

# 九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42

7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	九泰天宝混合	
基金主代码	000892	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 23 日	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,403,700,308.48 份	
下属分级基金的基金简称:	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C
下属分级基金的交易代码:	000892	002028
报告期末下属分级基金的份额总额	2,163,324.82 份	2,401,536,983.66 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理，在有效控制组合风险的前提下，力争为投资者获取长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金重点关注在中国经济结构优化、产业结构升级或技术创新过程中成长性确定且估值合理的上市公司、价值被严重低估的传统行业的上市公司，以及上市公司事件驱动带来的投资机会。通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析进行大类资产配置；通过定性分析方法和定量分析方法相结合的策略进行股票投资；通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势进行债券投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		九泰基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢海波	林葛
	联系电话	010-52601690	010-66060069
	电子邮箱	service@jtamc.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-628-0606	95599
传真		010-66067330	010-68121816
注册地址		北京市丰台区丽泽路 18 号	北京市东城区建国门内大街 69

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	本基金选定的信息披露报纸为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金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	九泰基金管理有限公司	北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦西区 6 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	58,812.93	43,290,424.96
本期利润	52,126.14	38,633,824.13
加权平均基金份额本期利润	0.0219	0.0159
本期加权平均净值利润率	2.08%	1.52%
本期基金份额净值增长率	2.30%	1.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	145,711.08	141,067,891.62
期末可供分配基金份额利润	0.0674	0.0587
期末基金资产净值	2,309,057.59	2,542,631,725.60
期末基金份额净值	1.067	1.059
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	6.70%	1.63%

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

九泰天宝混合 A

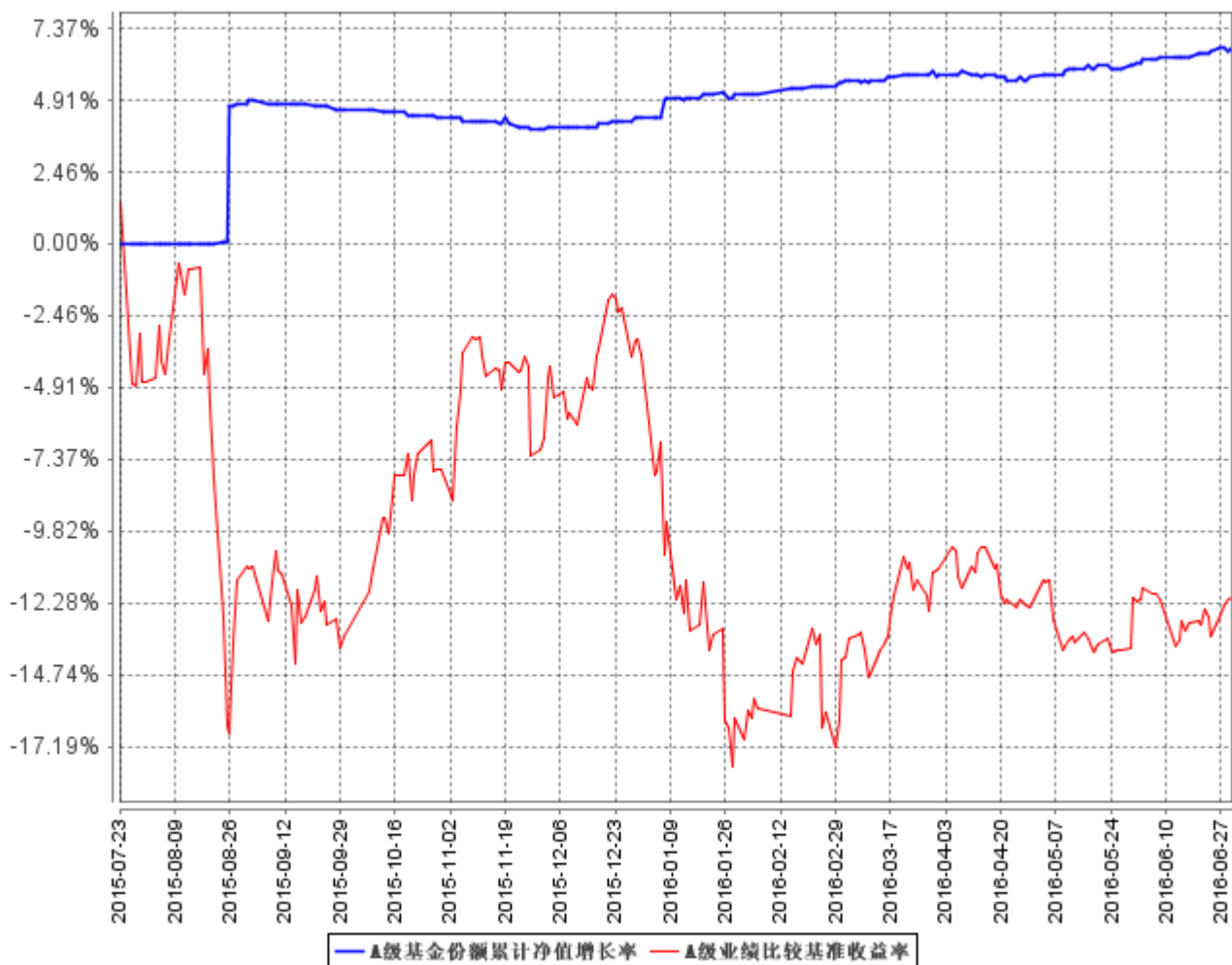
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.57%	0.05%	0.02%	0.59%	0.55%	-0.54%
过去三个月	0.95%	0.06%	-1.03%	0.61%	1.98%	-0.55%
过去六个月	2.30%	0.08%	-8.65%	1.11%	10.95%	-1.03%
自基金合同生效起至今	6.70%	0.31%	-12.09%	1.30%	18.79%	-0.99%

