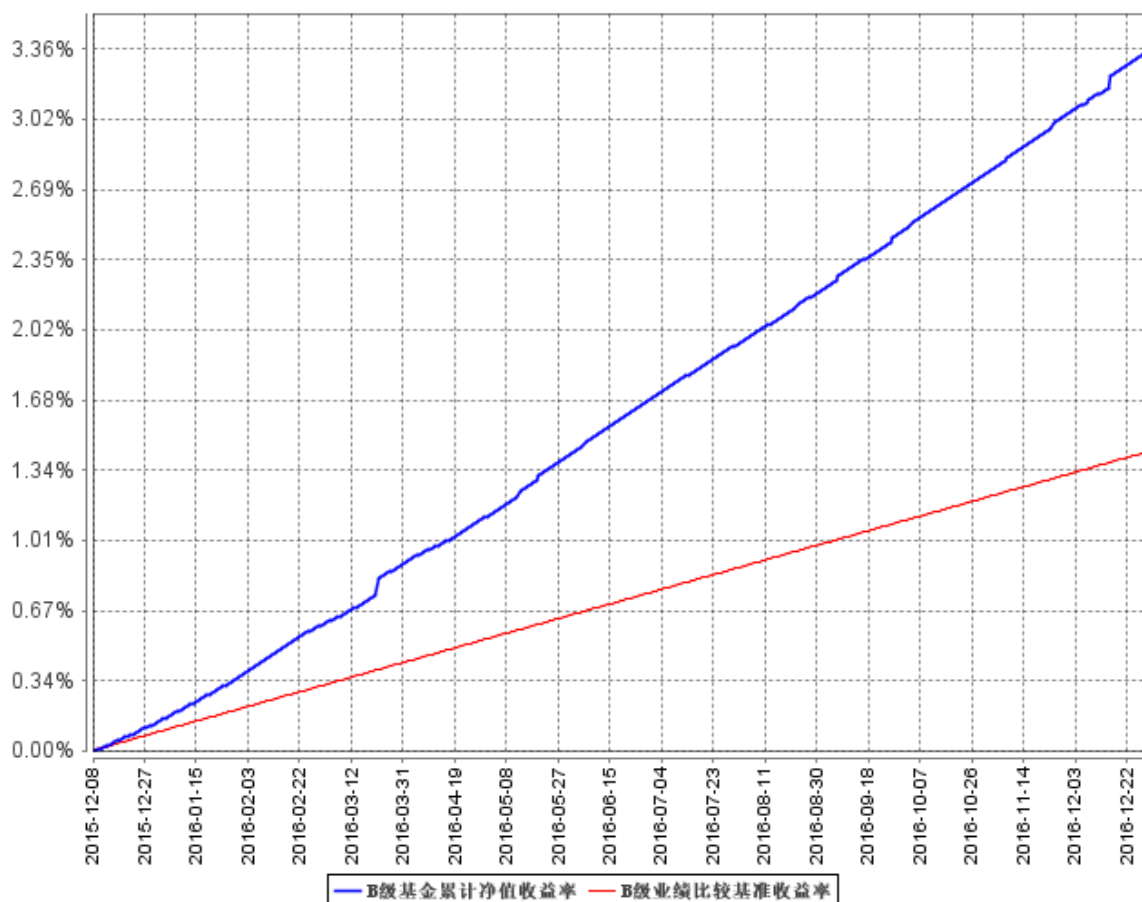
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.8518%	0.0061%	0.3393%	0.0000%	0.5125%	0.0061%
过去六个月	1.6464%	0.0048%	0.6787%	0.0000%	0.9677%	0.0048%
过去一年	3.2211%	0.0050%	1.3500%	0.0000%	1.8711%	0.0050%
自基金合同生效起至今	3.3593%	0.0049%	1.4388%	0.0000%	1.9205%	0.0049%

