

九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 25 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。本半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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 1 日起至 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 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.....	47
7.7 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.....	47
7.8 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.....	47
7.9 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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55

§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	九泰锐益定增混合（场内简称：九泰锐益）
场内简称	九泰锐益
基金主代码	168103
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 6 个月定期开放一次基金份额的申购、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。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），并更名为九泰锐益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 8 月 11 日
基金管理人	九泰基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,243,831,962.96 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	2016-11-23

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，基金合同生效后前五年内，利用定向增发项目，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，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事件性投资机会，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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢海波	方韡
	联系电话	010-52601690	4006800000
	电子邮箱	xiehaibo@jtamc.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-628-0606	95558
传真		010-66067330	010-85230024
注册地址		北京市丰台区丽泽路 18 号 院 1 号楼 801-16 室	北京市东城区朝阳门北大街 9 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	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
邮政编码		100033	100010
法定代表人		卢伟忠	李庆萍

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 《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	www.jtamc.com
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-11,177,579.49
本期利润	-13,880,282.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0062
本期加权平均净值利润率	-0.62%
本期基金份额净值增长率	-0.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-30,406,652.65
期末可供分配基金份额利润	-0.0136
期末基金资产净值	2,213,425,310.31
期末基金份额净值	0.986
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.40%

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6月30日。

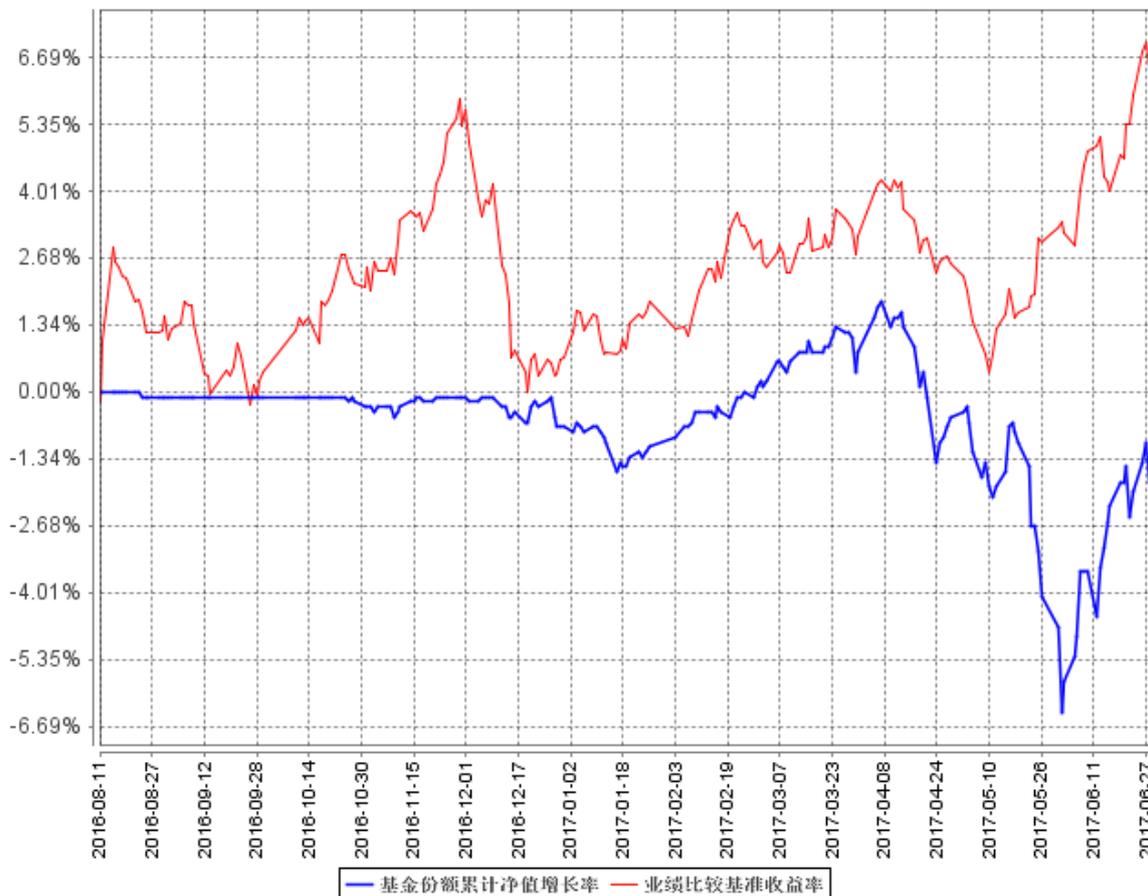
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	3.46%	0.72%	3.41%	0.41%	0.05%	0.31%
过去三个月	-2.18%	0.59%	3.59%	0.39%	-5.77%	0.20%
过去六个月	-0.70%	0.44%	6.10%	0.35%	-6.80%	0.09%
自基金合同生效起至今	-1.40%	0.33%	6.82%	0.41%	-8.22%	-0.08%