九泰天宝混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.57%	0.05%	0.02%	0.59%	0.55%	-0.54%
过去三个月	0.95%	0.06%	-1.03%	0.61%	1.98%	-0.55%
过去六个月	1.53%	0.06%	-8.65%	1.11%	10.18%	-1.05%
自基金合同生效起至今	1.63%	0.06%	-7.95%	1.08%	9.58%	-1.02%

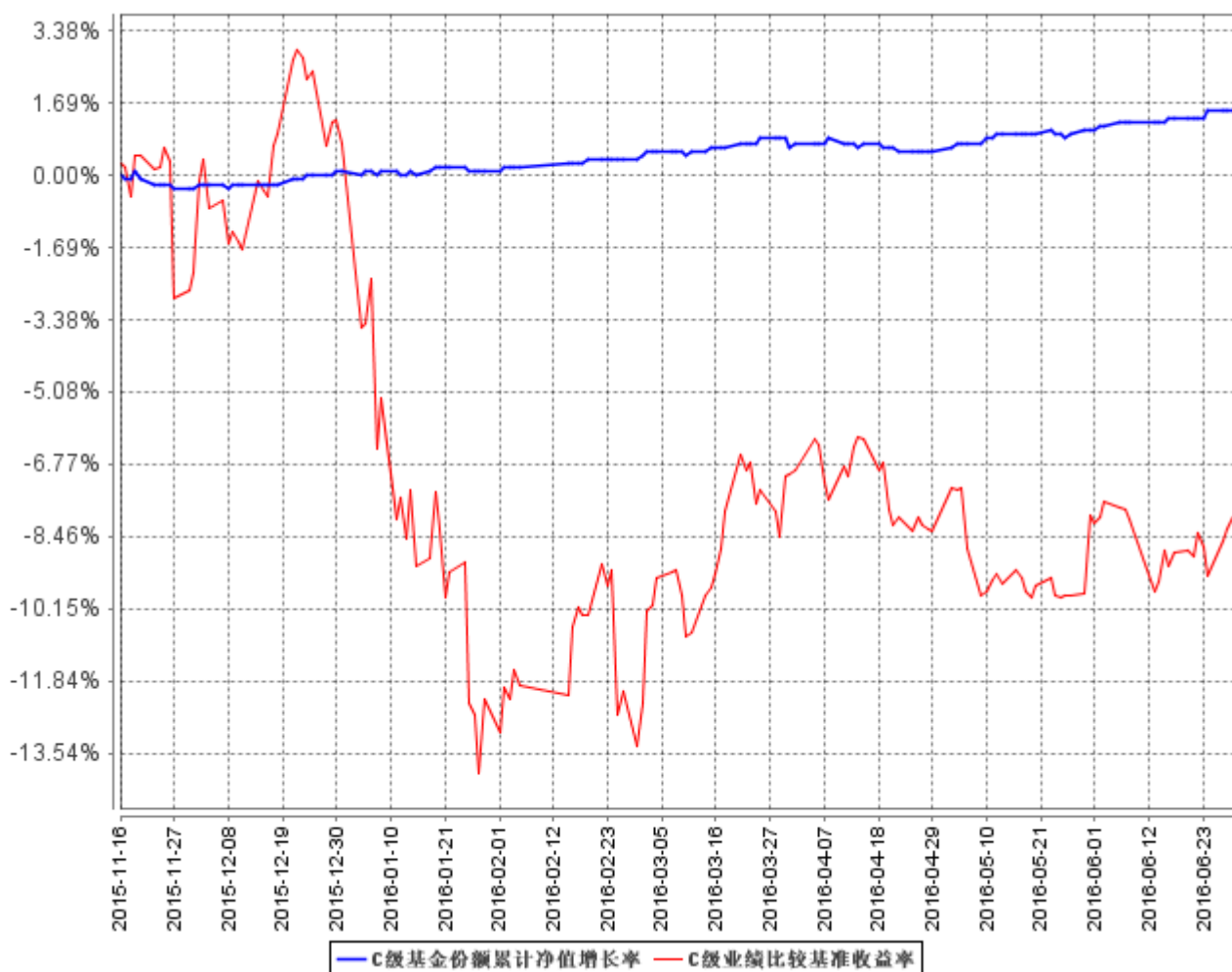
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**





