

# 九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券 投资基金 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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 23 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，投资者在做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 9 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
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.....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	40
8.7 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.....	40

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	40
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	40
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	40
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
8.12 投资组合报告附注 .....	41
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	42
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	42
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
11.4 基金投资策略的改变 .....	43
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
11.8 其他重大事件 .....	45
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
13.1 备查文件目录 .....	54
13.2 存放地点 .....	54
13.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	九泰泰富定增混合
场内简称	九泰泰富
基金主代码	168105
基金运作方式	上市契约型开放式 本基金在基金合同生效后前五年内，场内份额不开放申购、赎回业务，但可上市交易；场外份额每年定期开放一次申购、赎回业务，基金管理人可采取部分确认的方式确保申购、赎回结束后本基金的总份额基本保持不变。本基金合同生效后第五个年度对日起，本基金转为上市开放式基金（LOF），并更名为“九泰泰富灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，接受场内、场外申购与赎回等业务，并继续上市交易。
基金合同生效日	2016年9月26日
基金管理人	九泰基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	335,629,280.84份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017-01-10

### 2.2 基金产品说明

投资目标	基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，在基金合同生效后前五年内，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的定向增发投资机会，力争在参与定增项目的基础上，提升流动性和收益水平，获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，通过深入挖掘国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越各阶段业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在基金合同生效后前五年内，通过对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的定向增发投资机会，在行业分析轮动效应与定向增发项目优势的深入研究的基础上，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定

	向增发主题相关证券进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线，形成以定向增发为核心的投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债总指数（总值）财富指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高风险收益特征的证券投资基金品种。

### 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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢海波	郭杰
	联系电话	010-52601690	0755-82943666
	电子邮箱	xiehaibo@jtamc.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-628-0606	95565
传真		010-66067330	0755-82960794
注册地址		北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室	深圳市福田区益田路江苏大厦 38 层至 45 层
办公地址		北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦西区 6 层	深圳市福田区益田路江苏大厦 38 层至 45 层
邮政编码		100033	518026
法定代表人		卢伟忠	宫少林

### 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《上海证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	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 9 月 26 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	17,238.68
本期利润	-1,151,526.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0034
本期加权平均净值利润率	-0.34%
本期基金份额净值增长率	-0.34%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末
期末可供分配利润	-1,151,526.53
期末可供分配基金份额利润	-0.0034
期末基金资产净值	334,477,754.31
期末基金份额净值	0.9966
3.1.3 累计期末指标	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-0.34%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日；

