

九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资 基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 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	九泰久盛量化混合	
基金主代码	001897	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 11 月 10 日	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	649,301,062.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	九泰久盛量化混合 A	九泰久盛量化混合 C
下属分级基金的交易代码:	001897	004510
报告期末下属分级基金的份额总额	645,865,501.84 份	3,435,560.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	采用多策略量化模型，在有效控制组合风险的前提下，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。
投资策略	本基金是混合型基金，主要目的是在市场中找出具有投资价值的标的，实现资产的长期保值增值，投资主要依托于量化多策略体系平台来实现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中等风险收益特征的证券投资基金品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛
	联系电话	010-57383799
	电子邮箱	chenpei@jtamc.com
客户服务电话	400-628-0606	95588
传真	010-57383766	010-66105798

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		2015 年 11 月 10 日(基金合同生效日)- 2015 年 12 月 31 日	
	九泰久盛量化混合 A	九泰久盛量化混合 C	九泰久盛量化混合 A	九泰久盛量化混合 C	九泰久盛量化混合 A	九泰久盛量化混合 C
本期已实现收益	39,989,296.29	3,163,533.60	10,615,567.56	-	7,244,098.12	-
本期利润	36,059,702.15	2,115,458.52	6,686,448.82	-	11,834,400.17	-
加权平均基金份额本期利润	0.0922	0.1747	0.0321	-	0.0344	-
本期基金份额净值增长率	7.53%	12.43%	5.96%	-	4.10%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0002	0.0002	0.0963	-	0.0255	-
期末基金资产净值	650,050,770.42	3,458,910.41	318,445,483.59	-	231,212,269.24	-
期末基金份额净值	1.006	1.007	1.103	-	1.041	-

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、本基金基金合同于 2015 年 11 月 10 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算；

5、自 2017 年 5 月 16 日起，本基金分设两类基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额，详情请查阅相关公告。

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

九泰久盛量化混合 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
过去三个月	-4.11%	0.93%	3.89%	0.64%	-8.00%	0.29%
过去六个月	8.12%	0.90%	7.81%	0.56%	0.31%	0.34%
过去一年	7.53%	0.94%	16.89%	0.51%	-9.36%	0.43%
自基金合同生效起至今	18.61%	1.40%	5.06%	0.90%	13.55%	0.50%

九泰久盛量化混合 C

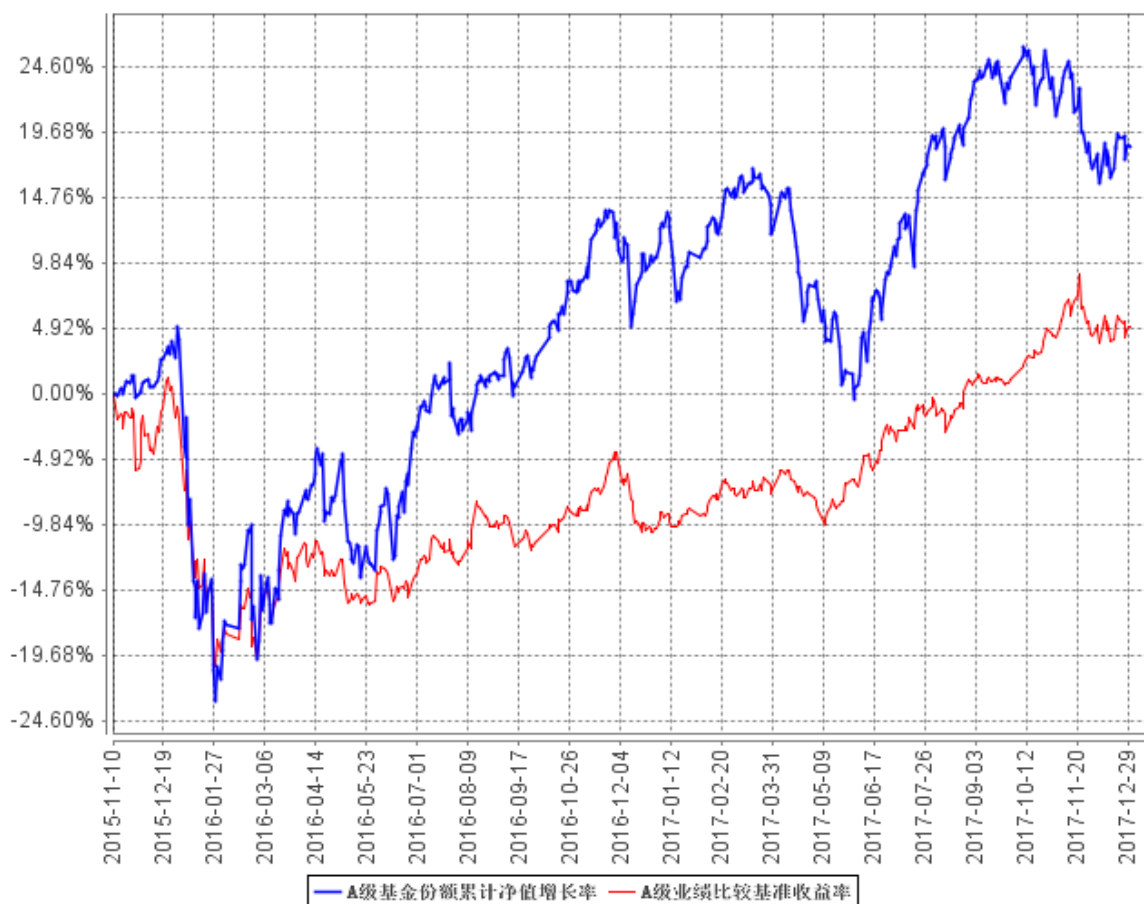
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.10%	0.93%	3.89%	0.64%	-7.99%	0.29%
过去六个月	7.93%	0.91%	7.80%	0.56%	0.13%	0.35%
自基金合同生效起至今	12.43%	0.99%	14.06%	0.55%	-1.63%	0.44%