C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金合同于 2015 年 7 月 23 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

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基金合同有关投资比例的约定。

## § 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（2016 年 6 月 30 日），基金管理人共管理七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，证券投资基金规模约为 69.33 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王玥晰	基金经理	2015 年 8 月 3 日	-	8	经济系金融经济学硕士，中国籍，全国银行间同业拆解市场本币交易员。8 年证券从业经验，具有基金从业资格。历任诺安基金管理有限公司债券交易员，基金经理助理，诺安货币市场基金 A/B 基金经理（2013 年 7 月 31 日至 2015 年 1 月 6 日）。2015 年 6 月加入九泰基金管理有限公司担任基金经理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3.2 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

九泰天宝基金以做绝对收益的思路，分析各大类资产的风险收益水平，进行组合配置。积极参与新股及新债申购，辅以货币市场工具的操作。报告期内，九泰天宝基金的流动性没有出现异常，满足了投资者正常的申购及赎回要求。九泰天宝基金把保证资产的安全性放在首位，在参考外部评级数据的基础上，进行严谨的内部评级筛选，严格把控信用风险。产品在报告期内取得正收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值 A 类增长率为 2.30%，业绩比较基准收益率为-8.65%；本报告期基金份额净值 C 类增长率为 1.53%，业绩比较基准收益率为-8.65%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济增长动能减弱，预计下半年财政持续发力，政府投资继续托底经济。企业去杠杆，破旧立新后的新经济增速将保持低位。通胀保持平稳。人民币仍有贬值压力，外汇占款的减少将扩大基础货币的缺口。在经济稳增长、填补基础货币缺口和全球大放水的背景下，年内或有降准空间。整体的投资收益率将持续降低。展望下半年，基本面、政策面和资金面均有利于债券走势，银行理财新规的出台也将助推债券收益率的下行。

## 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十九条中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 141,213,602.70 元，其中：九泰天宝灵活配置混合（A 类）期末可供分配利润为 145,711.08 元，（九泰天宝灵活配置混合（A 类）的未分配利润已实现部分为 145,711.08 元，未分配利润未实现部分为 21.69 元）；九泰天宝灵活配置混合（C 类）期末可供分配利润为 141,067,891.62 元，九泰天宝灵活配置混合（C 类）的未分配利润已实现部分为 141,067,891.62 元，未分配利润未实现部分为 26,850.32 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

本基金在本报告期内持续 59 个交易日出现持有人低于 200 人的情形，基金管理人已通过持续营销等方式解决；本报告期内未出现基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—九泰基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，九泰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本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本基金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：九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,977,711.08	371,058,664.34
结算备付金		1,193,452.39	29,493,522.59
存出保证金		156,075.33	401,095.03
交易性金融资产	6.4.7.2	2,365,239,685.82	41,664,725.30
其中：股票投资		29,762,781.32	38,986,723.50
基金投资		-	-
债券投资		2,335,476,904.50	2,678,001.80
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	143,280,916.87	1,670,403,915.50
应收证券清算款		5,078,481.64	491,074,922.90
应收利息	6.4.7.5	33,724,350.21	1,590,016.46
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	21,646.85	-

资产总计		2, 552, 672, 320. 19	2, 605, 686, 862. 12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<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		4, 999, 877. 50	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		996. 54	61, 576. 39
应付管理人报酬		1, 663, 976. 49	1, 764, 081. 75
应付托管费		311, 995. 61	330, 765. 33
应付销售服务费		415, 615. 94	439, 697. 66
应付交易费用	6.4.7.7	34, 620. 01	683, 407. 01
应交税费		-	-
应付利息		464. 97	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	303, 989. 94	160, 154. 71
负债合计		7, 731, 537. 00	3, 439, 682. 85
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2, 403, 700, 308. 48	2, 495, 402, 002. 98
未分配利润	6.4.7.10	141, 240, 474. 71	106, 845, 176. 29
所有者权益合计		2, 544, 940, 783. 19	2, 602, 247, 179. 27
负债和所有者权益总计		2, 552, 672, 320. 19	2, 605, 686, 862. 12

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，天宝 A 份额净值为人民币 1.067 元，天宝 C 份额净值为人民币 1.059 元；基金份额总额为 2, 403, 700, 308. 48 份，天宝 A 份额 2, 163, 324. 82 份，天宝 C 份额 2, 401, 536, 983. 66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		54, 461, 822. 54
1.利息收入		45, 940, 835. 18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	654, 738. 11
债券利息收入		40, 274, 028. 70
资产支持证券利息收入		338, 858. 08
买入返售金融资产收入		4, 673, 210. 29
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13, 170, 460. 54