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 8 月 11 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。本基金建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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（2017年6月30日），基金管理人共管理16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、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金、九泰久益灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐诚定增灵活配置混合型证券投资基金，证券投资基金规模约为123.94亿元。

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		
刘开运	基金经理	2016年8月11日	-	6	金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格，6年证券从业经验。多年股权投资与行业研究经验，历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。2014年7月加入九泰基金管理有限公司。现任战略投资部定增业务组（锐系列）执行投资总监，九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金（2015年7月16日至2016年7月16日）、九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金（2015年

				8月14日至今)、九泰锐富事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(2016年2月4日至今)、九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金(2016年8月11日至今)、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(2016年8月30日至今)、九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月19日至今)、九泰锐诚定增灵活配置混合型证券投资基金(2017年3月24日至今)的基金经理。
--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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》等法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在严格控制投资风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益, 没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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)的半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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

九泰锐益自成立以来，始终保持积极进取、同时严格控制投资风险的态度展开投资运作。九泰锐益专注于定增投资，将 80%以上非现金资产投资上市公司定向增发。在上市公司选择方面，坚持选取行业前景广阔，公司基本面扎实的上市公司进行定增投资，在获取定增折价收益的同时，最大程度上分享上市公司中长期发展带来的价值提升。

2017 年 5 月 27 日，证监会发布了《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》（证监会公告（2017）9 号），上海、深圳证券交易所也出台了完善减持制度的专门规则。此次出台的股份减持新规在短期内有利于遏制特定股东利用信息、成本优势无序减持、清仓式减持，有利于引导市场建立稳定预期、恢复市场信心，中长期来看，对于引导市场践行长期投资和价值投资，维护市场长期稳定健康发展将起到至关重要的作用。

随着 2017 年定增新规以及减持新规的出台，基金及时进行了定增投资策略的调整完善，在定增投资标的选择方面更加关注上市公司中长期核心竞争力与内生成长性，通过更加严格的基本面标准选择优质的上市公司进行投资，通过伴随优质上市公司的中长期成长获取较高收益。九泰锐益将长期恪守“稳健投资、价值投资”的理念，密切关注定增市场变化，长期专注于优质定增标的投资，力争为投资者带来长期稳健回报。

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 0.986 元；本报告期本基金份额净值增长率为-0.70%，同期业绩比较基准收益率为 6.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年上半年，我国宏观总体经济运行平稳，得益于消费需求增长、出口活跃等因素的拉动，2 季度经济获得 6.9%的增速。展望全年，欧美经济持续复苏，有望带动出口保持较高增速。众多行业通过供给侧改革，淘汰落后产能、僵尸企业，企业盈利水平持续改善。货币政策保持中性，流动性较难出现进一步收紧。经济有望全年实现平稳平稳增长，出现大幅下滑的风险较小。

上半年国内证券市场在监管环境收紧的大环境下，出现了明显的震荡分化行情。金融行业监管导致流动性收紧，IPO 常态化发行对于中小板、创业板等高估值板块形成压制，并购重组、再融资新规、减持新规等政策的出台，进一步强化了市场对业绩与成长确定性的偏好。展望下半年，金融监管对流动性进一步冲击有限，市场对监管带来的恐慌情绪将逐步修复，市场风险偏好有望逐步提升，下半年证券市场将出现更多投资机会。行业方面，新能源汽车行业有望实现持续高速增长、新一轮国企改革与一带一路战略实施推进将带来新的投资机遇，持续消费升级与商业变革

将带来消费领域长期繁荣，我们将持续关注并布局以上领域与主题投资机会。

4.6 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。

本基金管理人基金估值小组在投资研究部、监察稽核部、风险管理部、基金运营部的协调、配合下组织开展工作。基金估值小组负责人可由公司总裁担任或总裁授权管委会成员担任、小组成员包括业务分管领导、督察长及投资研究部、监察稽核部、风险管理部、基金运营部等部门的负责人，各部门可另行指定专员负责具体事务。

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签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 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，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2017 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-30,406,652.65 元，其中：未分配利润已实现部分为-17,328,435.39 元，未分配利润未实现部分为-13,078,217.26 元。

