

九泰日添金货币市场基金 2016 年年度报告

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 重要提示及目录

1.1 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况	42
8.2 债券回购融资情况	42
8.3 基金投资组合平均剩余期限	43
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	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	44
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	44

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	45
8.9 投资组合报告附注	45
§9 基金份额持有人信息	45
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§10 开放式基金份额变动	47
§11 重大事件揭示	47
11.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
11.4 基金投资策略的改变	48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	49
11.9 其他重大事件	49
§12 影响投资者决策的其他重要信息	58
§13 备查文件目录	58
13.1 备查文件目录	58
13.2 存放地点	59
13.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	九泰日添金货币市场基金	
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
注册地址		北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦西区 6 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		卢伟忠	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	本基金选定的信息披露报纸为 《证券日报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	九泰基金管理有限公司	北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦西区 6 层

§ 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

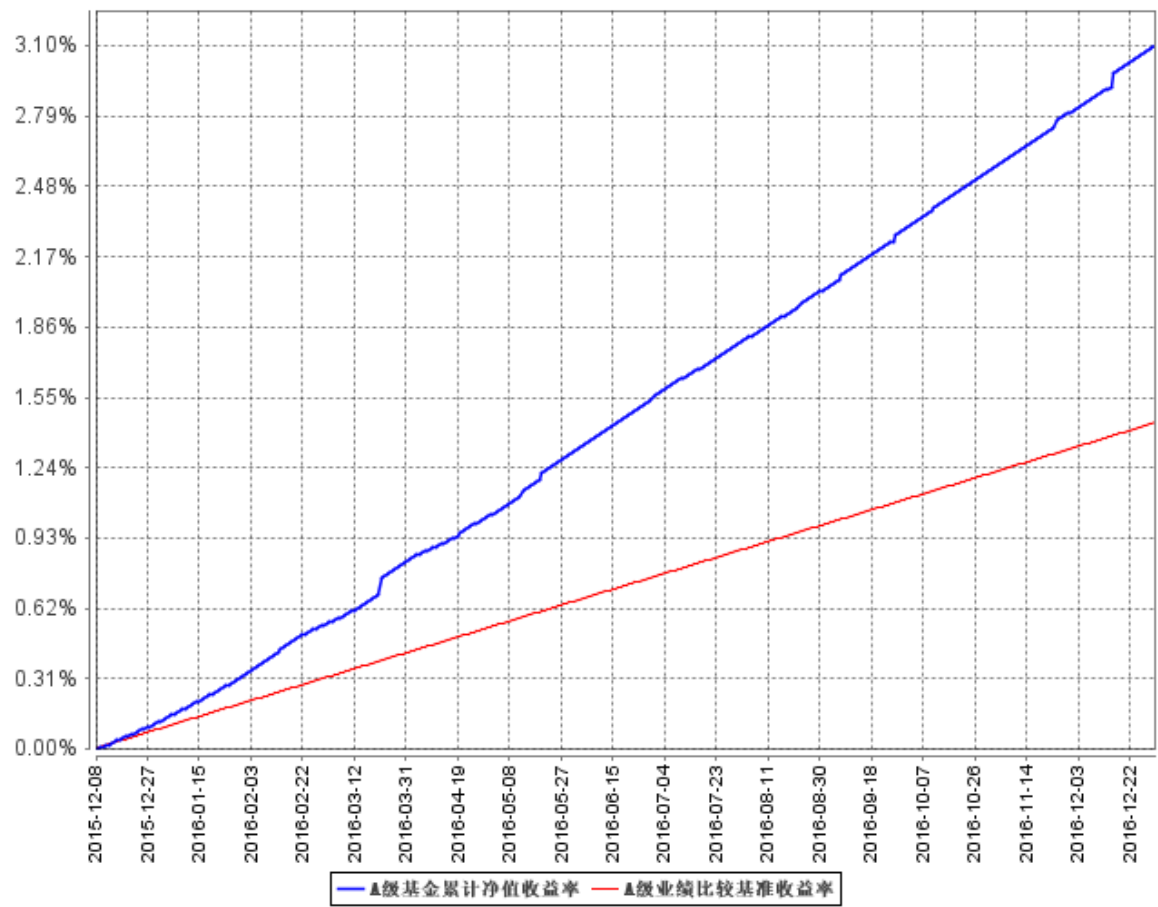
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7914%	0.0061%	0.3393%	0.0000%	0.4521%	0.0061%
过去六个月	1.5243%	0.0047%	0.6787%	0.0000%	0.8456%	0.0047%
过去一年	2.9771%	0.0050%	1.3500%	0.0000%	1.6271%	0.0050%
自基金合同 生效起至今	3.0988%	0.0049%	1.4388%	0.0000%	1.6600%	0.0049%

