

九泰日添金货币市场基金 2024 年年度报告

2024 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：2025 年 3 月 31 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 2025 年 3 月 27 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 2024 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
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	14
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	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 债券回购融资情况	50
8.3 基金投资组合平均剩余期限	50
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	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细	52

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	52
8.8 期末按实际利率计算账面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	52
8.9 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.4 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	55
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品 情况	55
§10 开放式基金份额变动	56
§11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	59
11.9 其他重大事件	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息	62
12.1 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	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§13 备查文件目录	64
13.1 备查文件目录	64
13.2 存放地点	64
13.3 查阅方式	64

§ 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	117,197,434.84 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	77,671,765.80 份	39,525,669.04 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。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。

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	郑立昌	王小飞
	联系电话	010-87940900	021-60637103
	电子邮箱	zhenglichang@jtamc.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-628-0606	021-60637228
传真		010-87940910	021-60635778
注册地址		北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-211 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 2 号楼 1 栋西侧一层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100012	100033

法定代表人	徐进	张金良
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://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或办公场所

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	北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 2 号楼 1 栋西侧一层

§ 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	2024 年		2023 年		2022 年	
	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	九泰日添金货币 A	九泰日添金货币 B
本期已实现收益	548,568.25	328,513.73	1,034,085.43	1,602.36	1,636,964.21	1,707.94
本期利润	548,568.25	328,513.73	1,034,085.43	1,602.36	1,636,964.21	1,707.94
本期净值收益率	1.3878%	1.5295%	1.4214%	1.6648%	1.1280%	1.3728%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	77,671,765.80	39,525,669.04	52,295,232.18	77,394.01	95,870,438.54	124,354.67

基金资产净值						
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
累计净值收益率	21.7791%	24.3275%	20.1122%	22.4545%	18.4289%	20.4493%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	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	0.4121%	0.0015%	0.3393%	0.0000%	0.0728%	0.0015%
过去六个月	0.7316%	0.0021%	0.6787%	0.0000%	0.0529%	0.0021%
过去一年	1.3878%	0.0021%	1.3500%	0.0000%	0.0378%	0.0021%
过去三年	3.9888%	0.0014%	4.0500%	0.0000%	-0.0612%	0.0014%
过去五年	7.6399%	0.0019%	6.7500%	0.0000%	0.8899%	0.0019%
自基金合同生效起至今	21.7791%	0.0041%	12.2388%	0.0000%	9.5403%	0.0041%

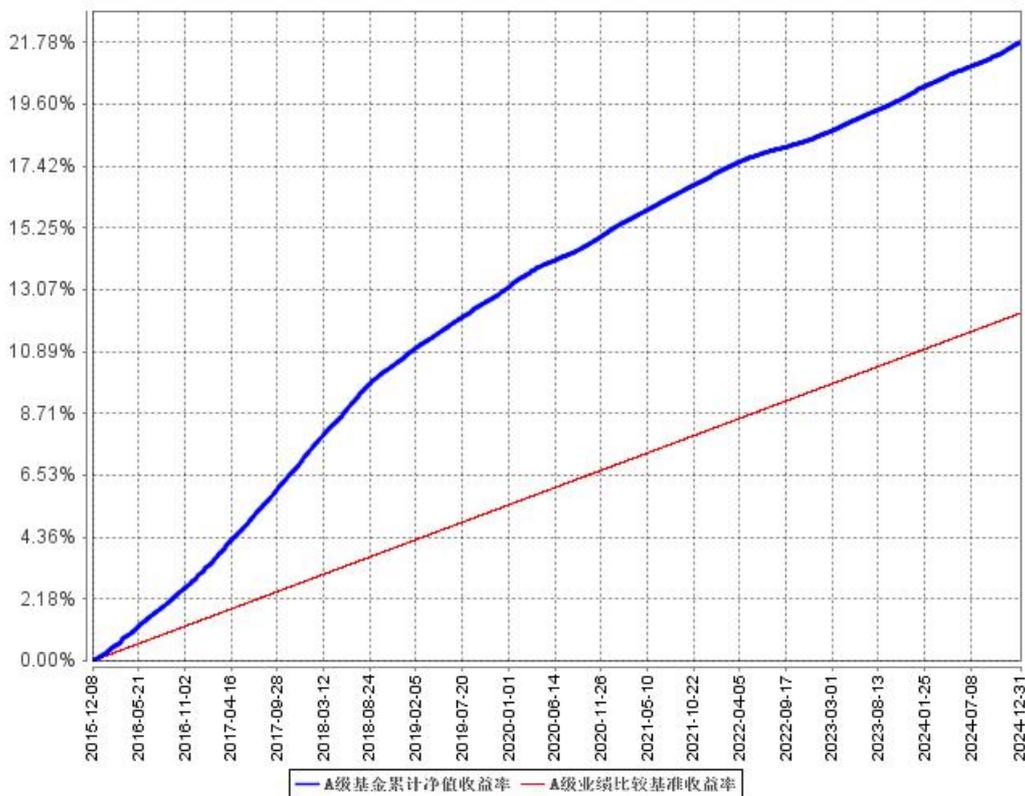
九泰日添金货币 B

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	0.4471%	0.0015%	0.3393%	0.0000%	0.1078%	0.0015%
过去六个月	0.8021%	0.0021%	0.6787%	0.0000%	0.1234%	0.0021%
过去一年	1.5295%	0.0021%	1.3500%	0.0000%	0.1795%	0.0021%
过去三年	4.6368%	0.0014%	4.0500%	0.0000%	0.5868%	0.0014%
过去五年	8.8272%	0.0019%	6.7500%	0.0000%	2.0772%	0.0019%
自基金合同生效起至今	24.3275%	0.0041%	12.2388%	0.0000%	12.0887%	0.0041%