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

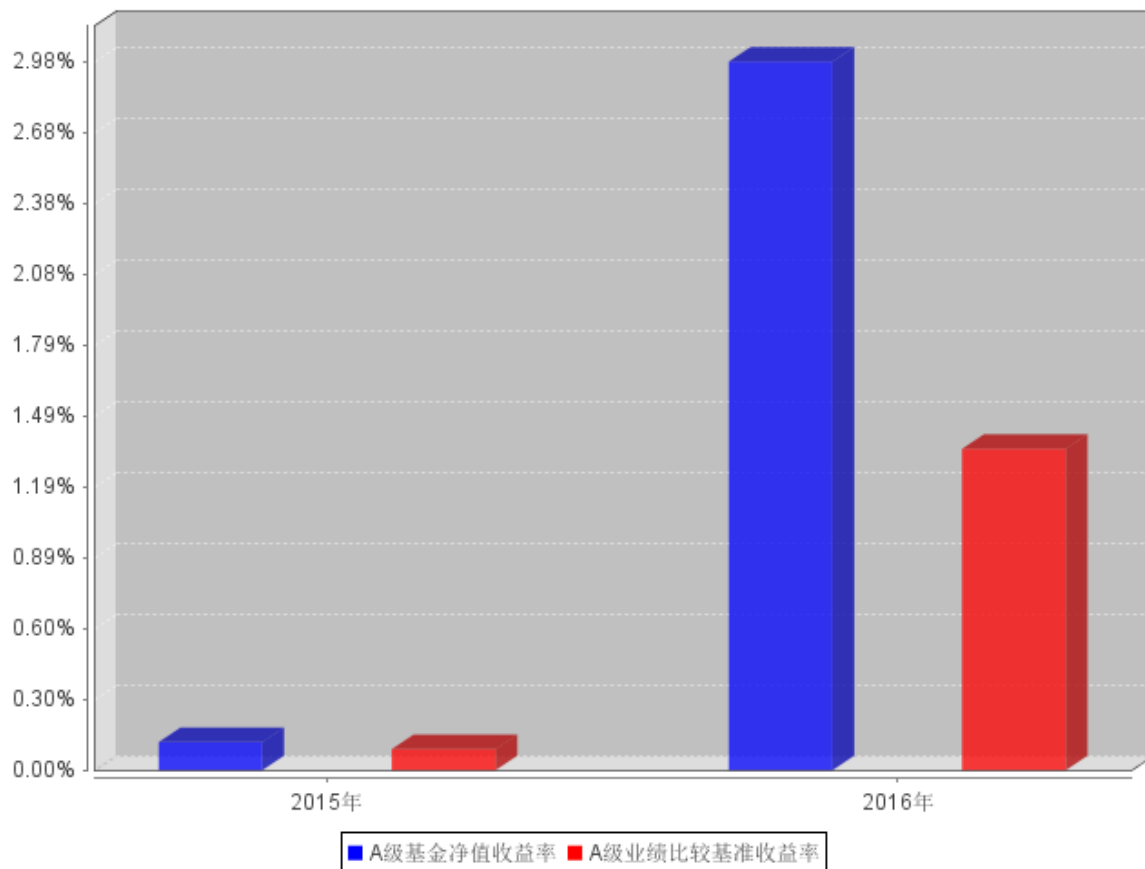


注：1. 本基金合同于 2015 年 12 月 8 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束不满一年。

