

九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，请阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.4 信息披露方式

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

§ 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。

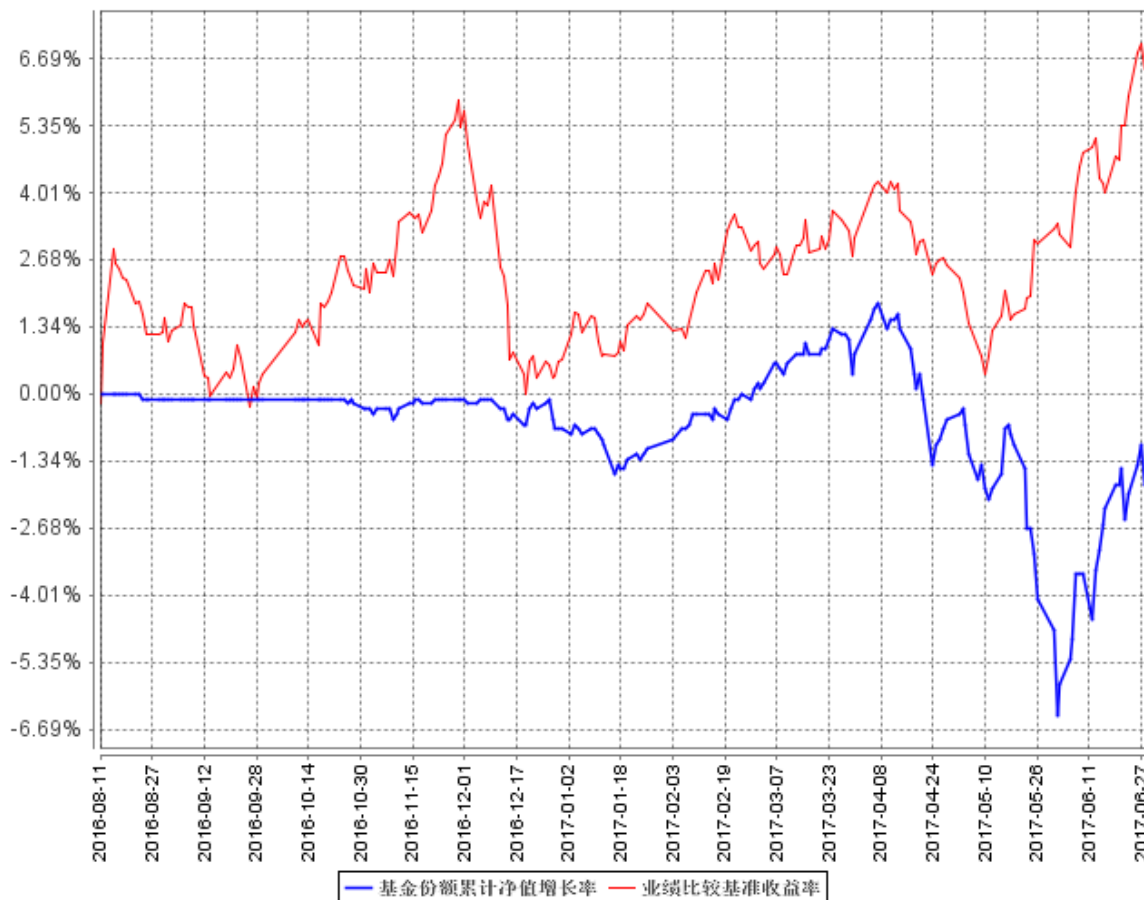
3.2 基金净值表现

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，未发现有关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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	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	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	-	-
资产总计	2,217,671,474.98	2,231,748,847.82
负债和所有者权益	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	-	-
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	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	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	2,243,831,962.96	2,243,831,963.03
未分配利润	-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	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	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	403,893.02
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	3,825,354.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-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）	2,611.70
减：二、费用	25,088,955.75
1. 管理人报酬	22,060,094.35
2. 托管费	2,757,511.79

3. 销售服务费	-
4. 交易费用	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	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。

6.4.6.1 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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

6.4.8 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。

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	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。

6.4.8.2.3 销售服务费

无

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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	
	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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.10.1 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	华友钴业	2016年12月23日	2017年12月21日	非公开发行流通受限	31.86	46.74	2,777,780	88,500,070.80	129,833,437.20	-
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	泰格医药	2017年5月12日	2018年5月16日	非公开发行流通受限	24.89	24.20	2,142,763	53,333,371.07	51,854,864.60	-
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	-

				限							
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	北方国际	2016年12月27日	2017年12月28日	非公开发行流通受限	25.11	23.78	865,079	21,799,990.80	20,571,578.62	注10	
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	2017年3月30日	2018年3月31日	非公开发行流	13.47	13.86	1,091,823	14,999,971.04	15,132,666.78	注12	

	份		日	通受限							
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。

6.4.10.2 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；

6.4.10.3 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。

6.4.11 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

0	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前十名股票投资明细

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

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	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

§ 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。

九泰基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日