其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,280,453.66
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,615,009.62
资产支持证券投资收益		-23,863.56
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	298,860.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-4,663,287.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,814.44
<b>减：二、费用</b>		15,775,872.27
1. 管理人报酬		10,153,353.27
2. 托管费		1,903,753.70
3. 销售服务费		2,535,811.79
4. 交易费用	6.4.7.18	86,313.14
5. 利息支出		837,900.78
其中：卖出回购金融资产支出		837,900.78
6. 其他费用	6.4.7.19	258,739.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		38,685,950.27
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		38,685,950.27

注：本基金合同于 2015 年 7 月 23 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：九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	2,495,402,002.98	106,845,176.29	2,602,247,179.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,685,950.27	38,685,950.27
三、本期基金份额交易	-91,701,694.50	-4,290,651.85	-95,992,346.35

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	332,285.34	19,398.72	351,684.06
2.基金赎回款	-92,033,979.84	-4,310,050.57	-96,344,030.41
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)	2,403,700,308.48	141,240,474.71	2,544,940,783.19

注：本基金合同于 2015 年 7 月 23 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

九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金，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【2014】1135 号文《关于准予九泰天宝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作为发起人于 2015 年 6 月 24 日至 2015 年 7 月 21 日向社会公开募集，募集结束经北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 7 月 23 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 215,045,061.67 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 210,801.39 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 215,255,863.06 元，折合 215,255,863.06 份基金份额。本基金的基金管理人、注册登记机构均为九泰基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。



本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》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) 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；
- (3) 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，2015 年 9 月 8 日之前其股息红利所得暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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；

(4) 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；

(5) 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) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	3,977,711.08
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,977,711.08

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	32,202,167.32	29,762,781.32	-2,439,386.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	446,423,623.33	443,477,904.50
	银行间市场	1,887,029,459.84	1,891,999,000.00
	合计	2,333,453,083.17	2,335,476,904.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,365,655,250.49	2,365,239,685.82	-415,564.67

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金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 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	143,280,916.87	103,280,616.87
合计	143,280,916.87	103,280,616.87

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金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 2016年6月30日
应收活期存款利息	7,443.90
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	3,218.84
应收债券利息	33,618,075.09
应收买入返售证券利息	95,549.20
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	63.18
合计	33,724,350.21

注：其他是指结算保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	21,646.85
合计	21,646.85

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,775.45
银行间市场应付交易费用	28,844.56
合计	34,620.01

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.50
预提费用	303,987.44
-	-
合计	303,989.94

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

九泰天宝混合 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,326,557.78	7,326,557.78
本期申购	332,285.34	332,285.34
本期赎回(以“-”号填列)	-5,495,518.30	-5,495,518.30
- 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	2,163,324.82	2,163,324.82

金额单位：人民币元

九泰天宝混合 C		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,488,075,445.20	2,488,075,445.20
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-86,538,461.54	-86,538,461.54
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,401,536,983.66	2,401,536,983.66

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

九泰天宝混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	303,511.56	13,439.23	316,950.79
本期利润	58,812.93	-6,686.79	52,126.14
本期基金份额交易产生的变动数	-216,613.41	-6,730.75	-223,344.16
其中：基金申购款	19,551.87	-153.15	19,398.72
基金赎回款	-236,165.28	-6,577.60	-242,742.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	145,711.08	21.69	145,732.77

单位：人民币元

九泰天宝混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	101,965,692.98	4,562,532.52	106,528,225.50
本期利润	43,290,424.96	-4,656,600.83	38,633,824.13
本期基金份额交易产生的变动数	-4,188,226.32	120,918.63	-4,067,307.69
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-4,188,226.32	120,918.63	-4,067,307.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	141,067,891.62	26,850.32	141,094,741.94

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	146,343.98
定期存款利息收入	348,430.58
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	156,003.22
其他	3,960.33
合计	654,738.11

**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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	18,779,658.14
减：卖出股票成本总额	7,499,204.48
买卖股票差价收入	11,280,453.66

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,615,009.62
债券投资收益——赎回差价收入	0.00
债券投资收益——申购差价收入	0.00
合计	1,615,009.62

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,646,174,863.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,565,028,891.56
减：应收利息总额	79,530,962.60
买卖债券差价收入	1,615,009.62

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末取得债券投资收益赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末取得债券投资收益申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	61,107,472.87
减：卖出资产支持证券成本总额	60,258,367.66
减：应收利息总额	872,968.77
资产支持证券投资收益	-23,863.56

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期末进行衍生工具投资。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	298,860.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	298,860.82

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,663,287.62
——股票投资	-6,426,107.15
——债券投资	1,762,819.53
——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	-4,663,287.62