4.8 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

作为本基金的托管人，中信银行股份有限公司严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对九泰基金管理有限公司 2017 年半年度基金的投资运作，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，不存在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九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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 托管人对本半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九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,050,590.09	255,850,537.55
结算备付金		26,845,668.42	47,427,272.73
存出保证金		64,422.40	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,757,061,357.80	873,784,378.77
其中：股票投资		1,656,106,875.30	873,784,378.77
基金投资		-	-
债券投资		100,954,482.50	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	410,000,000.00	730,000,000.00
应收证券清算款		5,129,964.11	324,607,393.02
应收利息	6.4.7.5	1,519,472.16	79,265.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,217,671,474.98	2,231,748,847.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
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		3,569,431.34	3,789,559.92
应付托管费		446,178.91	473,695.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,541.49	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	219,012.93	180,000.00
负债合计		4,246,164.67	4,443,254.93
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,243,831,962.96	2,243,831,963.03
未分配利润	6.4.7.10	-30,406,652.65	-16,526,370.14
所有者权益合计		2,213,425,310.31	2,227,305,592.89
负债和所有者权益总计		2,217,671,474.98	2,231,748,847.82

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9860 元，基金份额总额 2,243,831,962.96 份。

6.2 利润表

会计主体：九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		11,208,673.28
1.利息收入		9,679,516.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	977,087.00
债券利息收入		365,432.93
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		8,336,996.73
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,229,247.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	403,893.02
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	3,825,354.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,702,702.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,611.70
减：二、费用		25,088,955.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,060,094.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,757,511.79

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	141,741.66
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	129,607.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,880,282.47
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,880,282.47

注：本基金合同于 2016 年 8 月 11 日生效，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	2,243,831,963.03	-16,526,370.14	2,227,305,592.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,880,282.47	-13,880,282.47
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）	-0.07	-0.04	-0.11
其中：1. 基金申购款	556,773.61	-2,971.37	553,802.24
2. 基金赎回款	-556,773.68	2,971.33	-553,802.35
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）	2,243,831,962.96	-30,406,652.65	2,213,425,310.31

注：本基金合同于 2016 年 8 月 11 日生效，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

九泰锐益定增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]1271 号文《关于准予九泰锐益定增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《九泰锐益定增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 7 月 11 日至 2016 年 8 月 5 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 2,243,454,063.76 元,在募集期间产生的利息为人民币 377,899.27 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 2,243,831,963.03 元,折合 2,243,831,963.03 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 8 月 11 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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰锐益定增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交易的股票(包括创业板、中小板股票及其他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、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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则以及 2014 年颁布及经修订的准则及相关规定(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。

6.4.3 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至

2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日

活期存款	17,050,590.09
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	17,050,590.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,669,122,497.16	1,656,106,875.30	-13,015,621.86
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	101,017,077.90	100,954,482.50
	银行间市场	-	-
	合计	101,017,077.90	100,954,482.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,770,139,575.06	1,757,061,357.80	-13,078,217.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	410,000,000.00	-
合计	410,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	3,873.53
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	10,872.54
应收债券利息	1,482,040.01
应收买入返售证券利息	22,659.98
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	26.10
合计	1,519,472.16

注：其他是指结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

无

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	11,541.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,541.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	39,671.58
预提信息披露费用	149,588.57
预提上市年费	29,752.78
合计	219,012.93

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,243,831,963.03	2,243,831,963.03
本期申购	556,773.61	556,773.61
本期赎回(以“-”号填列)	-556,773.68	-556,773.68
- 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	2,243,831,962.96	2,243,831,962.96

6.4.7.10 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
上年度末	-6,150,855.86	-10,375,514.28	-16,526,370.14
本期利润	-11,177,579.49	-2,702,702.98	-13,880,282.47
本期基金份额交易产生的变动数	-0.04	-	-0.04
其中：基金申购款	-2,132.33	-839.04	-2,971.37
基金赎回款	2,132.29	839.04	2,971.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,328,435.39	-13,078,217.26	-30,406,652.65

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	586,326.16
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	390,541.03
其他	219.81
合计	977,087.00

注：其他是指结算保证金利息收入、直销申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	4,401,612.02
减：卖出股票成本总额	3,997,719.00
买卖股票差价收入	403,893.02

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内未发生债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末未进行衍生工具投资。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至2017年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-

注：本基金本报告期末未进行衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,825,354.88
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,825,354.88

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,702,702.98
——股票投资	-2,640,107.58
——债券投资	-62,595.40
——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	-2,702,702.98

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	2,611.70
合计	2,611.70

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	141,741.66
银行间市场交易费用	-
合计	141,741.66

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	49,588.57
上市费	29,752.78

银行汇划费	10,195.02
其他	400.00
合计	129,607.95

注：其他是指证券开户费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中信银行股份有限公司	基金托管人

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,060,094.35	-
其中：支付销售机构的客户维护费	4,328,603.46	-