注：1. 本基金合同于 2015 年 11 月 10 日生效，截至本报告期末，本基金距建仓结束已满一年。

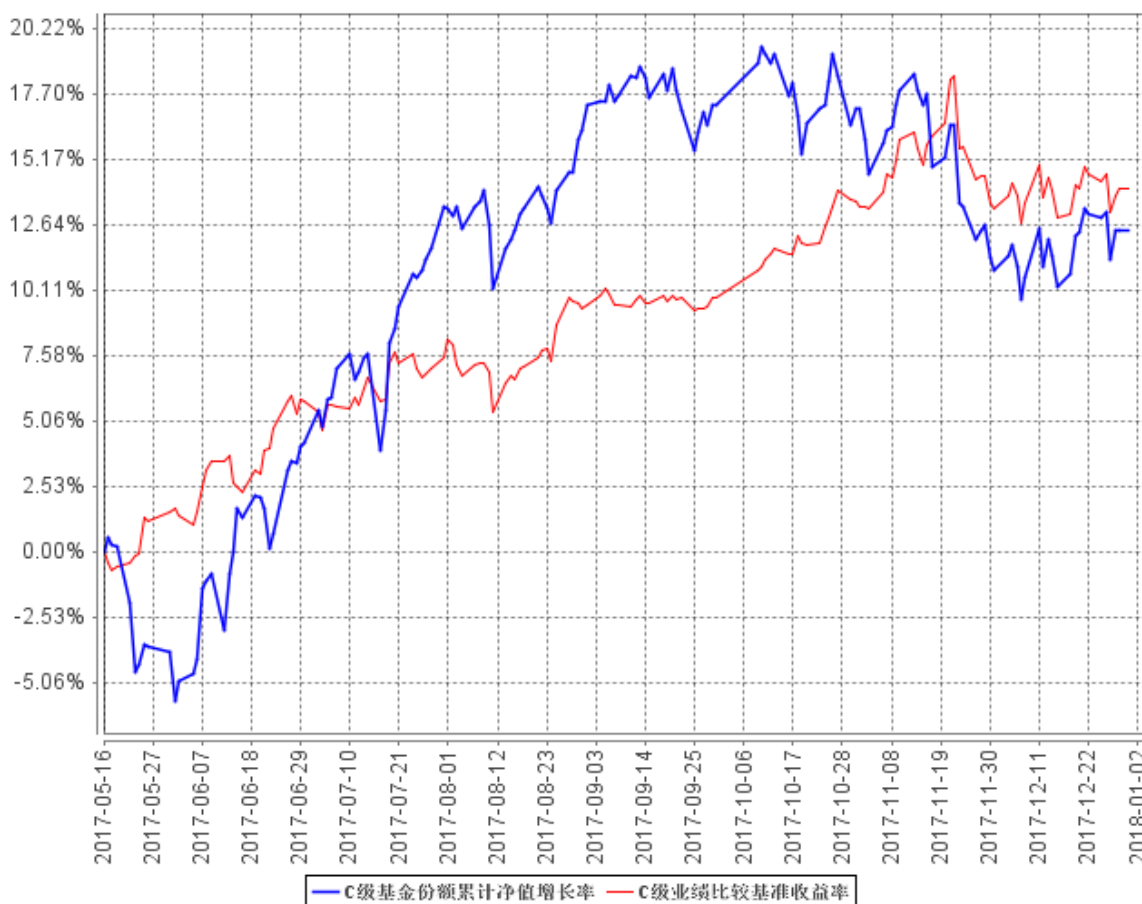
2. 根据基金合同的规定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求，本基金建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