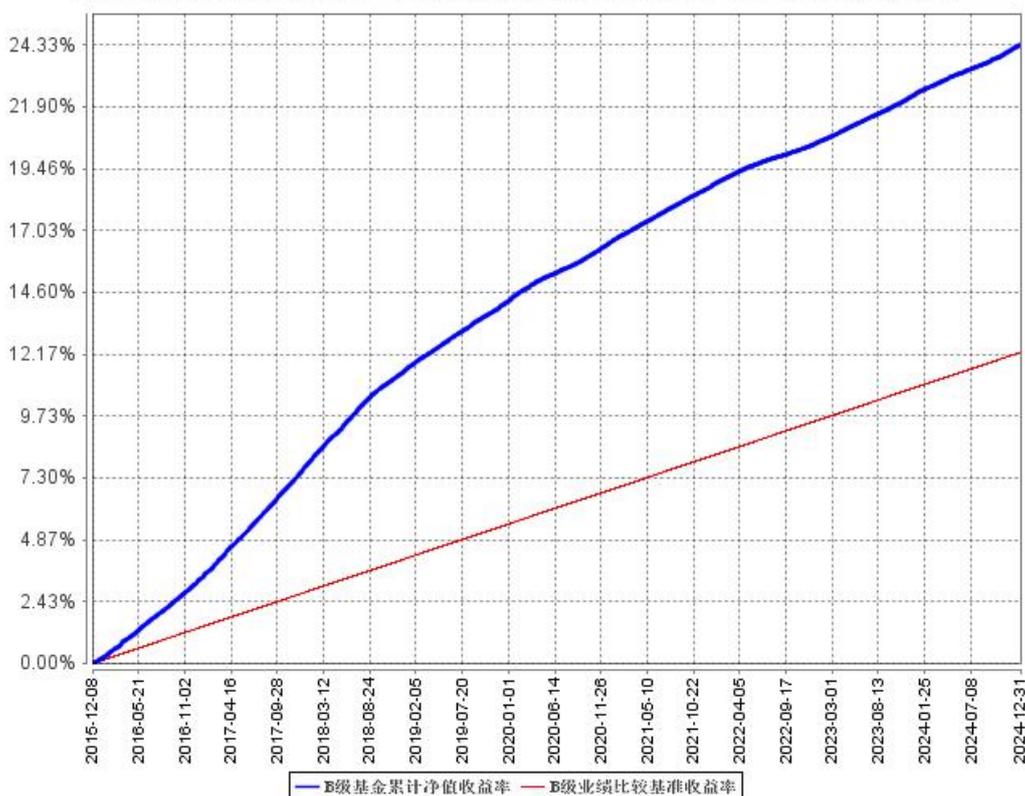
注：本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