九泰日添金货币 B

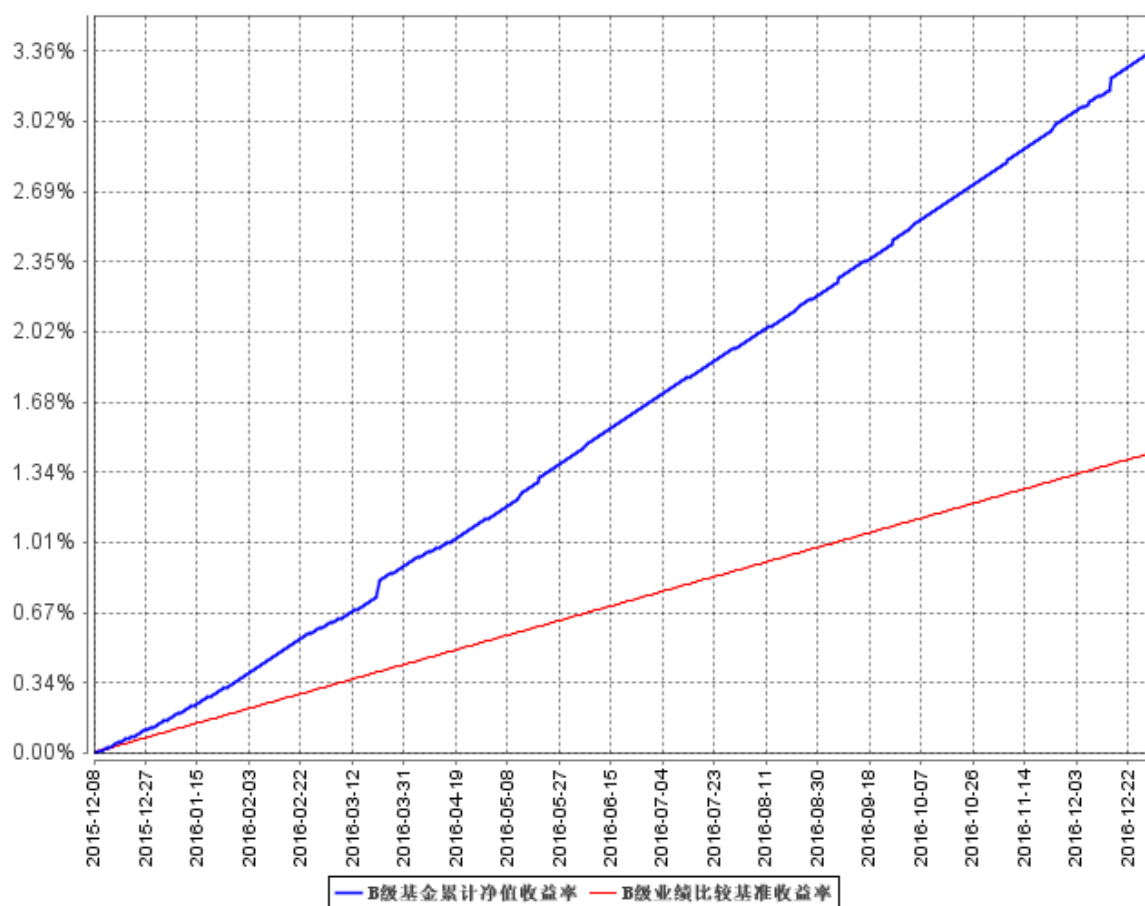
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.8518%	0.0061%	0.3393%	0.0000%	0.5125%	0.0061%
过去六个月	1.6464%	0.0048%	0.6787%	0.0000%	0.9677%	0.0048%
过去一年	3.2211%	0.0050%	1.3500%	0.0000%	1.8711%	0.0050%
自基金合同 生效起至今	3.3593%	0.0049%	1.4388%	0.0000%	1.9205%	0.0049%