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

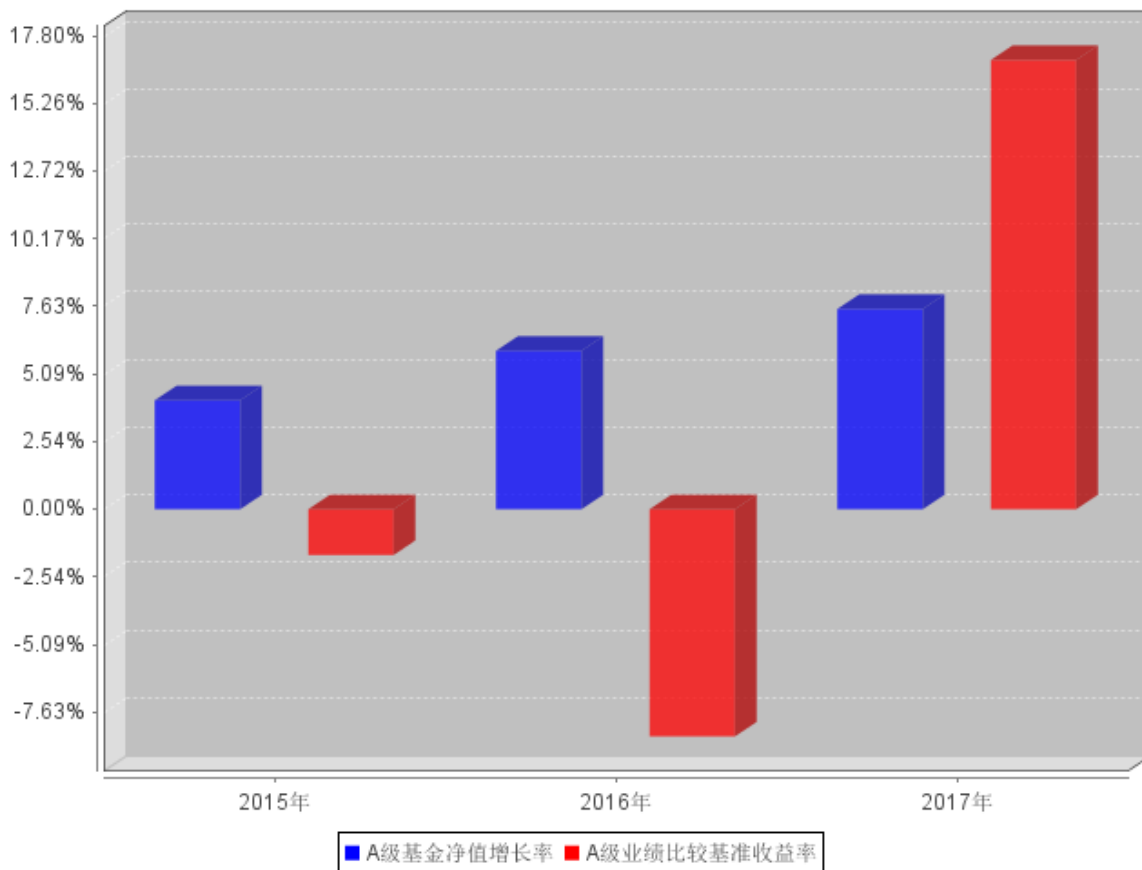


注：1. 本基金合同于 2015 年 11 月 10 日生效，截至本报告期末，本基金距建仓结束已满一年。

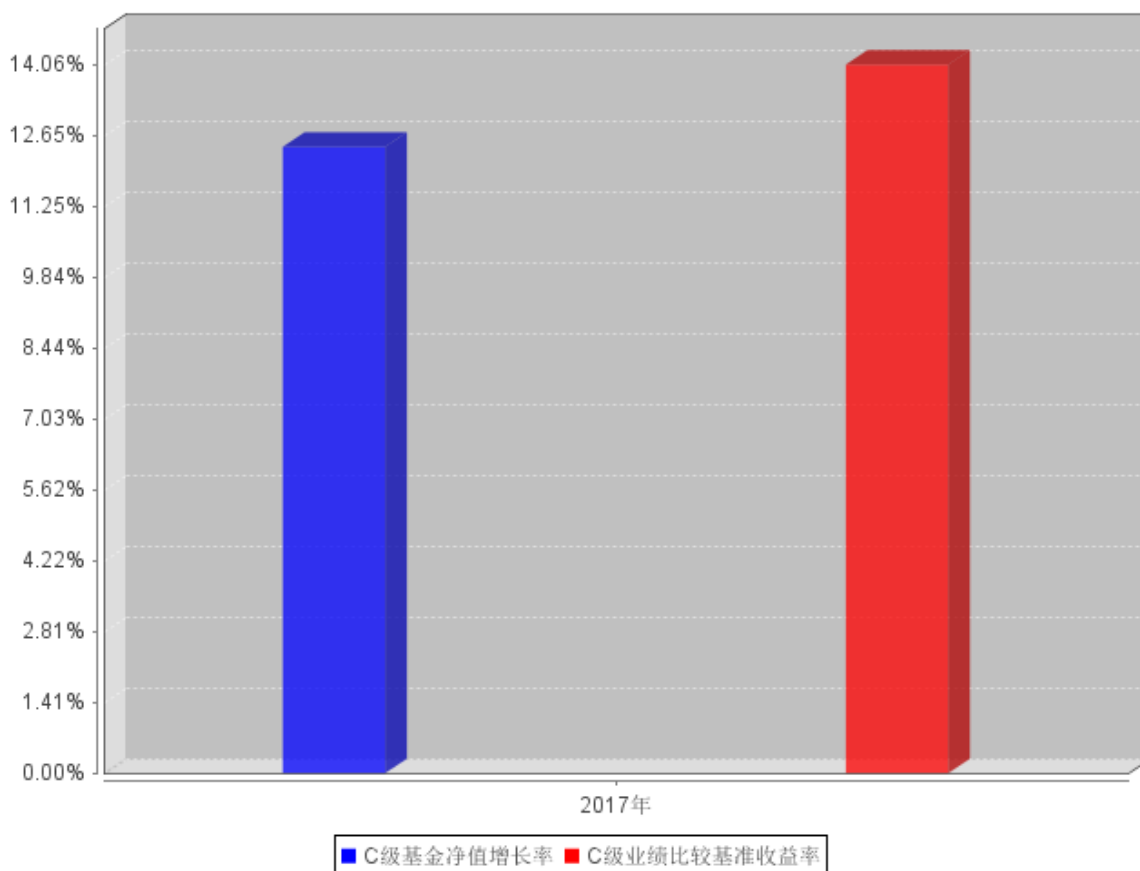
2. 根据基金合同的规定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求，本基金建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

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

A级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



C级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：合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

九泰久盛量化混合 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	1.8100	44,300,860.91	61,723,994.39	106,024,855.30	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	1.8100	44,300,860.91	61,723,994.39	106,024,855.30	

九泰久盛量化混合 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	1.8100	457,601.43	122,935.28	580,536.71	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	1.8100	457,601.43	122,935.28	580,536.71	

§ 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		
孟亚强	基金经理	2016年6月7日	-	8	南开大学保险精算硕士，中国籍，具有基金从业资格。8年证券从业经历。历任博时基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、投资经理。2015年8月加入九泰基金管理有限公司，现任九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金（2016年6月7日至今）、九泰久稳保本混合型证券投资基金（2016年6月7日至今）、九泰天富改革新

					动力灵活配置混合型证券投资基金（2016 年 12 月 26 日至今）、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金（2017 年 2 月 10 日至今）、九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金（2017 年 8 月 16 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

2017 年市场分化比较严重, 200 亿以上的股票有 310 只, 平均收益率 20%, 而剩下的 2700 只股票平均收益-20%。市场认为未来 A 股会向港股一样, 长期偏向价值风格。但从我们的研究来看, 无论是成熟市场还是发展中市场, 风格轮动是长期存在的现象。当价值股遇到估值和盈利不匹配的时候, 市场自然会转向新的估值洼地。2017 年一季度, 市场风格快速转向大盘风格, 量化模型也随着市场的调整而调整风格的权重, 模型在 6 月份之后跟上了市场的反弹, 并在反弹中占得先机。之后由于模型的小盘暴露上的问题没有得到根本性的解决, 所以在随后的 4 季度中再度落后。我们对模型这个比较严重的问题做了根本性的解决, 未来模型也会更加灵活, 即便再遇到此类市场分化, 模型的收益率也会大幅提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末九泰久盛量化混合 A 基金份额净值为 1.006 元, 本报告期基金份额净值增长率为 7.53%, 业绩比较基准收益率为 16.89%; 截至本报告期末九泰久盛量化混合 C 基金份额净值为 1.007 元, 本报告期基金份额净值增长率为 12.43%, 业绩比较基准收益率为 14.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年中国经济增长的持续性会逐步得到确认, 金融监管下的市场系统性风险也会持续下降, 中国资产会继续重估。尽管依然存在房地产销量增长继续下滑、金融监管与去杠杆深化等担心, 但地产库存偏低、长效机制增加供给、资本开支周期和外需复苏仍有有惯性。新老经济机构转换在推进, 城镇化深化、消费升级、产业升级以及产业整合趋势将会愈发明显, 我们认为 A 股指数将会继续上涨。

