

# 九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金

## 金

### 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 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 2018 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 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<br>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   | 2,243,831,962.80 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   | 陈沛                | 李修滨                    |
|         | 联系电话 | 010-57383799      | 4006800000             |
|         | 电子邮箱 | chenpei@jtamc.com | lixubini@citicbank.com |
| 客户服务电话  |      | 400-628-0606      | 95558                  |
| 传真      |      | 010-57383766      | 010-85230024           |

## 2.4 信息披露方式

|                     |               |
|---------------------|---------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.jtamc.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2017 年        | 2016 年 8 月 11 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------|---|
| 本期已实现收益       | 39,979,691.77 | -6,150,855.86                             |
| 本期利润          | -3,194,169.36 | -16,526,370.14                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0014       | -0.0074                                   |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 本期基金份额净值增长率   | -0.20%           | -0.70%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末          | 2016 年末          |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0088          | -0.0074          |
| 期末基金资产净值      | 2,224,111,422.84 | 2,227,305,592.89 |
| 期末基金份额净值      | 0.991            | 0.993            |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

4、本基金基金合同生效日为 2016 年 8 月 11 日，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

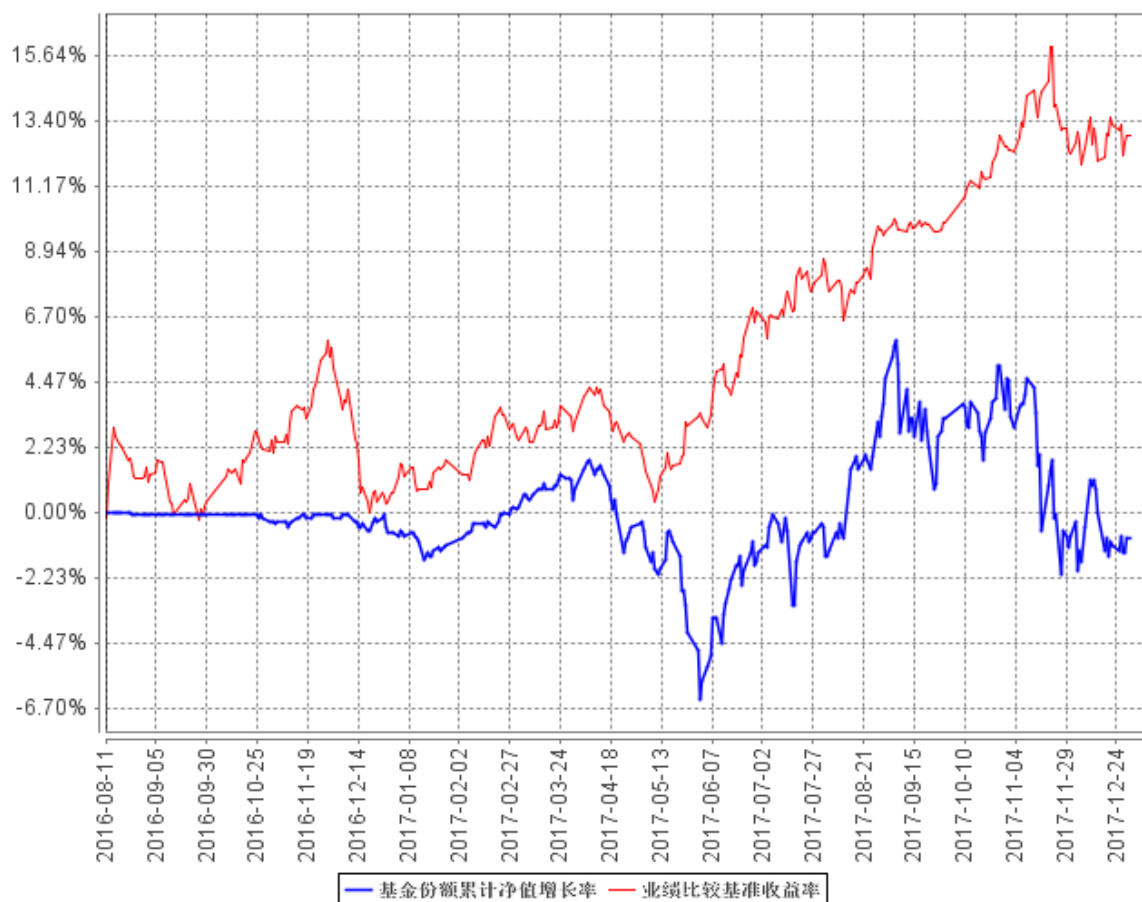
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -3.97%   | 0.88%       | 2.70%      | 0.48%         | -6.67%  | 0.40% |
| 过去六个月      | 0.51%    | 0.83%       | 5.69%      | 0.42%         | -5.18%  | 0.41% |
| 过去一年       | -0.20%   | 0.67%       | 12.15%     | 0.39%         | -12.35% | 0.28% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.90%   | 0.57%       | 12.90%     | 0.41%         | -13.80% | 0.16% |