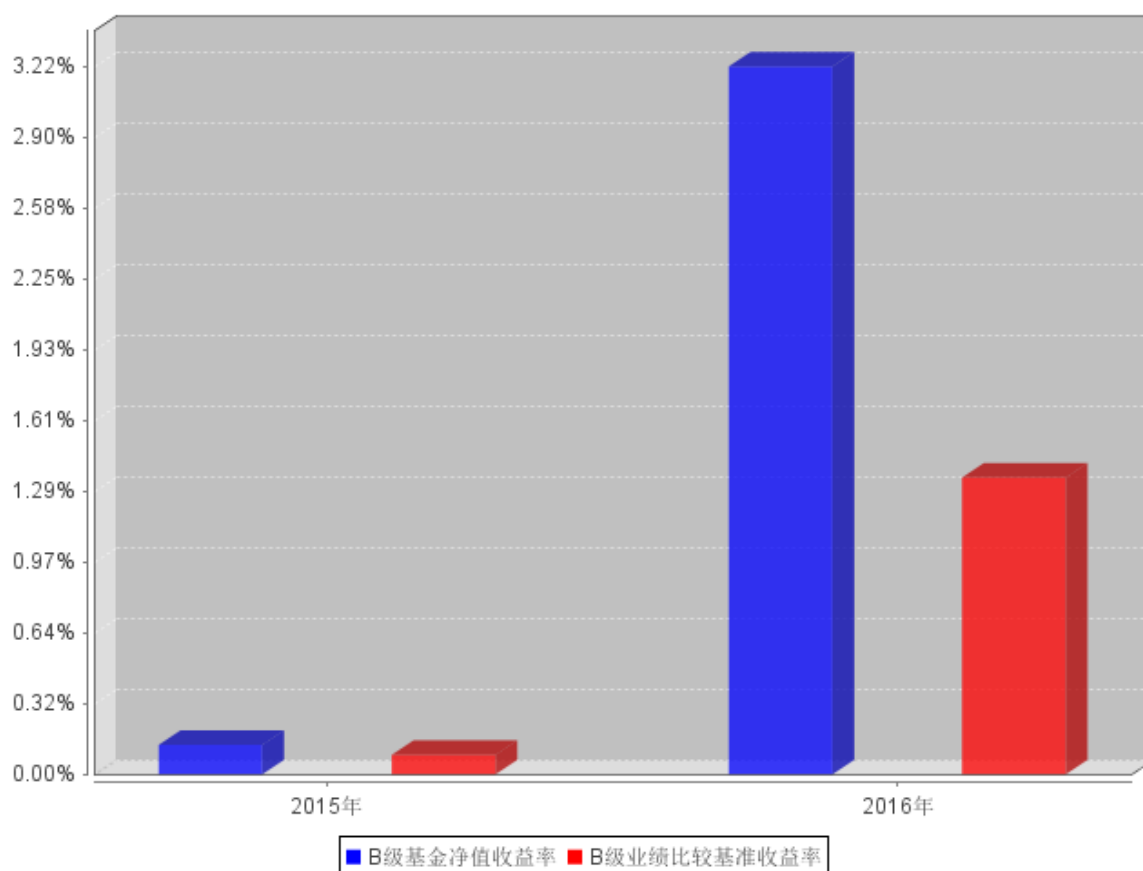
2. 根据基金合同的规定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2015 年 12 月 8 日生效，合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

九泰日添金货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016年	3,352,727.56	-	40,442.31	3,393,169.87	
2015年12月8 日(基金合同 生效日)至 2015年12月31 日	287.77	-	10.27	298.04	
合计	3,353,015.33	-	40,452.58	3,393,467.91	

单位：人民币元

九泰日添金货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016年	18,775,134.79	-	-195,502.75	18,579,632.04	
2015年12月8 日(基金合同 生效日)	450,813.29	-	209,240.76	660,054.05	

生效日)至 2015年12月 31日					
合计	19,225,948.08	-	13,738.01	19,239,686.09	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

九泰基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2014】650号文批准，于2014年7月3日正式成立，现注册资本2亿元人民币，其中昆吾九鼎投资管理有限公司、同创九鼎投资管理集团股份有限公司、拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司和九州证券股份有限公司分别占注册资本26%、25%、25%和24%的股权。截至本报告期末（2016年12月31日），基金管理人共管理13只开放式证券投资基金，包括九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金、九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金、九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金、九泰日添金货币市场基金、九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金、九泰久稳保本混合型证券投资基金，九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金，九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金，九泰久利灵活配置混合型证券投资基金，九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金，九泰久鑫债券型证券投资基金，证券投资基金规模约为119.00亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 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	理学硕士，中国籍，具有基金从业资格，8年证券从业经验。历任诺安基金管理有限公司债券交易员，诺安基金管理有限公司基金经理助理，诺安货币市场基金A/B基金经理（2013年7月至2015年1月）。2015年4月加入九泰基金管理有限公司，现任九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（2015年8月3日至今）、九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金（2015年11月10日至今），九泰日添金货币市