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的专业胜任能力。

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十八部分中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2017 年 12 月 26 日对 2017 年度收益进行了利润分配，分配总金额为 106,605,392.01 元，其中：九泰久盛量化 A 分配金额为：106,024,855.30 元；九泰久盛量化

C 分配金额为：580,536.71 元。

本基金截至 2017 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为-142,508.73 元，其中：九泰久盛量化 A 期末可供分配利润为-143,144.88 元（九泰久盛量化 A 的未分配利润已实现部分为-143,144.88 元，未分配利润未实现部分为 4,328,413.46 元）；九泰久盛量化 C 期末可供分配利润为 636.15 元（九泰久盛量化 C 的未分配利润已实现部分为 636.15 元，未分配利润未实现部分为 22,714.02 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

本报告期内，本基金托管人在对九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金的管理人——九泰基金管理有限公司在九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 A 类 1.81 元/10 份，C 类 1.81 元/10 份。

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

本托管人依法对九泰基金管理有限公司编制和披露的九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：九泰久盛量化先锋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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	6,057,877.12	25,384,028.92
结算备付金	12,319,587.84	6,011,981.15
存出保证金	403,807.44	1,776,775.28
交易性金融资产	603,242,987.05	288,658,965.79
其中：股票投资	573,394,810.83	288,658,965.79
基金投资	-	-
债券投资	29,848,176.22	-
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	-	-
应收证券清算款	35,073,643.84	70,214.09
应收利息	293,980.44	9,571.67
应收股利	-	-
应收申购款	205,363.59	747,575.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	657,597,247.32	322,659,112.41
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-

应付赎回款	1,533,429.00	2,351,521.25
应付管理人报酬	605,620.01	390,916.12
应付托管费	100,936.66	65,152.66
应付销售服务费	2,658.13	-
应付交易费用	1,691,792.12	1,252,845.55
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	153,130.57	153,193.24
负债合计	4,087,566.49	4,213,628.82
所有者权益：		
实收基金	649,301,062.08	288,597,546.14
未分配利润	4,208,618.75	29,847,937.45
所有者权益合计	653,509,680.83	318,445,483.59
负债和所有者权益总计	657,597,247.32	322,659,112.41

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，久盛量化混合 A 份额净值为人民币 1.006 元，久盛量化混合 C 份额净值为人民币 1.007 元；基金份额总额为 649,301,062.08 份，久盛量化混合 A 份额 645,865,501.84 份，久盛量化混合 C 份额 3,435,560.24 份。

7.2 利润表

会计主体：九泰久盛量化先锋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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	61,633,872.98	20,797,265.64
1.利息收入	930,099.72	238,883.87
其中：存款利息收入	326,070.31	228,835.79
债券利息收入	529,663.63	1,326.87
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	74,365.78	8,721.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	62,852,040.94	24,116,972.54
其中：股票投资收益	57,627,932.08	22,238,943.74
基金投资收益	-	-

债券投资收益	-27,345.35	43,482.42
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	1,090,760.00	1,246,960.00
股利收益	4,160,694.21	587,586.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,977,669.22	-3,929,118.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,829,401.54	370,527.97
减：二、费用	23,458,712.31	14,110,816.82
1. 管理人报酬	6,874,534.92	3,036,424.24
2. 托管费	1,145,755.78	506,070.61
3. 销售服务费	75,144.96	-
4. 交易费用	15,163,104.44	10,389,232.47
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	200,172.21	179,089.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	38,175,160.67	6,686,448.82
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	38,175,160.67	6,686,448.82

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰久盛量化先锋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 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）	288,597,546.14	29,847,937.45	318,445,483.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	38,175,160.67	38,175,160.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	360,703,515.94	42,790,912.64	403,494,428.58

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,091,010,535.95	167,724,225.65	1,258,734,761.60
2. 基金赎回款	-730,307,020.01	-124,933,313.01	-855,240,333.02
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)	-	-106,605,392.01	-106,605,392.01
五、期末所有者权益(基金净值)	649,301,062.08	4,208,618.75	653,509,680.83
	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
项目	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)	222,130,970.75	9,081,298.49	231,212,269.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	6,686,448.82	6,686,448.82
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)	66,466,575.39	14,080,190.14	80,546,765.53
其中：1. 基金申购款	249,534,339.48	17,730,704.79	267,265,044.27
2. 基金赎回款	-183,067,764.09	-3,650,514.65	-186,718,278.74
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)	288,597,546.14	29,847,937.45	318,445,483.59

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

严军

荣静

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

九泰久盛量化先锋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[2015]2171 号文《关于准予九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册,由九泰基金管理公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关规定和《九泰久盛量化先锋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 2015 年 10 月 12 日至 2015 年 11 月 6 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。首次设立募集基金份额为 388,036,526.34 份,经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)验证。基金合同于 2015 年 11 月 10 日生效。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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《九泰基金管理有限公司关于九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》,本基金管理人九泰基金管理有限公司经与本基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,决定于 2017 年 5 月 16 日起增设本基金的 C 类基金份额,增设的 C 类基金份额不收取投资者认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

根据《九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(2015 年修订),本基金根据销售服务费、赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰久盛量化先锋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的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票),债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债及其他中国证监会允许投资的债券)、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准是:沪深 300 指数收益率 \times 80%+中国债券总指数收益率 \times 20%。

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。

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、债券免征营业税和增值税；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；

(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，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，暂不缴纳企业所得税；

(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。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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、基金代销机构