4、本基金基金合同于 2016 年 9 月 26 日生效，截至本报告期末本基金成立未满一年。

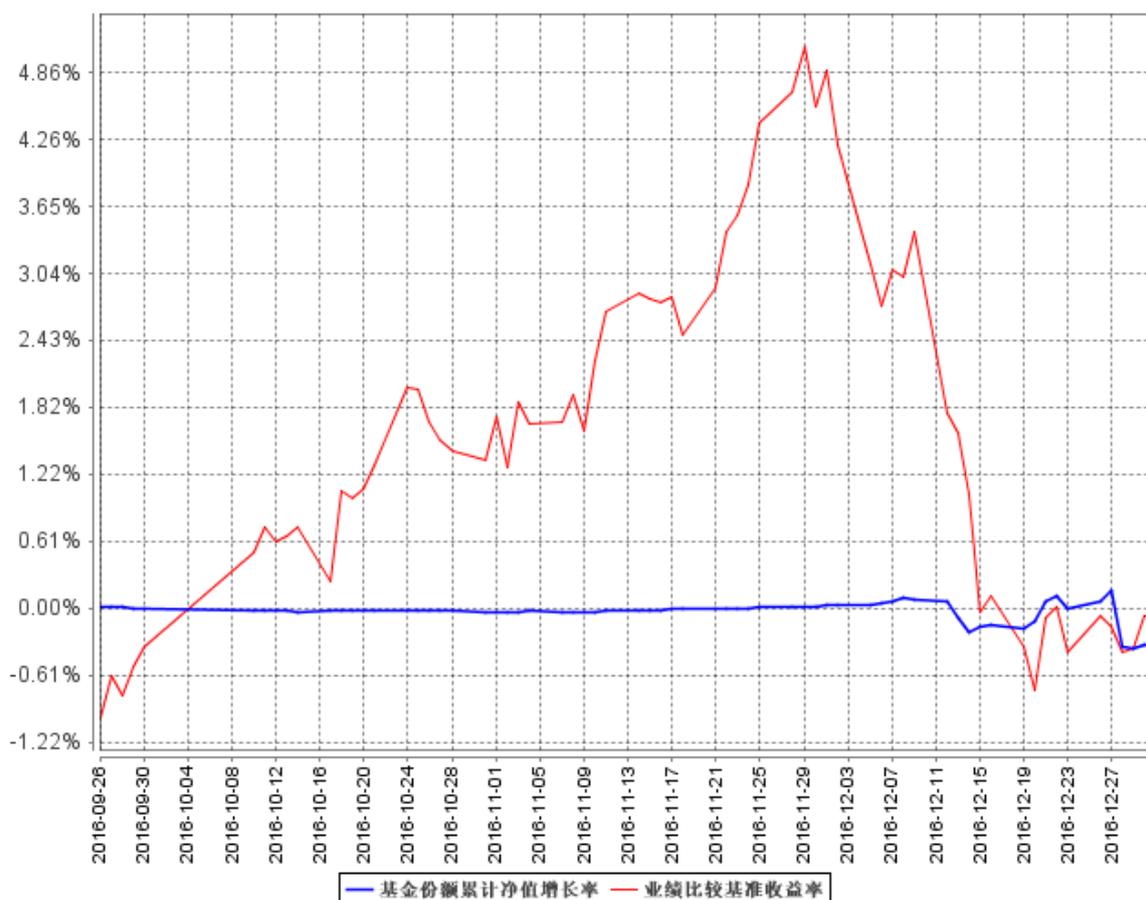
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 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	-0.34%	0.08%	0.29%	0.46%	-0.63%	-0.38%
自基金合同 生效起至今	-0.34%	0.08%	-0.07%	0.46%	-0.27%	-0.38%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

