

九泰天宝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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
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	56

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	56
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	56
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12	投资组合报告附注	57
§9	基金份额持有人信息	58
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
§10	开放式基金份额变动	59
§11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4	基金投资策略的改变	60
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8	其他重大事件	61
§12	影响投资者决策的其他重要信息	69
§13	备查文件目录	69
13.1	备查文件目录	69
13.2	存放地点	69
13.3	查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	九泰天宝灵活配置混合	
基金主代码	000892	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 23 日	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	803, 154, 353. 39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C
下属分级基金的交易代码:	000892	002028
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 617, 369. 73 份	801, 536, 983. 66 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理，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。
投资策略	本基金重点关注在中国经济结构优化、产业结构升级或技术创新过程中成长性确定且估值合理的上市公司、价值被严重低估的传统行业的上市公司，以及上市公司事件驱动带来的投资机会。通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析进行大类资产配置；通过定性分析方法和定量分析方法相结合的策略进行股票投资；通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势进行债券投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×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，属于较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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢海波	林葛
	联系电话	010-52601690	010-66060069
	电子邮箱	xiehaibo@jtamc.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-628-0606	95599
传真		010-66067330	010-68121816
注册地址		北京市丰台区丽泽路 18 号	北京市东城区建国门内大街 69

	院 1 号楼 801-16 室	号
办公地址	北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦西区 6 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	卢伟忠	周慕冰

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《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jtamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年		2015 年 7 月 23 日 (基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C
本期已实现收益	103,569.75	72,137,739.71	842,317.91	369,635.89
本期利润	83,053.51	64,037,812.27	856,006.05	4,603,670.70
加权平均基金份额本期利润	0.0387	0.0343	0.0153	0.0021
本期加权平均净值利润率	3.63%	3.25%	1.52%	0.20%

本期基金份额净值增长率	3.84%	2.78%	4.30%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
期末可供分配利润	133,673.85	57,698,730.08	303,511.56	101,965,692.98
期末可供分配基金份额利润	0.0826	0.0720	0.0414	0.0410
期末基金资产净值	1,751,043.58	859,235,713.74	7,643,508.57	2,594,603,670.70
期末基金份额净值	1.083	1.072	1.043	1.043
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末	
基金份额累计净值增长率	8.30%	2.88%	4.30%	0.10%

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。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

4、本基金基金合同生效日为 2015 年 7 月 23 日，合同生效当前的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

九泰天宝混合 A

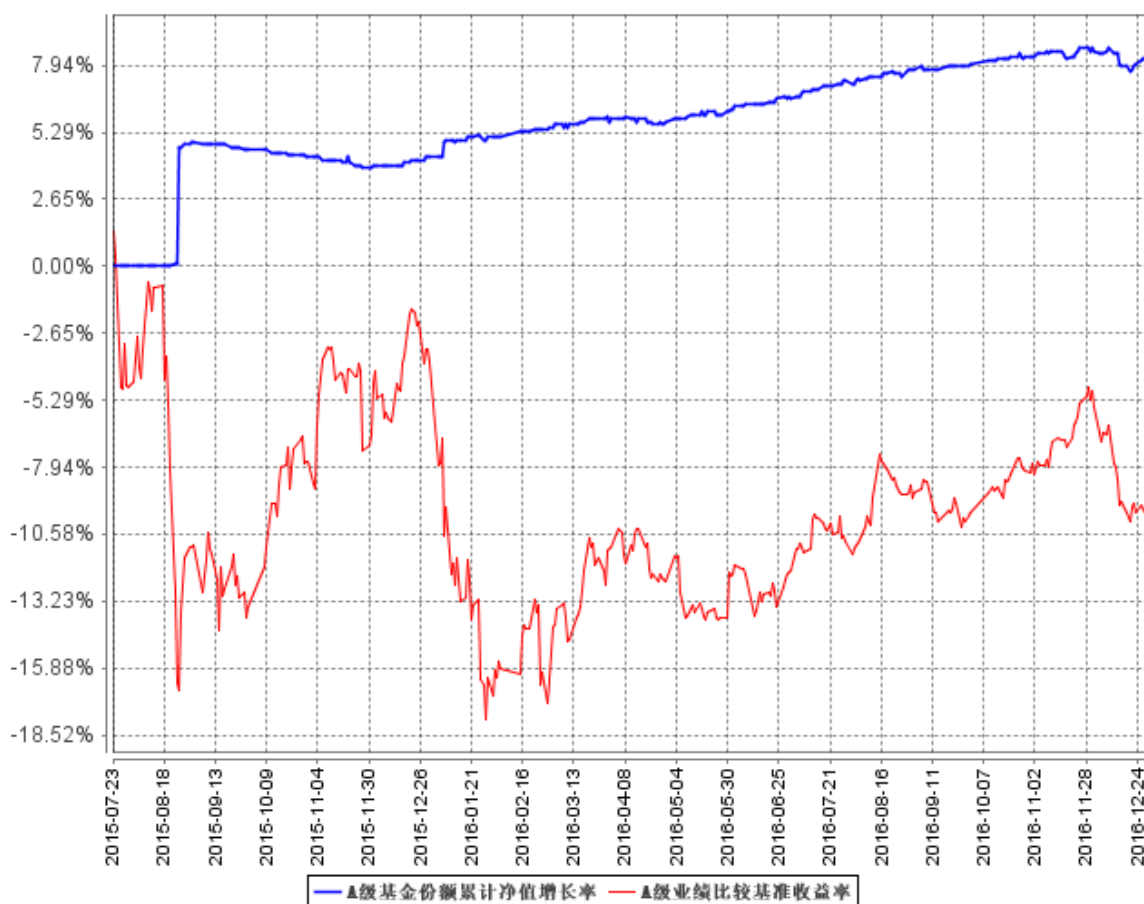
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.28%	0.09%	0.29%	0.46%	-0.01%	-0.37%
过去六个月	1.50%	0.07%	3.00%	0.47%	-1.50%	-0.40%
过去一年	3.84%	0.08%	-5.90%	0.84%	9.74%	-0.76%
自基金合同生效起至今	8.30%	0.25%	-9.45%	1.08%	17.75%	-0.83%