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,874,534.92	3,036,424.24
其中：支付销售机构的客户维护费	3,989,829.97	1,869,128.18

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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、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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,145,755.78	506,070.61

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、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。

7.4.8.2.3 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 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰久盛量化混合 A	九泰久盛量化混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	304.65	304.65
合计	-	304.65	304.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰久盛量化混合 A	九泰久盛量化混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金 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 0.80%。本基金销售服务费按前一日的 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的销售服务费划款指令在月初三个工作日内从基金财产中一次性支付给本基金登记机构，并由登记机构代为支付给 C 类基金份额销售机构。若遇不可抗力致使无法按时支付的，顺延至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

本基金本报告期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 1 月 1 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
中国工商银行股份有限公司	6,057,877.12	197,694.03	25,384,028.92	147,446.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

注：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	股票	停牌日	停牌	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值总	备注
----	----	-----	----	----	----	----	-------	----	-------	----

代码	名称	期	原因	估值单价	日期	开盘单价		成本总额	额	
000006	深振业 A	2017 年 9 月 11 日	重大事项停牌	9.85	2018 年 3 月 8 日	8.87	1,113,500	9,299,713.91	10,967,975.00	-
000688	建新矿业	2017 年 9 月 6 日	重大事项停牌	10.95	2018 年 2 月 7 日	9.86	158,500	1,631,626.57	1,735,575.00	-
002033	丽江旅游	2017 年 12 月 14 日	重大事项停牌	9.10	2018 年 3 月 14 日	9.19	13,300	116,341.00	121,030.00	-
300159	新研股份	2017 年 11 月 22 日	重大事项停牌	10.40	2018 年 3 月 22 日	9.36	14,000	152,850.00	145,600.00	-
600309	万华化学	2017 年 12 月 5 日	重大事项停牌	37.94	-	-	99,300	3,716,594.76	3,767,442.00	-
601369	陕鼓动力	2017 年 12 月 28 日	重大事项停牌	7.60	2018 年 3 月 2 日	6.85	59,800	437,311.23	454,480.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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及应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 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 556,103,520.05 元，属于第二层次的余额为 47,139,467.00 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次 274,369,748.39 元，第二层次 14,289,217.40 元，无第三层次的余额）。

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

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	573,394,810.83	87.20
	其中：股票	573,394,810.83	87.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,848,176.22	4.54
	其中：债券	29,848,176.22	4.54
	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	-	-
	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	18,377,464.96	2.79
8	其他各项资产	35,976,795.31	5.47
9	合计	657,597,247.32	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	133,431.00	0.02
B	采矿业	29,249,692.14	4.48
C	制造业	227,288,043.99	34.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,119,492.50	1.55
E	建筑业	15,079,417.40	2.31
F	批发和零售业	4,931,739.00	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	13,061,106.83	2.00
H	住宿和餐饮业	223,520.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,942,596.35	1.98
J	金融业	208,056,983.06	31.84
K	房地产业	43,428,481.00	6.65
L	租赁和商务服务业	5,388,060.36	0.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,999,543.20	0.31
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	1,492,704.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	573,394,810.83	87.74

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投资股票。

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	600519	贵州茅台	64,896	45,264,311.04	6.93
2	601318	中国平安	577,295	40,399,104.10	6.18
3	600036	招商银行	1,210,355	35,124,502.10	5.37
4	000333	美的集团	431,585	23,922,756.55	3.66
5	600104	上汽集团	574,400	18,403,776.00	2.82
6	000002	万科 A	585,500	18,185,630.00	2.78
7	601088	中国神华	729,300	16,897,881.00	2.59
8	600887	伊利股份	507,583	16,339,096.77	2.50
9	601601	中国太保	356,800	14,778,656.00	2.26
10	000001	平安银行	999,800	13,297,340.00	2.03

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	601318	中国平安	63,816,755.76	20.04
2	600519	贵州茅台	44,156,358.71	13.87
3	600036	招商银行	36,710,846.83	11.53
4	601678	滨化股份	34,232,372.56	10.75
5	601601	中国太保	30,007,935.26	9.42
6	600052	浙江广厦	29,486,971.31	9.26
7	600308	华泰股份	29,208,217.93	9.17
8	601339	百隆东方	28,437,034.65	8.93
9	002309	中利集团	28,277,957.14	8.88
10	002101	广东鸿图	28,036,086.30	8.80
11	300040	九洲电气	27,715,376.09	8.70
12	601677	明泰铝业	27,435,727.23	8.62
13	002496	辉丰股份	27,097,541.20	8.51
14	000528	柳工	25,450,778.83	7.99
15	600875	东方电气	24,683,492.49	7.75
16	002083	孚日股份	24,350,166.90	7.65
17	600409	三友化工	24,196,464.17	7.60
18	000725	京东方 A	24,188,610.00	7.60

19	000333	美的集团	24,077,549.96	7.56
20	601636	旗滨集团	23,815,222.43	7.48
21	600761	安徽合力	23,418,907.80	7.35
22	002534	杭锅股份	23,182,703.62	7.28
23	000002	万科 A	22,884,233.41	7.19
24	000900	现代投资	22,747,427.44	7.14
25	601666	平煤股份	22,726,274.47	7.14
26	600104	上汽集团	22,635,243.85	7.11
27	600282	南钢股份	22,341,456.68	7.02
28	600782	新钢股份	22,044,612.35	6.92
29	002039	黔源电力	21,961,260.36	6.90
30	002238	天威视讯	21,956,089.93	6.89
31	000030	富奥股份	21,822,273.19	6.85
32	600383	金地集团	20,864,283.05	6.55
33	600309	万华化学	20,752,026.40	6.52
34	000936	华西股份	20,736,399.49	6.51
35	600507	方大特钢	20,668,708.14	6.49
36	002203	海亮股份	20,626,039.42	6.48
37	600675	中华企业	20,233,793.66	6.35
38	000830	鲁西化工	19,925,105.99	6.26
39	600325	华发股份	19,897,193.45	6.25
40	600708	光明地产	19,451,296.21	6.11
41	002078	太阳纸业	19,345,831.28	6.08
42	600711	盛屯矿业	19,112,310.04	6.00
43	000425	徐工机械	19,039,517.77	5.98
44	300120	经纬电材	18,824,740.77	5.91
45	600808	马钢股份	18,699,600.60	5.87
46	000521	美菱电器	18,558,537.84	5.83
47	002567	唐人神	18,333,970.84	5.76
48	000415	渤海金控	18,275,733.32	5.74
49	601628	中国人寿	17,469,154.57	5.49
50	000036	华联控股	17,417,040.11	5.47
51	601088	中国神华	17,269,500.68	5.42
52	300046	台基股份	17,129,588.93	5.38
53	603518	维格娜丝	16,981,842.13	5.33
54	002244	滨江集团	16,974,552.87	5.33