### 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

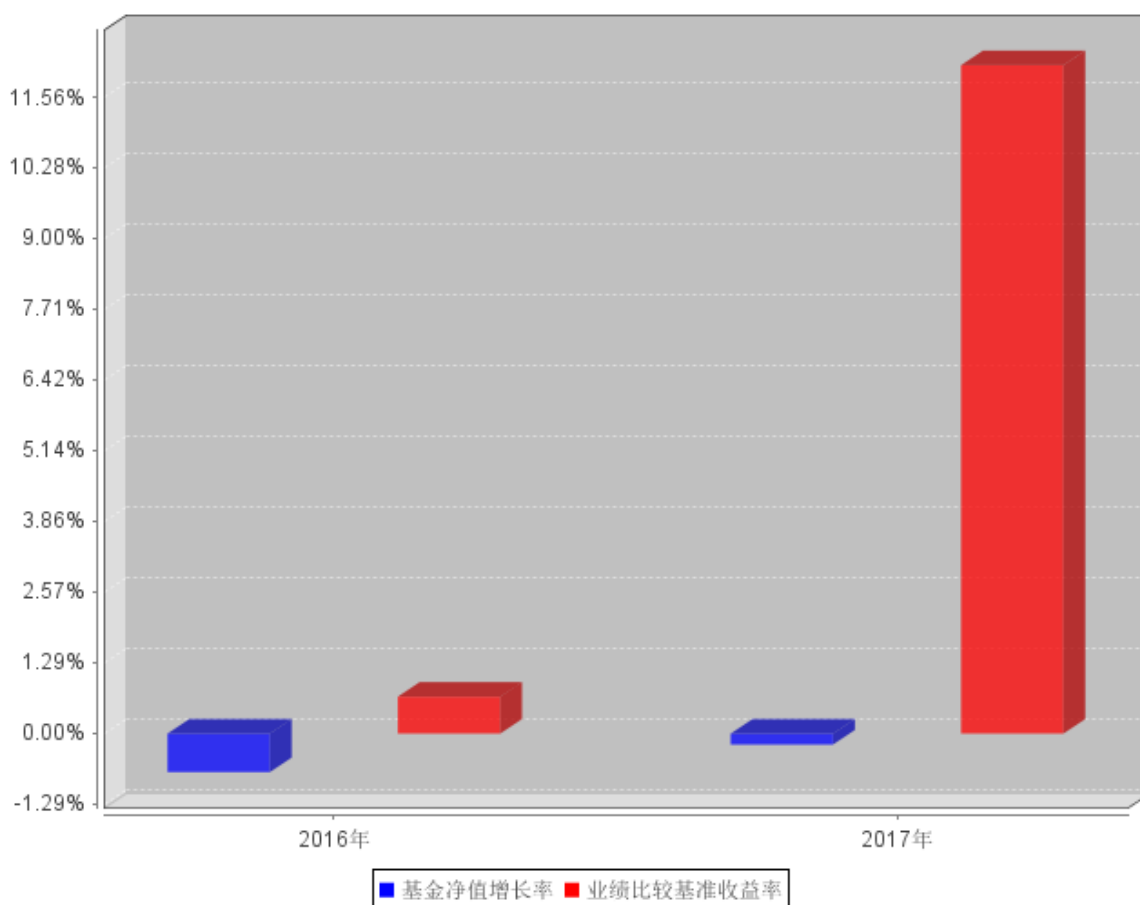


注：1. 本基金合同于 2016 年 8 月 11 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期届满不足一年。

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。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2016 年 8 月 11 日生效，合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同生效日为 2016 年 8 月 11 日，截至至本报告期末未发生利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

九泰基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2014】650 号文批准，于 2014 年 7 月 3 日正式成立，现注册资本 2 亿元人民币，其中昆吾九鼎投资管理有限公司、同创九鼎投资管理集团股份有限公司、拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司和九州证券股份有限公司分别占注册资本 26%、25%、25%和 24%的股权。截至本报告期末（2017 年 12 月 31 日），基金管理人共管理 17 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，九泰鸿祥服务升级混合型证券投资基金，证券投资基金规模约为 143.97 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、定增投资中心总经理、锐系列定增业务组执行投资总监 | 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。 |
|--|--|--|--|--|--|

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下(1 日内、3 日内、

5 日内) 的本年度同向交易价差进行了专项分析, 未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基金在报告期内, 严格遵循基金合同约定, 主要通过定增投资策略, 参与上市公司定向增发。伴随着定向增发一些类政策的落地, 未来通过定向增发融资的上市公司质量通过市场化优胜劣汰, 有望获得提升。未来, 基金将积极参与投资具备较强内生增长能力的上市公司, 努力为投资者获取稳健回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.991 元; 本报告期基金份额净值增长率为-0.20%, 业绩比较基准收益率为 12.15%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年, 国内证券市场呈现分化格局, 以沪深 300 为代表的价值蓝筹股表现强劲, 相反, 以创业板为代表成长股表现较差。展望未来, 全球主要经济体继续表现较好, 外需强劲, 国内经济仍将有望保持平稳增长。证券市场在宏观经平稳增长、货币政策稳健中性、证券市场制度不断优化的大背景下, 有望出现多元化的投资机会。未来重点关注中长期受益于消费升级的行业领域及受益于市场与政策的新兴战略成长领域。

## 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。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度, 明确了基金估值的程序和技术, 建立了估值委员会, 健全了估值决策体系。本基金管理人在具体的基金估值业务执行上, 在遵守中国证监会相关规定和基金合同的同时, 参考了行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据, 以确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制定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。对下属管理的不同基金持有的具有相同特征的同一投资品种的估值原则、程序及技术保持一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。

本基金管理人设立了由督察长、估值业务分管高管、研究业务分管高管、风险管理部、研究发展部、基金运营部等部门负责人组成的基金估值委员会，负责制定或完善估值政策、估值程序，定期复核和审阅估值程序和技术适用性，以确保相关估值程序和技术不存在重大缺陷。委员会成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域专业胜任能力。

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和负责本基金审计业务的会计师事务所。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。托管人在复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格之前，应认真审阅基金管理人采用的估值原则及技术。当对估值原则及技术有异议时，托管人有义务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。本基金管理人当发生改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的情况时，将所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。此外，会计师事务所出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程的各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。同时与中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票流动性折扣数据。

#### 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，2017 年度未实施利润分配。

本基金截至 2017 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为-19,720,539.96 元，其中：未分配利润已实现部分为 33,828,835.47 元，未分配利润未实现部分为-53,549,375.43 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，对九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，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 2017 年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