注：1、本基金合同于2016年8月11日生效，无上年度可比期间。

2、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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由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 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、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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,757,511.79	-

注：1、本基金合同于 2016 年 8 月 11 日生效，无上年度可比期间。

2、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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由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 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、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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

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。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	17,050,590.09	586,326.16	-	-

注：本基金合同于2016年8月11日生效，无上年度可比期间。

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无需说明其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002475	立讯精密	2016年10月21日	2017年10月24日	非公开发行流通受限	19.65	26.28	9,364,351	184,009,497.15	246,095,144.28	-
603799	华友钴	2016年12月23日	2017年12月21日	非公开发行流	31.86	46.74	2,777,780	88,500,070.80	129,833,437.20	-

	业	日	日	通受限							
002400	省广股份	2016年9月21日	2017年9月22日	非公开发行流通受限	10.42	8.03	15,316,642	159,999,994.56	122,992,635.26	注1	
000519	中兵红箭	2017年1月25日	2018年1月16日	非公开发行流通受限	12.13	12.33	9,475,103	114,932,999.39	116,828,019.99	-	
600339	中油工程	2017年1月19日	2018年1月19日	非公开发行流通受限	6.16	6.30	13,805,032	85,038,997.12	86,971,701.60	-	
600277	亿利洁能	2017年2月14日	2018年2月12日	非公开发行流通受限	6.93	7.27	11,544,012	80,000,003.16	83,924,967.24	-	
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	27.16	3,060,000	94,003,200.00	83,109,600.00	-	
600531	豫光金铅	2016年12月20日	2017年12月18日	非公开发行流通受限	7.45	7.36	9,861,973	73,964,797.50	72,584,121.28	注2	
002157	正邦科技	2017年1月9日	2018年1月10日	非公开发行流通受限	6.05	4.55	14,561,559	88,825,509.90	66,255,093.45	注3	
000862	银星能源	2017年1月17日	2018年1月18日	非公开发行流通受限	7.03	7.42	7,105,263	49,949,998.89	52,721,051.46	-	
300347	泰格	2017年5月	2018年5月	非公开发	24.89	24.20	2,142,763	53,333,371.07	51,854,864.60	-	

	医药	12 日	月 16 日	行流通受限							
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	15.70	3,299,857	46,000,006.58	51,807,754.90	-	
300184	力源信息	2017 年 4 月 12 日	2017 年 4 月 12 日	非公开发行流通受限	11.03	11.13	4,533,091	49,999,993.73	50,453,302.83	-	
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	25.54	16.70	2,737,583	69,999,997.31	45,717,636.10	注 4	
002611	东方精工	2017 年 4 月 24 日	2018 年 4 月 25 日	非公开发行流通受限	14.77	14.34	3,009,002	44,503,139.58	43,149,088.68	注 5	
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	12.80	8.99	4,115,358	52,882,350.30	36,997,068.42	注 6	
002374	丽鹏股份	2016 年 11 月 1 日	2017 年 11 月 2 日	非公开发行流通受限	7.49	5.88	5,718,085	42,999,999.20	33,622,339.80	注 7	
002131	利欧股份	2016 年 9 月 8 日	2017 年 9 月 11 日	非公开发行流通受限	4.96	3.29	10,063,252	49,999,988.85	33,108,099.08	注 8	
002040	南京港	2017 年 1 月 18 日	2018 年 1 月 19 日	非公开发行流通受限	14.82	15.94	1,752,021	25,999,991.64	27,927,214.74	注 9	
000065	北	2016	2017	非公	25.11	23.78	865,079	21,799,990.80	20,571,578.62	注 10	

	方国际	年 12 月 27 日	年 12 月 28 日	开发行流通受限							
300410	正业科技	2017 年 3 月 22 日	2018 年 3 月 26 日	非公开发行流通受限	42.73	36.10	427,689	18,305,089.20	15,439,572.90	注 11	
002705	新宝股份	2017 年 3 月 30 日	2018 年 3 月 31 日	非公开发行流通受限	13.47	13.86	1,091,823	14,999,971.04	15,132,666.78	注 12	
000909	数源科技	2017 年 1 月 13 日	2018 年 2 月 27 日	非公开发行流通受限	14.77	12.10	865,738	12,821,579.78	10,475,429.80	-	
002686	亿利达	2017 年 2 月 24 日	2018 年 2 月 27 日	非公开发行流通受限	14.23	13.68	559,990	7,968,657.70	7,660,663.20	注 13	
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-	
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-	
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-	
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-	
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-	

300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股 流通 受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股 流通 受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股 流通 受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股 流通 受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注：1、本基金持有的省广股份（002400）认购价格为 13.58 元/股，于 2017 年 6 月 8 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.38 元，每 10 股转增 3 股。本基金新增 3,534,610 股，转增股后共持有 15,316,642 股，认购价格为除权后价格 10.42 元/股。