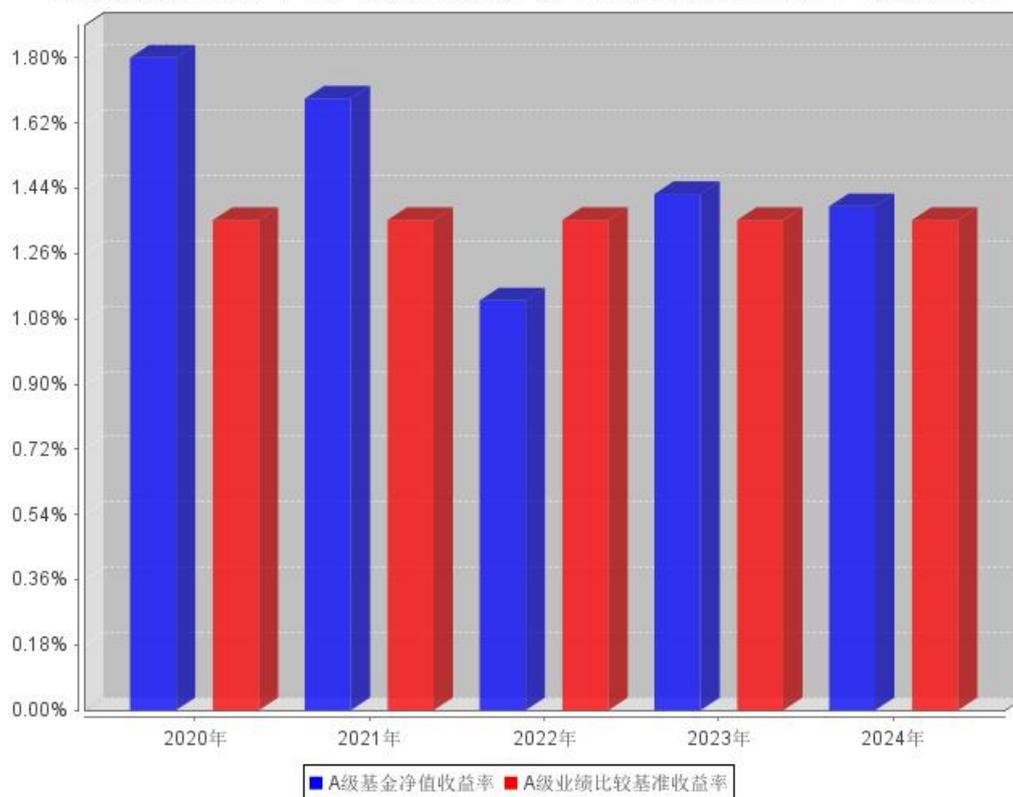


注：1. 本基金合同于 2015 年 12 月 8 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束已满一年。

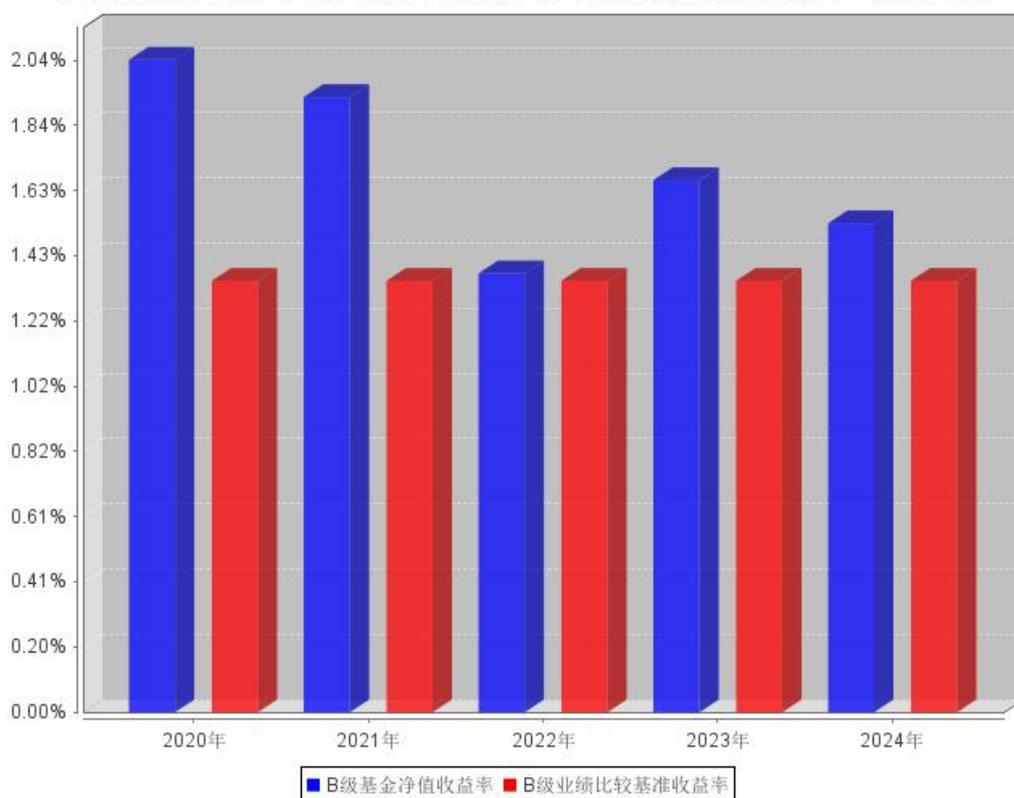
2. 根据基金合同的约定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求，本基金建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年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级过去五年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



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
2024	556,567.42	-	-7,999.17	548,568.25	
2023	1,032,270.19	-	1,815.24	1,034,085.43	
2022	1,639,280.93	-	-2,316.72	1,636,964.21	
合计	3,228,118.54	-	-8,500.65	3,219,617.89	

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
2024	326,647.42	-	1,866.31	328,513.73	
2023	1,598.64	-	3.72	1,602.36	
2022	1,702.88	-	5.06	1,707.94	
合计	329,948.94	-	1,875.09	331,824.03	

§ 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，注册地位于北京市，截至报告期末，设立有深圳分公司。

公司优先发展公募基金业务，创新拓展私募资产管理业务，坚持“持有人利益优先”和“风控第一”原则，以“大资管”时代金融资本市场改革发展为契机，积极推动业务和产品创新，不断探索新的商业模式，发展特色产品线，打造差异化的竞争优势。公司秉承长期投资、价值投资的经营理念，建立有效的公司治理和激励约束机制。