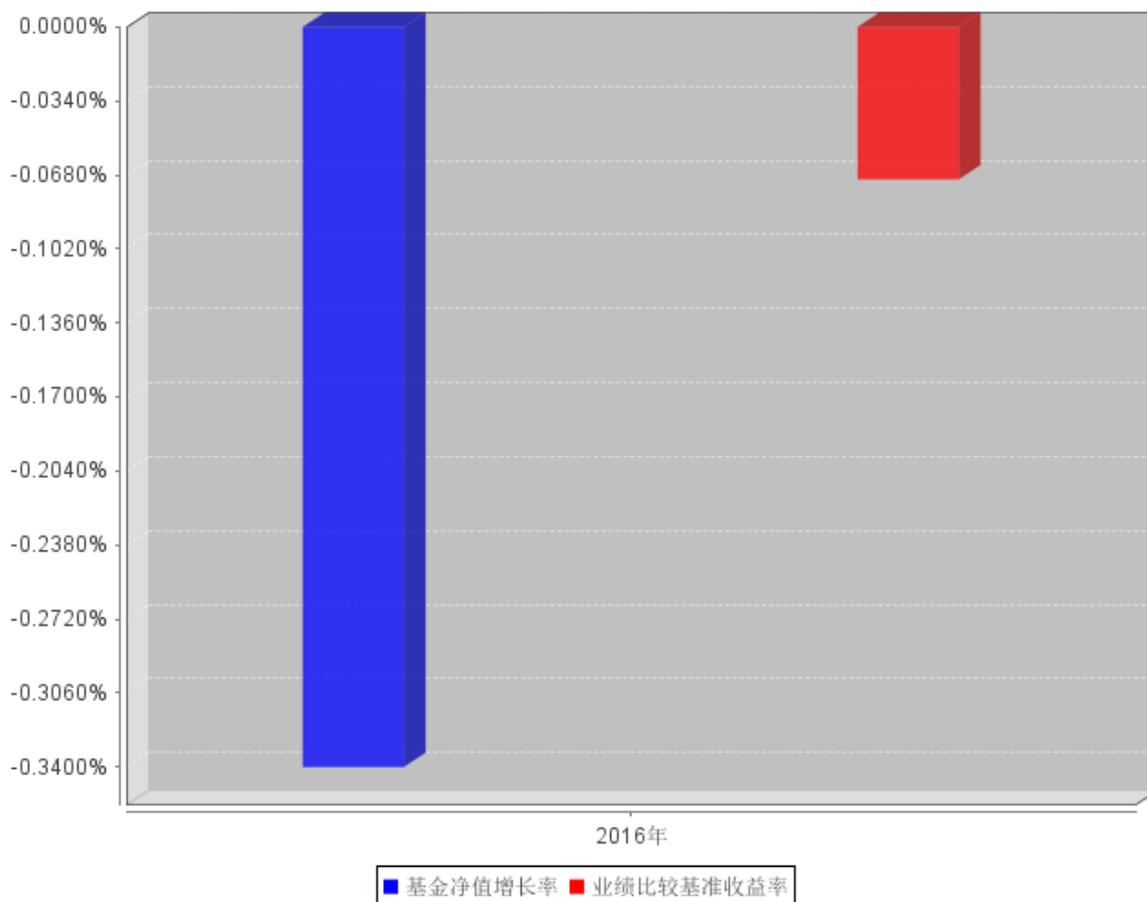


注：1. 本基金合同于 2016 年 9 月 26 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2. 根据基金合同的规定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

### 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

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对比图



注：本基金合同于 2016 年 9 月 26 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

本基金基金合同生效日为 2016 年 9 月 26 日，截至本报告期末本基金成立未满一年，本基金于 2016 年度未进行利润分配。

## § 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		
吴祖尧	基金经理	2016 年 9 月 26 日	-	21	清华大学铸造专业硕士，中国籍，21 年金融证券从业经验，具有基金从业资格。历任中国信达信托投资公司证券研究部副经理，中国银河证券研究中心研究主管、董事总经理，中国银河证券投行内核小组成员，中国银河证券投资顾问部董事总经理，中国银河证券投资决策委员会委员。2014 年 7 月加入九泰基金管理有限公司现任总裁助理，九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金（2015 年 12 月 9 日至今）、九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金（2016 年 9 月 26 日至今）的基金经理。
徐占杰	基金经理	2016 年 9 月 26 日	-	7	南开大学世界经济硕士，CFA、FRM，7 年证券研究投资经验，中国籍，具有基金从业资格。历任华泰证券首席交运行业研究员、湘财证券首席电子行业研究员、中国华电集团资本控股公司高级投资项目经理。2015 年加入九泰基金，现任战略投资部定增团队负责人，九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金（2016 年 9 月 26 日至今）的基金经理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、

研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度的规定。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价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

九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金是以 A 股非公开发行股票为主要投资标的的公募基金，并有可能择机建立部分二级市场仓位。

自 2016 年 9 月份成立以来，基金参与投资了多只一年期定增项目，并拟参与几只三年期定增项目，择机配置了一些新能源、通信、军工、混改、PPP、油气等领域的标的。总的来说，目前基金仓位不高，标的占比较为分散，仍处于风险防范的阶段。

定增投资与二级市场投资既有类似也有区别，类似在于都需要注重基本面、估值预期，区别

在于定增投资标的可选范围较窄，盈利和自由现金流稳定的公司定增需求较少，时间窗口窄，难以做价值投资和逆向投资，同时定增市场资金供过于求、标的被过度研究和追捧的现象较为明显，因此投资难度较大。但是综合折价率和投资时点因素考虑，我们也可以发掘一些投资机会。另外，基于定增投资的特点，我们在配置上以较长的周期来审视行业变革，布局有较远大前景和革命性变化的行业和公司（由于供需变化或行业变革，这些行业或公司在未来一到三年可能会出现 ROIC 的提升），从而为持有人创造较好的阿尔法收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末本基金份额净值为 0.9966 元；本报告期本基金份额净值增长率为-0.34%，同期业绩比较基准收益率为-0.07%。

#### 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，宏观环境将较为复杂，国内外经济都面临经济复苏和扩张货币政策退出所带来的震荡格局，A 股市场整体仍然不够便宜，风险因素较多。未来，泰富基金经理仍将秉承谨慎投资和防风险理念，更加注重择时和择股，投资于定向增发和二级市场性价比较高的标的，重点布局通信、军工、消费、PPP、石油天然气以及其他领域的投资机会，努力为基金持有人创造较稳健的投资回报。

#### 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十七部分中对基金利润分配原则的约定，本基金 2016 年度未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为-1,151,526.53 元，其中：未分配利润已实现部分为 17,238.68 元，未分配利润未实现部分为-1,168,765.21 元。

#### **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，招商证券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，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。

## 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(17)第 P00397 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	九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金全体持有人：
引言段	我们审计了后附的九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 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泰富定增主题灵活配置混合型证券投资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	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。  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