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	13,814.44

合计	13,814.44
----	-----------

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	57,738.14
银行间市场交易费用	28,575.00
合计	86,313.14

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	43,162.47
信息披露费	149,178.12
银行汇划费	48,009.00
其他	300.00
帐户维护费	18,090.00
-	-
合计	258,739.59

### 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，本基金并无须作披露的重大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

1. 2016年2月22日，基金管理人股东“九州证券有限公司”变更名称为“九州证券股份有限公司”；

2. 2016年3月28日，基金管理人全资控股子公司九泰基金销售（北京）管理有限公司受让九泰财富管理有限公司100%股权。



**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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
九州证券股份有限公司	基金管理人的股东

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
九州证券	10,704,142.95	49.87%

**6.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
九州证券	22,311,428.63	0.59%

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
九州证券	9,968.74	49.87%	5,775.45	100.00%

## 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
	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	10,153,353.27
其中：支付销售机构的客户维护费	2,578.54

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	1,903,753.70

注：基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	2,535,811.79	2,535,811.79
合计	-	2,535,811.79	2,535,811.79

注：基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 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

单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行股份有限公司	-	99,920,434.25	-	-	200,000,000.00	10,684.93

#### 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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

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。

#### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	3,977,711.08	146,343.98

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未参与关联方主承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2016 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
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

### 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
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项停牌	19.22	-	-	79,600	1,470,626.36	1,529,912.00	-
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-
002266	浙富控股	2016年5月25日	重大事项停牌	5.35	-	-	21,700	195,556.19	116,095.00	-

注：本基金截至 2016 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金截至 2016 年 06 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,999,877.50, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
011699397	16 锡产业 SCP002	2016 年 8 月 1 日	100.01	50,000	5,000,500.00
合计				50,000	5,000,500.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 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, 属于较高风险收益特征的证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制组合风险的前提下, 力争为投资者获取长期稳健的投资回报。

本基金的基金管理人建立了董事会及风险控制委员会、总经理、风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风控法务部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工商银行，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均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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日
A-1	289,969,000.00
A-1 以下	-
未评级	1,069,698,000.00
合计	1,359,667,000.00

注：以上债券不包括国债、政策性金融债、央行票据，未评级的债券主要包括超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	49,900,000.00	2,008,001.80
AAA 以下	588,057,904.50	670,000.00
未评级	-	-
合计	637,957,904.50	2,678,001.80

注：以上债券不包括国债、政策性金融债、央行票据。

#### 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

风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风控法务部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 06 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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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

及存出保证金等。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 2016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	3,977,711.08	-	-	-	-	-	3,977,711.08
结算备付金	1,193,452.39	-	-	-	-	-	1,193,452.39
存出保证金	156,075.33	-	-	-	-	-	156,075.33
交易性金融资产	100,075,000.00	40,040,000.00	1,269,587,000.00	717,834,904.50	207,940,000.00	29,762,781.32	2,365,239,685.82
买入返售金融资产	143,280,916.87	-	-	-	-	-	143,280,916.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,078,481.64	5,078,481.64
应收利息	-	-	-	-	-	33,724,350.21	33,724,350.21
其他资产	-	-	-	-	-	21,646.85	21,646.85
资产总计	248,683,155.67	40,040,000.00	1,269,587,000.00	717,834,904.50	207,940,000.00	68,587,260.02	2,552,672,320.19
负债							
卖出回购金融资产款	4,999,877.50	-	-	-	-	-	4,999,877.50
应付赎回款	-	-	-	-	-	996.54	996.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,663,976.49	1,663,976.49
应付托管费	-	-	-	-	-	311,995.61	311,995.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	415,615.94	415,615.94
应付交	-	-	-	-	-	34,620.01	34,620.01



易费用							
应付利息	-	-	-	-	-	464.97	464.97
其他负债	-	-	-	-	-	303,989.94	303,989.94
负债总计	4,999,877.50	-	-	-	-	2,731,659.50	7,731,537.00
利率敏感度缺口	243,683,278.17	40,040,000.00	1,269,587,000.00	717,834,904.50	207,940,000.00	65,855,600.52	2,544,940,783.19
上年度末 2015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	371,058,664.34	-	-	-	-	-	371,058,664.34
结算备付金	29,493,522.59	-	-	-	-	-	29,493,522.59
存出保证金	401,095.03	-	-	-	-	-	401,095.03
交易性金融资产	-	-	-	2,008,001.80	670,000.00	38,986,723.50	41,664,725.30
买入返售金融资产	1,670,403,915.50	-	-	-	-	-	1,670,403,915.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-491,074,922.90	491,074,922.90
应收利息	-	-	-	-	-	1,590,016.46	1,590,016.46
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,071,357,197.46	-	-	2,008,001.80	670,000.00	531,651,662.86	2,605,686,862.12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	61,576.39	61,576.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,764,081.75	1,764,081.75
应付托	-	-	-	-	-	330,765.33	330,765.33