55	002376	新北洋	16,952,362.81	5.32
56	600801	华新水泥	16,894,585.44	5.31
57	600019	宝钢股份	16,734,253.03	5.25
58	002636	金安国纪	16,647,049.29	5.23
59	002247	帝龙文化	16,537,832.64	5.19
60	600887	伊利股份	16,432,902.12	5.16
61	600823	世茂股份	16,351,447.40	5.13
62	600966	博汇纸业	16,262,600.69	5.11
63	002599	盛通股份	15,816,396.86	4.97
64	002048	宁波华翔	15,776,155.44	4.95
65	600368	五洲交通	15,744,836.27	4.94
66	600028	中国石化	15,648,787.25	4.91
67	600380	健康元	15,626,160.23	4.91
68	002597	金禾实业	15,623,707.94	4.91
69	002706	良信电器	15,607,717.70	4.90
70	600641	万业企业	15,458,818.69	4.85
71	600757	长江传媒	15,446,233.98	4.85
72	601186	中国铁建	15,320,849.10	4.81
73	002071	长城影视	15,278,867.35	4.80
74	600230	沧州大化	15,216,943.86	4.78
75	601900	南方传媒	15,210,631.81	4.78
76	600723	首商股份	15,177,617.51	4.77
77	000597	东北制药	15,081,985.39	4.74
78	000060	中金岭南	15,050,341.76	4.73
79	600835	上海机电	15,037,314.33	4.72
80	300338	开元股份	14,827,181.18	4.66
81	601231	环旭电子	14,735,003.12	4.63
82	600746	江苏索普	14,636,268.24	4.60
83	002416	爱施德	14,584,127.18	4.58
84	000157	中联重科	14,506,313.00	4.56
85	300308	中际旭创	14,478,127.29	4.55
86	600114	东睦股份	14,470,590.15	4.54
87	000001	平安银行	14,457,437.18	4.54
88	601006	大秦铁路	14,431,459.83	4.53
89	600961	株冶集团	14,415,811.04	4.53
90	000004	国农科技	14,414,347.81	4.53

91	002338	奥普光电	14,411,656.12	4.53
92	600741	华域汽车	14,161,062.57	4.45
93	300226	上海钢联	14,101,182.38	4.43
94	600166	福田汽车	13,928,376.14	4.37
95	600510	黑牡丹	13,731,057.53	4.31
96	600031	三一重工	13,654,579.00	4.29
97	601668	中国建筑	13,472,690.39	4.23
98	600785	新华百货	13,421,939.82	4.21
99	600978	宜华生活	13,358,341.92	4.19
100	600449	宁夏建材	13,350,975.22	4.19
101	300415	伊之密	13,314,433.60	4.18
102	600271	航天信息	13,114,377.30	4.12
103	300334	津膜科技	13,019,515.17	4.09
104	000863	三湘印象	12,934,602.96	4.06
105	603609	禾丰牧业	12,884,657.44	4.05
106	002406	远东传动	12,833,481.18	4.03
107	300102	乾照光电	12,715,864.00	3.99
108	600582	天地科技	12,679,638.20	3.98
109	000822	山东海化	12,627,635.25	3.97
110	000488	晨鸣纸业	12,600,823.00	3.96
111	300138	晨光生物	12,587,647.60	3.95
112	600229	城市传媒	12,570,777.16	3.95
113	600291	西水股份	12,461,451.61	3.91
114	600585	海螺水泥	12,449,679.15	3.91
115	002554	惠博普	12,420,676.80	3.90
116	600720	祁连山	12,331,619.06	3.87
117	300082	奥克股份	12,328,418.18	3.87
118	000829	天音控股	12,201,989.82	3.83
119	000878	云南铜业	12,169,543.40	3.82
120	002026	山东威达	11,813,173.63	3.71
121	000789	万年青	11,812,546.16	3.71
122	600569	安阳钢铁	11,811,725.00	3.71
123	000921	海信科龙	11,807,553.72	3.71
124	002712	思美传媒	11,745,068.47	3.69
125	603599	广信股份	11,654,399.32	3.66
126	600269	赣粤高速	11,650,713.00	3.66

127	601567	三星医疗	11,630,266.87	3.65
128	002601	龙蟠佰利	11,613,301.13	3.65
129	002237	恒邦股份	11,564,185.00	3.63
130	002637	赞宇科技	11,490,817.89	3.61
131	002214	大立科技	11,446,323.03	3.59
132	002354	天神娱乐	11,389,446.47	3.58
133	600051	宁波联合	11,294,018.01	3.55
134	600664	哈药股份	11,206,237.46	3.52
135	002533	金杯电工	11,195,707.30	3.52
136	000417	合肥百货	11,184,486.19	3.51
137	002352	顺丰控股	11,157,901.84	3.50
138	002015	霞客环保	11,098,276.34	3.49
139	300121	阳谷华泰	11,064,504.40	3.47
140	600203	福日电子	11,028,309.91	3.46
141	600016	民生银行	10,998,453.78	3.45
142	000926	福星股份	10,980,197.45	3.45
143	600755	厦门国贸	10,842,669.94	3.40
144	000498	山东路桥	10,764,342.71	3.38
145	000400	许继电气	10,748,226.30	3.38
146	002661	克明面业	10,611,794.94	3.33
147	600567	山鹰纸业	10,553,415.00	3.31
148	300293	蓝英装备	10,488,197.05	3.29
149	002472	双环传动	10,472,054.44	3.29
150	000919	金陵药业	10,456,908.47	3.28
151	600121	*ST 郑煤	10,426,530.13	3.27
152	600389	江山股份	10,409,645.70	3.27
153	002649	博彦科技	10,381,581.02	3.26
154	600998	九州通	10,352,122.53	3.25
155	600580	卧龙电气	10,325,872.67	3.24
156	600677	航天通信	10,310,375.44	3.24
157	600183	生益科技	10,307,447.80	3.24
158	002666	德联集团	10,305,284.70	3.24
159	000338	潍柴动力	10,283,131.47	3.23
160	600742	一汽富维	10,209,883.34	3.21
161	002540	亚太科技	10,204,926.20	3.20
162	600268	国电南自	10,052,755.00	3.16