公司旗下拥有较为完整的公募基金产品线，覆盖股票型、混合型、货币型等产品类别，以定开式、开放式、上市LOF等不同模式运作，有效满足广大投资者不同的投资理财需求。

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		
刘翰飞	基金经理	2021年12月24日	-	6	北京大学经济学博士，6年证券从业经历。2018年3月加入九泰基金管理有限公司，曾任研究发展部债券研究员，现任固收投资部基金经理，具有基金从业资格。

注：

- 1、证券从业的含义遵从监管部门和行业协会的相关规定。
- 2、基金经理的“任职日期”为基金合同生效日或公司相关公告中披露的聘任日期，“离任日期”为公司相关公告中披露的解聘日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金未发生基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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》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 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

本报告期内，本公司所管理的投资组合，在参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的情况共出现了 1 次，未发现异常。本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

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

报告期内，本基金对投资策略进行了优化。作为流动性现金管理工具，本基金以流动性管理为主，把低风险性和流动性摆在首位，采取低风险偏好，接近无杠杆水平运作。

(1) 资产配置上，报告期内本基金以国股行同业存单作为主要投资品种，逆回购和利率债为辅；在货币市场收益水平不断走低的情况下，在严控风险的前提下，寻找小持仓比例的高等级非托管行存单和城投债等其他品种增厚收益。

(2) 本基金根据资金面情况、负债端情况以及利率走势研判，灵活合理调整产品剩余期限分布和资产配置比例，致力于实现流动性、安全性、收益率三者的合理兼顾。

(3) 公司已建立完善的信评内控流程和流动性观察体系，相关制度和风控指标建设完备，保障产品健康平稳运作。

4.4.2 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 1.3878%，本报告期本基金 B 类份额净值增长率为 1.5295%，同期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

宏观经济方面，中国经济长期向好的基本趋势没有改变，支撑中国经济高质量发展的要素条件在不断积累增多。但同时，中国 GDP 增速从高速增长（2000-2010 年均 10%左右）逐步过渡到中高速（当前 5%附近），中国经济进入了新常态。我们认为，随着中国经济体量的不断增大和经济发展自有规律的作用，长期来看，潜在经济增速预计会有所下行，并大概率推动广谱利率中枢也随之趋势性下行。在此情形下，债券品种依然存在一定的资本利得空间，其仍然是重要的投资品种。

尽管货币基金在一定阶段其绝对收益率出现下降趋势，但货币基金作为良好的现金管理工具，具有流动性好、安全性高、收益稳定、低门槛、低费率等特征，其仍然是市场投资者重要的投资品种。

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有相应制度，并进行及时的修订更新，持续完善公司合规制度建设；通过开展合规咨询、合规审查、合规培训、合规考试、合规问责等形式，不断提升员工的合规守法意识；通过对业务部门专兼职合规管理员的培训和管理，强化业务合规管理，将合规管理内置到前台业务中。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，加强防控风险，保护持有人利益；持续加强投资风险监控工作，通过人员培训、系统建设、流程梳理等手段不断提高风险监控能力，把控投资风险；加强绩效评价工作频率和质量，积极促进投研业务水平提高。在监察稽核方面，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展各项业务的专项稽核，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。

本基金管理人将不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以基金持有人利益最大化为原则，持续防控风险。

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。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确了基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，健全了估值决策体系。本基金管理人在具体的基金估值业务执行上，在遵守中国证监会相关规定和基金合同的同时，参考了行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，以确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制定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。对下属管理的不同基金持有的具有相同特征的同一种投资品种的估值原则、程序及技术保持一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。

本基金管理人设立了由督察长、估值业务分管高管、研究业务分管高管、风险管理部、研究发展部、基金运营部等部门负责人组成的基金估值委员会，负责制定或完善估值政策、估值程序，定期复核和审阅估值程序和技术的适用性，以确保相关估值程序和技术不存在重大缺陷。委员会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负责本基金审计业务的会计师事务所。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。托管人在复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格之前，应认真审阅基金管理人采用的估值原则及技术。当对估值原则及技术有异议时，托管人有义务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。本基金管理人当发生改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的情况时，将所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。此外，会计师事务所出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程的各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。同时与中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票流动性折扣数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集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

本基金报告期内出现超过连续 20 个工作日（2024 年 5 月 8 日-2024 年 6 月 4 日、2024 年 10 月 9 日-2024 年 11 月 7 日）基金资产净值低于 5000 万元的情形，未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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(25)第 P00546 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：
审计意见	<p>我们审计了九泰日添金货币市场基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于九泰日添金货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>九泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括九泰日添金货币市场基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责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，使其实现公允反映，并设计、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。</p>

	<p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估九泰日添金货币市场基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算九泰日添金货币市场基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督九泰日添金货币市场基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,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。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对九泰日添金货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致九</p>

