

九泰久利灵活配置混合型证券投资基金

招募说明书更新摘要

2017 年第 1 号

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

重要提示

本基金的募集申请经中国证监会 2015 年 7 月 7 日证监许可【2015】1547 号文注册。本基金的基金合同于 2016 年 11 月 7 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、政策风险、本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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，属于中等风险收益特征的证券投资基金品种。本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券，

其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。因此，中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

本基金可投资股指期货、权证等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 5 月 7 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人的基本情况

名称：九泰基金管理有限公司

住所：北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室

办公地址：北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦西区 6 层

设立日期：2014 年 7 月 3 日

法定代表人：卢伟忠

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期限：2014 年 7 月 3 日至长期

联系电话：010-52601666

传真：010-52601699

联系人：王海滨

股权结构：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、九州证券股份有限公司出资分别占注册资本的 26%、25%、25%和 24%的股权。

二、主要人员情况

1、董事会成员

吴强先生，管理学硕士，董事长。曾任万联证券投行部业务经理，宏源证券资本市场部副总经理，安信证券投行部业务副总裁，国信证券投行业务部总经理助理。现任昆吾九鼎投资管理有限公司董事、副总经理，九州证券股份有限公司董事长，九泰基金管理有限公司董事长。

吴刚先生，管理学硕士，董事。曾任闽发证券投资银行部项目经理，中国证监会机构监管部副处长、处长。现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司董事长。

卢伟忠先生，金融学硕士，董事、法定代表人，总经理。曾任金瑞期货研究员，安信证券股指期货 IB 业务专员，安信期货办公室主任，安信期货 IB 业务部总经理，安信证券资产管理部产品总监，安信乾盛常务副总经理。现任九泰基金管理有限公司董事、法定代表人，总经理。

袁小文女士，高级管理人员工商管理硕士，独立董事。曾任广东万通期货公司副总经理，浙江金马期货公司常务副总，长城伟业期货经纪有限公司（后更名为华泰长城期货有限公司）副总经理，华泰长城期货有限公司总经理，中信证券股份有限公司下属子公司执行副董事长，中信期货有限公司董事长，现任阳富教育咨询服务（深圳）有限公司董事长职务。

徐艳女士，经济学博士，独立董事。曾任长春税务学院金融系国际金融教研室主任，海国投工业开发股份有限公司投资部经理，现任海南大学 MBA 教育中心主任职务，院学位委员会委员、院学术委员会委员等职务。

陈耿先生，经济学博士，教授，独立董事。曾任青岛崂山区政府(高科技开发区)职员，重庆大学工商管理博士后科研站博士后，重庆大学经济与工商管理学院教师，现任重庆大学经济与工商管理学院 EMBA 中心主任职务。

2、监事会成员

古志鹏先生，大学本科，监事。曾任毕马威会计师事务所经理助理，中国科学院中国科学传播研究所业务主管，昆吾九鼎投资管理有限公司吉林业务部门负责人、东北业务大区总经理。现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司副总经理。

刘开运先生，金融学硕士，监事。曾任毕马威华振会计师事务所审计师，昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理、合伙人助理。现任九泰基金管理有限公司战略投资部定增业务组（锐系列）执行投资总监。

3、公司高级管理人员

卢伟忠先生，简历同上。

王玉女士，涉外经济本科，副总经理。曾任陕西群力子弟学校教师，北京思拓克斯商贸有限公司经理助理，太平洋人寿保险北京分公司营销业务部经理、海淀支公司总经理、分公司党委委员、副总经理，国风共创管理咨询有限公司总经理。现任九泰基金管理有限公司副总经理。

吴祖尧先生，工学硕士，副总经理。曾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。现任九泰基金管理有限公司副总经理。

王彦斌先生，经济学硕士，董事会秘书。曾任中国建设银行邯郸市分行科员，平安证券有限责任公司科员，银华基金管理有限公司业务主管，信达澳银基金管理有限公司基金运营中心副总经理、监察稽核总监，九泰基金管理有限公司总经理。现任九泰基金管理有限公司董事会秘书。