本报告已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。

投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于九泰基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |                                 |                                  |
| 银行存款            | 32,285,566.95                   | 255,850,537.55                   |
| 结算备付金           | 19,445,179.65                   | 47,427,272.73                    |
| 存出保证金           | 272,074.79                      | -                                |
| 交易性金融资产         | 1,652,152,584.53                | 873,784,378.77                   |
| 其中：股票投资         | 1,552,177,152.03                | 873,784,378.77                   |
| 基金投资            | -                               | -                                |
| 债券投资            | 99,975,432.50                   | -                                |
| 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        | 522,000,000.00                  | 730,000,000.00                   |
| 应收证券清算款         | 199,926.74                      | 324,607,393.02                   |
| 应收利息            | 2,816,049.39                    | 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            | 2,229,171,382.05                | 2,231,748,847.82                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |                                 |                                  |
| 短期借款            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | -                               | -                                |
| 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       | 3,785,400.37     | 3,789,559.92     |
| 应付托管费         | 473,175.04       | 473,695.01       |
| 应付销售服务费       | -                | -                |
| 应付交易费用        | 621,383.80       | -                |
| 应交税费          | -                | -                |
| 应付利息          | -                | -                |
| 应付利润          | -                | -                |
| 递延所得税负债       | -                | -                |
| 其他负债          | 180,000.00       | 180,000.00       |
| 负债合计          | 5,059,959.21     | 4,443,254.93     |
| <b>所有者权益：</b> |                  |                  |
| 实收基金          | 2,243,831,962.80 | 2,243,831,963.03 |
| 未分配利润         | -19,720,539.96   | -16,526,370.14   |
| 所有者权益合计       | 2,224,111,422.84 | 2,227,305,592.89 |
| 负债和所有者权益总计    | 2,229,171,382.05 | 2,231,748,847.82 |

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.991 元，基金份额总额为 2,243,831,962.80 份；

2、本基金合同生效日为 2016 年 8 月 11 日，上年度可比期间为 2016 年 8 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止。

## 7.2 利润表

会计主体：九泰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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 8 月 11 日(基金<br>合同生效日)至 2016 年<br>12 月 31 日 |
|-------------------|---|--|
| <b>一、收入</b>       | 49,610,811.43                             | 3,253,696.98   |
| 1. 利息收入           | 16,103,604.79                             | 13,629,211.26  |
| 其中：存款利息收入         | 1,294,289.23                              | 2,575,748.69   |
| 债券利息收入            | 1,818,457.49                              | -  |
| 资产支持证券利息收入        | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入        | 12,990,858.07                             | 11,053,462.57  |
| 其他利息收入            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 76,678,048.75                             | -  |
| 其中：股票投资收益         | 70,124,166.62                             | -  |
| 基金投资收益            | -   | -  |

|                            |                      |                       |
|----------------------------|----------------------|-----------------------|
| 债券投资收益                     | 73,950.70            | -                     |
| 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                       | 6,479,931.43         | -                     |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | -43,173,861.13       | -10,375,514.28        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -                    | -                     |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 3,019.02             | -                     |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>52,804,980.79</b> | <b>19,780,067.12</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 44,970,139.79        | 17,382,745.84         |
| 2. 托管费                     | 5,621,267.46         | 2,172,843.23          |
| 3. 销售服务费                   | -                    | -                     |
| 4. 交易费用                    | 1,950,685.07         | -                     |
| 5. 利息支出                    | -                    | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                    | -                     |
| 6. 其他费用                    | 262,888.47           | 224,478.05            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-3,194,169.36</b> | <b>-16,526,370.14</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-3,194,169.36</b> | <b>-16,526,370.14</b> |

注：本基金合同生效日为 2016 年 8 月 11 日，上年度可比期间为 2016 年 8 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                        | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |                |                  |
|---------------------------|--|----------------|------------------|
|                           | 实收基金                                   | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）           | 2,243,831,963.03                       | -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（本期净利润） | -                                      | -3,194,169.36  | -3,194,169.36    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -0.23                                  | -0.46          | -0.69            |

|  |  |                |                  |
|--|--|----------------|------------------|
| (净值减少以“-”号填列)                          |  |                |                  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 724,210.63                                 | 2,164.59       | 726,375.22       |
| 2. 基金赎回款                               | -724,210.86                                | -2,165.05      | -726,375.91      |
| 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）                        | 2,243,831,962.80                           | -19,720,539.96 | 2,224,111,422.84 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2016年8月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |                |                  |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 2,243,831,963.03                           | -              | 2,243,831,963.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -  | -16,526,370.14 | -16,526,370.14   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -  | -              | -                |
| 其中：1. 基金申购款                            | -  | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                               | -  | -              | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -              | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,243,831,963.03                           | -16,526,370.14 | 2,227,305,592.89 |

注：本基金合同生效日为2016年8月11日，上年度可比期间为2016年8月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
卢伟忠

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
严军

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
荣静

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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 $\times$ 60%+中债总指数(总值)财富指数收益率 $\times$ 40%。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.4.4 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估计与最近一期年度报告发生了变更。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13号)和《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(中基协发[2017]6号)相关规定,本基金自2017年9月8日起,对所持有的流通受限股票的估值方法进行调整,新的估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响,于2017年9月8日,相关会计估计调整对基金资产净值的影响超过0.25%。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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、债券免营业税和增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税;

(2) 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;

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,其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;

(3) 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；

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称            | 与本基金的关系         |
|------------------|-----------------|
| 九泰基金管理有限公司       | 基金管理人、基金销售机构    |
| 中信银行股份有限公司       | 基金托管人           |
| 九州证券股份有限公司       | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司 | 基金管理人的股东        |
| 同创九鼎投资管理集团股份有限公司 | 基金管理人的股东        |
| 昆吾九鼎投资管理有限公司     | 基金管理人的股东        |
| 九泰基金销售（北京）有限公司   | 基金管理人的全资子公司     |