163	600502	安徽水利	10,047,099.63	3.16
164	600713	南京医药	10,017,204.87	3.15
165	002061	浙江交科	9,984,738.00	3.14
166	000759	中百集团	9,858,791.78	3.10
167	300158	振东制药	9,835,926.73	3.09
168	000581	威孚高科	9,789,033.81	3.07
169	002068	黑猫股份	9,756,463.99	3.06
170	300448	浩云科技	9,652,191.21	3.03
171	600050	中国联通	9,596,489.91	3.01
172	603223	恒通股份	9,579,289.43	3.01
173	002394	联发股份	9,578,218.08	3.01
174	000006	深振业 A	9,397,429.82	2.95
175	601100	恒立液压	9,359,781.78	2.94
176	002209	达意隆	9,357,106.67	2.94
177	000909	数源科技	9,353,770.00	2.94
178	000905	厦门港务	9,290,142.70	2.92
179	300451	创业软件	9,247,778.42	2.90
180	002462	嘉事堂	9,244,190.45	2.90
181	000513	丽珠集团	9,219,130.27	2.90
182	600552	凯盛科技	9,000,007.21	2.83
183	002133	广宇集团	8,944,994.00	2.81
184	000651	格力电器	8,916,506.97	2.80
185	000929	兰州黄河	8,912,395.27	2.80
186	000402	金融街	8,698,584.29	2.73
187	000401	冀东水泥	8,696,012.84	2.73
188	300164	通源石油	8,680,420.09	2.73
189	600674	川投能源	8,675,678.80	2.72
190	000011	深物业 A	8,643,601.78	2.71
191	600057	象屿股份	8,599,419.46	2.70
192	002182	云海金属	8,569,311.20	2.69
193	601166	兴业银行	8,551,504.00	2.69
194	600668	尖峰集团	8,510,754.53	2.67
195	002648	卫星石化	8,453,829.25	2.65
196	601390	中国中铁	8,446,026.90	2.65
197	300047	天源迪科	8,444,494.45	2.65
198	000593	大通燃气	8,413,522.76	2.64

199	300058	蓝色光标	8,389,376.42	2.63
200	000565	渝三峡 A	8,358,176.73	2.62
201	000554	泰山石油	8,258,386.00	2.59
202	000010	美丽生态	8,228,412.00	2.58
203	600695	绿庭投资	8,219,278.59	2.58
204	600285	羚锐制药	8,199,434.90	2.57
205	300094	国联水产	8,114,786.24	2.55
206	300233	金城医药	8,069,885.68	2.53
207	002574	明牌珠宝	8,042,360.25	2.53
208	002629	仁智股份	8,013,667.20	2.52
209	600385	山东金泰	7,999,441.52	2.51
210	601939	建设银行	7,991,111.23	2.51
211	002627	宜昌交运	7,973,886.97	2.50
212	601137	博威合金	7,966,787.18	2.50
213	600335	国机汽车	7,953,852.98	2.50
214	600734	实达集团	7,944,279.69	2.49
215	600188	兖州煤业	7,914,644.16	2.49
216	600896	览海投资	7,895,372.05	2.48
217	600987	航民股份	7,851,130.58	2.47
218	603883	老百姓	7,807,436.20	2.45
219	600984	建设机械	7,787,224.99	2.45
220	600419	天润乳业	7,781,779.74	2.44
221	002385	大北农	7,726,995.84	2.43
222	000890	法尔胜	7,660,986.75	2.41
223	600056	中国医药	7,644,259.43	2.40
224	600048	保利地产	7,483,662.00	2.35
225	000800	一汽轿车	7,469,008.38	2.35
226	300182	捷成股份	7,403,555.70	2.32
227	300080	易成新能	7,386,383.72	2.32
228	000726	鲁泰 A	7,331,031.95	2.30
229	002458	益生股份	7,314,711.27	2.30
230	300193	佳士科技	7,292,305.49	2.29
231	000023	深天地 A	7,255,673.20	2.28
232	000422	湖北宜化	7,231,955.60	2.27
233	600597	光明乳业	7,227,314.29	2.27
234	002146	荣盛发展	7,197,584.37	2.26

235	002420	毅昌股份	7,094,776.00	2.23
236	000631	顺发恒业	7,056,096.11	2.22
237	002449	国星光电	7,054,836.08	2.22
238	000985	大庆华科	7,044,810.76	2.21
239	002171	楚江新材	7,020,740.91	2.20
240	002164	宁波东力	6,945,390.00	2.18
241	002092	中泰化学	6,879,883.47	2.16
242	300241	瑞丰光电	6,855,488.94	2.15
243	300038	梅泰诺	6,814,882.61	2.14
244	600997	开滦股份	6,814,372.87	2.14
245	000951	中国重汽	6,804,259.00	2.14
246	600661	新南洋	6,774,445.65	2.13
247	300063	天龙集团	6,764,157.23	2.12
248	603225	新凤鸣	6,758,993.42	2.12
249	600626	申达股份	6,750,991.16	2.12
250	601328	交通银行	6,720,786.00	2.11
251	002468	申通快递	6,720,126.00	2.11
252	000858	五粮液	6,686,144.90	2.10
253	600969	郴电国际	6,666,340.49	2.09
254	000667	美好置业	6,636,582.57	2.08
255	600105	永鼎股份	6,628,272.10	2.08
256	600280	中央商场	6,600,627.42	2.07
257	600475	华光股份	6,592,173.67	2.07
258	000703	恒逸石化	6,558,208.10	2.06
259	002366	台海核电	6,548,785.78	2.06
260	600606	绿地控股	6,544,256.00	2.06
261	600452	涪陵电力	6,541,351.63	2.05
262	002279	久其软件	6,534,323.60	2.05
263	002006	精功科技	6,510,856.26	2.04
264	300071	华谊嘉信	6,509,573.79	2.04
265	601818	光大银行	6,481,454.00	2.04
266	000070	特发信息	6,474,148.25	2.03
267	600516	方大炭素	6,467,579.00	2.03
268	300323	华灿光电	6,453,232.87	2.03
269	000066	中国长城	6,447,915.24	2.02
270	000016	深康佳 A	6,426,748.00	2.02