	<p>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	<p>我们认为，九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资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，公允反映了九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
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：九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	48,263,083.22
结算备付金		7,773,181.82
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	79,355,902.54
其中：股票投资		79,355,902.54
基金投资		-
债券投资		-
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	170,000,000.00
应收证券清算款		29,773,522.58
应收利息	7.4.7.5	57,928.83
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		335,223,618.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
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		568,331.76
应付托管费		71,041.46
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	6,491.46
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	100,000.00
负债合计		745,864.68
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	335,629,280.84
未分配利润	7.4.7.10	-1,151,526.53
所有者权益合计		334,477,754.31
负债和所有者权益总计		335,223,618.99

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.9966 元，基金份额总额为 335,629,280.84 份。

2、本基金合同生效日为 2016 年 9 月 26 日，本会计期间为 2016 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

## 7.2 利润表

会计主体：九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年9月26日(基金合同 生效日)至2016年12月31 日
<b>一、收入</b>		935,912.97
1. 利息收入		2,104,678.18
其中：存款利息收入	7.4.7.11	567,500.37
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		1,537,177.81
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
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	-
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	-1,168,765.21
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	-
<b>减：二、费用</b>		2,087,439.50
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,760,293.19
2. 托管费	7.4.10.2.2	220,036.63
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	7,109.68
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	100,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,151,526.53
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,151,526.53

注：本基金合同生效日为2016年9月26日，本会计期间为2016年9月26日（基金合同生效日）至2016年12月31日止。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)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）	335,629,280.84	-	335,629,280.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,151,526.53	-1,151,526.53
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	335,629,280.84	-1,151,526.53	334,477,754.31

注：本基金合同生效日为 2016 年 9 月 26 日，本会计期间为 2016 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 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

九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金(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[2016]1567 号文《关于准予九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起，于 2016 年 8 月 22 日至 2016 年 9 月 20 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 335,539,034.39 元，在募集期间产生的结转为份额的利息为人民币 90,246.45 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 335,629,280.84 元，折合 335,629,280.84 份基金份额。上述募集资金已

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 2016 年 9 月 26 日生效。本基金的基金管理人为九泰基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，权证，股指期货，货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×60%+中债总指数（总值）财富指数收益率×40%。

#### 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 日的财务状况以及 2016 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 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。本会计期间为 2016 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 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

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

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、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金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。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

金融负债应当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两类。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

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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债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收到的全部股利和利息计入相关损益。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

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(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(可转换债券和资产支持证券除外), 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。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时, 申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、

红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认，于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面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) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；
- (4) 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；
- (5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (6) 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；
- (7) 资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认；
- (8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；
- (9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
- (10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (11) 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。

#### 7.4.4.10 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 2.0%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 0.25%的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提；
- (4) 交易费用发生时按照确定的金额计入费用；

(5)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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体方案公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式：基金合同生效后前五年内的收益分配方式为现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)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

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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；
- (4) 对基金所持上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；
- (5) 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；
- (6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

#### 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
活期存款	48,263,083.22
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	48,263,083.22

##### 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		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	80,524,667.75	79,355,902.54	-1,168,765.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	80,524,667.75	79,355,902.54	-1,168,765.21

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末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	170,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	-	-
合计	170,000,000.00	-

##### 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
应收活期存款利息	16,052.79
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,497.90
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	38,378.14
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	57,928.83

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 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
交易所市场应付交易费用	6,491.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,491.46

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提信息披露费	50,000.00
预提审计费	50,000.00
合计	100,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	335,629,280.84	335,629,280.84
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	335,629,280.84	335,629,280.84

注：本基金于 2016 年 8 月 22 日起至 2016 年 9 月 20 日向社会公开募集，截至 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)止，募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 335,539,034.39 元，在募集期间产生的结转为份额的利息为人民币 90,246.45 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 335,629,280.84 元，折合 335,629,280.84 份基金份额。

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	17,238.68	-1,168,765.21	-1,151,526.53
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	-	-	-
本期末	17,238.68	-1,168,765.21	-1,151,526.53

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月 31日
活期存款利息收入	552,015.46
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	15,484.91
其他	-
合计	567,500.37

**7.4.7.12 股票投资收益**

本基金于2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日止会计期间无股票投资收益。

**7.4.7.13 债券投资收益**

本基金于2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日止会计期间无债券投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金于2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日止会计期间无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