#### 7.4.8 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。

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 8 月 11 日(基金合同生效日)<br>至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 44,970,139.79                             | 17,382,745.84   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 7,965,863.33                              | 3,519,799.01  |

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

$$H=E \times 2.0\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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。

#### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日 | 2016 年 8 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,621,267.46                     | 2,172,843.23                               |

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期间及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 7.4.8.5 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                               |            | 上年度可比期间                                    |              |
|------------|----------------------------------|------------|--|--------------|
|            | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |            | 2016 年 8 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |              |
|            | 期末余额                             | 当期利息收入     | 期末余额                                       | 当期利息收入       |
| 中信银行股份有限公司 | 32,285,566.95                    | 752,676.59 | 255,850,537.55                             | 2,425,590.47 |

注：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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需说明的其他关联方交易事项。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.10.1.1 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<br>(单位：股) | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
| 000065               | 北方国际 | 2016年12月27日 | 2018年12月28日 | 非公开发行流通受限 | 25.11 | 16.48  | 432,539      | 10,899,982.80 | 7,128,242.72  | -  |
| 000519               | 中兵红箭 | 2017年1月25日  | 2018年1月26日  | 非公开发行流通受限 | 12.13 | 9.50   | 4,737,552    | 57,466,505.76 | 45,006,744.00 | -  |
| 000519               | 中兵红箭 | 2017年1月25日  | 2019年1月28日  | 非公开发行流通受限 | 12.13 | 8.85   | 4,737,551    | 57,466,493.63 | 41,927,326.35 | -  |
| 000555               | 神州信息 | 2016年12月28日 | 2018年12月31日 | 非公开发行流通受限 | 25.54 | 10.93  | 1,368,791    | 34,999,985.87 | 14,960,885.63 | -  |
| 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  | 4.78   | 3,552,632    | 24,975,002.96 | 16,981,580.96 | -  |
| 000862               | 银星能源 | 2017年1月17日  | 2019年1月18日  | 非公开发行流通受限 | 7.03  | 4.57   | 3,552,631    | 24,974,995.93 | 16,235,523.67 | -  |
| 000901               | 航天科技 | 2016年11月17日 | 2018年11月19日 | 非公开发行流通受限 | 30.72 | 21.74  | 1,530,000    | 47,001,600.00 | 33,262,200.00 | -  |
| 000909               | 数源科技 | 2017年1月13日  | 2018年1月     | 非公开发行流    | 14.77 | 10.43  | 432,869      | 6,410,789.89  | 4,514,823.67  | -  |

|        |      |             |             |               |       |       |           |               |                |   |
|--------|------|-------------|-------------|---------------|-------|-------|-----------|---------------|----------------|---|
|        |      |             | 16日         | 通受限           |       |       |           |               |                |   |
| 000909 | 数源科技 | 2017年1月13日  | 2019年1月16日  | 非公开发行流<br>通受限 | 14.77 | 9.75  | 432,869   | 6,410,789.89  | 4,220,472.75   | - |
| 002040 | 南京港  | 2017年1月18日  | 2018年1月19日  | 非公开发行流<br>通受限 | 14.82 | 12.46 | 876,011   | 13,000,003.24 | 10,915,097.06  | - |
| 002040 | 南京港  | 2017年1月18日  | 2019年1月21日  | 非公开发行流<br>通受限 | 14.82 | 11.04 | 876,010   | 12,999,988.40 | 9,671,150.40   | - |
| 002050 | 三花智控 | 2017年9月18日  | 2018年9月20日  | 非公开发行流<br>通受限 | 15.00 | 16.89 | 1,116,667 | 16,750,005.00 | 18,860,505.63  | - |
| 002050 | 三花智控 | 2017年9月18日  | 2019年9月20日  | 非公开发行流<br>通受限 | 15.00 | 16.40 | 1,116,666 | 16,749,990.00 | 18,313,322.40  | - |
| 002131 | 利欧股份 | 2016年9月8日   | 2018年9月10日  | 非公开发行流<br>通受限 | 4.96  | 2.47  | 5,031,626 | 24,999,994.42 | 12,428,116.22  | - |
| 002157 | 正邦科技 | 2017年1月9日   | 2018年1月10日  | 非公开发行流<br>通受限 | 6.05  | 5.67  | 7,280,780 | 44,412,758.00 | 41,282,022.60  | - |
| 002157 | 正邦科技 | 2017年1月9日   | 2019年1月10日  | 非公开发行流<br>通受限 | 6.05  | 5.30  | 7,280,779 | 44,412,751.90 | 38,588,128.70  | - |
| 002302 | 西部建设 | 2017年12月25日 | 2018年12月26日 | 非公开发行流<br>通受限 | 8.80  | 15.00 | 1,136,362 | 9,999,985.60  | 17,045,430.00  | - |
| 002302 | 西部建设 | 2017年12月25日 | 2019年12月26日 | 非公开发行流<br>通受限 | 8.80  | 14.56 | 1,136,361 | 9,999,976.80  | 16,545,416.16  | - |
| 002310 | 东方园林 | 2016年11月10日 | 2018年11月12日 | 非公开发行流<br>通受限 | 13.91 | 18.66 | 1,649,928 | 22,999,996.32 | 30,787,656.48  | - |
| 002374 | 丽鹏股份 | 2016年11月1日  | 2018年11月2日  | 非公开发行流<br>通受限 | 7.49  | 5.16  | 2,859,042 | 21,499,995.84 | 14,752,656.72  | - |
| 002400 | 省广股份 | 2016年9月21日  | 2018年9月24日  | 非公开发行流<br>通受限 | 10.42 | 4.95  | 7,658,321 | 79,999,997.28 | 37,908,688.95  | - |
| 002475 | 立讯   | 2016年       | 2018        | 非公开           | 13.05 | 21.76 | 7,023,263 | 92,004,742.03 | 152,826,202.88 | - |