谢海波先生，经济学硕士，督察长。曾任南宁铁路局助理工程师，广西斯壮股份有限公司投资部负责人，中国证监会广西监管局主任科员、副处长，中国证监会青海监管局局长助理。现任九泰基金管理有限公司督察长。

严军先生，工商管理硕士，总经理助理。曾任天津证券深圳营业部电脑部总经理，渤海证券电子商务部银证通中心总经理，博时基金管理有限公司运维主管，信达澳银基金管理有限公司运营总监。现任九泰基金管理有限公司总经理助理。

郑立昌先生，工商管理硕士，总经理助理。曾任立信会计师事务所北京总部高级审计经理，昆吾九鼎投资管理有限公司风险控制部负责人。现任九泰基金管理有限公司总经理助理。

王泳先生，工商管理硕士，总经理助理。曾任深圳清华大学研究院国际教育学院办公室主任，安信证券经纪业务总部渠道组经理、渠道组总监、渠道和营销团队组负责人、财富管理中心产品总监，安信乾盛结构融资部总经理，安信乾盛总经理助理。现任九泰基金管理有限公司总经理助理。

4、基金经理

王玥晰女士，英国莱斯特理学硕士，中国籍，具有基金从业资格，9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 日至今）、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金（2017 年 1 月 20 日至今）、九泰久益灵活配置混合型证券投资基金（2017 年 1 月 25 日至今）的基金经理。

刘心任先生，北京大学经济学硕士，中国籍，6 年证券从业经验，具有基金从业资格。曾任广发基金管理有限公司研究员。2015 年 5 月加入九泰基金管理有限公司任研究发展部总监兼定增投资中心副总经理，九泰久利灵活配置混合型证券投资基金（2016 年 11 月 15 日至今）的基金经理。

林柏川先生，北京大学药物化学硕士，药学学士，中国籍，具有基金从业资格，6 年证券从业经历。曾任普华永道中天会计师事务所审计师，中信建投

证券股份有限公司研究员，信诚人寿保险有限公司研究员。2015年6月加入九泰基金管理有限公司任研究发展部研究员，九泰久利灵活配置混合型证券投资基金（2017年1月5日至今）的基金经理。

5、公募投资决策委员会成员

本公司公募投资决策委员会成员包括：吴祖尧先生（委员会主席）、张勇先生、李永兴先生、刘开运先生、刘心任先生。

吴祖尧先生，同上。

张勇先生，经济学硕士，中国籍，14年证券从业经验，9年基金经理任职经验。历任南京市商业银行信贷员、债券交易员，博时基金管理有限公司债券交易员、基金经理助理、固定收益部副总经理、固定收益总部现金管理组投资总监、博时现金收益证券投资基金基金经理（2006年7月至2015年5月）、博时策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2009年8月至2015年5月）、博时稳定价值债券投资基金基金经理（2010年8月至2014年2月）、博时安盈债券型证券投资基金基金经理（2013年4月至2015年5月）、博时宏观回报债券型证券投资基金基金经理（2014年2月至2015年5月）、博时天天增利货币市场基金（2014年8月至2015年6月）基金经理、博时现金宝货币市场基金（2014年9月至2015年6月）基金经理、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金（2014年9月至2015年6月）基金经理、博时保证金实时交易型货币市场基金（2014年11月至2015年6月）基金经理。现任九泰基金管理有限公司总裁助理、绝对收益部总经理兼执行投资总监。

李永兴先生，经济学硕士，中国籍。曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理助理，交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月加入九泰基金管理有限公司，现任盛世投资管理部投资总监兼总经理。

刘开运先生，同上。

刘心任先生，北京大学、香港大学经济金融双硕士，中国籍，6年证券从业经验，具有基金从业资格。曾任广发基金管理有限公司研究员。2015年5月加入九泰基金管理有限公司任研究发展部总监兼定增投资中心副总经理。现任

九泰久利灵活配置混合型证券投资基金（2016 年 11 月 15 日至今）的基金经理。

6、公司董事长吴强先生与公司董事吴刚先生系兄弟关系。除此以外，上述人员之间无近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