本基金于2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日止会计期间无股利收益。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年9月26日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,168,765.21
——股票投资	-1,168,765.21
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,168,765.21

**7.4.7.17 其他收入**

本基金于 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止会计期间无其他收入。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月 31日
交易所市场交易费用	7,109.68
银行间市场交易费用	-
合计	7,109.68

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12 月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	50,000.00
合计	100,000.00

## 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、基金销售机构
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
九州证券股份有限公司	基金管理人的股东
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

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

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券股份有限公司	6,970,281.00	100.00%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例

招商证券股份有限公司	4,867,600,000.00	100.00%
------------	------------------	---------

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金于 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止会计期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券股份 有限公司	6,491.46	100.00%	6,491.46	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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9月26日(基金合同生效日)至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,760,293.19
其中：支付销售机构的客户维护费	490,230.65

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 2.0% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 2.0\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

**7.4.10.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费	220,036.63	

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

**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**

本基金于 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止会计期间无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**

本基金的基金管理人于 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止会计期间未运用固有资金投资本基金。

**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**

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

**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9月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	48,263,083.22	552,015.46

注：本基金的银行存款存放在由具有基金托管资格的招商证券股份有限公司在交通银行股份有限公司开立的银行账户内，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止会计期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于 2016 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止会计期间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——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000901	航天科技	2016 年 11 月 17 日	2017 年 11 月 20 日	非公开发行流通受限	30.72	31.00	550,000	16,896,000.00	17,050,000.00	-
603799	华友钴业	2016 年 12 月 23 日	2017 年 12 月 21 日	非公开发行流通受限	31.86	31.94	533,584	16,999,986.24	17,042,672.96	-
002310	东方园林	2016 年 11 月 10 日	2017 年 11 月 13 日	非公开发行流通受限	13.94	13.97	717,360	9,999,998.40	10,021,519.20	-
000065	北方国际	2016 年 12 月 27 日	2017 年 12 月 28 日	非公开发行流通受限	25.20	25.23	396,825	9,999,990.00	10,011,894.75	-
300213	佳讯飞鸿	2016 年 11 月 1 日	2017 年 11 月 2 日	非公开发行流通受限	25.70	26.11	375,814	9,658,419.80	9,812,503.54	-
000555	神州信息	2016 年 12 月 28 日	2017 年 12 月 29 日	非公开发行流通受限	25.57	21.23	391,083	9,999,992.31	8,302,692.09	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

2、截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

#### **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**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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。

#### **7.4.12.4 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险与预期收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，属于中高风险收益特征的证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资、资产支持证券投资及股指期货投资等。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有效控制组合风险的前提下，力争为投资者获取长期稳健的投资回报。

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、风控法务部和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。

#### 7.4.12.5 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商证券股份有限公司在交通银行股份有限公司开立的账户内，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。

##### 7.4.12.5.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.12.5.2 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.12.6 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在基金转为开放式基金后的所有开放日，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通过独立的风控法务部门设定流动性比例要求，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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时

变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 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。

#### 7.4.12.6.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.12.7 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。

##### 7.4.12.7.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及买入返售金融资产等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 7.4.12.7.1.1 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	48,263,083.22	-	-	-	-	-	48,263,083.22
结算备付金	7,773,181.82	-	-	-	-	-	7,773,181.82
交易性金融资产	-	-	-	-	-	79,355,902.54	79,355,902.54
买入返售金融资产	170,000,000.00	-	-	-	-	-	170,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	29,773,522.58	29,773,522.58
应收利息	-	-	-	-	-	57,928.83	57,928.83
资产总计	226,036,265.04	-	-	-	-	109,187,353.95	335,223,618.99
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	568,331.76	568,331.76
应付托管费	-	-	-	-	-	71,041.46	71,041.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,491.46	6,491.46

其他负债	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	745,864.68	745,864.68
利率敏感度缺口	226,036,265.04	-	-	-	-108,441,489.27	334,477,754.31

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。

#### 7.4.12.7.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有债券，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.12.7.2 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。

#### 7.4.12.7.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持与的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.12.7.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	79,355,902.54	23.73
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	79,355,902.54	23.73

##### 7.4.12.7.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	5,961,894.89
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-5,961,894.89

#### 7.4.12.7.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.13 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和其他金融负债，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属于第一层次的余额为 7,114,620 元，属于第二层次的余额为 72,241,282.54 元，无属于第三层次的余额。