|        |      |             |            |           |       |       |           |               |               |  |   |
|--------|------|-------------|------------|-----------|-------|-------|-----------|---------------|---------------|--|---|
|        | 精密   | 10月21日      | 年10月24日    | 发行流通受限    |       |       |           |               |               |  |   |
| 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 | 12.62 | 1,504,501 | 22,251,569.79 | 18,986,802.62 |  | - |
| 002611 | 东方精工 | 2017年4月24日  | 2019年4月25日 | 非公开发行流通受限 | 14.77 | 11.85 | 1,504,501 | 22,251,569.79 | 17,828,336.85 |  | - |
| 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 | 14.16 | 12.42 | 279,995   | 3,984,328.85  | 3,477,537.90  |  | - |
| 002686 | 亿利达  | 2017年2月24日  | 2019年2月27日 | 非公开发行流通受限 | 14.16 | 11.86 | 279,995   | 3,984,328.85  | 3,320,740.70  |  | - |
| 002705 | 新宝股份 | 2017年3月30日  | 2018年4月2日  | 非公开发行流通受限 | 13.47 | 11.94 | 545,912   | 7,499,992.39  | 6,518,189.28  |  | - |
| 002705 | 新宝股份 | 2017年3月30日  | 2019年4月1日  | 非公开发行流通受限 | 13.47 | 11.39 | 545,911   | 7,499,978.65  | 6,217,926.29  |  | - |
| 002709 | 天赐材料 | 2017年7月31日  | 2018年8月2日  | 非公开发行流通受限 | 41.62 | 42.46 | 592,541   | 24,661,556.42 | 25,159,290.86 |  | - |
| 002709 | 天赐材料 | 2017年7月31日  | 2019年8月2日  | 非公开发行流通受限 | 41.62 | 40.11 | 592,541   | 24,661,556.42 | 23,766,819.51 |  | - |
| 002923 | 润都股份 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日  | 新股流通受限    | 17.01 | 17.01 | 954       | 16,227.54     | 16,227.54     |  | - |
| 300184 | 力源信息 | 2017年4月12日  | 2020年4月14日 | 非公开发行流通受限 | 11.03 | 9.48  | 2,266,546 | 25,000,002.38 | 21,486,856.08 |  | - |
| 300184 | 力源信息 | 2017年4月12日  | 2021年4月14日 | 非公开发行流通受限 | 11.03 | 8.93  | 2,266,545 | 24,999,991.35 | 20,240,246.85 |  | - |
| 300213 | 佳讯飞鸿 | 2016年11月1日  | 2018年11月2日 | 非公开发行流通受限 | 12.80 | 6.96  | 2,057,679 | 26,441,175.15 | 14,321,445.84 |  | - |
| 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 | 33.47 | 1,071,382 | 26,666,697.98 | 35,859,155.54 |  | - |
| 300347 | 泰格医药 | 2017年5月12日  | 2019年5月    | 非公开发行流    | 24.89 | 32.28 | 1,071,381 | 26,666,673.09 | 34,584,178.68 |  | - |

|        |      |             |             |               |       |       |           |               |               |   |
|--------|------|-------------|-------------|---------------|-------|-------|-----------|---------------|---------------|---|
|        |      |             | 16日         | 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<br>通受限 | 42.73 | 33.71 | 213,845   | 9,152,566.00  | 7,208,714.95  | - |
| 300410 | 正业科技 | 2017年3月22日  | 2019年3月25日  | 非公开发行流<br>通受限 | 42.73 | 31.87 | 213,844   | 9,152,523.20  | 6,815,208.28  | - |
| 300664 | 鹏鹞环保 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日   | 新股流<br>通受限    | 8.88  | 8.88  | 3,640     | 32,323.20     | 32,323.20     | - |
| 600277 | 亿利洁能 | 2017年2月14日  | 2018年2月12日  | 非公开发行流<br>通受限 | 6.89  | 6.24  | 5,772,006 | 40,000,001.58 | 36,017,317.44 | - |
| 600277 | 亿利洁能 | 2017年2月14日  | 2019年2月11日  | 非公开发行流<br>通受限 | 6.89  | 6.06  | 5,772,006 | 40,000,001.58 | 34,978,356.36 | - |
| 600339 | 中油工程 | 2017年1月19日  | 2018年1月19日  | 非公开发行流<br>通受限 | 6.16  | 5.66  | 6,902,516 | 42,519,498.56 | 39,068,240.56 | - |
| 600339 | 中油工程 | 2017年1月19日  | 2019年1月21日  | 非公开发行流<br>通受限 | 6.16  | 5.30  | 6,902,516 | 42,519,498.56 | 36,583,334.80 | - |
| 600531 | 豫光金铅 | 2016年12月20日 | 2018年12月17日 | 非公开发行流<br>通受限 | 7.45  | 6.06  | 4,930,986 | 36,982,395.00 | 29,881,775.16 | - |
| 603161 | 科华控股 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日   | 新股流<br>通受限    | 16.75 | 16.75 | 1,239     | 20,753.25     | 20,753.25     | - |
| 603788 | 宁波高发 | 2017年8月16日  | 2018年8月15日  | 非公开发行流<br>通受限 | 38.51 | 33.54 | 882,888   | 34,000,016.88 | 29,612,063.52 | - |
| 603788 | 宁波高发 | 2017年8月16日  | 2019年8月15日  | 非公开发行流<br>通受限 | 38.51 | 31.92 | 882,887   | 33,999,978.37 | 28,181,753.04 | - |
| 603799 | 华友钴业 | 2016年12月23日 | 2018年12月21日 | 非公开发行流<br>通受限 | 31.86 | 69.81 | 1,388,890 | 44,250,035.40 | 96,958,410.90 | - |
| 603889 | 新澳股份 | 2017年8月1日   | 2018年7月30日  | 非公开发行流<br>通受限 | 13.01 | 13.96 | 2,305,919 | 30,000,006.19 | 32,190,629.24 | - |
| 603889 | 新澳股份 | 2017年8月1日   | 2019年7月     | 非公开发<br>行流    | 13.01 | 13.21 | 2,305,918 | 29,999,993.18 | 30,461,176.78 | - |



|  |  |  |      |     |  |  |  |  |  |
|--|--|--|------|-----|--|--|--|--|--|
|  |  |  | 29 日 | 通受限 |  |  |  |  |  |
|--|--|--|------|-----|--|--|--|--|--|