九泰天宝混合 C

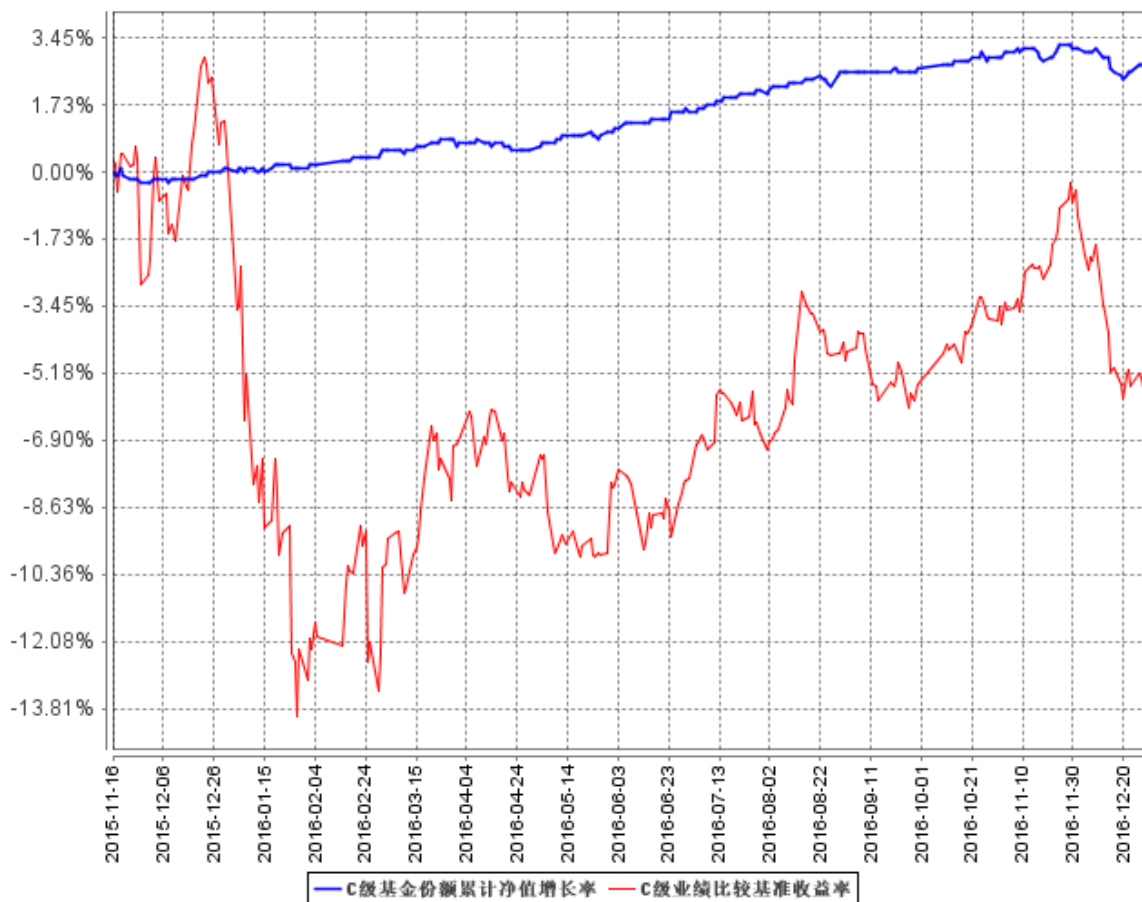
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.19%	0.08%	0.29%	0.46%	-0.10%	-0.38%
过去六个月	1.23%	0.07%	3.00%	0.47%	-1.77%	-0.40%
过去一年	2.78%	0.07%	-5.90%	0.84%	8.68%	-0.77%
自基金合同生效起至今	2.88%	0.07%	-5.18%	0.86%	8.06%	-0.79%