管费							
应付销售服务费		-	-	-	-	439,697.66	439,697.66
应付交易费用		-	-	-	-	683,407.01	683,407.01
其他负债		-	-	-	-	160,154.71	160,154.71
负债总计		-	-	-	-	3,439,682.85	3,439,682.85
利率敏感度缺口	2,071,357,197.46	-	-	2,008,001.80	670,000.00	528,211,980.01	2,602,247,179.27

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	9,334,900.58	34.85
	市场利率上升 25 个基点	-9,198,755.63	-34.32

#### 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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

**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 2016年6月30日		上年度末 2015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	29,762,781.32	1.17	38,986,723.50	1.50
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	2,678,001.80	0.10
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	29,762,781.32	1.17	41,664,725.30	1.60

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有交易性权益类金融资产占资产净值比例较低，其他价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

**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**

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。

**§ 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	29,762,781.32	1.17
	其中：股票	29,762,781.32	1.17
2	固定收益投资	2,335,476,904.50	91.49
	其中：债券	2,335,476,904.50	91.49
	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	143,280,916.87	5.61
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	103,280,616.87	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,171,163.47	0.20
7	其他各项资产	38,980,554.03	1.53
8	合计	2,552,672,320.19	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	182,208.00	0.01
B	采矿业	2,863,522.35	0.11
C	制造业	12,306,130.07	0.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	166,432.00	0.01
E	建筑业	1,187,245.88	0.05
F	批发和零售业	925,785.20	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	34,776.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	340,760.40	0.01
J	金融业	10,467,592.73	0.41
K	房地产业	259,788.00	0.01
L	租赁和商务服务业	183,690.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	227,139.25	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	597,585.34	0.02
S	综合	-	-
	合计	29,762,781.32	1.17

## 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

## 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	600028	中国石化	569,200	2,686,624.00	0.11
2	601328	交通银行	460,162	2,590,712.06	0.10
3	601398	工商银行	563,200	2,500,608.00	0.10
4	600036	招商银行	91,148	1,595,090.00	0.06
5	000651	格力电器	79,600	1,529,912.00	0.06
6	600016	民生银行	165,321	1,476,316.53	0.06
7	000858	五粮液	30,800	1,001,924.00	0.04
8	601988	中国银行	287,500	922,875.00	0.04
9	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
10	002415	海康威视	33,150	711,399.00	0.03
11	002024	苏宁云商	61,800	671,148.00	0.03
12	002450	康得新	37,773	645,918.30	0.03
13	002304	洋河股份	8,798	632,752.16	0.02
14	000625	长安汽车	36,200	494,854.00	0.02
15	000423	东阿阿胶	9,200	486,036.00	0.02
16	000538	云南白药	7,214	463,860.20	0.02
17	002142	宁波银行	30,000	443,400.00	0.02
18	002202	金风科技	27,700	419,101.00	0.02
19	000568	泸州老窖	11,800	350,460.00	0.01
20	000895	双汇发展	16,388	342,181.44	0.01
21	002236	大华股份	24,350	318,985.00	0.01
22	000623	吉林敖东	12,306	307,034.70	0.01
23	300027	华谊兄弟	22,391	303,174.14	0.01
24	601818	光大银行	77,600	291,776.00	0.01
25	600000	浦发银行	18,700	291,159.00	0.01
26	002252	上海莱士	7,600	286,368.00	0.01
27	000630	铜陵有色	107,800	273,812.00	0.01
28	000963	华东医药	3,778	254,637.20	0.01
29	002385	大北农	29,700	239,382.00	0.01
30	000887	中鼎股份	10,500	232,155.00	0.01

31	000413	东旭光电	27,000	231,930.00	0.01
32	300072	三聚环保	8,267	228,499.88	0.01
33	000826	启迪桑德	7,435	227,139.25	0.01
34	002038	双鹭药业	6,999	211,229.82	0.01
35	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
36	002030	达安基因	7,260	201,828.00	0.01
37	000425	徐工机械	65,600	200,736.00	0.01
38	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
39	002081	金螳螂	19,500	195,390.00	0.01
40	000581	威孚高科	9,400	189,504.00	0.01
41	002400	省广股份	13,000	183,690.00	0.01
42	000998	隆平高科	9,600	182,208.00	0.01
43	002422	科伦药业	11,200	172,592.00	0.01
44	601166	兴业银行	11,200	170,688.00	0.01
45	002353	杰瑞股份	8,400	161,952.00	0.01
46	300002	神州泰岳	15,200	161,728.00	0.01
47	300251	光线传媒	13,400	154,904.00	0.01
48	000566	海南海药	14,000	152,740.00	0.01
49	000697	炼石有色	6,571	150,147.35	0.01
50	000778	新兴铸管	31,600	146,624.00	0.01
51	300133	华策影视	8,960	139,507.20	0.01
52	002250	联化科技	9,400	134,608.00	0.01
53	002146	荣盛发展	19,900	133,728.00	0.01
54	000800	一汽轿车	12,200	132,736.00	0.01
55	000883	湖北能源	28,200	130,566.00	0.01
56	000786	北新建材	14,100	128,028.00	0.01
57	000656	金科股份	33,000	126,060.00	0.00
58	300216	千山药机	3,800	120,194.00	0.00
59	600519	贵州茅台	400	116,768.00	0.00
60	002266	浙富控股	21,700	116,095.00	0.00
61	002375	亚厦股份	9,700	109,610.00	0.00
62	300287	飞利信	8,100	108,540.00	0.00
63	002325	洪涛股份	11,640	106,971.60	0.00
64	601169	北京银行	10,100	104,737.00	0.00
65	600887	伊利股份	4,900	81,683.00	0.00
66	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
67	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
68	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
69	600104	上汽集团	2,680	54,377.20	0.00