2、本基金持有的豫光金铅（600531）认购价格为 7.50 元/股，于 2017 年 6 月 30 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.5 元，认购价格为除权后价格 7.45 元/股。

3、本基金持有的正邦科技（002157）认购价格为 6.10 元/股，于 2017 年 5 月 18 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.50 元，认购价格为除权后价格 6.05 元/股。

4、本基金持有的东方精工（002611）认购价格为 14.79 元/股，于 2017 年 6 月 8 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.20 元，认购价格为除权后价格 14.77 元/股。

5、本基金持有的神州信息（000555）认购价格为 25.57 元/股，于 2017 年 5 月 23 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.26 元，认购价格为除权后价格 25.54 元/股

6、本基金持有的佳讯飞鸿（300213）认购价格为 25.70 元/股，于 2017 年 4 月 17 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 1.00 元，每 10 股转增 10 股。本基金新增 2,057,679 股，转增股后共持有 4,115,358 股，认购价格为除权后价格 12.80 元/股。

7、本基金持有的丽鹏股份（002374）认购价格为 7.52 元/股，于 2017 年 5 月 19 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.30 元，认购价格为除权后价格 7.49 元/股。

8、本基金持有的利欧股份（002131）认购价格为 17.39 元/股，于 2017 年 6 月 13 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.37 元，每 10 股转增 25 股，本基金新增 7,188,037 股，转增

股后共持有 10,063,252 股，认购价格为除权后价格 4.96 元/股。

9、本基金持有的南京港（002040）认购价格为 14.84 元/股，于 2017 年 6 月 27 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.20 元，认购价格为除权后价格 14.82 元/股。

10、本基金持有的北方国际（000065）认购价格为 25.20 元/股，于 2017 年 6 月 27 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.90 元，认购价格为除权后价格 25.11 元/股。

11、本基金持有的正业科技（300410）认购价格为 42.80 元/股，于 2017 年 6 月 27 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.70 元，认购价格为除权后价格 42.73 元/股。

12、本基金持有的新宝股份（002705）认购价格为 17.86 元/股，于 2017 年 6 月 9 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 3.50 元，每 10 股转增 3 股，本基金新增 251,959 股，转增股后共持有 1,091,823 股，认购价格为除权后价格 13.47 元/股。

13、本基金持有的亿利达（002686）认购价格为 14.23 元/股，于 2017 年 4 月 20 日实施 2016 年年度权益分配方案，每 10 股派 0.70 元，认购价格为除权后价格 14.16 元/股。

14、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，所认购的非公开发行新增股份上市首日起 12 个月内不得转让，同时按照中国证监会修订的《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》（证监会公告[2017]9 号）的补充规定，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持数量不得超过持有该次非公开发行股份数量的 50%；

15、以上“可流通日”最终日期以上市公司公告为准。

16、截至本报告期末 2017 年 06 月 30 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。

6.4.12.2 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
300145	中金环境	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	16.92	-	-	323,680	4,997,202.82	5,476,665.60	-

注：流通受限股票的复牌日期以上市公司发布的公告时间为准；

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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严格控制投资风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人建立了董事会及风险控制委员会、总经理、风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风控法务部以及各个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。

6.4.13.2 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信银行股份有限公司，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.3 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处于流通受限状态、所处的交易市场不活跃等原因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发行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，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通受限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 2017 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、结算备付金及债券资产等。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6 月30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	17,050,590.09	-	-	-	-	-	17,050,590.09
结算备付金	26,845,668.42	-	-	-	-	-	26,845,668.42
存出保证金	64,422.40	-	-	-	-	-	64,422.40
交易性金融资产	-	45,011,432.90	55,943,049.60	-	-	1,656,106,875.30	1,757,061,357.80
买入返售金融资产	410,000,000.00	-	-	-	-	-	410,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,129,964.11	5,129,964.11
应收利息	-	-	-	-	-	1,519,472.16	1,519,472.16
资产总计	453,960,680.91	45,011,432.90	55,943,049.60	-	-	1,662,756,311.57	2,217,671,474.98
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,569,431.34	3,569,431.34
应付托管	-	-	-	-	-	446,178.91	446,178.91