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

A级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



C级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

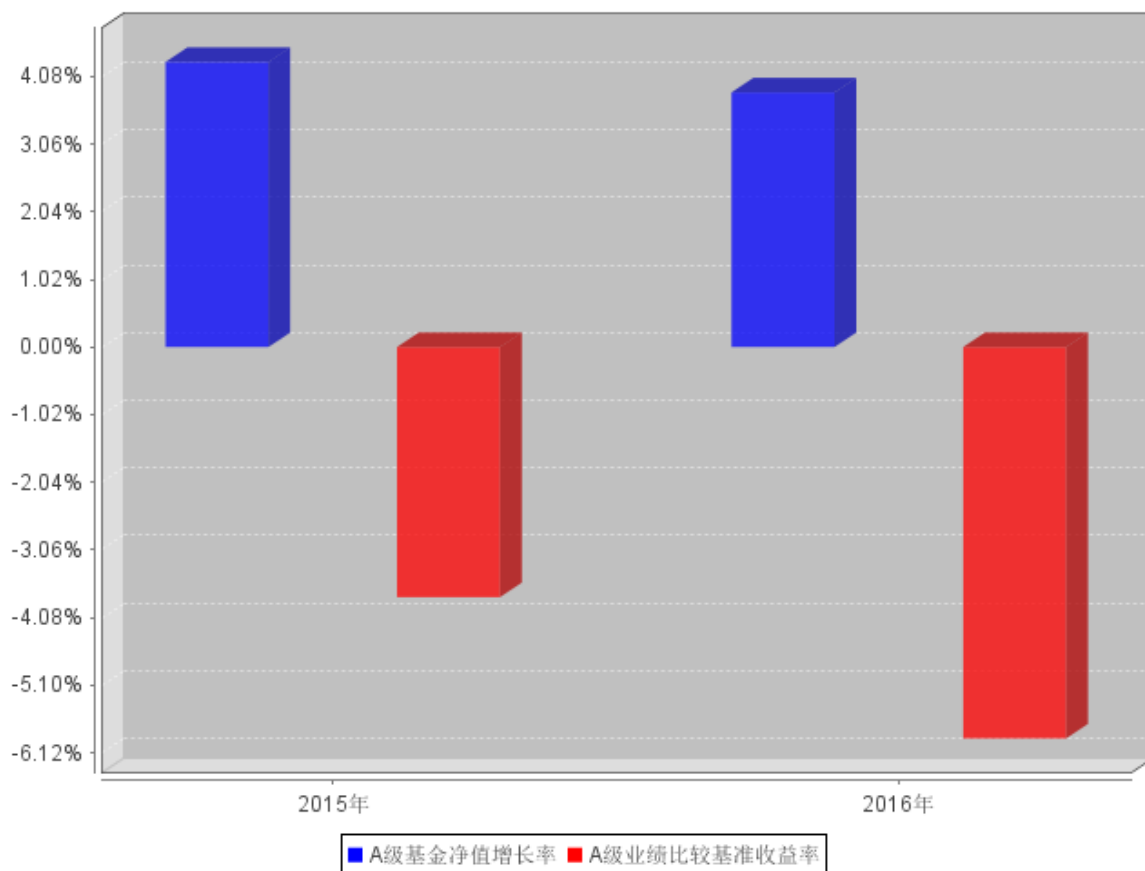


注：1. 本基金合同于 2015 年 7 月 23 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束不满一年。

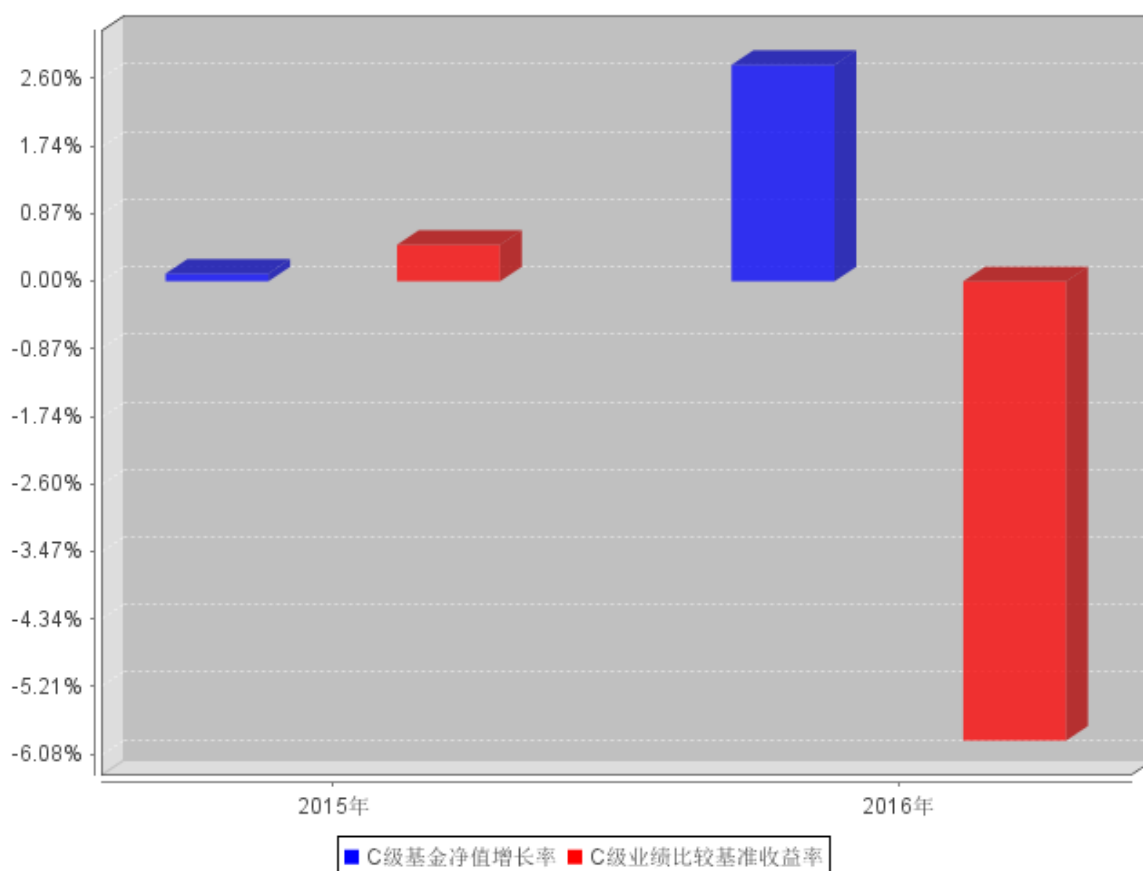
2. 根据基金合同的规定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求。本基金建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

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

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



C级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：合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015年7月23日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 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		
王玥晰	基金经理	2015 年 8 月 3 日	-	8	理学硕士，中国籍，具有基金从业资格，8 年证券从业经验。历任诺安基金管理有限公司债券交易员，诺安基金管理有限公司基金经理助理，诺安货币市场基金 A/B 基金经理（2013 年 7 月至 2015 年 1 月）。2015 年 4 月加入九泰基金管理有限公司，现任九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（2015 年 8 月 3 日至今）、九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金（2015 年 11 月 10 日至今），九泰日添金货币市场基金（2015 年 12 月 8 日至今）、九泰久稳保本混合型证券投资基金（2016 年 4 月 22 日至今）、九泰久利灵活配置混合型证券投资基金（2016 年 11 月 7 日至今）、九泰久鑫债券型证券投资基金（2016 年 12 月 19 日）的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年，供给侧改革是国内宏观经济的主线。在基建和地产的拉动下，经济逐步企稳；供给收缩叠加需求回暖，年末通胀预期再起。在汇率压力和防资产泡沫的背景下，货币政策逐步收紧。在负债端成本上行的压力下，债券市场终迎来调整，息差收益被大幅挤压，收益率明显上行。九泰天宝以做绝对收益的思路，分析各大类资产的风险收益水平，进行组合配置。积极参与新股申购，辅以货币市场工具的操作。报告期内，九泰天宝的流动性没有出现异常，满足了投资者正常的申购及赎回要求。九泰天宝把保证资产的安全性放在首位，在参考外部评级的基础上，进行严谨的内部评级筛选，严格把控信用风险。产品在报告期内取得正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 1.083 元，本报告期基金份额净值 A 类增长率为 3.84%，