	<p>泰日添金货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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)
注册会计师的姓名	韩攻 强占新
会计师事务所的地址	中国·上海
审计报告日期	2025 年 3 月 28 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,000,333.13	772,314.28
结算备付金		8,054,332.41	-
存出保证金		484.26	-
交易性金融资产	7.4.7.2	45,963,906.95	30,667,300.97
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		45,963,906.95	30,667,300.97
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	37,008,944.90	21,019,869.87
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		24,231,503.74	95,702.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		117,259,505.39	52,555,188.01
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,615.31	12,695.93
应付托管费		9,423.63	4,592.38
应付销售服务费		5,743.69	10,745.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		771.74	-
应付利润		5,385.38	11,518.24
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	26,130.80	143,009.93
负债合计		62,070.55	182,561.82
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	117,197,434.84	52,372,626.19
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		117,197,434.84	52,372,626.19
负债和净资产总计		117,259,505.39	52,555,188.01

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，九泰日添金货币 A 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 77,671,765.80 份；九泰日添金货币 B 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 39,525,669.04 份。九泰日添金货币份额总额合计为 117,197,434.84 份。

7.2 利润表

会计主体：九泰日添金货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,164,109.34	1,690,179.82
1.利息收入		391,928.06	508,080.91
其中：存款利息收入	7.4.7.13	45,720.37	4,263.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		346,207.69	503,817.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		772,181.28	1,182,098.91
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.15	772,181.28	1,182,098.91
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		287,027.36	654,492.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	90,794.41	219,107.83
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	60,209.80	74,650.37
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	61,857.16	185,669.84
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		12,888.28	172.55
其中：卖出回购金融资产支出		12,888.28	172.55
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		292.71	-
8. 其他费用	7.4.7.23	60,985.00	174,891.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		877,081.98	1,035,687.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		877,081.98	1,035,687.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		877,081.98	1,035,687.79

7.3 净资产变动表

会计主体：九泰日添金货币市场基金

本报告期：2024年1月1日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年12月31日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	52,372,626.19	-	-	52,372,626.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	52,372,626.19	-	-	52,372,626.19
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	64,824,808.65	-	-	64,824,808.65
(一)、综合收益总额	-	-	877,081.98	877,081.98
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以“-” 号填列)	64,824,808.65	-	-	64,824,808.65
其中：1.基金申购款	458,068,345.76	-	-	458,068,345.76
2.基金赎回款	-393,243,537.11	-	-	-393,243,537.11
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的净资产变动(净资 产减少以“-”号填列)	-	-	-877,081.98	-877,081.98
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	117,197,434.84	-	-	117,197,434.84
	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
项目	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	95,994,793.21	-	-	95,994,793.21
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	95,994,793.21	-	-	95,994,793.21
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-43,622,167.02	-	-	-43,622,167.02
(一)、综合收益总额	-	-	1,035,687.79	1,035,687.79
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以“-” 号填列)	-43,622,167.02	-	-	-43,622,167.02
其中：1.基金申购款	27,452,170.22	-	-	27,452,170.22
2.基金赎回款	-71,074,337.24	-	-	-71,074,337.24

会计准则”)、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

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。

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) 金融资产的分类

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和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债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负债和其他金融负债。本基金暂无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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，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。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融

产，并相应确认相关负债。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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债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，将其公允价值划分为三个层次。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。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。在本基金存续期间，基金管理人定期计算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后采用估值技术确定最能反映公允价值的价格。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，且目前可执行该种法定权利，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基金份额所对应的金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

-

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

债券投资收益包括债券利息收入以及买卖债券价差收入。基金持有的附息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应收利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

(3) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566号）所规定的固定收益品种，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种使用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要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[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》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助

服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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增值税; 2018年1月1日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人作为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税;

(2) 对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;

(3) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	2,000,333.13	772,314.28
等于：本金	2,000,167.08	772,230.09
加：应计利息	166.05	84.19
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计：	2,000,333.13	772,314.28

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2024 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算账 面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	4,046,342.97	4,050,535.89	4,192.92	0.0036
	银行间市场	41,917,563.98	41,939,565.48	22,001.50	0.0188
	合计	45,963,906.95	45,990,101.37	26,194.42	0.0224
资产支持证券		-	-	-	-
合计		45,963,906.95	45,990,101.37	26,194.42	0.0224
项目		上年度末			
		2023 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算账 面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	30,667,300.97	30,670,846.57	3,545.60	0.0068
	合计	30,667,300.97	30,670,846.57	3,545.60	0.0068
资产支持证券		-	-	-	-
合计		30,667,300.97	30,670,846.57	3,545.60	0.0068

注：

- 1、偏离金额=影子定价-摊余成本；
- 2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金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 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	37,008,944.90	-
合计	37,008,944.90	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	21,019,869.87	-
合计	21,019,869.87	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

无。

7.4.7.6 其他债权投资

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

无。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	7,830.80	3,709.93
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	7,830.80	3,709.93

应付利息	-	-
预提信息披露费	-	80,000.00
预提审计费	9,000.00	50,000.00
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	26,130.80	143,009.93

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

九泰日添金货币 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	52,295,232.18	52,295,232.18
本期申购	89,492,667.90	89,492,667.90
本期赎回(以“-”号填列)	-64,116,134.28	-64,116,134.28
- 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	77,671,765.80	77,671,765.80