70	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
71	600015	华夏银行	4,126	40,806.14	0.00
72	601939	建设银行	8,300	39,425.00	0.00
73	601006	大秦铁路	5,400	34,776.00	0.00
74	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
75	600795	国电电力	9,200	26,956.00	0.00
76	601857	中国石油	3,700	26,751.00	0.00
77	600585	海螺水泥	1,700	24,718.00	0.00
78	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
79	600066	宇通客车	1,100	21,780.00	0.00
80	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
81	600352	浙江龙盛	2,300	19,826.00	0.00
82	600660	福耀玻璃	1,200	16,800.00	0.00
83	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
84	600398	海澜之家	1,100	12,430.00	0.00
85	600315	上海家化	400	11,536.00	0.00
86	600312	平高电气	600	9,396.00	0.00
87	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
88	600027	华电国际	1,800	8,910.00	0.00
89	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600028	中国石化	2,682,400.00	0.10
2	002797	第一创业	212,044.56	0.01
3	601966	玲珑轮胎	199,126.18	0.01
4	601611	中国核建	128,594.73	0.00
5	603377	东方时尚	113,750.40	0.00
6	601900	南方传媒	112,559.06	0.00
7	002790	瑞尔特	100,209.52	0.00
8	002791	坚朗五金	85,697.61	0.00
9	603608	天创时尚	78,341.20	0.00
10	603919	金徽酒	72,236.82	0.00
11	002792	通宇通讯	70,678.14	0.00

12	002788	鹭燕医药	68,314.95	0.00
13	603868	飞科电器	59,372.79	0.00
14	603027	千禾味业	53,375.52	0.00
15	601127	小康股份	50,326.22	0.00
16	300511	雪榕生物	48,307.04	0.00
17	300512	中亚股份	39,164.43	0.00
18	603861	白云电器	34,476.00	0.00
19	002789	建艺集团	33,795.00	0.00
20	300474	景嘉微	33,649.88	0.00

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	3,815,731.40	0.15
2	603508	思维列控	1,631,378.50	0.06
3	002781	奇信股份	1,084,320.00	0.04
4	603866	桃李面包	1,043,066.97	0.04
5	603999	读者传媒	1,036,206.00	0.04
6	300495	美尚生态	765,107.75	0.03
7	300494	盛天网络	587,399.76	0.02
8	002782	可立克	579,072.00	0.02
9	603778	乾景园林	496,230.00	0.02
10	002797	第一创业	490,253.40	0.02
11	002787	华源包装	415,456.50	0.02
12	603299	井神股份	411,557.49	0.02
13	601900	南方传媒	402,127.80	0.02
14	002780	三夫户外	370,864.00	0.01
15	002777	久远银海	355,873.44	0.01
16	603377	东方时尚	348,187.20	0.01
17	300490	华自科技	316,438.80	0.01
18	300474	景嘉微	313,555.70	0.01
19	300491	通合科技	312,178.50	0.01
20	300516	久之洋	261,884.67	0.01



### 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	2,682,400.00
卖出股票收入（成交）总额	18,779,658.14

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	337,852,000.00	13.28
	其中：政策性金融债	337,852,000.00	13.28
4	企业债券	535,002,904.50	21.02
5	企业短期融资券	1,359,667,000.00	53.43
6	中期票据	100,410,000.00	3.95
7	可转债（可交换债）	2,545,000.00	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,335,476,904.50	91.77

### 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	136176	16 绿地 01	2,000,000	194,880,000.00	7.66
2	150218	15 国开 18	1,500,000	154,725,000.00	6.08
3	101580013	15 华菱 MTN001	1,000,000	100,410,000.00	3.95
4	011699392	16 南汇 SCP002	1,000,000	100,020,000.00	3.93
5	011699397	16 锡产业 SCP002	1,000,000	100,010,000.00	3.93