业绩比较基准收益率为-5.90%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.072 元，本报告期基金份额净值 C 类增长率为 2.78%，业绩比较基准收益率为-5.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

行。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六条中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 57,832,403.93 元，其中：九泰天宝混合 A 期末可供分配利润为 133,673.85 元（九泰天宝混合 A 的未分配利润已实现部分为 146,141.98 元，未分配利润未实现部分为-12,468.13 元）；九泰天宝混合 C 期末可供分配利润为 57,698,730.08 元（九泰天宝混合 C 的未分配利润已实现部分为 63,817,373.42 元，未分配利润未实现部分为-6,118,643.34 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

本基金在 2016 年 1 月 4 日至 3 月 31 日连续 59 个交易日，2016 年 10 月 11 日至 12 月 2 日连续 39 个交易日，分别出现持有人低于 200 人的情形，基金管理人已通过持续营销等方式解决；本报告期内未出现基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—九泰基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，九泰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份

额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，九泰基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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 P00389 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	九泰天宝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天宝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 年度利润表、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天宝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。 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。	
审计意见段	我们认为，九泰天宝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，公允反映了九泰天宝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 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	文启斯	杨丽
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国·上海	
审计报告日期	2017 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：九泰天宝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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,975,668.37	371,058,664.34
结算备付金		743,277.76	29,493,522.59
存出保证金		185,425.84	401,095.03
交易性金融资产	7.4.7.2	1,140,214,360.34	41,664,725.30
其中：股票投资		64,963,790.34	38,986,723.50
基金投资		-	-
债券投资		1,075,250,570.00	2,678,001.80
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	-	1,670,403,915.50
应收证券清算款		-	491,074,922.90
应收利息	7.4.7.5	17,234,981.04	1,590,016.46
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		1,162,353,713.35	2,605,686,862.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		300,031,149.95	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,010.55	61,576.39
应付管理人报酬		583,356.20	1,764,081.75
应付托管费		109,379.29	330,765.33
应付销售服务费		145,529.63	439,697.66
应付交易费用	7.4.7.7	50,341.12	683,407.01
应交税费		-	-
应付利息		66,185.48	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	380,003.81	160,154.71
负债合计		301,366,956.03	3,439,682.85
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	803,154,353.39	2,495,402,002.98
未分配利润	7.4.7.10	57,832,403.93	106,845,176.29
所有者权益合计		860,986,757.32	2,602,247,179.27
负债和所有者权益总计		1,162,353,713.35	2,605,686,862.12

注 1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，九泰天宝混合 A 份额净值为人民币 1.083 元，九泰天宝混合 C 份额净值为人民币 1.072 元；基金份额总额为 803,154,353.39 份，九泰天宝混合 A 份额 1,617,369.73 份，九泰天宝混合 C 份额 801,536,983.66 份。

2、本基金合同生效日为 2015 年 7 月 23 日，上年度可比期间为 2015 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基 金合同生效日)至2015

			年 12 月 31 日
一、收入		90,125,262.16	10,068,088.76
1.利息收入		75,162,107.93	4,423,153.44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	745,398.11	1,269,875.28
债券利息收入		68,175,549.75	1,665.04
资产支持证券利息收入		338,858.08	-
买入返售金融资产收入		5,902,301.99	3,151,613.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		23,069,158.24	611,205.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	18,537,482.66	611,205.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,631,289.59	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-23,863.56	-
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	924,249.55	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-8,120,443.68	4,247,722.95
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	14,439.67	786,006.84
减：二、费用		26,004,396.38	4,608,412.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	15,820,622.20	2,364,799.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,966,366.59	443,215.52
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,950,541.34	543,891.90
4. 交易费用	7.4.7.18	164,005.64	1,075,379.23
5. 利息支出		2,584,740.35	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,584,740.35	-
6. 其他费用	7.4.7.19	518,120.26	181,126.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		64,120,865.78	5,459,676.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		64,120,865.78	5,459,676.75

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 7 月 23 日，2015 年度实际报告期间为 2015 年 7 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,495,402,002.98	106,845,176.29	2,602,247,179.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	64,120,865.78	64,120,865.78
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）	-1,692,247,649.59	-113,133,638.14	-1,805,381,287.73
其中：1. 基金申购款	456,711.85	30,044.96	486,756.81
2. 基金赎回款	-1,692,704,361.44	-113,163,683.10	-1,805,868,044.54
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）	803,154,353.39	57,832,403.93	860,986,757.32
项目	上年度可比期间 2015年7月23日（基金合同生效日）至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	215,255,863.06	-	215,255,863.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,459,676.75	5,459,676.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,280,146,139.92	101,385,499.54	2,381,531,639.46
其中：1. 基金申购款	2,488,856,261.96	101,928,809.72	2,590,785,071.68
2. 基金赎回款	-208,710,122.04	-543,310.18	-209,253,432.22
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）	2,495,402,002.98	106,845,176.29	2,602,247,179.27
-----------------	------------------	----------------	------------------

注：本基金合同生效日为 2015 年 7 月 23 日，上年度可比期间为 2015 年 7 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>卢伟忠</u>	<u>严军</u>	<u>荣静</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人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》、《九泰天宝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”）及其他有关法律法规的规定，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 2014[1135] 号文注册并公开发行。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 215,255,863.06 份，经北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）验证。《九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 23 日正式生效。本基金的基金管理人和注册登记机构均为九泰基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同及《九泰天宝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（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、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，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%+中国债券总指数收益率×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 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。上年度可比期间为 2015 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

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、资产支持证券和中小企业私募债券除外)，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”。

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 0.8%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 0.15%的年费率逐日计提;

(3) 根据基金合同,本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提;

(4) 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;

(5) 交易费用发生时按照确定的金额计入费用;

(6) 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) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 6 次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%,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分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于 A 类基金份额不收取而 C 类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同;本基金同一类别的每份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	上年度末 2015年12月31日
活期存款	3,975,668.37	131,058,664.34
定期存款	-	240,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	-	240,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	3,975,668.37	371,058,664.34