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的非公开发行新增股份上市首日起 12 个月或 36 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%。

2、本基金对限售期内出现权益分配的股票认购价格进行调整，公式为：新认购价格=(原认购价格-股息金额+配股价\*配股率) ÷ (1+配股率+送股率)。

3、截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

#### 7.4.9.2 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 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|-----------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 300156 | 神雾环保 | 2017 年 7 月 17 日 | 重大事项停牌 | 24.16  | 2018 年 1 月 17 日 | 21.74  | 293,300 | 7,995,866.00 | 7,086,128.00 |    |
| 601600 | 中国铝业 | 2017 年 9 月 12 日 | 重大事项停牌 | 6.64   | 2018 年 2 月 26 日 | 7.28   | 743,498 | 5,999,524.02 | 4,936,826.72 |    |

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项及其他金融负债，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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 296,135,130.33 元，属于第二层次的余额为 112,130,752.22 元，属于第三层次的余额为 1,243,886,701.98 元(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)。

本基金持有的金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

## (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

## (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层次的余额为人民币 1,243,886,701.98 元；本报告期因调整估值方法由第二层次转入第三层次的金额为人民币 1,829,622,773.56 元，转出第三层次的金额为人民币 483,727,514.14 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币-102,008,557.44 元。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|----|----|---------------|
|----|----|----|---------------|

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 1 | 权益投资              | 1,552,177,152.03 | 69.63  |
|   | 其中：股票             | 1,552,177,152.03 | 69.63  |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 99,975,432.50    | 4.48   |
|   | 其中：债券             | 99,975,432.50    | 4.48   |
|   | 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          | 522,000,000.00   | 23.42  |
|   | 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      | 51,730,746.60    | 2.32   |
| 8 | 其他各项资产            | 3,288,050.92     | 0.15   |
| 9 | 合计                | 2,229,171,382.05 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 5,707,268.00     | 0.26          |
| B  | 采矿业              | 75,651,575.36    | 3.40          |
| C  | 制造业              | 1,070,551,293.26 | 48.13         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 33,217,104.63    | 1.49          |
| E  | 建筑业              | 60,540,783.92    | 2.72          |
| F  | 批发和零售业           | 52,603,792.93    | 2.37          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 33,768,069.62    | 1.52          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 43,558,566.00    | 1.96          |
| J  | 金融业              | 54,344,910.64    | 2.44          |
| K  | 房地产业             | -                | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 37,908,688.95    | 1.70          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 5,146,468.08     | 0.23          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -             |

|   |           |                  |       |
|---|-----------|------------------|-------|
| P | 教育        | -                | -     |
| Q | 卫生和社会工作   | 70,443,334.22    | 3.17  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -                | -     |
| S | 综合        | 8,735,296.42     | 0.39  |
|   | 合计        | 1,552,177,152.03 | 69.79 |

### 8.2.2 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股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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 | 7,023,263  | 152,826,202.88 | 6.87         |
| 2  | 603799 | 华友钴业 | 1,602,264  | 114,077,406.92 | 5.13         |
| 3  | 000519 | 中兵红箭 | 9,475,103  | 86,934,070.35  | 3.91         |
| 4  | 002157 | 正邦科技 | 14,561,559 | 79,870,151.30  | 3.59         |
| 5  | 600339 | 中油工程 | 13,805,032 | 75,651,575.36  | 3.40         |
| 6  | 600277 | 亿利洁能 | 11,544,012 | 70,995,673.80  | 3.19         |
| 7  | 300347 | 泰格医药 | 2,142,763  | 70,443,334.22  | 3.17         |
| 8  | 603889 | 新澳股份 | 4,611,837  | 62,651,806.02  | 2.82         |
| 9  | 603788 | 宁波高发 | 1,765,775  | 57,793,816.56  | 2.60         |
| 10 | 002709 | 天赐材料 | 1,185,082  | 48,926,110.37  | 2.20         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 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  | 603788 | 宁波高发 | 67,999,995.25 | 3.05 |
| 6  | 603889 | 新澳股份 | 59,999,999.37 | 2.69 |
| 7  | 300347 | 泰格医药 | 53,333,371.07 | 2.39 |
| 8  | 300184 | 力源信息 | 49,999,993.73 | 2.24 |
| 9  | 000862 | 银星能源 | 49,949,998.89 | 2.24 |
| 10 | 002709 | 天赐材料 | 49,323,112.84 | 2.21 |
| 11 | 002611 | 东方精工 | 44,503,139.58 | 2.00 |
| 12 | 002050 | 三花智控 | 33,499,995.00 | 1.50 |
| 13 | 002040 | 南京港  | 25,999,991.64 | 1.17 |
| 14 | 002460 | 赣锋锂业 | 21,978,191.70 | 0.99 |
| 15 | 002302 | 西部建设 | 19,999,962.40 | 0.90 |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 19,988,582.14 | 0.90 |
| 17 | 300410 | 正业科技 | 18,305,089.20 | 0.82 |
| 18 | 300115 | 长盈精密 | 16,991,776.40 | 0.76 |
| 19 | 000001 | 平安银行 | 15,998,943.00 | 0.72 |
| 20 | 002241 | 歌尔股份 | 15,995,823.00 | 0.72 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 002475 | 立讯精密 | 173,779,277.38 | 7.80            |
| 2  | 603799 | 华友钴业 | 95,942,364.12  | 4.31            |
| 3  | 002400 | 省广股份 | 45,853,641.11  | 2.06            |
| 4  | 000901 | 航天科技 | 39,170,750.95  | 1.76            |
| 5  | 002310 | 东方园林 | 33,804,347.82  | 1.52            |
| 6  | 600531 | 豫光金铅 | 31,509,792.99  | 1.41            |
| 7  | 300213 | 佳讯飞鸿 | 17,126,282.90  | 0.77            |
| 8  | 002374 | 丽鹏股份 | 15,862,273.08  | 0.71            |
| 9  | 002131 | 利欧股份 | 15,642,096.86  | 0.70            |
| 10 | 600019 | 宝钢股份 | 14,578,604.72  | 0.65            |
| 11 | 002241 | 歌尔股份 | 13,313,839.10  | 0.60            |
| 12 | 300115 | 长盈精密 | 11,802,624.34  | 0.53            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 13 | 601888 | 中国国旅 | 10,518,956.00 | 0.47 |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 10,000,273.72 | 0.45 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 9,999,345.52  | 0.45 |
| 16 | 600507 | 方大特钢 | 9,165,410.27  | 0.41 |
| 17 | 601377 | 兴业证券 | 9,045,899.80  | 0.41 |
| 18 | 300145 | 中金环境 | 7,911,033.81  | 0.36 |
| 19 | 000001 | 平安银行 | 7,797,375.00  | 0.35 |
| 20 | 600535 | 天士力  | 7,753,072.00  | 0.35 |