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,541.49	11,541.49
其他负债	-	-	-	-	-	219,012.93	219,012.93
负债总计	-	-	-	-	-	4,246,164.67	4,246,164.67
利率敏感度缺口	453,960,680.91	45,011,432.90	55,943,049.60	-	-	-1,658,510,146.90	2,213,425,310.31
上年度末 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	255,850,537.55	-	-	-	-	-	255,850,537.55
结算备付金	47,427,272.73	-	-	-	-	-	47,427,272.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	873,784,378.77	873,784,378.77
买入返售金融资产	730,000,000.00	-	-	-	-	-	730,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	324,607,393.02	324,607,393.02
应收利息	-	-	-	-	-	79,265.75	79,265.75
资产总计	1,033,277,810.28	-	-	-	-	-1,198,471,037.54	2,231,748,847.82
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,789,559.92	3,789,559.92
应付托管费	-	-	-	-	-	473,695.01	473,695.01
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	4,443,254.93	4,443,254.93
利率敏感度缺口	1,033,277,810.28	-	-	-	-	-1,194,027,782.61	2,227,305,592.89

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有债券资产占净值比例较低，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产—股票投资	1,656,106,875.30	74.82	873,784,378.77	39.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	100,954,482.50	4.56	-	-
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	1,757,061,357.80	79.38	873,784,378.77	39.23

6.4.13.4.3.2 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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	76,369,537.93	58,447,913.71
2. 沪深 300 指数下降 5%	-76,369,537.93	-58,447,913.71	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

6.4.14 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及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 2017 年 6 月 30 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 280,220,679.26 元，属于第二层次的余额为 1,476,840,678.54 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：无属于第一层次、第三层次的余额，属于第二层次的余额为 873,784,378.77 元。)

(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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,656,106,875.30	74.68
	其中：股票	1,656,106,875.30	74.68
2	固定收益投资	100,954,482.50	4.55
	其中：债券	100,954,482.50	4.55
	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	410,000,000.00	18.49
	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	43,896,258.51	1.98
7	其他各项资产	6,713,858.67	0.30
8	合计	2,217,671,474.98	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	86,971,701.60	3.93
C	制造业	1,065,075,135.39	48.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,721,051.46	2.38
E	建筑业	77,006,774.08	3.48
F	批发和零售业	58,077,754.83	2.62
G	交通运输、仓储和邮政业	40,596,653.08	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,864,186.99	3.56
J	金融业	5,937,833.49	0.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	123,034,482.38	5.56
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,491,007.60	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	51,854,864.60	2.34
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	10,475,429.80	0.47
	合计	1,656,106,875.30	74.82

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 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	002475	立讯精密	9,364,351	246,095,144.28	11.12
2	603799	华友钴业	2,777,780	129,833,437.20	5.87
3	002400	省广股份	15,316,642	122,992,635.26	5.56
4	000519	中兵红箭	9,475,103	116,828,019.99	5.28
5	600339	中油工程	13,805,032	86,971,701.60	3.93
6	600277	亿利洁能	11,544,012	83,924,967.24	3.79
7	000901	航天科技	3,060,000	83,109,600.00	3.75
8	600531	豫光金铅	9,861,973	72,584,121.28	3.28
9	002157	正邦科技	14,561,559	66,255,093.45	2.99
10	000862	银星能源	7,105,263	52,721,051.46	2.38
11	300347	泰格医药	2,142,763	51,854,864.60	2.34
12	002310	东方园林	3,299,857	51,807,754.90	2.34
13	300184	力源信息	4,533,091	50,453,302.83	2.28
14	000555	神州信息	2,737,583	45,717,636.10	2.07
15	002611	东方精工	3,009,002	43,149,088.68	1.95
16	300213	佳讯飞鸿	4,115,358	36,997,068.42	1.67
17	002374	丽鹏股份	5,718,085	33,622,339.80	1.52
18	002131	利欧股份	10,063,252	33,108,099.08	1.50
19	002040	南京港	1,752,021	27,927,214.74	1.26
20	000065	北方国际	865,079	20,571,578.62	0.93
21	300410	正业科技	427,689	15,439,572.90	0.70
22	002705	新宝股份	1,091,823	15,132,666.78	0.68
23	000651	格力电器	337,300	13,886,641.00	0.63
24	000333	美的集团	292,400	12,584,896.00	0.57
25	000909	数源科技	865,738	10,475,429.80	0.47
26	600535	天士力	200,400	8,324,616.00	0.38
27	300161	华中数控	430,938	8,222,297.04	0.37
28	002686	亿利达	559,990	7,660,663.20	0.35
29	601933	永辉超市	1,076,900	7,624,452.00	0.34
30	601111	中国国航	718,500	7,005,375.00	0.32
31	600085	同仁堂	188,779	6,599,713.84	0.30
32	000858	五粮液	114,800	6,389,768.00	0.29