					场基金（2015 年 12 月 8 日至今）、九泰久稳保本混合型证券投资基金（2016 年 4 月 22 日至今）、九泰久利灵活配置混合型证券投资基金（2016 年 11 月 7 日至今）、九泰久鑫债券型证券投资基金（2016 年 12 月 19 日）的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

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》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，公平交易制度，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年，供给侧改革是国内宏观经济的主线。在基建和地产的拉动下，经济逐步企稳；供给收缩叠加需求回暖，年末通胀预期再起。在汇率压力和防资产泡沫的背景下，货币政策逐步收紧。在负债端成本上行的压力下，债券市场终迎来调整，息差收益被大幅挤压，收益率明显上行。九泰日添金做为“现金管理工具”，始终把资产的流动性放在首位。报告期内，日添金货币市场基金的流动性未现异常，满足了投资者正常的申购、赎回要求及大额赎回申请。九泰日添金灵活运用债券回购和存款存单等货币市场工具，使组合具有较强的流动性。九泰日添金注重资产的安全性，在参考外部评级的基础上，进行严谨的内部评级筛选，严格把控信用风险。九泰日添金在报告期内取得了正收益，远超业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金 A 类份额净值收益率为 2.9771%，业绩比较基准收益率为 1.3500%；本报告期基金 B 类份额净值收益率为 3.2211%，业绩比较基准收益率为 1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，预计国内经济进入 L 型探底期，通胀保持温和。实行积极的财政政策和中性偏紧的货币政策；全球流动性拐点到来，叠加金融降杠杆的背景，资金面难言宽松，无风险利率继续上行。经济基本面对债券市场的支撑尚存，预计下半年的债市将迎来不错的中长期投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由督察长、公司总裁助理、风控法务部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，

具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程的各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金的收益“每日分配、按日支付”，自基金合同生效日起根据每日收益情况，将当日收益全部分配和结转。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金的收益“每日分配、按日支付”，自基金合同生效日起根据每日收益情况，将当日收益全部分配和结转。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法复核九泰基金管理有限公司编制和披露的 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于九泰基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：九泰日添金货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	26,022,700.64	2,753,171,269.83
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	150,088,237.85	-
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	150,088,237.85	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	156,500,646.25	100,000,000.00
应收证券清算款	-	19,458.30
应收利息	3,003,725.53	709,791.14
应收股利	-	-
应收申购款	956,746.24	4,002.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	336,572,056.51	2,853,904,521.27

负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	100,500.94	62,772.11
应付托管费	33,500.33	20,924.04
应付销售服务费	50,930.25	2,131.86
应付交易费用	17,739.22	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	54,190.59	209,251.03
递延所得税负债	-	-
其他负债	179,000.00	8,000.00
负债合计	435,861.33	303,079.04
所有者权益:		
实收基金	336,136,195.18	2,853,601,442.23
未分配利润	-	-
所有者权益合计	336,136,195.18	2,853,601,442.23
负债和所有者权益总计	336,572,056.51	2,853,904,521.27

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 336,136,195.18 份，其中 A 类基金份额总额 255,917,807.18 份，基金份额净值 1.00 元；B 类基金份额总额 80,218,388.00 份，基金份额净值 1.00 元。

2、本基金合同生效日为 2015 年 12 月 8 日，上年度可比期间为 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：九泰日添金货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 8 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	25,761,063.24	757,225.10
1.利息收入	24,600,599.05	757,225.10
其中：存款利息收入	6,729,326.08	718,734.37

债券利息收入	4,345,884.76	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,525,388.21	38,490.73
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,160,463.86	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,160,463.86	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	0.33	-
减：二、费用	3,788,261.33	96,873.01
1. 管理人报酬	2,254,464.54	62,772.11
2. 托管费	751,488.27	20,924.04
3. 销售服务费	345,218.54	2,131.86
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	184,707.20	-
其中：卖出回购金融资产支出	184,707.20	-
6. 其他费用	252,382.78	11,045.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	21,972,801.91	660,352.09
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	21,972,801.91	660,352.09