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	65,953,071.67	64,963,790.34	-989,281.33	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	137,143,547.64	134,957,570.00	-2,185,977.64
	银行间市场	940,990,461.76	940,293,000.00	-697,461.76
	合计	1,078,134,009.40	1,075,250,570.00	-2,883,439.40
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,144,087,081.07	1,140,214,360.34	-3,872,720.73	
项目	上年度末 2015年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	35,000,002.35	38,986,723.50	3,986,721.15	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,417,000.00	2,678,001.80	261,001.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,417,000.00	2,678,001.80	261,001.80
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	37,417,002.35	41,664,725.30	4,247,722.95	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券_交易所	-	-
买入返售证券_银行间	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券_交易所	633,400,000.00	-
买入返售证券_银行间	1,037,003,915.50	-
合计	1,670,403,915.50	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	946.39	137,964.51
应收定期存款利息	-	65,444.42
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	334.40	13,272.10
应收债券利息	17,233,616.75	1,665.04
应收买入返售证券利息	-	1,371,489.89
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	83.50	180.50
合计	17,234,981.04	1,590,016.46

注：其他指应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	32,006.57	668,551.67
银行间市场应付交易费用	18,334.55	14,855.34
合计	50,341.12	683,407.01

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3.81	154.71
预提审计费	80,000.00	40,000.00
预提信息披露费	300,000.00	120,000.00
合计	380,003.81	160,154.71

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

九泰天宝混合 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	7,326,557.78	7,326,557.78
本期申购	456,711.85	456,711.85
本期赎回(以“-”号填列)	-6,165,899.90	-6,165,899.90
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,617,369.73	1,617,369.73

金额单位：人民币元

九泰天宝混合 C	
项目	本期

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,488,075,445.20	2,488,075,445.20
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,686,538,461.54	-1,686,538,461.54
- 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	801,536,983.66	801,536,983.66

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

九泰天宝混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	303,511.56	13,439.23	316,950.79
本期利润	103,569.75	-20,516.24	83,053.51
本期基金份额交易产生的变动数	-260,939.33	-5,391.12	-266,330.45
其中：基金申购款	30,378.72	-333.76	30,044.96
基金赎回款	-291,318.05	-5,057.36	-296,375.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	146,141.98	-12,468.13	133,673.85

单位：人民币元

九泰天宝混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	101,965,692.98	4,562,532.52	106,528,225.50
本期利润	72,137,739.71	-8,099,927.44	64,037,812.27
本期基金份额交易产生的变动数	-110,286,059.27	-2,581,248.42	-112,867,307.69
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-110,286,059.27	-2,581,248.42	-112,867,307.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,817,373.42	-6,118,643.34	57,698,730.08

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 7 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	228,450.52	746,727.93
定期存款利息收入	348,430.58	366,060.92
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	161,851.82	40,012.95
其他	6,665.19	117,073.48
合计	745,398.11	1,269,875.28

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入和上交所利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基金 合同生效日)至2015年12月 31日
卖出股票成交总额	28,566,436.29	343,147,834.43
减：卖出股票成本总额	10,028,953.63	342,536,628.90
买卖股票差价收入	18,537,482.66	611,205.53

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基金合 同生效日)至2015年12月31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	7,589,507,724.12	-
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	7,456,261,118.40	-
减：应收利息总额	129,615,316.13	-
买卖债券差价收入	3,631,289.59	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
卖出资产支持证券成交总 额	61,107,472.87	-
减：卖出资产支持证券成本 总额	60,258,367.66	-
减：应收利息总额	872,968.77	-
资产支持证券投资收益	-23,863.56	-

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	924,249.55	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	924,249.55	-

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1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-8,120,443.68	4,247,722.95
——股票投资	-4,976,002.48	3,986,721.15
——债券投资	-3,144,441.20	261,001.80
——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	-8,120,443.68	4,247,722.95

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	14,439.67	786,006.84
合计	14,439.67	786,006.84

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	114,150.64	1,075,379.23
银行间市场交易费用	49,855.00	-
合计	164,005.64	1,075,379.23

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
审计费用	110,000.00	40,000.00
信息披露费	300,000.00	120,000.00
银行费用	71,040.26	18,036.21
其他	900.00	-
帐户维护费	36,180.00	3,090.00
合计	518,120.26	181,126.21

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：2016年2月22日，九州证券有限公司变更名称为九州证券股份有限公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
九州证券股份有限 公司	54,465,529.57	83.51%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	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 成交总额的 比例
九州证券股份有限 公司	25,040,921.80	0.50%	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

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1月1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
九州证券股份有限 公司	50,725.70	83.51%	32,006.57	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同生效日)至2015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
九州证券股份有限 公司	-	-	-	-

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1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付 的管理费	15,820,622.20
其中：支付销售机构的客 户维护费	4,538.97	9,702.88

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.8%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% / \text{当年天数}$$

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 3 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、公休假等，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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,966,366.59	443,215.52

注：基金托管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 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	3,950,541.34	3,950,541.34
合计	-	3,950,541.34	3,950,541.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	543,891.90	543,891.90
合计	-	543,891.90	543,891.90

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提。计算方法

如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，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

单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行股份有限公司	-	99,855,206.85	-	-	200,000,000.00	10,984.93
上年度可比期间 2015 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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

份额单位：份

九泰天宝混合 C				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

九州证券股份有限公司	-	-	86,538,461.54	3.4800%
------------	---	---	---------------	---------

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年7月23日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	3,975,668.37	228,450.52	131,058,664.34	746,727.93

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需说明的其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-

002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-

注：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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000887	中鼎股份	2016年11月18日	重大事项停牌	25.94	2017年2月15日	23.99	27,000	676,742.03	700,380.00	-
002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项停牌	13.79	-	-	13,000	259,390.46	179,270.00	-
000697	炼石有色	2016年11月17日	重大事项停牌	23.51	-	-	6,571	174,858.00	154,484.21	-

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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 300,031,149.95 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
011698083	16 中建国际 SCP001	2017年1月3日	100.31	500,000	50,155,000.00
111610344	16 兴业	2017年1月	99.54	500,000	49,770,000.00