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

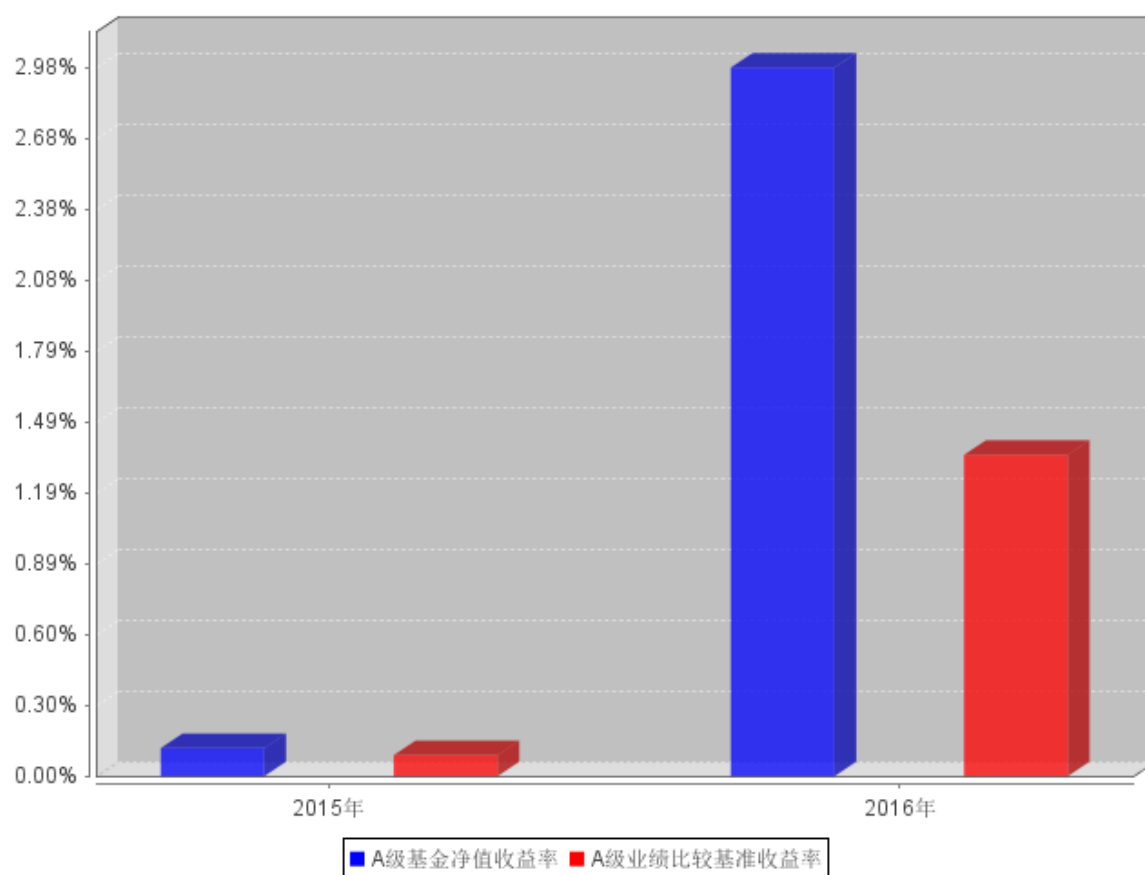


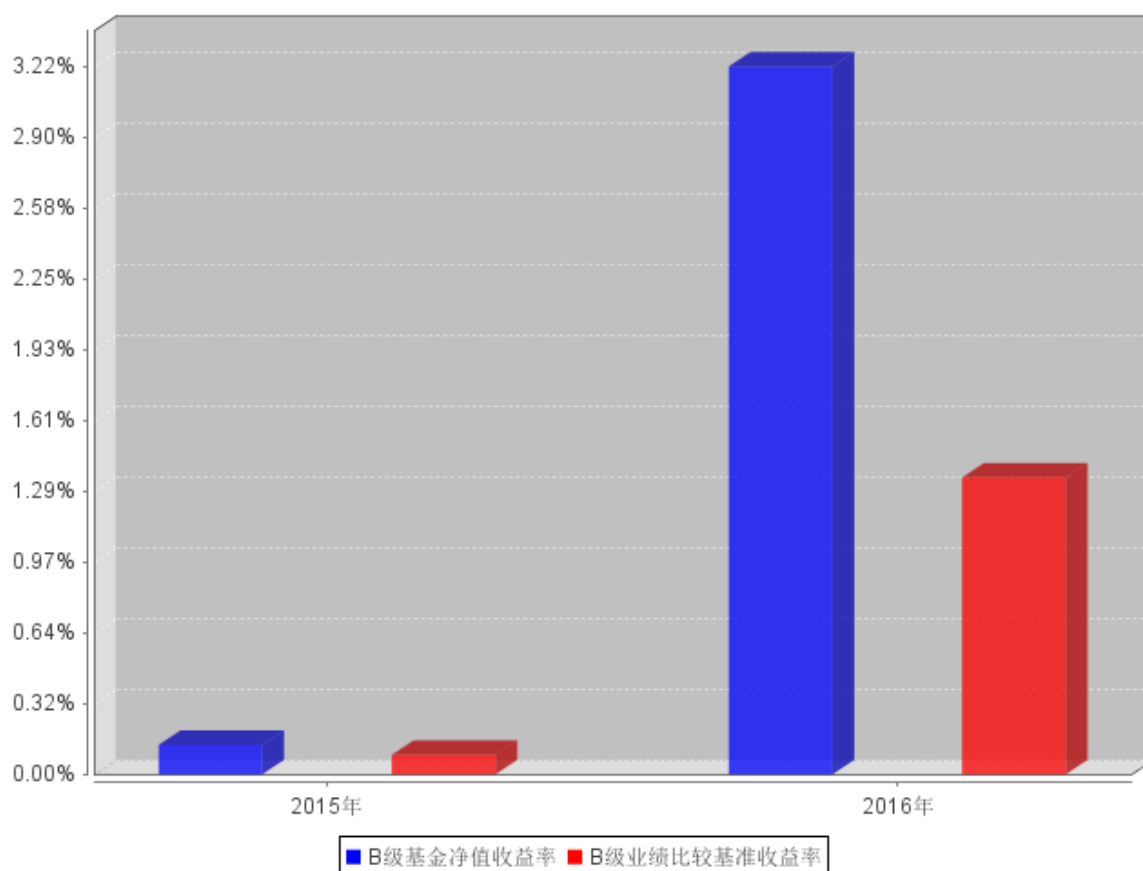
注：1. 本基金合同于 2015 年 12 月 8 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束不满一年。

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)至 2015年12月31 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 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 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，本基金管理人从合法、合规、为持有人创造价值出发，依照公司内部控制的整体要求，持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司在投资管理、研究支持、证券交易、基金运营、市场销售、客户服务、反洗钱、员工投资行为管理等多方面制订了多项制度，进一步完善合规制度建设；通过开展合规培训、合规考试等形式，不断提升员工的合规守法意识。在风险控制方面，持续推动风险控制前置，对新产品和新业务的风险控制方面加强布局，确保有效防控风险，确保保护持有人利益，坚守合规底线。在监察稽核方面，通过实时监控、现场建厂、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展各项涉及公司运营、产品运作、投资管理等方面的专项稽核，对于发现的问题及时提出整改要求并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监