注：本基金合同生效日为 2015 年 12 月 8 日，上年度可比期间为 2015 年 12 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰日添金货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	2,853,601,442.23	-	2,853,601,442.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,972,801.91	21,972,801.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,517,465,247.05	-	-2,517,465,247.05
其中：1. 基金申购款	3,906,212,303.27	-	3,906,212,303.27
2. 基金赎回款	-6,423,677,550.32	-	-6,423,677,550.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-21,972,801.91	-21,972,801.91
五、期末所有者权益（基金净值）	336,136,195.18	-	336,136,195.18
项目	上年度可比期间		
	2015年12月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	210,238,656.83	-	210,238,656.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	660,352.09	660,352.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,643,362,785.40	-	2,643,362,785.40
其中：1. 基金申购款	2,843,763,684.37	-	2,843,763,684.37
2. 基金赎回款	-200,400,898.97	-	-200,400,898.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-660,352.09	-660,352.09
五、期末所有者权益（基金净值）	2,853,601,442.23	-	2,853,601,442.23

注：本基金合同生效日为2015年12月8日，上年度可比期间为2015年12月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

卢伟忠

严军

荣静

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

九泰日添金货币市场基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2004 号文《关于准予九泰日添金货币市场基金注册的批复》准予募集注册,由九泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关规定和《九泰日添金货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的规定发起,于 2015 年 12 月 7 日至 2015 年 12 月 7 日向社会公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限为不定期。募集期间净认购资金总额为人民币 210,238,656.83 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 0 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 210,238,656.83 元,折合 210,238,656.83 份基金份额。上述募集资金经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)验证。经向中国证监会备案后,基金合同于 2015 年 12 月 8 日正式生效。本基金的基金管理人和注册登记机构均为九泰基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰日添金货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为现金;期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准是:七天通知存款利率(税后)。

7.4.2 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税;
- (2)证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征营业税和增值税;
- (3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及

其他收入，暂不缴纳企业所得税；

(4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

7.4.4 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
九泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
九州证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司	基金管理人的股东
同创九鼎投资管理集团股份有限公司	基金管理人的股东
昆吾九鼎投资管理有限公司	基金管理人的股东
九泰基金销售（北京）有限公司	基金管理人的全资子公司、基金销售机构

注：2016 年 2 月 22 日，九州证券有限公司变更名称为九州证券股份有限公司。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2, 254, 464. 54	62, 772. 11
其中：支付销售机构的客户维护费	104, 193. 24	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	751,488.27	20,924.04

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.5.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰日添金货币 A	九泰日添金货币 B	合计
九泰基金管理有限公司	139,853.94	59,298.20	199,152.14
九州证券股份有限公司	1,757.86	-	1,757.86
九泰基金销售(北京)有限公司	0.05	-	0.05
合计	141,611.85	59,298.20	200,910.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰日添金货币 A	九泰日添金货币 B	合计
九泰基金管理有限公司	41.09	2,090.77	2,131.86
九州证券股份有限公司	-	-	-
九泰基金销售(北京)有限公司	-	-	-
合计	41.09	2,090.77	2,131.86

注：本基金 A 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提；B 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times G / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的对应级别基金资产净值

G 为对应的销售服务费率

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

九泰日添金货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
同创九鼎投资管理集团股份有限公司	71,907.02	0.0200%	-	-

九泰日添金货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
同创九鼎投资管理集团股份有限公司	-	-	300,048,036.70	10.5100%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算

并支付。

7.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年12月8日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,022,700.64	35,218.00	3,171,269.83	13,818.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需说明的其他关联方交易事项。

7.4.6 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项及其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重

要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层次、第三层次的余额，属于第二层次的余额为 150,088,237.85 元（于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有以公允价值计量的金融工具）。