33	000513	丽珠集团	89,500	6,094,950.00	0.28
34	600487	亨通光电	214,500	6,016,725.00	0.27
35	600016	民生银行	699,500	5,749,890.00	0.26
36	002450	康得新	254,797	5,738,028.44	0.26
37	000538	云南白药	60,700	5,696,695.00	0.26
38	600004	白云机场	306,829	5,664,063.34	0.26
39	300070	碧水源	294,424	5,491,007.60	0.25
40	300145	中金环境	323,680	5,476,665.60	0.25
41	600528	中铁工业	368,600	5,267,294.00	0.24
42	600066	宇通客车	237,100	5,209,087.00	0.24
43	600519	贵州茅台	10,500	4,954,425.00	0.22
44	600068	葛洲坝	411,694	4,627,440.56	0.21
45	600582	天地科技	905,624	4,156,814.16	0.19
46	002206	海利得	409,250	3,040,727.50	0.14
47	300294	博雅生物	72,150	2,975,466.00	0.13
48	300230	永利股份	174,900	2,892,846.00	0.13
49	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
50	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.00
51	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.00
52	300660	江苏雷利	946	74,979.96	0.00
53	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
54	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
55	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
56	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.00
57	002875	安奈儿	1,158	41,514.30	0.00
58	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
59	002877	智能自控	1,436	36,302.08	0.00
60	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
61	603042	华脉科技	1,232	35,013.44	0.00
62	603496	恒为科技	912	31,354.56	0.00
63	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	0.00
64	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
65	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
66	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
67	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
68	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
69	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
70	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
71	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00

72	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
73	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
74	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
75	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
76	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
77	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
78	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
79	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
80	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
81	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 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	000519	中兵红箭	114,932,999.39	5.16
2	002157	正邦科技	88,825,509.90	3.99
3	600339	中油工程	85,038,997.12	3.82
4	600277	亿利洁能	80,000,003.16	3.59
5	300347	泰格医药	53,333,371.07	2.39
6	300184	力源信息	49,999,993.73	2.24
7	000862	银星能源	49,949,998.89	2.24
8	002611	东方精工	44,503,139.58	2.00
9	002040	南京港	25,999,991.64	1.17
10	300410	正业科技	18,305,089.20	0.82
11	002705	新宝股份	14,999,971.04	0.67
12	000909	数源科技	12,821,579.78	0.58
13	300161	华中数控	11,527,591.50	0.52
14	000651	格力电器	9,997,437.00	0.45
15	000333	美的集团	9,996,539.00	0.45
16	600535	天士力	7,996,947.00	0.36
17	002686	亿利达	7,968,657.70	0.36
18	600528	中铁工业	5,998,195.00	0.27
19	600085	同仁堂	5,996,012.41	0.27
20	600016	民生银行	5,987,404.30	0.27

7.4.2 累计卖出金额超前 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	002475	立讯精密	4,401,612.02	0.20

7.4.3 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	788,960,323.11
卖出股票收入（成交）总额	4,401,612.02

注：本项中 7.4.1、7.4.2 和 7.4.3 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。

7.5 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	100,954,482.50	4.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,954,482.50	4.56

7.6 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	019557	17 国债 03	561,250	55,906,112.50	2.53
2	019546	16 国债 18	450,610	45,011,432.90	2.03

3	019301	13 国债 01	370	36,937.10	0.00
---	--------	----------	-----	-----------	------

注：本基金本报告期末仅持有上述三只债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	64,422.40
2	应收证券清算款	5,129,964.11
3	应收股利	-
4	应收利息	1,519,472.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,713,858.67

7.12.4 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。

7.12.5 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价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002475	立讯精密	246,095,144.28	11.12	非公开发行股票流通受限
2	603799	华友钴业	129,833,437.20	5.87	非公开发行股票流通受限
3	002400	省广股份	122,992,635.26	5.56	非公开发行股票流通受限
4	000519	中兵红箭	116,828,019.99	5.28	非公开发行股票流通受限
5	600339	中油工程	86,971,701.60	3.93	非公开发行股票流通受限
6	600277	亿利洁能	83,924,967.24	3.79	非公开发行股票流通受限
7	000901	航天科技	83,109,600.00	3.75	非公开发行股票流通受限
8	600531	豫光金铅	72,584,121.28	3.28	非公开发行股票流通受限
9	002157	正邦科技	66,255,093.45	2.99	非公开发行股票流通受限
10	000862	银星能源	52,721,051.46	2.38	非公开发行股票流通受限

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
22,718	98,768.90	564,402,828.30	25.15%	1,679,429,134.66	74.85%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国石化财务有限责任公司	50,002,430.00	3.03%
2	清华大学教育基金会	41,668,464.00	2.53%
3	西南证券股份有限公司	30,000,583.00	1.82%
4	上海斯诺波投资管理有限公司—私募工场自由之路母基金证券投资基金	21,319,879.00	1.29%
5	南京盛泉恒元投资有限公司—盛泉恒元定增套利多策略6号私募基金	13,341,482.00	0.81%
6	沈阳铁路局企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	11,923,318.00	0.72%
7	张志毅	9,889,041.00	0.60%
8	宋鲁燕	9,580,558.00	0.58%
9	珠峰财产保险股份有限公司—资本金	9,013,830.00	0.55%
10	苏玉珍	8,678,349.00	0.53%

