

九泰日添金货币市场基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17日

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2019年7月15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先仔细阅读本基金的招募说明书。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Includes details for 九泰日添金货币市场基金.

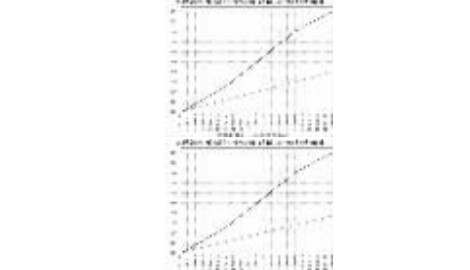
3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (Reporting Period). Shows performance metrics for the fund.

3.2 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。

Table with 2 columns: 报告期 (Reporting Period) and 基金业绩 (Fund Performance). Shows performance metrics for the fund.

注: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。



注:1.本基金合同于2015年12月9日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已逾一年,距建仓结束已满一年。
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,本基金建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

Table with 2 columns: 姓名 (Name) and 职务 (Position). Lists the fund manager and other key personnel.

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指公司相关公告披露的日期。

4.2 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5%的情况。

Table with 2 columns: 报告期 (Reporting Period) and 基金业绩 (Fund Performance). Shows performance metrics for the fund.

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指公司相关公告披露的日期。

Table with 2 columns: 姓名 (Name) and 职务 (Position). Lists the fund manager and other key personnel.

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指公司相关公告披露的日期。

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金基金经理的任期 证券从业年限 说明

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指公司相关公告披露的日期。

4.2 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5%的情况。

Table with 2 columns: 姓名 (Name) and 职务 (Position). Lists the fund manager and other key personnel.

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指公司相关公告披露的日期。

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金基金经理的任期 证券从业年限 说明

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指公司相关公告披露的日期。

4.2 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5%的情况。

Table with 2 columns: 姓名 (Name) and 职务 (Position). Lists the fund manager and other key personnel.

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指公司相关公告披露的日期。

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金基金经理的任期 证券从业年限 说明

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指公司相关公告披露的日期。

4.2 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5%的情况。

综合考虑外评评级和内部评级,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0.5472%,本报告期九泰日添金货币B的基金份额净值收益率为0.6074%,同期业绩比较基准收益率为0.3369%。

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人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Lists the fund's investment portfolio.

5.2 报告期末债券回购融资情况
序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

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平均值。

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

Table with 2 columns: 报告期 (Reporting Period) and 基金业绩 (Fund Performance). Shows performance metrics for the fund.

注:报告期内,本基金投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
报告期内,本基金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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Lists the fund's investment portfolio.

注:报告期内,本基金投资组合平均剩余期限超过240天情况说明
报告期内,本基金投资组合平均剩余期限超过240天的情况。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top five bond investments.

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top five asset-backed investments.

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top ten stock investments.

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top ten warrant investments.

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top five precious metal investments.

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top five warrant investments.

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.12 投资组合报告附注
5.12.1 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

5.12.2 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况的说明

5.12.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists other assets.

5.12.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists stock investments by industry.

5.12.5 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists Hong Kong stock investments.

5.12.6 报告期末按公允价值分类的股指期货投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists futures investments.

5.12.7 报告期末按公允价值分类的国债期货投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists Treasury futures investments.

5.12.8 报告期末按公允价值分类的贵金属投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists precious metal investments.

5.12.9 报告期末按公允价值分类的权证投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists warrant investments.

6.1 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.2 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.3 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.4 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.5 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.6 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.7 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.8 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.9 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.10 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.11 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.12 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.13 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.14 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.15 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.16 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.17 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.18 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.19 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.20 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.21 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.22 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.23 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.24 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.25 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.26 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.27 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.28 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.29 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.30 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.31 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.32 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.33 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.34 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.35 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.36 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.37 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.38 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.39 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.40 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.41 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.42 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.43 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.44 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.45 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

6.46 基金资产净值及基金份额净值
截至本报告期末,本基金资产净值为 1,231,000,000.00 元,基金份额净值为 1.0000 元。

九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2019年第二季度报告

基金管理人:九泰基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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先仔细阅读本基金的招募说明书。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金代码 (Fund Code). Includes details for 九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金(LOF).

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4月1日至2019年6月30日)

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (Reporting Period). Shows performance metrics for the fund.

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 2 columns: 报告期 (Reporting Period) and 基金业绩 (Fund Performance). Shows performance metrics for the fund.

注:1.本基金合同于2019年3月25日生效,截至本报告期末,本基金合同生效未逾一年。

Table with 2 columns: 姓名 (Name) and 职务 (Position). Lists the fund manager and other key personnel.

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指公司相关公告披露的日期。

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金基金经理的任期 证券从业年限 说明

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指公司相关公告披露的日期。

4.2 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5%的情况。

Table with 2 columns: 姓名 (Name) and 职务 (Position). Lists the fund manager and other key personnel.

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指公司相关公告披露的日期。

开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理人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《证券投资基金管理人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5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,股票市场呈现一定幅度的震荡,整体表现大致持平。期间,以食品饮料、家电为代表的消费类行业,以及银行和非银行金融为代表的金融类行业表现较好。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.0706元;本报告期基金份额净值增长率为-1.67%,业绩比较基准收益率为-0.39%。

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人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Item). Lists the fund's investment portfolio.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists stock investments by industry.

5.3 报告期末按公允价值分类的股指期货投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists futures investments.

5.4 报告期末按公允价值分类的国债期货投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists Treasury futures investments.

5.5 报告期末按公允价值分类的贵金属投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists precious metal investments.

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top five bond investments.

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top five asset-backed investments.

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top ten stock investments.

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists the top five warrant investments.

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.12 投资组合报告附注
5.12.1 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

5.12.2 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况的说明

5.12.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists other assets.

5.12.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists stock investments by industry.

5.12.5 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists Hong Kong stock investments.

5.12.6 报告期末按公允价值分类的股指期货投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists futures investments.

5.12.7 报告期末按公允价值分类的国债期货投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists Treasury futures investments.

5.12.8 报告期末按公允价值分类的贵金属投资组合

Table with 2 columns: 代码 (Code) and 名称 (Name). Lists precious metal investments.

5.12.9 报告期末按公允价值分类的权证投资组合