察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(17)第 P00392 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	九泰日添金货币市场基金全体持有人：
引言段	我们审计了后附的九泰日添金货币市场基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度及 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是九泰日添金货币市场基金的基金管理人九泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，九泰日添金货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了九泰日添金货币市场基金 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度及 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	文启斯	杨丽
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国·上海	
审计报告日期	2017 年 3 月 27 日	

§ 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	附注号	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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	156,500,646.25	100,000,000.00
应收证券清算款		-	19,458.30
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
资产总计		336,572,056.51	2,853,904,521.27
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	336,136,195.18	2,853,601,442.23
未分配利润	7.4.7.10	-	-
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	附注号	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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	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	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	0.33	-
减：二、费用		3,788,261.33	96,873.01
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,254,464.54	62,772.11
2.托管费	7.4.10.2.2	751,488.27	20,924.04
3.销售服务费	7.4.10.2.3	345,218.54	2,131.86
4.交易费用	7.4.7.18	-	-

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	7.4.7.19	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：

<u>卢伟忠</u>	<u>严军</u>	<u>荣静</u>
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 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度及 2015 年 12 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债券投资,在资产负债表中作为交易性金融资产列报。

本基金将持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款和应收款项。

（2）金融负债分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债，暂不分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款和应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于贷款和应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金

合同进行财产清算等措施。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（资产支持证券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值；

(2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件时，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值小组认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的九泰日添金货币 A、九泰日添金货币 B 基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

(2) 债券利息收入按实际利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的

净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率，在实际持有期间内逐日计提；

(4) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 的年费率逐日计提；

(2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提；

(3) 根据基金合同，基金 A 级基金份额和 B 级基金份额的销售服务费分别按前一日该级基金资产净值的 0.25% 和 0.01% 的年费率逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每日进行支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理(因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止)；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配和结转，若当日已实现收益大于零时，为投资者记正收益，增加基金份额；若当日已实现收益等于零时，当日投资者不记收益，基金份额不变；若当日已实现收益小于零时，为投资者记负收益，减少基金份额；

(5) 当日收益结转时，如投资者的未结转收益为正，则为份额持有人增加相应的基金份额；如当日的未结转收益等于零时，份额持有人的基金份额保持不变；如投资者的未结转收益为负，则为份额持有人缩减相应的基金份额；

(6) 当日申购的基金份额自下一个交易日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；

(8) 法律法规或监管机关另有规定的从其规定。

7.4.4.11 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	2,022,700.64	3,171,269.83

定期存款	24,000,000.00	2,750,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	24,000,000.00	2,750,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	26,022,700.64	2,753,171,269.83

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	150,088,237.85	150,345,000.00	256,762.15	0.0764%
	合计	150,088,237.85	150,345,000.00	256,762.15	0.0764%
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	19,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	137,500,646.25	-
合计	156,500,646.25	-

项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	100,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	-	-
合计	100,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	346.55	4,902.92
应收定期存款利息	29,700.00	704,888.22
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	2,866,794.07	-
应收买入返售证券利息	106,884.91	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	3,003,725.53	709,791.14

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	17,739.22	-
合计	17,739.22	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提信息披露费	100,000.00	8,000.00
预提审计费	70,000.00	-
预提中债登账户维护费	4,500.00	-
预提上清所债券账户维护费	4,500.00	-
合计	179,000.00	8,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

九泰日添金货币 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	153,383.19	153,383.19
本期申购	1,520,462,595.41	1,520,462,595.41
本期赎回(以“-”号填列)	-1,264,698,171.42	-1,264,698,171.42
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	255,917,807.18	255,917,807.18

金额单位：人民币元

九泰日添金货币 B		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,853,448,059.04	2,853,448,059.04
本期申购	2,385,749,707.86	2,385,749,707.86
本期赎回(以“-”号填列)	-5,158,979,378.90	-5,158,979,378.90
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	80,218,388.00	80,218,388.00
-----	---------------	---------------

注：申购份额含红利再投、转入份额和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含转出份额和因份额升降级导致的强制调减份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