8.3 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	56,099.01	0.0025%

8.4 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
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年8月11日）基金份额总额	2,243,831,963.03
本报告期期初基金份额总额	2,243,831,963.03
本报告期基金总申购份额	556,773.61
减：本报告期基金总赎回份额	556,773.68
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,243,831,962.96

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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. 2017 年 1 月 19 日，由本公司第一届董事会 2017 年第五次会议通过，同意任命吴祖尧先生担任九泰基金管理有限公司副总经理，任期三年，并已向北京监管局、中国证券投资基金业协会备案。

2. 2017 年 3 月 30 日，经公司总裁提名，报公司董事长核准，同意任命王泳先生为九泰基金管理有限公司总裁助理，公司管理委员会成员。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计的会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2017 年 1 月 14 日，基金管理人收到中国证监会下发的《关于对九泰基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》（行政监管措施决定书【2017】7 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。2017 年 6 月 19 日，基金管理人接受了北京证监局对整改落实情况的现场检查，北京证监局对整改情况未提出异议。本报告内基金管理人的高级管理人员未受稽查或处罚情况。

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
华西证券	2	134,547,501.70	100.00%	125,304.04	100.00%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

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：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

10.7.2 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
华西证券	101,017,077.90	100.00%	46,252,000,000.00	100.00%	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

10.8 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	2017年1月6日
2	关于增加中泰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	2017年1月6日
3	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	2017年1月11日
4	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	2017年1月16日
5	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	2017年1月17日
6	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	2017年1月19日
7	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	2017年1月20日
8	九泰基金管理有限公司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	2017年1月20日
9	九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金2016年第4季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2017年1月19日
10	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	2017年1月21日
11	关于九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金首次受限开放申购、赎回业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017年2月3日
12	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	2017年1月25日
13	关于《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》的更正公告	证监会指定报刊和公司网站	2017年1月26日
14	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	2017年2月3日
15	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证监会指定报刊和公司网站	2017年2月14日
16	九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金首次受限开放申购、赎回结果的	证监会指定报刊和公司网站	2017年2月14日

	公告		
17	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	2017年2月16日
18	关于增加贵州华阳众惠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	2017年2月16日
19	关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为我公司旗下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	2017年2月22日
20	关于增加深圳盈信基金销售有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017年2月23日
21	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	2017年2月28日
22	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	2017年2月28日
23	关于增加长江证券股份有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017年3月17日
24	关于调整我公司旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司申购下限的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017年3月20日
25	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	2017年3月24日
26	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	2017年3月24日
27	九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新 2017 年第 1 号	公司网站	2017年3月28日
28	九泰锐益定增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	证监会指定报刊和公司网站	2017年3月28日
29	九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	证监会指定报刊和公司网站	2017年3月29日
30	九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告	公司网站	2017年3月29日
31	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	2017年3月31日
32	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	2017年4月1日
33	关于增加济安财富（北京）资本	证监会指定报刊和	2017年4月6日

	管理有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	公司网站	
34	关于增加民生证券股份有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017 年 4 月 10 日
35	九泰基金管理有限公司关于九泰锐益定增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	2017 年 4 月 11 日
36	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	2017 年 4 月 11 日
37	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	2017 年 4 月 14 日
38	九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2017 年 4 月 24 日
39	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	2017 年 4 月 26 日
40	关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017 年 5 月 10 日
41	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	2017 年 5 月 16 日
42	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	2017 年 5 月 17 日
43	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	2017 年 5 月 18 日
44	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	2017 年 5 月 24 日
45	关于增加北京格上富信投资顾问有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017 年 6 月 2 日
46	关于增加上海基煜基金销售有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017 年 6 月 9 日
47	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为我公司所管理部分公开募集证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017 年 6 月 9 日
48	关于增加上海朝阳永续基金销售有限公司为我公司所管理部分公	证监会指定报刊和公司网站	2017 年 6 月 19 日

	开募集证券投资基金销售机构的公告		
49	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	2017 年 6 月 27 日
50	九泰基金管理有限公司关于落实《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017 年 6 月 28 日
51	关于调整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申购下限的公告	证监会指定报刊和公司网站	2017 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未发生单一投资者持有的基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金报告期内没有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《九泰锐益定增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、九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内九泰锐益定增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

12.2 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。

12.3 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8月25日