	CD344	3 日			
111610353	16 兴业 CD353	2017 年 1 月 3 日	99.54	500,000	49,770,000.00
041658044	16 中科资 产 CP001	2017 年 1 月 3 日	99.36	300,000	29,808,000.00
011698057	16 渝机电 SCP001	2017 年 1 月 3 日	100.13	300,000	30,039,000.00
011698110	16 粤广业 SCP003	2017 年 1 月 3 日	99.87	28,000	2,796,360.00
041651031	16 天安数 码 CP001	2017 年 1 月 3 日	99.83	300,000	29,949,000.00
041651009	16 富通 CP001	2017 年 1 月 3 日	100.56	300,000	30,168,000.00
041664035	16 黄山旅 游 CP001	2017 年 1 月 3 日	99.30	200,000	19,860,000.00
041658039	16 仙琚制 药 CP001	2017 年 1 月 3 日	99.68	200,000	19,936,000.00
041659035	16 武汉商 贸 CP001	2017 年 1 月 3 日	99.63	75,000	7,472,250.00
合计				3,203,000	319,723,610.00

注：本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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。

7.4.13 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，属于较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、权证投资及资产支持证券投资等。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。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	390,994,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	449,821,000.00	-
合计	840,815,000.00	-

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

2. 以上信用评级系根据第三方评估机构的债券评级报告确定。

3. 未评级的品种为超短期融资券和同业存单。

7.4.13.2.2 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	2,008,001.80
AAA 以下	184,777,570.00	670,000.00
未评级	-	-
合计	184,777,570.00	2,678,001.80

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，以上列示债券不包括国债、政策性金融债、央行票据。

2. 以上信用评级系根据第三方评估机构的债券评级报告确定。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，除卖出回购金融资产款余额中有 300,031,149.95 元将在 1 个月内到期且计息外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。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。

下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,975,668.37	-	-	-	-	-	3,975,668.37
结算备付金	743,277.76	-	-	-	-	-	743,277.76

存出保证金	185,425.84	-	-	-	-	-	185,425.84
交易性金融资产	90,471,000.00	290,682,000.00	637,151,370.00	56,946,200.00	-64,963,790.34	-	1,140,214,360.34
应收利息	-	-	-	-	-	-17,234,981.04	17,234,981.04
资产总计	95,375,371.97	290,682,000.00	637,151,370.00	56,946,200.00	-82,198,771.38	-	1,162,353,713.35
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	300,031,149.95	-	-	-	-	-	300,031,149.95
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,010.55	1,010.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	583,356.20	583,356.20
应付	-	-	-	-	-	109,379.29	109,379.29

托管费							
应付销售服务费						145,529.63	145,529.63
应付交易费用						50,341.12	50,341.12
应付利息						66,185.48	66,185.48
其他负债						380,003.81	380,003.81
负债总计	300,031,149.95					1,335,806.08	301,366,956.03
利率敏感度缺口	-204,655,777.98	290,682,000.00	637,151,370.00	56,946,200.00		-80,862,965.30	860,986,757.32
上年度末 2015 年 12 月 31	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

目							
资产							
银行存款	371,058,664.34	-	-	-	-	-	371,058,664.34
结算备付金	29,493,522.59	-	-	-	-	-	29,493,522.59
存出保证金	401,095.03	-	-	-	-	-	401,095.03
交易性金融资产	-	-	-2,008,001.80	670,000.00	38,986,723.50	-	41,664,725.30
买入返售金融资产	1,670,403,915.50	-	-	-	-	-	1,670,403,915.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-491,074,922.90	-	491,074,922.90
应收利息	-	-	-	-	-1,590,016.46	-	1,590,016.46
其他	-	-	-	-	-	-	-

资产							
资产总计	2,071,357,197.46	-	-	2,008,001.80	670,000.00	531,651,662.86	2,605,686,862.12
负债							
应付赎回款		-	-			61,576.39	61,576.39
应付管理人报酬		-	-			1,764,081.75	1,764,081.75
应付托管费		-	-			330,765.33	330,765.33
应付销售服务费		-	-			439,697.66	439,697.66
应付交易费用		-	-			683,407.01	683,407.01
其他负债		-	-			160,154.71	160,154.71
负债总计		-	-			3,439,682.85	3,439,682.85

计							
利率敏感度缺口	2,071,357,197.46	-	-2,008,001.80	670,000.00	528,211,980.01	2,602,247,179.27	

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	1. 市场利率上升 25个基点	-1,229,601.59	-34.32
2. 市场利率下降 25个基点	1,233,116.73	34.85	

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有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。

7.4.13.4.3.1 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		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	64,963,790.34	7.55	38,986,723.50	1.50
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,075,250,570.00	124.89	2,678,001.80	0.10
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	1,140,214,360.34	132.43	41,664,725.30	1.60

注：由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有交易性权益类金融资产占资产净值比例较低，其他价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项和其他金融负债，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 63,691,964.19 元，属于第二层次的余额为 1,076,522,396.15 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次级 38,939,123.50 元，第二层次级 2,725,601.80 元，无第三层次级的余

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证券，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证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证券的公允价值列入第一层次。

(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	64,963,790.34	5.59
	其中：股票	64,963,790.34	5.59
2	固定收益投资	1,075,250,570.00	92.51
	其中：债券	1,075,250,570.00	92.51
	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	-	-
	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	4,718,946.13	0.41
7	其他各项资产	17,420,406.88	1.50
8	合计	1,162,353,713.35	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	205,728.00	0.02

B	采矿业	4,069,629.21	0.47
C	制造业	31,096,129.22	3.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	742,415.00	0.09
E	建筑业	540,398.63	0.06
F	批发和零售业	1,397,896.46	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	402,144.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	236,838.00	0.03
J	金融业	24,789,804.52	2.88
K	房地产业	579,550.00	0.07
L	租赁和商务服务业	179,270.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	245,206.30	0.03
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	478,781.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	64,963,790.34	7.55