本基金持有的第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

无。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	150,088,237.85	44.59
	其中：债券	150,088,237.85	44.59
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	156,500,646.25	46.50
	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	26,022,700.64	7.73
4	其他各项资产	3,960,471.77	1.18
5	合计	336,572,056.51	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	1.31	
	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：本基金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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	43
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	9

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。

8.3.2 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	54.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	8.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	23.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	8.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	2.97	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		98.95	-

8.4 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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,002,228.33	5.95
	其中：政策性金融债	20,002,228.33	5.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	130,086,009.52	38.70
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	150,088,237.85	44.65
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	011698103	16 鲁能源 SCP004	300,000	30,092,011.69	8.95
2	041673003	16 中信重工 CP001	300,000	29,996,581.47	8.92
3	041659015	16 义乌国资 CP002	300,000	29,988,017.35	8.92
4	041655006	16 泰华信 CP001	200,000	20,010,230.91	5.95
5	160209	16 国开 09	200,000	20,002,228.33	5.95
6	041656009	16 泉州国资 CP001	100,000	10,003,382.57	2.98
7	041651033	16 粤航运 CP001	100,000	9,995,785.53	2.97

注：本基金本报告期末仅持有以上 7 只债券。

8.7 “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	-0.0743%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0472%

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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

本基金的债券投资采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

8.9.2

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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,003,725.53
4	应收申购款	956,746.24
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,960,471.77

8.9.4 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
九泰日添金货币 A	112,455	2,275.74	11,937,084.69	4.66%	243,980,722.49	95.34%
九泰日添金货币 B	6	13,369,731.33	47,614,730.32	59.36%	32,603,657.68	40.64%
合计	112,461	2,988.91	59,551,815.01	17.72%	276,584,380.17	82.28%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	九泰日添金货币 A	995,951.40	0.3892%
	九泰日添金货币 B	-	-
	合计	995,951.40	0.2963%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持	九泰日添金货币 A	10~50
	九泰日添金货币 B	0

有本开放式基金	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	九泰日添金货币 A	0
	九泰日添金货币 B	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	九泰日添金货币 A	九泰日添金货币 B
基金合同生效日（2015 年 12 月 8 日）基金份额总额	238,656.83	210,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	153,383.19	2,853,448,059.04
本报告期基金总申购份额	1,520,462,595.41	2,385,749,707.86
减:本报告期基金总赎回份额	1,264,698,171.42	5,158,979,378.90
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	255,917,807.18	80,218,388.00

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：

1. 公司于 2016 年 1 月 27 日以书面方式召开 2016 年第一次股东会会议，审议同意龚六堂先生辞去公司第一届董事会独立董事职务；任命陈耿先生担任公司第一届董事会独立董事职务，任期为：原独立董事龚六堂先生任期的剩余期限。

2. 公司于 2016 年 12 月 29 日以书面方式召开 2016 年第五次股东会会议，审议同意陈晓红女士辞去公司第一届董事会独立董事职务；任命袁小文女士担任公司第一届董事会独立董事职务，

任期为：原独立董事陈晓红女士任期的剩余期限。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 70,000.00 元。目前该会计师事务所首次为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2016 年 11 月 16 日，基金管理人收到中国证监会北京监管局下发的《关于对九泰基金管理有限责任公司采取责令改正的行政监管措施的决定》（行政监管措施决定书[2016]67 号），基金管理人高度重视本次整改工作，及时制定了整改方案，并逐一落实。截至本报告期末，基金管理人已完成全部的整改工作，并向中国证监会北京监管局报送了《关于行政监管措施决定书所认定问题整改情况的报告》（九泰字[2016]411 号）。本报告期内基金管理人的高级管理人员无受稽查或处罚情况。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
中信证券	-	-228,000,000.00	100.00%	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与基金管理人具有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

券商经纪人具有较强的研究能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力。

2、本公司租用券商交易单元的程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单经公募基金业务投资决策委员会或专户业务投资决策委员会审批同意后与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。监察稽核部对委托协议的合法合规性进行审查。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况

无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况

无。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期间未发生偏离度绝对值超过 0.5%情况。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，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》。

九泰基金管理有限公司
2017 年 3 月 29 日