金额单位：人民币元

九泰日添金货币 B		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,394.01	77,394.01
本期申购	368,575,677.86	368,575,677.86
本期赎回(以“-”号填列)	-329,127,402.83	-329,127,402.83
- 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	39,525,669.04	39,525,669.04

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额及金额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 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	-	-	-
加：会计政策变更 (若有)	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	548,568.25	-	548,568.25
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	-548,568.25	-	-548,568.25
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	-	-	-
加：会计政策变更 (若有)	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	328,513.73	-	328,513.73
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	-328,513.73	-	-328,513.73
本期末	-	-	-

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	2,413.70	4,263.59
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	43,303.68	-
其他	2.99	-
合计	45,720.37	4,263.59

注：其他包括结算保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益**7.4.7.14.1 股票投资收益**

无。

7.4.7.15 债券投资收益**7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	712,238.64	1,188,456.94
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	59,942.64	-6,358.03
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	772,181.28	1,182,098.91

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	293,083,007.00	180,277,653.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	290,534,919.44	179,821,011.86
减：应计利息总额	2,488,144.92	463,000.00

减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	59,942.64	-6,358.03

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

无。

7.4.7.19 股利收益

无。

7.4.7.20 公允价值变动收益

无。

7.4.7.21 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
审计费用	9,000.00	50,000.00
信息披露费	-	80,000.00

证券出借违约金	-	-
银行汇划费	14,785.00	7,691.44
债券账户维护费	37,200.00	37,200.00
其他	-	-
合计	60,985.00	174,891.44

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

截至本财务报告批准报出日，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
华源证券股份有限公司	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

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	90,794.41	219,107.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	26,452.03	90,649.56
应支付基金管理人的净管理费	64,342.38	128,458.27

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	60,209.80	74,650.37

注：自2024年1月1日至2024年12月29日，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

根据《九泰基金管理有限公司关于九泰日添金货币市场基金降低费率并相应修订基金合同等法律文件的公告》，自2024年12月30日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	18,928.12	432.19	19,360.31
九泰基金销售（北京）有限公司	-	-	-
华源证券股份有限公司	9.04	-	9.04
合计	18,937.16	432.19	19,369.35
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	31,701.39	1.80	31,703.19
九泰基金销售（北京）有限公司	56.94	-	56.94
华源证券股份有限公司	104.79	-	104.79
合计	31,863.12	1.80	31,864.92

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 0.15% 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	2,000,333.13	2,413.70	772,314.28	4,263.59

注：本基金的上述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交易事项。

7.4.11 利润分配情况

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
556,567.42	-	-7,999.17	548,568.25	-

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
326,647.42	-	1,866.31	328,513.73	-

7.4.12 期末（2024 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

本基金在日常经营活动中面临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、风险管理部以及相关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险管理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。

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约责任，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人在商业银行开立的托管账户，投资其他银行存款由基金管理人根据投资制度审慎选择存款银行，与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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,012,622.78	-
合计	2,012,622.78	-

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、央行票据和同业存单。

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短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	36,872,522.88	9,993,708.78
合计	36,872,522.88	9,993,708.78

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	3,032,418.32	-
合计	3,032,418.32	-

注：1. 长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券，以上列示不包括国债、政策性金融债、央行票据和同业存单。

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险**7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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，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、组合在短期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、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，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%。

综上所述，本基金在本报告期内流动性良好，无重大流动性风险。

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 2024 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							
货币资金	2,000,333.13	-	-	-	-	-	2,000,333.13
结算备付金	8,054,332.41	-	-	-	-	-	8,054,332.41
存出保证金	484.26	-	-	-	-	-	484.26
交易性金融资产	10,995,224.38	7,970,157.00	26,998,525.57	-	-	-	45,963,906.95
买入返售金融资产	37,008,944.90	-	-	-	-	-	37,008,944.90
应收申购款	-	-	-	-	-	-24,231,503.74	24,231,503.74
资产总计	58,059,319.08	7,970,157.00	26,998,525.57	-	-	-24,231,503.74	117,259,505.39
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,615.31	14,615.31

应付托管费	-	-	-	-	-	9,423.63	9,423.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,743.69	5,743.69
应交税费	-	-	-	-	-	771.74	771.74
应付利润	-	-	-	-	-	5,385.38	5,385.38
其他负债	-	-	-	-	-	26,130.80	26,130.80
负债总计	-	-	-	-	-	62,070.55	62,070.55
利率敏感度缺口	58,059,319.08	7,970,157.00	26,998,525.57	-	-	-24,169,433.19	117,197,434.84
上年度末 2023 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							
货币资金	772,314.28	-	-	-	-	-	772,314.28
交易性金融资产	30,667,300.97	-	-	-	-	-	30,667,300.97
买入返售金融资产	21,019,869.87	-	-	-	-	-	21,019,869.87
应收申购款	-	-	-	-	-	95,702.89	95,702.89
资产总计	52,459,485.12	-	-	-	-	95,702.89	52,555,188.01
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,695.93	12,695.93
应付托管费	-	-	-	-	-	4,592.38	4,592.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,745.34	10,745.34
应付利润	-	-	-	-	-	11,518.24	11,518.24
其他负债	-	-	-	-	-	143,009.93	143,009.93
负债总计	-	-	-	-	-	182,561.82	182,561.82
利率敏感度缺口	52,459,485.12	-	-	-	-	-86,858.93	52,372,626.19