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,374,154,063.41 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 722,728,665.24   |

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 99,975,432.50 | 4.50         |
| 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        | 99,975,432.50 | 4.50         |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019557 | 17 国债 03 | 561,250 | 56,046,425.00 | 2.52         |
| 2  | 019563 | 17 国债 09 | 439,950 | 43,929,007.50 | 1.98         |

注：本基金本报告期末仅持有上述两只债券。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体之一中兵红箭股份有限公司在本报告期内出现被监管部门立案调查的情形。

中兵红箭涉嫌信息披露违法违规，被中国证监会立案调查，目前尚未收到中国证监会就上述立案调查事项的结论性意见。中兵红箭 2017 年 12 月 29 日最新公告如下：“2017 年 8 月 1 日，中兵红箭股份有限公司（以下简称“公司”）收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》（编号：湘稽调查字 0579 号），因公司涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对公司进行立案调查。公司已于 2017 年 8 月 2 日在《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网上披露了《中兵红箭股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》（公告编号：2017-58），并分别于 2017 年 9 月 1 日、2017 年 9 月 29 日、2017 年 10 月 31 日和 2017 年 11 月 29 日在《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网上披露了《中兵红箭股份有限公司关于立案调查事项进展暨风险提示的公告》（公告编号：2017-75）、《中兵红箭股份有限公司关于立案调查事项进展暨风险提示的公告》（公告编号：2017-83）、《中兵红箭股份有限公司关于立案调查事项进展暨风险提示的公告》（公告编号：2017-88）和《中兵红箭股份有限公司关于立案调查事项进展暨风险提示的公告》（公告编号：2017-90）。目前证监会调查工作仍在正常进行中，期间公司经营活动未受事件影响，经营情况正常。根据《深圳证券交易所股票上市规则（2014 年修订）》的相关规定，如公司因此受到中国证监会行政处罚，并在行政处罚决定书中被认定构成重大违法行为，或因涉嫌违规披露、不披露重要信息罪被依法移送公安机关的，公司将因触及 13.2.1 条规定的重大信息披露违法情形，公司股票交易被实行退市风险警示。实行退市风险警示三十个交易日期限届满后次一交易日，公司股票将被停牌，直至深圳证券交易所在停牌后的十五个交易日内作出是否暂停公司股票上市的决定。如公司所涉及立案调查事项最终未被中国证监会认定为重大信息披露违法行为，公司股票将不会因此次事件而被实施退市风险警示及暂停上市。截至本公告日，公司尚未收到中国证监会就上述立案调查事项的结论性意见，在此之前，公司将严格按照《深圳证券交易所股票上市规则（2014 年修订）》11.11.3 条的要求，每月至少披露一次调查进展提示性公告。”

本基金做出如下说明：本基金参与认购中兵红箭为募集配套资金而发行的股份，认购股份于



2017 年 1 月 26 日上市，解禁日期为 2018 年 1 月 26 日。中兵红箭股份有限公司实际控制人为中国兵器工业集团公司。目前，中兵红箭股份有限公司业务分为四大板块：智能弹药行业业务板块、专用车业务板块（冷藏保温汽车、爆破器材运输车等）、汽车零部件业务板块（汽车轴类零部件、内燃机配件等）、超硬材料板块（人造金刚石、立方氮化硼等）。本报告期末证监会调查工作仍在正常进行中，期间公司经营活动未受事件影响，经营情况正常。今后，基金管理人将继续加强与该中兵红箭股份有限公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等中兵红箭股份有限公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，其他九名证券发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 272,074.79   |
| 2  | 应收证券清算款 | 199,926.74   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,816,049.39 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,288,050.92 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值    | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明  |
|----|--------|------|----------------|---------------|-----------|
| 1  | 002475 | 立讯精密 | 152,826,202.88 | 6.87          | 非公开发行流通受限 |

|    |        |      |               |      |           |
|----|--------|------|---------------|------|-----------|
| 2  | 603799 | 华友钴业 | 96,958,410.90 | 4.36 | 非公开发行流通受限 |
| 3  | 000519 | 中兵红箭 | 86,934,070.35 | 3.91 | 非公开发行流通受限 |
| 4  | 002157 | 正邦科技 | 79,870,151.30 | 3.59 | 非公开发行流通受限 |
| 5  | 600339 | 中油工程 | 75,651,575.36 | 3.40 | 非公开发行流通受限 |
| 6  | 600277 | 亿利洁能 | 70,995,673.80 | 3.19 | 非公开发行流通受限 |
| 7  | 300347 | 泰格医药 | 70,443,334.22 | 3.17 | 非公开发行流通受限 |
| 8  | 603889 | 新澳股份 | 62,651,806.02 | 2.82 | 非公开发行流通受限 |
| 9  | 603788 | 宁波高发 | 57,793,816.56 | 2.60 | 非公开发行流通受限 |
| 10 | 002709 | 天赐材料 | 48,926,110.37 | 2.20 | 非公开发行流通受限 |