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	601328	交通银行	679,162	3,918,764.74	0.46
2	600016	民生银行	424,221	3,851,926.68	0.45
3	000651	格力电器	155,200	3,821,024.00	0.44
4	600028	中国石化	658,000	3,559,780.00	0.41
5	600036	招商银行	197,748	3,480,364.80	0.40
6	601398	工商银行	759,200	3,348,072.00	0.39

7	000858	五粮液	79,019	2,724,575.12	0.32
8	601166	兴业银行	143,200	2,311,248.00	0.27
9	002415	海康威视	86,750	2,065,517.50	0.24
10	600000	浦发银行	122,800	1,990,588.00	0.23
11	601988	中国银行	473,700	1,629,528.00	0.19
12	002304	洋河股份	22,798	1,609,538.80	0.19
13	600519	贵州茅台	4,500	1,503,675.00	0.17
14	000625	长安汽车	92,400	1,380,456.00	0.16
15	002142	宁波银行	76,300	1,269,632.00	0.15
16	000423	东阿阿胶	22,900	1,233,623.00	0.14
17	000895	双汇发展	58,888	1,232,525.84	0.14
18	002202	金风科技	71,100	1,216,521.00	0.14
19	601169	北京银行	109,220	1,065,987.20	0.12
20	000568	泸州老窖	30,400	1,003,200.00	0.12
21	000623	吉林敖东	31,406	973,271.94	0.11
22	002252	上海莱士	41,680	962,391.20	0.11
23	002236	大华股份	63,250	865,260.00	0.10
24	601818	光大银行	217,300	849,643.00	0.10
25	000630	铜陵有色	275,500	848,540.00	0.10
26	002450	康得新	37,773	721,842.03	0.08
27	002024	苏宁云商	61,800	707,610.00	0.08
28	000887	中鼎股份	27,000	700,380.00	0.08
29	000963	华东医药	9,578	690,286.46	0.08
30	600104	上汽集团	28,480	667,856.00	0.08
31	000538	云南白药	7,214	549,346.10	0.06
32	000581	威孚高科	24,400	547,536.00	0.06
33	002422	科伦药业	31,800	512,616.00	0.06
34	002038	双鹭药业	18,199	486,095.29	0.06
35	601939	建设银行	89,200	485,248.00	0.06
36	600015	华夏银行	44,426	482,022.10	0.06
37	000566	海南海药	36,200	460,102.00	0.05
38	002353	杰瑞股份	21,600	438,480.00	0.05
39	002146	荣盛发展	51,800	406,630.00	0.05
40	601006	大秦铁路	56,800	402,144.00	0.05
41	002250	联化科技	24,800	401,264.00	0.05
42	300072	三聚环保	8,267	382,679.43	0.04
43	601857	中国石油	44,700	355,365.00	0.04
44	600795	国电电力	105,700	335,069.00	0.04
45	002081	金螳螂	33,600	328,944.00	0.04

46	000413	东旭光电	27,000	304,020.00	0.04
47	600585	海螺水泥	17,700	300,192.00	0.03
48	600027	华电国际	56,200	278,190.00	0.03
49	300027	华谊兄弟	22,391	246,301.00	0.03
50	000826	启迪桑德	7,435	245,206.30	0.03
51	600660	福耀玻璃	12,900	240,327.00	0.03
52	000786	北新建材	22,900	235,641.00	0.03
53	600066	宇通客车	11,700	229,203.00	0.03
54	600352	浙江龙盛	24,200	222,882.00	0.03
55	000425	徐工机械	65,600	221,728.00	0.03
56	002385	大北农	29,700	210,870.00	0.02
57	000998	隆平高科	9,600	205,728.00	0.02
58	002400	省广股份	13,000	179,270.00	0.02
59	000656	金科股份	33,000	172,920.00	0.02
60	002030	达安基因	7,260	168,432.00	0.02
61	000778	新兴铸管	31,600	163,372.00	0.02
62	000726	鲁泰 A	12,200	156,282.00	0.02
63	000697	炼石有色	6,571	154,484.21	0.02
64	600398	海澜之家	13,700	147,823.00	0.02
65	300002	神州泰岳	15,200	140,448.00	0.02
66	000800	一汽轿车	12,200	132,614.00	0.02
67	300251	光线传媒	13,400	130,784.00	0.02
68	000883	湖北能源	28,200	129,156.00	0.02
69	300216	千山药机	3,800	128,934.00	0.01
70	002557	洽洽食品	8,000	128,480.00	0.01
71	600315	上海家化	4,700	127,417.00	0.01
72	002266	浙富控股	21,700	124,992.00	0.01
73	600252	中恒集团	24,700	113,126.00	0.01
74	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
75	002375	亚厦股份	9,700	102,626.00	0.01
76	300133	华策影视	8,960	101,696.00	0.01
77	600312	平高电气	6,200	96,844.00	0.01
78	300287	飞利信	8,100	96,390.00	0.01
79	002325	洪涛股份	11,640	93,236.40	0.01
80	600887	伊利股份	4,900	86,240.00	0.01
81	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
82	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
83	002805	丰元股份	971	48,676.23	0.01
84	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00

85	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
86	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
87	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
88	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
89	300591	万里马	2,396	7,355.72	0.00

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	3,120,474.00	0.12
2	600016	民生银行	2,373,258.00	0.09
3	601166	兴业银行	2,135,765.00	0.08
4	600036	招商银行	1,918,991.00	0.07
5	600000	浦发银行	1,704,455.40	0.07
6	000651	格力电器	1,672,355.00	0.06
7	000858	五粮液	1,629,595.66	0.06
8	002415	海康威视	1,341,512.00	0.05
9	600519	贵州茅台	1,269,159.00	0.05
10	601328	交通银行	1,220,996.00	0.05
11	000895	双汇发展	982,049.00	0.04
12	002304	洋河股份	963,060.90	0.04
13	601169	北京银行	901,493.00	0.03
14	000625	长安汽车	887,642.00	0.03
15	601398	工商银行	867,060.00	0.03
16	000423	东阿阿胶	789,419.00	0.03
17	002142	宁波银行	749,404.00	0.03
18	002202	金风科技	687,104.00	0.03
19	600919	江苏银行	630,410.88	0.02
20	601988	中国银行	629,604.00	0.02