11、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

四、基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；

- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制体系

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

1、公司的内部控制目标

- (1) 确保合法合规经营；
- (2) 防范和化解风险；
- (3) 提高经营效率；
- (4) 保护基金份额持有人和股东的合法权益。

2、公司内部控制遵循的原则

- (1) 健全性原则

风险管理必须涵盖公司各个部门和各个岗位，并渗透到各项业务过程和业务环节，包括各项业务的决策、执行、监督、反馈等环节。

（2）有效性原则

通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护风险管理制度的有效执行。

（3）独立性原则

公司各机构、部门和岗位确保相对独立并承担各自的风险控制职责。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作须分离。督察长和监察稽核部对公司风险控制制度的执行情况进行检查和监督。

（4）相互制约原则

公司在制度安排、组织机构的设计、部门和岗位设置上形成权责分明、相互制约的机制，从而建立起不同岗位之间的制衡体系，消除内部风险控制中的盲点，强化监察稽核部对业务的监督检查功能。

（5）成本效益原则

公司将运用科学化的经营管理方法，并充分发挥各机构、部门及员工的工作积极性，尽量降低经营成本，提高经营效益，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

（6）适时性原则

风险管理应具有前瞻性，并且必须随着国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变和公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化及时进行相应的修改和完善。

（7）内控优先原则

内控制度具有高度的权威性，所有员工必须严格遵守，自觉形成风险防范意识；执行内控制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；公司业务的发展必须建立在内控制度完善并稳固的基础之上。

（8）防火墙原则

公司在敏感岗位如：基金投资、交易执行、基金清算岗位之间，基金会计和公司会计之间、会计与出纳之间等等，在物理上和制度上设置严格的防火墙进行隔离，以控制风险。

3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。监察稽核部定期对公司制度、内部控制方式、方法和执行情况实行持续的检验，并出具专项报告。

4、内控监控防线

为体现职责明确、相互制约的原则，公司根据基金管理业务的特点，设立顺序递进、权责分明、严密有效的三道监控防线：

（1）建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责，各业务均制定详尽的操作流程，各岗位人员上岗前必须以书面形式声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责；

（2）建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督的责任；

（3）建立以督察长、监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

5、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

（1）授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

（2）公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

（3）基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

（4）交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；建立了交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善了相关的安全设施；集中交易室对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立了科学的投资交易绩效评价体系。

（5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制重点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

（6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律

法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

（7）监察稽核

公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，配备了充足的人员，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

6、基金管理人关于内部控制制度声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部控制制度。

第二部分 基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2017 年 3 月 31 日，本集团总资产 60,006.74 亿元人民币，高级法下资本充足率 14.43%，权重法下资本充足率 12.08%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职能处室，现有员工 60 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF

基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996年12月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领

域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2017 年 3 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 285 只开放式基金。

（四） 托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于

内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

（4）有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要，并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

（6）防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

（7）重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

（8）制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

（9）成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计

核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备，同时，每日实时对托管业务数据库进行备份，托管业务数据每日进行备份，所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

（5）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

（6）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

投资者可以通过九泰基金管理有限公司直销中心以及电子交易平台办理本基金的开户及认购等业务。

(1) 九泰基金管理有限公司直销中心

办公地址：北京市西城区华远北街2号通港大厦812-818室

电话：010-83369933

传真：010-52601225

邮箱：service@jtamc.com

网址：www.jtamc.com

联系人：潘任会

(2) 九泰基金管理有限公司电子交易平台

二、登记机构

名称：九泰基金管理有限公司

住所：北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室

办公地址：北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦西区 6 层

法定代表人：卢伟忠

电话：010-52601666

传真：010-52601699

联系人：付翩

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

负责人：朱小辉

电话：010-57763888

传真：010-57763777

经办律师：吴冠雄、李晗

联系人：李晗

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）北京分所

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城西二办公楼 8 层 10 室

北京分所负责人：崔劲

联系人：杨婧

联系电话：010-8512 4461、18588883695 传真电话：010-85181218

经办注册会计师：文启斯、杨丽

第四部分 基金的名称

九泰久利灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金的运作方式

契约型开放式

第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票(包含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债及其他中国证监会允许投资的债券)、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