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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1、市场利率下降 25 个基点	27,931.96	766.30
	2、市场利率上升 25 个基点	-27,883.74	-766.18

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 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	45,963,906.95	30,667,300.97
第三层次	-	-
合计	45,963,906.95	30,667,300.97

7.4.14.2.2 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.2.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

-

7.4.14.2.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	45,963,906.95	39.20
	其中: 债券	45,963,906.95	39.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	37,008,944.90	31.56
	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	10,054,665.54	8.57
4	其他各项资产	24,231,988.00	20.67
5	合计	117,259,505.39	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		1.09
	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	46
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

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	49.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	1.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	5.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	18.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	4.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	79.29	-

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	按实际利率计算账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	4,046,342.97	3.45
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	2,012,622.78	1.72
6	中期票据	3,032,418.32	2.59
7	同业存单	36,872,522.88	31.46
8	其他	-	-
9	合计	45,963,906.95	39.22
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面价值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)	按实际利率计算的 账面价值	占基金资产净值 比例 (%)
1	112471307	24 苏州银行 CD294	100,000	9,995,613.78	8.53
2	112406148	24 交通银行 CD148	80,000	7,962,582.95	6.79
3	019740	24 国债 09	40,000	4,046,342.97	3.45
4	102483069	24 昆明交通 MTN001	30,000	3,032,418.32	2.59
5	112417113	24 光大银行 CD113	30,000	2,988,620.79	2.55
6	112414074	24 江苏银行 CD074	30,000	2,983,918.74	2.55
7	112411060	24 平安银行 CD060	30,000	2,983,390.61	2.55
8	112497706	24 南京银行 CD092	30,000	2,981,898.99	2.54
9	042480406	24 青岛上合 CP003	20,000	2,012,622.78	1.72
10	112415125	24 民生银行 CD125	20,000	1,992,193.29	1.70

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0692%
报告期内偏离度的最低值	-0.0077%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0267%

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 期末按实际利率计算账面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 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。

8.9.2 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，苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。平安银行股份有限公司在报告编制前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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，其余证券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。

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	484.26
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	24,231,503.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	24,231,988.00

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	160,931	482.64	41,986,795.20	54.06%	35,684,970.60	45.94%
九泰日添金货币 B	81	487,971.22	36,859,864.82	93.26%	2,665,804.22	6.74%
合计	161,012	727.88	78,846,660.02	67.28%	38,350,774.82	32.72%

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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	其他机构	15,000,822.75	12.80%
2	信托类机构	14,003,874.52	11.95%
3	其他机构	10,002,581.44	8.53%
4	其他机构	10,000,000.00	8.53%
5	其他机构	8,965,246.49	7.65%
6	券商类机构	7,951,414.26	6.78%
7	个人	3,410,000.00	2.91%
8	其他机构	2,970,488.71	2.53%
9	其他机构	2,758,453.83	2.35%
10	其他机构	2,021,132.52	1.72%
11	合计	77,084,014.52	65.77%

9.3 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	19,080.96	0.0246%
	九泰日添金货币 B	50.52	0.0001%
	合计	19,131.48	0.0163%

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。

9.4 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	0~10
	九泰日添金货币 B	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	九泰日添金货币 A	0~10
	九泰日添金货币 B	0
	合计	0~10

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

无。

§ 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	52,295,232.18	77,394.01
本报告期基金总申购份额	89,492,667.90	368,575,677.86
减:本报告期基金总赎回份额	64,116,134.28	329,127,402.83
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	77,671,765.80	39,525,669.04

注：申购份额含红利再投、转入份额而调增份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

一、本报告期内，基金管理人发生以下重要人员变更事项：

1、4月15日，谢海波先生担任本公司首席信息官，详见2024年4月16日本公司发布的《九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》。

2、5月15日，徐进先生担任本公司总经理，详见2024年5月16日本公司发布的《九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》。

3、7月2日，郑立昌先生担任本公司副总经理，详见2024年7月4日本公司发布的《九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》。

4、12月17日，郑立昌先生担任本公司督察长，详见2024年12月19日本公司发布的《九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》。

二、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门发生以下重要人员变更事项：

经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

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

本报告期内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9,000.00元。截止本报告期末，该会计师事务所已为本基金提供9年的审计服务。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 券商经纪人经营行为规范、风险管理健全，在业内有较好的声誉；
- (2) 具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 券商经纪人具有较强的研究支持能力：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。

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审批，同意后与被选择的证券经营机构签订相关协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订协议时，要明确签定协议双方的公司名称、协议有效期、佣金率、双方的权利义务等。

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。

11.7.2 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	12,721,159.00	100.00%	-	-	-	-