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	3,815,731.40	0.15
2	603508	思维列控	1,631,378.50	0.06
3	600977	中国电影	1,446,375.63	0.06
4	600919	江苏银行	1,166,310.40	0.04
5	002781	奇信股份	1,084,320.00	0.04
6	603866	桃李面包	1,043,066.97	0.04
7	603999	读者传媒	1,036,206.00	0.04
8	601997	贵阳银行	860,567.50	0.03
9	601611	中国核建	839,756.94	0.03
10	300495	美尚生态	765,107.75	0.03
11	601966	玲珑轮胎	638,205.60	0.02
12	300494	盛天网络	587,399.76	0.02
13	002782	可立克	579,072.00	0.02
14	603778	乾景园林	496,230.00	0.02
15	002797	第一创业	490,253.40	0.02
16	002787	华源包装	415,456.50	0.02
17	603299	井神股份	411,557.49	0.02
18	601900	南方传媒	402,127.80	0.02
19	601127	小康股份	382,848.62	0.01
20	002780	三夫户外	370,864.00	0.01

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	41,029,622.95
卖出股票收入（成交）总额	28,566,436.29

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,658,000.00	5.77
	其中：政策性金融债	49,658,000.00	5.77

4	企业债券	134,957,570.00	15.67
5	企业短期融资券	721,703,000.00	83.82
6	中期票据	49,820,000.00	5.79
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	119,112,000.00	13.83
9	其他	-	-
10	合计	1,075,250,570.00	124.89

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	011698083	16 中建国际 SCP001	500,000	50,155,000.00	5.83
2	101580013	15 华菱 MTN001	500,000	49,820,000.00	5.79
3	111610353	16 兴业 CD353	500,000	49,770,000.00	5.78
3	111610344	16 兴业 CD344	500,000	49,770,000.00	5.78
4	122093	11 中孚债	430,000	42,823,700.00	4.97
5	122158	12 西钢债	427,650	41,824,170.00	4.86

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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

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	185,425.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,234,981.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,420,406.88

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

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

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

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
九泰天宝混合 A	240	6,739.04	0.00	0.00%	1,617,369.73	100.00%
九泰天宝混合 C	1	801,536,983.66	801,536,983.66	100.00%	0.00	0.00%
合计	241	3,332,590.68	801,536,983.66	99.80%	1,617,369.73	0.20%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	九泰天宝混合 A	179,535.52	11.1005%
	九泰天宝混合 C	0.00	0.0000%
	合计	179,535.52	0.0224%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持	九泰天宝混合 A	0~10
	九泰天宝混合 C	0

有本开放式基金	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	九泰天宝混合 A	0~10
	九泰天宝混合 C	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 23 日）基金份额总额	215,255,863.06	-
本报告期期初基金份额总额	7,326,557.78	2,488,075,445.20
本报告期基金总申购份额	456,711.85	-
减:本报告期基金总赎回份额	6,165,899.90	1,686,538,461.54
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	1,617,369.73	801,536,983.66

§ 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。

基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内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 80,000.00 元。截至本报告期末，该会计师事务所已向本基金提供 1 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

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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
九州证券股份有限公司	2	54,465,529.57	83.51%	50,725.70	83.51%	-
联讯证券股份有限公司	2	10,757,915.19	16.49%	10,018.99	16.49%	-

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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

		例		成交总额 的比例		比例
九州证券股份 有限公司	25,040,921.80	0.50%				
联讯证券股份 有限公司	5,004,591,814.82	99.50%	2,230,000,000.00	100.00%		

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

11.8 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	证监会指定报刊和公司网站	2016年1月8日

	告		
5	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 14 日
6	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 22 日
7	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司作为我公司部分开放式基金销售机构并开通基金定投、转换业务及参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 26 日
8	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 27 日
9	关于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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2016 年第 1 号）	公司网站	2016 年 3 月 4 日
15	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要（2016 年第 1 号）	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
16	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
17	关于增加九泰基金销售（北	证监会指定报刊和	2016 年 3 月 17 日

	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	公司网站	
18	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
19	关于九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额恢复申购业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年3月29日
20	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告	公司网站	2016年3月30日
21	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	证监会指定报刊和公司网站	2016年3月30日
22	九泰基金管理有限公司关于九泰天宝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3月31日
23	关于增加首创证券有限责任公司为我公司所管理部分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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016年4月20日
29	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
30	关于增加湘财证券投资管理	证监会指定报刊和	2016年4月22日

	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	公司网站	
31	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
32	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
33	九泰基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年5月14日
34	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
35	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
36	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
37	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
38	关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年5月27日
39	关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为我公司所管理基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年6月2日
40	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
41	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

42	关于增加湘财证券股份有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
43	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
44	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
45	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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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
51	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
52	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
53	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 7 月 21 日
54	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
55	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

56	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
57	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
58	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
59	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
60	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
61	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
62	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
63	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
64	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 8 月 26 日
65	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2016 年第 2 号)	公司网站	2016 年 8 月 26 日
66	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要(2016 年第 2 号)	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 8 月 26 日
67	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
68	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
69	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
70	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
71	关于九泰基金管理有限公司	公司网站	2016 年 9 月 26 日

	客服电话及在线咨询暂停相关服务的公告		
72	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
73	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
74	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金继续暂停申购、定投和转换转入业务的提示性公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 10 月 25 日
75	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 10 月 25 日
76	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
77	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
78	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
79	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
80	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
81	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 11 月 15 日
82	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
83	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
84	关于增加杭州科地瑞富基金	证监会指定报刊和	2016 年 11 月 16 日

	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	公司网站	
85	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
86	关于九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额恢复申购业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 1 日
87	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
88	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
89	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
90	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
91	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
92	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 12 月 21 日
93	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
94	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
95	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金继续暂停申购、定投和转换转入业务的提示性公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 28 日
96	九泰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 29 日

97	九泰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 12 月 30 日
98	开放式基金净值表	公司网站	2016 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

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天宝灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《九泰天宝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、九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内九泰天宝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。

九泰基金管理有限公司
2017 年 3 月 29 日