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 19,777       | 113,456.64    | 790,984,949.59 | 35.25%     | 1,452,847,013.21 | 64.75%     |

### 9.2 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<br>额比例 |
|----|---|----------------|--------------|
| 1  | 伦敦市投资管理有限公司一<br>客户资金                    | 112,169,157.00 | 7.37%        |
| 2  | 中国石化财务有限责任公司                            | 50,002,430.00  | 3.29%        |
| 3  | 清华大学教育基金会                               | 41,668,464.00  | 2.74%        |
| 4  | 上海斯诺波投资管理有限公<br>司一私募工场自由之路母基<br>金证券投资基金 | 38,516,233.00  | 2.53%        |
| 5  | 西南证券股份有限公司                              | 30,000,583.00  | 1.97%        |
| 6  | 神华集团有限责任公司企业<br>年金计划一中国建设银行股<br>份有限公司   | 26,534,036.00  | 1.74%        |
| 7  | 南京盛泉恒元投资有限公司                            | 13,691,711.00  | 0.90%        |

|    |                        |               |       |
|----|------------------------|---------------|-------|
|    | —盛泉恒元定增套利多策略<br>6号私募基金 |               |       |
| 8  | 山东金都百货股份有限公司           | 11,540,522.00 | 0.76% |
| 9  | 宋鲁燕                    | 9,580,558.00  | 0.63% |
| 10 | 珠峰财产保险股份有限公司<br>—资本金   | 9,013,830.00  | 0.59% |

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 55,998.91 | 0.0025%  |

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2016年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               | 724,210.63       |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 724,210.86       |
| 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              | 2,243,831,962.80 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人重大人事变动情况如下：

1、公司于 2017 年 1 月 19 日以书面方式召开第一届董事会 2017 年第五次会议，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。

2、公司于 2017 年 7 月 31 日以书面方式召开 2017 年第二次股东会会议，审议通过：

(1)《九泰基金管理有限公司关于任命第二届董事会成员》的议案，议案内容为：根据《公司章程》第六十四条规定，董事每届任期为三年，可连选连任，现对第一届董事会成员吴强先生、吴刚先生、卢伟忠先生、徐艳女士、陈耿先生、袁小文女士进行连选连任，相关任命如下：1) 同意任命吴强先生担任公司第二届董事会董事职务，任期三年；2) 同意任命吴刚先生担任公司第二届董事会董事职务，任期三年；3) 同意任命卢伟忠先生担任公司第二届董事会董事职务，任期三年；4) 同意任命徐艳女士担任公司第二届董事会独立董事职务，任期三年；5) 同意任命陈耿先生担任公司第二届董事会独立董事职务，任期三年；6) 同意任命袁小文女士担任公司第二届董事会独立董事职务，任期三年。

(2)《九泰基金管理有限公司关于任命第二届执行监事成员》的议案，议案内容为：根据《公司章程》第一百条规定，监事的任期为三年，可连选连任。现对公司员工表决选举的执行监事刘开运先生进行连任，对古志鹏先生进行改选，选举股东联合提名的徐磊磊先生担任执行监事，相关任命如下：1) 同意任命徐磊磊先生担任公司第二届监事会执行监事职务，任期三年；2) 同意任命刘开运先生担任公司第二届监事会执行监事职务，任期三年。

3、公司于 2017 年 8 月 24 日以书面方式召开第二届董事会 2017 年第二次会议，同意续聘王玉女士担任公司副总经理，任期三年。

4、公司于 2017 年 10 月 23 日以书面方式召开第二届董事会 2017 年第五次会议，同意谢海波先生辞去公司督察长职务；同意任命陈沛先生担任公司督察长职务，任期三年。

二、托管人基金托管部门重大人事变动情况：

基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 80,000.00 元。截至本报告期末，该会计师事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。本报告期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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易              |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|------|--------|-------------------|--------------|--------------|------------|----|
|      |        | 成交金额              | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 华西证券 |        | 21,188,813,932.71 | 100.00%      | 1,107,145.13 | 100.00%    | -  |
| 东吴证券 | 2      | -                 | -            | -            | -          | -  |

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华西证券 | 145,053,403.40 | 100.00%      | 68,648,600,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 东吴证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |

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。

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。

**§ 12 影响投资者决策的其他重要信息****12.1 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基金份额比例达到或超过 20%的情况。

**12.2 影响投资者决策的其他重要信息**

自 2017 年 9 月 8 日起，本基金持有的流通受限股票根据中国证券投资基金业协会发布的《证

券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行了估值调整。具体请参见本基金管理人 2017 年 9 月 8 日发布的《九泰基金管理有限公司关于调整旗下证券投资基金持有流通受限股票估值方法的公告》。

因九泰基金管理有限公司第一届董事会任期届满，根据《公司章程》的规定，经公司 2017 年第二次股东会会议审议通过，选举产生公司第二届董事会成员，共 6 名董事：吴强先生、吴刚先生、卢伟忠先生、徐艳女士、陈耿先生、袁小文女士。其中徐艳、陈耿、袁小文为独立董事。相关人员无变更，并于 2017 年 8 月 1 日进行了公告，详见《九泰基金管理有限公司关于董事会成员换届的公告》。

九泰基金管理有限公司  
2018 年 3 月 28 日