### 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	156,075.33
2	应收证券清算款	5,078,481.64
3	应收股利	-
4	应收利息	33,724,350.21
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	21,646.85
8	其他	-
9	合计	38,980,554.03

#### 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处于转股期的可转换债券。

#### 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	000651	格力电器	1,529,912.00	0.06	重大事项停牌
2	601611	中国核建	775,274.28	0.03	临时停牌

#### 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
九泰天宝混合 A	218	9,923.51	-	-	2,163,324.82	100.00%
九泰天宝混合 C	1	2,401,536,983.66	2,401,536,983.66	100.00%	-	-

合计	219	10,975,800.50	2,401,536,983.66	99.91%	2,163,324.82	0.09%
----	-----	---------------	------------------	--------	--------------	-------

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	九泰天宝混合 A	162,652.95	7.5187%
	九泰天宝混合 C	-	-
	合计	162,652.95	0.0068%

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 23 日）基金份额总额	215,255,863.06	-
本报告期期初基金份额总额	7,326,557.78	2,488,075,445.20
本报告期基金总申购份额	332,285.34	-
减：本报告期基金总赎回份额	5,495,518.30	86,538,461.54
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,163,324.82	2,401,536,983.66

## § 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：公司于 2016 年 1 月 27 日以书面方式召开 2016 年第一次股东会会议，审议同意龚六堂先生辞去公司第一届董事会独立董事职务；任命陈耿先生担任公司第一届董事会独立董事职务，任期为：原独立董事龚六堂先生任期的剩余期限。

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

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变更。

### 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

本报告期内无涉及管理人、托管人及高级管理人员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	
联讯证券	2	10,757,915.19	50.13%	10,018.99	50.13%	-
九州证券	2	10,704,142.95	49.87%	9,968.74	49.87%	-

## 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
联讯证券	3,728,753,108.73	99.41%	2,230,000,000.00	100.00%	-	-
九州证券	22,311,428.63	0.59%	-	-	-	-

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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	九泰基金管理有限公司关于交易所指数发生不可恢复熔断导致我公司部分基金业务办理时间调整的公告	公司网站	2016年1月5日
2	九泰基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年1月6日
3	九泰基金管理有限公司关于交易所指数发生不可恢复熔断导致我公司部分基金业务办理时间调整的公告	公司网站	2016年1月7日
4	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年1月8日
5	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016年1月14日
6	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金2015年第4季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016年1月22日
7	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司作为我公司部分开放式基金销售机构	证监会指定报刊和公司网站	2016年1月26日

	并开通基金定投、转换业务及参与费率优惠活动的公告		
8	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 27 日
9	关于增加上海汇付金融服务有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
10	关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
11	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
12	关于增加陆金所资管公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
13	关于增加珠海盈米财富管理有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
14	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	公司网站	2016 年 3 月 4 日
15	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
16	关于九泰基金管理有限公司电子直销交易系统维护的公告	公司网站	2016 年 3 月 14 日
17	关于增加九泰基金销售（北京）有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 17 日
18	关于增加深圳富济财富管理有限公司作为我公司开放式基金销售机构并开通基金定投、转换业务及参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 18 日
19	关于九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额恢复申购业务的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 29 日
20	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告	公司网站	2016 年 3 月 30 日
21	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 30 日
22	九泰基金管理有限公司关于九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金增加销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 31 日
23	关于增加首创证券有限责任公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 6 日
24	关于增加首创证券有限责任公司为我公司所管理部分基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 11 日
25	关于增加华融证券股份有限公司为我公司	证监会指定报刊	2016 年 4 月 12 日

	所管理部分开放式基金销售机构的公告	和公司网站	
26	关于增加华融证券股份有限公司为我公司所管理部分基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 14 日
27	关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 18 日
28	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 20 日
29	关于增加大泰金石投资管理有限公司作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 22 日
30	关于增加湘财证券投资管理有限公司作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 4 月 22 日
31	关于增加北京汇成基金销售有限公司作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 9 日
32	关于增加乾道金融公司为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 9 日
33	九泰基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 14 日
34	关于九泰基金管理有限公司所管理部分开放式基金开通电子直销定期定额申购业务及费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 16 日
35	关于增加上海大智慧财富管理有限公司为我公司所管理基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 19 日
36	关于增加深圳金斧子作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 19 日
37	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 5 月 20 日
38	关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 27 日
39	关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为我公司所管理基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 2 日
40	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 7 日
41	关于增加大泰金石投资管理有限公司作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 16 日



42	关于增加湘财证券股份有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
43	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
44	九泰基金管理有限公司关于调整开户证件类型公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
45	关于增加深圳前海京西票号基金销售有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无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天宝灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、证监会要求的其他文件

### 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，也可按工本费购买复印件。

九泰基金管理有限公司  
2016 年 8 月 26 日