九泰日添金货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,393,169.87	-	3,393,169.87
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,393,169.87	-	-3,393,169.87
本期末	-	-	-

单位：人民币元

九泰日添金货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	18,579,632.04	-	18,579,632.04
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-18,579,632.04	-	-18,579,632.04
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	35,218.00	13,818.59
定期存款利息收入	6,661,611.22	704,888.22
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,146.14	-
其他	28,350.72	27.56
合计	6,729,326.08	718,734.37

注：其他指直销申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

无。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	1,095,259,777.50	-
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	1,079,756,855.37	-
减：应收利息总额	14,342,458.27	-
买卖债券差价收入	1,160,463.86	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

无。

7.4.7.16 公允价值变动收益

无。

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	-	-
其他	0.33	-
合计	0.33	-

注：其他指上清所结算账户款项利息。

7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内及上年度可比期间内无交易费用。

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	70,000.00	-
信息披露费	100,000.00	8,000.00
银行汇划费	46,302.78	2,685.00
其他	1,220.00	-
债券账户维护费	34,500.00	-
银行账户维护费	360.00	360.00
合计	252,382.78	11,045.00

注：其他包括沪深股东账户开户费、上清所查询费及已成交未清算回购交易费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 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。

7.4.10 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。

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

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。

7.4.10.2.3 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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金**

金额单位：人民币元

九泰日添金货币A

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	本期利润分配合计	备注
3,352,727.56	-	40,442.31	3,393,169.87	-

九泰日添金货币B

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	本期利润分配合计	备注
18,775,134.79	-	-195,502.75	18,579,632.04	-

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 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。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为货币市场基金，主要投资于货币市场工具，一般情况下其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、混合型基金、债券型基金，属于低风险收益特征的证券投资基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制投资风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人建立了董事会及风险控制委员会、总经理、风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风控法务部以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。董事会负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度。董事会下设风险控制委员会，风险控制委员会负责对公司经营管理与资产组合运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查；总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险管理委员会，负责审议公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等，重点是公司的合规控制和投资的风险控制；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风控法务部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风控法务部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	99,993,997.83	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,092,011.69	-

合计	130,086,009.52	-
----	----------------	---

注：1. 短期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以内的债券，以上列示债券不包括国债、政策性金融债、央行票据。

2. 以上信用评级系根据第三方评估机构的债券评级报告确定。

3. 以上未评级的债券为剩余期限在一年以内的超短期融资券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(主要包括企业债或短期融资券)，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 120 天，且能够通过提前支取定期存款和出售所持有的债券应对流动性需求。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日不得超过基金资产净值的 20%。

于 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行存款、交易所和银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,022,700.64	-	-	-	-	-	26,022,700.64
交易性金融 资产	-	110,000,440.63	40,087,797.22	-	-	-	150,088,237.85
买入返售金 融资产	156,500,646.25	-	-	-	-	-	156,500,646.25
应收利息	-	-	-	-	-	3,003,725.53	3,003,725.53
应收申购款	-	-	-	-	-	956,746.24	956,746.24
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	182,523,346.89	110,000,440.63	40,087,797.22	-	-	3,960,471.77	336,572,056.51
负债							
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	100,500.94	100,500.94
应付托管费	-	-	-	-	-	33,500.33	33,500.33
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	50,930.25	50,930.25
应付交易费 用	-	-	-	-	-	17,739.22	17,739.22
应付利润	-	-	-	-	-	54,190.59	54,190.59
其他负债	-	-	-	-	-	179,000.00	179,000.00