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%的情况。

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 2023 年 12 月 31 日基金资产净值公告	公司官网	2024 年 1 月 1 日
2	九泰基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告	规定报刊和规定网站	2024 年 1 月 9 日
3	九泰基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2024 年 1 月 22 日
4	九泰日添金货币市场基金 2023 年第 4 季度报告	规定网站	2024 年 1 月 22 日
5	九泰日添金货币市场基金暂停申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024 年 2 月 2 日
6	九泰日添金货币市场基金恢复申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024 年 2 月 19 日
7	九泰基金管理有限公司关于子公司九泰基金销售（北京）有限公司住所变更的公告	规定报刊和规定网站	2024 年 3 月 20 日
8	九泰基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	规定报刊	2024 年 3 月 29 日
9	九泰日添金货币市场基金 2023 年年度报告	规定网站	2024 年 3 月 29 日
10	九泰日添金货币市场基金暂停大额申购、大额转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024 年 3 月 30 日
11	九泰日添金货币市场基金恢复大额申购、大额转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024 年 4 月 3 日
12	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊和规定网站	2024 年 4 月 16 日
13	九泰日添金货币市场基金暂停大额申购、大额转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024 年 4 月 26 日
14	九泰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2024 年 4 月 22 日
15	九泰日添金货币市场基金 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024 年 4 月 22 日

16	九泰日添金货币市场基金恢复大额申购、大额转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024年4月30日
17	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊和规定网站	2024年5月16日
18	九泰基金管理有限公司办公电话及传真号码变更的公告	规定报刊和规定网站	2024年5月29日
19	九泰基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	规定报刊和规定网站	2024年6月1日
20	九泰基金管理有限公司关于住所变更的公告	规定报刊和规定网站	2024年6月1日
21	九泰基金管理有限公司关于上海分公司注销的公告	规定报刊和规定网站	2024年6月13日
22	九泰日添金货币市场基金（九泰日添金货币 A 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2024年6月27日
23	九泰日添金货币市场基金（九泰日添金货币 B 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2024年6月27日
24	九泰基金管理有限公司关于提请投资者及时更新相关信息的公告	规定报刊和规定网站	2024年6月28日
25	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊和规定网站	2024年7月4日
26	九泰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2024年7月19日
27	九泰日添金货币市场基金 2024 年第 2 季度报告	规定网站	2024年7月19日
28	九泰基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	规定报刊和规定网站	2024年8月14日
29	九泰基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	规定报刊	2024年8月31日
30	九泰日添金货币市场基金 2024 年中期报告	规定网站	2024年8月31日
31	九泰日添金货币市场基金暂停大额申购、大额转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024年9月11日
32	九泰日添金货币市场基金恢复大额申购、大额转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024年9月13日
33	九泰日添金货币市场基金暂停大额申购、大额转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024年9月24日

34	九泰日添金货币市场基金恢复大额申购、大额转换转入和定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2024年9月30日
35	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊和规定网站	2024年10月11日
36	九泰基金管理有限公司深圳分公司负责人变更的公告	规定报刊和规定网站	2024年10月17日
37	九泰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2024年10月25日
38	九泰日添金货币市场基金 2024 年第 3 季度报告	规定网站	2024年10月25日
39	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊和规定网站	2024年12月19日
40	九泰基金管理有限公司关于九泰日添金货币市场基金降低费率并相应修订基金合同等法律文件的公告	规定报刊和规定网站	2024年12月28日
41	九泰日添金货币市场基金基金合同	规定网站	2024年12月28日
42	九泰日添金货币市场基金托管协议	规定网站	2024年12月28日
43	九泰日添金货币市场基金招募说明书更新	规定网站	2024年12月30日
44	九泰日添金货币市场基金（九泰日添金货币 A 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2024年12月30日
45	九泰日添金货币市场基金（九泰日添金货币 B 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2024年12月30日
46	九泰基金管理有限公司关于提请投资者及时更新相关信息的公告	规定报刊和规定网站	2024年12月31日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20240228 至 20240229 , 20240320 至 20240326	0.00	13,022,111.61	13,022,111.61	0.00	0.00%
产品	1	20241202 至 20241229	0.00	50,066,332.60	50,066,332.60	0.00	0.00%
	2	20240723 至 20240730	0.00	18,905,427.78	18,905,427.78	0.00	0.00%
	3	20240627 至 20240721, 20240731 至 20240922	0.00	15,046,214.85	15,046,214.85	0.00	0.00%
	4	20240402 至 20240408	0.00	20,005,509.60	20,005,509.60	0.00	0.00%
	5	20240418 至 20240421	0.00	31,006,727.42	31,006,727.42	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>报告期内,本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、当持有基金份额比例较高的投资者集中赎回时,极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,进而引发基金的流动性风险。 2、当持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时,更容易触发巨额赎回条款,基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。 3、当投资者持有基金份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响。 4、若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元,本基金合同终止,无须召开基金份额持有人大会。 							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

自 2024 年 12 月 30 日起,本基金基金托管费年费率由 0.10%降低至 0.05%。详见 2024 年 12 月 28 日本公司发布的《九泰基金管理有限公司关于九泰日添金货币市场基金降低费率并相应修

订基金合同等法律文件的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 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。

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

2025年3月31日