第八部分 基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

2、股票投资策略

本基金采用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。

本基金的股票定性分析方法采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系。在灵活的类别资产配置的基础上，本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。

在定性分析的基础上，本基金的股票定量分析方法将分析备选股票的估值指标（如 PE、PB、PE/G、PS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等）、现金流量指标和其他财务指标，再通过比较市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平，并参考国际市场估值水平，来评估备选股票价值提升带来的投资机会。

3、固定收益投资策略

本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素的基础上，构建债券投资组合。本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略等多种策略进行债券投资。

4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

5、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。

6、股指期货、权证等投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，构建交易组合。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。

第九部分 基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 $\times$ 30%+中国债券总指数收益率 $\times$ 70%

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中等风险收益特征的证券投资基金品种。

第十一部分 基金投资组合报告

九泰基金管理公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责

任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	923,357,449.18	30.42
	其中：股票	923,357,449.18	30.42
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	830,000,570.00	27.35
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	1,008,539,460.53	33.23
8	其他资产	273,140,838.26	9.00
9	合计	3,035,038,317.97	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,714,025.40	0.19
B	采矿业	15,325,632.00	0.51
C	制造业	572,495,378.04	18.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	25,029.52	0.00
F	批发和零售业	74,088.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	131,314.89	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	315,528,843.44	10.41

K	房地产业	10,258,850.76	0.34
L	租赁和商务服务业	3,740,632.05	0.12
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.00
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	923,357,449.18	30.46

1.2.2 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。

1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600277	亿利洁能	43,290,043	305,194,803.15	10.07
2	600016	民生银行	28,641,721	242,881,794.08	8.01
3	600960	渤海活塞	18,861,607	158,437,498.80	5.23
4	300410	正业科技	1,191,589	47,699,307.67	1.57
5	300056	三维丝	2,042,594	36,521,580.72	1.20
6	601398	工商银行	2,567,900	12,428,636.00	0.41
7	601857	中国石油	1,289,400	10,147,578.00	0.33
8	601939	建设银行	1,703,500	10,118,790.00	0.33
9	000002	万科 A	445,122	9,160,610.76	0.30
10	000333	美的集团	251,700	8,381,610.00	0.28

1.4 报告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。

1.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

1.7 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。

1.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 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。

1.9.2 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。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 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。

1.10.2 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。

1.10.3 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。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1
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。

1.11.2
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。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	48,551.25
2	应收证券清算款	270,398,362.62
3	应收股利	—
4	应收利息	2,693,924.39
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	273,140,838.26

1.11.4 报告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处于转股期的可转换债券。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600277	亿利洁能	305,194,803.15	10.07	非公开发行
2	600960	渤海活塞	158,437,498.80	5.23	非公开发行
3	300410	正业科技	47,699,307.67	1.57	非公开发行

1.11.6 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。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	净值增长率①	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	0.20%	0.09%	0.95%	0.18%	-0.75%	-0.09%

第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；

- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.90% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性提取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不

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。

上述“一、基金费用的种类中第3—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自基金产品成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于基金产品成立一个月后的5个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商一致，调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2016年10月23日刊登的本基金招募说明书（《九泰久利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更

新,主要补充和更新的内容如下:

- 1、在“三、基金管理人”中,对基金管理人的基本情况进行了更新;
- 2、在“四、基金托管人”中,对基金托管人的基本情况进行了更新;
- 3、在“六、基金的募集与基金合同的生效”中,更新了基金合同生效日期等相关内容;
- 4、在“七、基金的份额申购与赎回”中,对申购和赎回份额相关信息进行了更新;
- 5、在“八、基金的投资”中,新增了“基金投资组合报告”的内容,数据内容截止时间为2017年3月31日;
- 6、在“十、基金的业绩”部分,列示了过去三个月的基金业绩数据;
- 7、在“二十一、其他应披露事项”部分,根据相关公告的内容进行了更新。

九泰基金管理有限公司

2017年6月21日