负债总计	-	-	-	-	-	435,861.33	435,861.33
利率敏感度缺口	182,523,346.89	110,000,440.63	40,087,797.22	-	-	-3,524,610.44	336,136,195.18
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,453,171,269.83	300,000,000.00	-	-	-	-	2,753,171,269.83
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,458.30	19,458.30
应收利息	-	-	-	-	-	709,791.14	709,791.14
应收申购款	4,002.00	-	-	-	-	-	4,002.00
资产总计	2,553,175,271.83	300,000,000.00	-	-	-	729,249.44	2,853,904,521.27
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	62,772.11	62,772.11
应付托管费	-	-	-	-	-	20,924.04	20,924.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,131.86	2,131.86
应付利润	-	-	-	-	-	209,251.03	209,251.03
其他负债	-	-	-	-	-	8,000.00	8,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	303,079.04	303,079.04
利率敏感度缺口	2,553,175,271.83	300,000,000.00	-	-	-	426,170.40	2,853,601,442.23

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	85,790.74	-
	市场利率上升 25 个基点	-85,676.65	-

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行存款和交易所、银行间市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		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有本开放式基金	九泰日添金货币 A	10~50
	九泰日添金货币 B	0
	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的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
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。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	九泰基金管理有限公司关于交易所指数发生不可恢复熔断导致我公司部分基金业务办理时间调整的公告	公司网站	2016 年 1 月 5 日
2	九泰基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 6 日
3	九泰基金管理有限公司关于交易所指数发生不可恢复熔断导致我公司部分基金业务办理时间调整的公告	公司网站	2016 年 1 月 7 日
4	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 8 日
5	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 14 日

6	九泰基金管理有限公司关于九泰日添金货币市场基金增加销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 15 日
7	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司作为我公司部分开放式基金销售机构并开通基金定投、转换业务及参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 26 日
8	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 27 日
9	关于九泰日添金货币市场基金 2016 年春节假期前暂停大额申购业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 2 月 1 日
10	关于增加上海汇付金融服务有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
11	关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
12	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
13	关于增加陆金所资管公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
14	关于增加珠海盈米财富管理有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
15	关于九泰基金管理有限公司电子直销交易系统维护的公告	公司网站	2016 年 3 月 14 日

16	关于增加九泰基金销售（北京）有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 17 日
17	关于增加深圳富济财富管理有限公司作为我公司开放式基金销售机构并开通基金定投、转换业务及参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 18 日
18	关于九泰日添金货币市场基金暂停大额申购业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 25 日
19	九泰基金管理有限公司关于九泰日添金货币市场基金增加销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 31 日
20	九泰日添金货币市场基金开放日常转换及定期定额投资业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 31 日
21	关于增加国金证券股份有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 1 日
22	关于增加首创证券有限责任公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 6 日
23	关于增加首创证券有限责任公司为我公司所管理部分基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 11 日
24	关于增加华融证券股份有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 12 日
25	关于增加华融证券股份有限公司为我公司所管理部分基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 14 日

26	关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 18 日
27	九泰日添金货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 20 日
28	关于增加大泰金石投资管理有限公司作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 22 日
29	关于增加湘财证券投资管理有限公司作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 22 日
30	关于增加北京汇成基金销售有限公司作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 9 日
31	关于增加乾道金融公司为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 9 日
32	九泰基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 14 日
33	关于九泰基金管理有限公司所管理部分开放式基金开通电子直销定期定额申购业务及费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 16 日
34	关于增加上海大智慧财富管理有限公司为我公司所管理基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 19 日
35	关于增加深圳金斧子作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 19 日

	动的公告		
36	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 5 月 20 日
37	关于九泰日添金货币市场基金调整大额申购业务金额上限的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 24 日
38	关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 27 日
39	关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为我公司所管理基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 2 日
40	九泰日添金货币市场基金 2016 年端午节假日前暂停申购业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 6 日
41	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 7 日
42	关于增加大泰金石投资管理有限公司作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 16 日
43	关于增加湘财证券股份有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
44	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
45	九泰基金管理有限公司关于调整开户证件类型的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
46	关于增加深圳前海京西票号基金销售有限公司为我公司所管理部分开	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 28 日