本基金持有的第一层次及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

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。2016 年本基金按公允价值计量的金融工具在第一层和第二层之间无重大转移。

##### (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	权益投资	79,355,902.54	23.67
	其中：股票	79,355,902.54	23.67
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	170,000,000.00	50.71
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	56,036,265.04	16.72
7	其他各项资产	29,831,451.41	8.90
8	合计	335,223,618.99	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	43,905,176.50	13.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	27,148,033.95	8.12
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,302,692.09	2.48

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	79,355,902.54	23.73

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002310	东方园林	1,220,160	17,136,139.20	5.12
2	000901	航天科技	550,000	17,050,000.00	5.10
3	603799	华友钴业	533,584	17,042,672.96	5.10
4	000065	北方国际	396,825	10,011,894.75	2.99
5	300213	佳讯飞鸿	375,814	9,812,503.54	2.93
6	000555	神州信息	391,083	8,302,692.09	2.48

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	603799	华友钴业	16,999,986.24	5.08
2	002310	东方园林	16,970,279.40	5.07
3	000901	航天科技	16,896,000.00	5.05

4	000555	神州信息	9,999,992.31	2.99
5	000065	北方国际	9,999,990.00	2.99
6	300213	佳讯飞鸿	9,658,419.80	2.89

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期间未卖出股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	80,524,667.75
卖出股票收入（成交）总额	-

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 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	29,773,522.58
3	应收股利	-
4	应收利息	57,928.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,831,451.41

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	-----------	----------	----------

			价值	例 (%)	
1	000901	航天科技	17,050,000.00	5.10	非公开发行股票流通受限
2	603799	华友钴业	17,042,672.96	5.10	非公开发行股票流通受限
3	002310	东方园林	10,021,519.20	3.00	非公开发行股票流通受限
4	000065	北方国际	10,011,894.75	2.99	非公开发行股票流通受限
5	300213	佳讯飞鸿	9,812,503.54	2.93	非公开发行股票流通受限
6	000555	神州信息	8,302,692.09	2.48	非公开发行股票流通受限

### 8.12.6 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

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
4,424	75,865.57	4,119,500.00	1.23%	331,509,780.84	98.77%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金在 2016 年 12 月 31 日未上市交易。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年9月26日）基金份额总额	335,629,280.84
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	335,629,280.84

## § 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。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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 50,000.00 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	
招商证券	2	6,970,281.00	100.00%	6,491.46	100.00%	-

### 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
招商证券	-	-	4,867,600,000.00	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

新增招商证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个。

#### (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况

无。

## 11.8 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	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	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 26 日

	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		
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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

16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 14 日

	他从业人员在子公司兼职情况的公告		
26	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
27	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
28	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动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年5月19日
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	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	证监会指定报刊和公司网站	2016年6月23日

	销售机构并参与费率优惠活动的公告		
35	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
36	九泰基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年6月23日
37	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28日
38	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
39	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
40	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
41	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
42	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
43	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
44	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
45	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

46	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
47	关于增加平安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8月4日
48	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
49	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
50	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
51	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
52	关于九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金开展认购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17日
53	九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年8月17日
54	九泰基金管理有限公司关于九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资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8月18日
55	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
56	九泰基金管理有限公司关于九泰泰富定增主题灵活配置混合型证	证监会指定报刊和公司网站	2016年8月19日

	券投资基金增加销售机构的公告		
57	九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金份额上网发售提示性公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年8月22日
58	九泰基金管理有限公司关于九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券	证监会指定报刊和公司网站	2016年8月23日
59	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
60	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
61	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
62	九泰基金管理有限公司关于九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资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9月7日
63	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
64	九泰基金管理有限公司关于九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资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9月12日
65	关于增加北京电盈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9月13日
66	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

67	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
68	九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 9 月 27 日
69	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
70	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
71	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
72	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
73	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
74	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
75	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机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 11 月 10 日
76	关于九泰基金管理有限公司系统	公司网站	2016 年 11 月 15 日

	维护暂停相关服务的公告		
77	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
78	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
79	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
80	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
81	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
82	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
83	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
84	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
85	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
86	关于九泰基金管理有限公司系统	公司网站	2016 年 12 月 21 日

	维护暂停相关服务的公告		
87	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
88	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
89	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
90	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
91	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

报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 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泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资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](http://www.jtamc.com)。

九泰基金管理有限公司  
2017年3月29日