	放式基金销售机构的公告		
47	关于电子直销平台增加富友支付渠道及部分费率优惠活动的公告	公司网站	2016 年 7 月 4 日
48	关于九泰掌贝基金宝移动 app 客户端上线公告	公司网站	2016 年 7 月 4 日
49	关于增加北京晟视天下投资管理有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 7 月 6 日
50	关于增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 7 月 6 日
51	关于九泰基金管理有限公司系统升级暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 7 月 8 日
52	关于九泰基金管理有限公司客服电话暂停服务的公告	公司网站	2016 年 7 月 19 日
53	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员在子公司兼职情况的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 7 月 20 日
54	九泰日添金货币市场基金 2016 年第 2 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 7 月 21 日
55	九泰日添金货币市场基金招募说明书更新（2016 年第 1 号）	公司网站	2016 年 7 月 22 日
56	九泰日添金货币市场基金招募说明书更新摘要（2016 年第 1 号）	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 7 月 22 日
57	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 7 月 25 日
58	关于增加平安证券有限责任公司为我公司所管理部分基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 8 月 4 日
59	关于增加平安证券有限责任公司为	证监会指定报刊和	2016 年 8 月 4 日

	我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	公司网站	
60	九泰基金关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 8 月 10 日
61	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金在浙江同花顺基金销售有限公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 8 月 10 日
62	九泰基金关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 8 月 12 日
63	关于调整旗下开放式基金申购金额下限的更正公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 8 月 13 日
64	关于增加陆金所资管为旗下开放式基金代销机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 8 月 19 日
65	关于九泰基金管理有限公司官网暂停服务的公告	公司网站	2016 年 8 月 25 日
66	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 8 月 26 日
67	九泰日添金货币市场基金 2016 年半年度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 8 月 26 日
68	关于九泰日添金货币市场基金修改基金合同的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 9 月 2 日
69	关于增加西南证券股份有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 9 月 7 日
70	关于九泰基金管理有限公司客服电话及在线咨询暂停相关服务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 9 月 12 日
71	关于增加北京电盈基金销售有限公司	证监会指定报刊和	2016 年 9 月 13 日

	司为我公司所管理部分基金销售机构的公告	公司网站	
72	关于九泰基金管理有限公司客服电话及在线咨询恢复相关服务的公告	公司网站	2016 年 9 月 26 日
73	关于九泰基金管理有限公司客服电话及在线咨询暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 9 月 26 日
74	关于增加上海华信证券有限责任公司为我公司所管理部分基金销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 9 月 28 日
75	九泰日添金货币市场基金 2016 年国庆节假期前暂停申购业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 9 月 28 日
76	关于九泰基金管理有限公司网上交易系统暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 10 月 13 日
77	九泰日添金货币市场基金 2016 年第 3 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 10 月 25 日
78	关于增加上海万得投资顾问有限公司为我公司所管理部分基金销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 10 月 27 日
79	关于九泰基金管理有限公司客服电话及在线咨询暂停服务的公告	公司网站	2016 年 10 月 28 日
80	关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为我公司所管理部分基金销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 11 月 1 日
81	关于增加华西证券股份有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 11 月 9 日
82	关于增加晋商银行股份有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 11 月 10 日

	机构的公告		
83	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 11 月 15 日
84	关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为我公司所管理部分基金销售机构并参与申购费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 11 月 15 日
85	关于增加杭州科地瑞富基金销售有限公司为我公司所管理部分基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 11 月 15 日
86	关于增加杭州科地瑞富基金销售有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 11 月 16 日
87	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 11 月 30 日
88	关于我公司旗下部分基金在上海凯石财富基金销售有限公司参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 2 日
89	关于我公司旗下部分基金在北京肯特瑞财富投资管理有限公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 9 日
90	九泰基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 13 日
91	关于我公司旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 21 日
92	九泰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 22 日

93	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 12 月 21 日
94	关于增加北京汇成基金销售有限公司为我公司所管理部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 23 日
95	九泰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 26 日
96	九泰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 29 日
97	九泰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 30 日
98	开放式基金净值表	公司网站	2016 年 12 月 31 日

§ 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》。

§ 13 备查文件目录

13.1 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、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、九泰日添金货币市场基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内九泰日添金货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 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。

13.3 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。

九泰基金管理有限公司
2017 年 3 月 29 日