271	600780	通宝能源	6,419,080.58	2.02
-----	--------	------	--------------	------

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	601678	滨化股份	35,640,304.18	11.19
2	600308	华泰股份	31,533,375.84	9.90
3	601339	百隆东方	31,492,690.06	9.89
4	600052	浙江广厦	30,491,094.13	9.57
5	300040	九洲电气	29,996,089.04	9.42
6	002496	辉丰股份	29,286,745.29	9.20
7	601677	明泰铝业	29,214,380.85	9.17
8	002101	广东鸿图	28,337,810.24	8.90
9	002309	中利集团	27,705,920.04	8.70
10	000830	鲁西化工	27,359,353.13	8.59
11	002534	杭锅股份	26,425,637.85	8.30
12	600761	安徽合力	26,421,956.31	8.30
13	601636	旗滨集团	25,919,804.21	8.14
14	600409	三友化工	25,305,478.61	7.95
15	000900	现代投资	25,227,136.08	7.92
16	600875	东方电气	25,109,850.96	7.89
17	002083	孚日股份	24,986,213.97	7.85
18	600282	南钢股份	24,867,283.48	7.81
19	601666	平煤股份	24,544,882.05	7.71
20	002238	天威视讯	24,451,741.25	7.68
21	000030	富奥股份	23,705,103.50	7.44
22	000528	柳工	23,622,808.97	7.42
23	600782	新钢股份	23,355,000.53	7.33
24	002039	黔源电力	23,051,116.41	7.24
25	601318	中国平安	22,876,099.47	7.18
26	000036	华联控股	22,858,355.50	7.18
27	600711	盛屯矿业	22,104,361.80	6.94
28	600708	光明地产	22,101,411.09	6.94
29	002203	海亮股份	21,854,749.60	6.86
30	600507	方大特钢	21,525,099.17	6.76
31	600808	马钢股份	21,462,759.11	6.74

32	600383	金地集团	21,373,347.01	6.71
33	002078	太阳纸业	21,291,178.72	6.69
34	000521	美菱电器	21,093,016.75	6.62
35	000725	京东方 A	20,999,705.00	6.59
36	000936	华西股份	20,756,492.80	6.52
37	300120	经纬电材	20,002,178.63	6.28
38	600801	华新水泥	19,426,140.42	6.10
39	600675	中华企业	19,322,700.37	6.07
40	600325	华发股份	19,200,806.32	6.03
41	002567	唐人神	18,983,218.79	5.96
42	600309	万华化学	18,510,774.01	5.81
43	000415	渤海金控	18,488,571.11	5.81
44	600961	株冶集团	17,803,461.99	5.59
45	000425	徐工机械	17,742,931.93	5.57
46	002244	滨江集团	17,698,028.21	5.56
47	300046	台基股份	17,593,635.54	5.52
48	000921	海信科龙	17,536,683.86	5.51
49	600757	长江传媒	17,204,939.54	5.40
50	603518	维格娜丝	17,060,316.44	5.36
51	600746	江苏索普	17,025,112.00	5.35
52	600966	博汇纸业	17,000,017.00	5.34
53	002636	金安国纪	16,932,242.25	5.32
54	600723	首商股份	16,931,700.58	5.32
55	601601	中国太保	16,795,536.00	5.27
56	002597	金禾实业	16,681,144.90	5.24
57	002048	宁波华翔	16,308,746.78	5.12
58	600230	沧州大化	16,091,191.91	5.05
59	300226	上海钢联	15,743,237.41	4.94
60	600823	世茂股份	15,717,993.84	4.94
61	600114	东睦股份	15,697,078.47	4.93
62	600641	万业企业	15,636,916.75	4.91
63	600380	健康元	15,623,092.37	4.91
64	300308	中际旭创	15,458,317.86	4.85
65	002706	良信电器	15,416,524.53	4.84
66	002599	盛通股份	15,367,366.60	4.83
67	002376	新北洋	15,360,611.44	4.82
68	600368	五洲交通	15,343,306.15	4.82
69	000597	东北制药	15,320,522.55	4.81

70	002247	帝龙文化	15,282,674.75	4.80
71	601231	环旭电子	15,211,695.17	4.78
72	601900	南方传媒	15,126,259.14	4.75
73	002071	长城影视	15,082,187.52	4.74
74	600510	黑牡丹	15,021,544.33	4.72
75	600835	上海机电	14,855,160.11	4.66
76	300334	津膜科技	14,787,443.31	4.64
77	300338	开元股份	14,709,733.73	4.62
78	600449	宁夏建材	14,565,954.00	4.57
79	300415	伊之密	14,426,312.93	4.53
80	600031	三一重工	14,305,888.70	4.49
81	600741	华域汽车	14,268,866.74	4.48
82	600720	祁连山	14,267,782.13	4.48
83	000060	中金岭南	14,113,732.27	4.43
84	600166	福田汽车	14,016,304.68	4.40
85	000789	万年青	13,980,476.94	4.39
86	002416	爱施德	13,865,237.04	4.35
87	600291	西水股份	13,843,476.72	4.35
88	000004	国农科技	13,827,773.14	4.34
89	002406	远东传动	13,634,000.63	4.28
90	600121	*ST 郑煤	13,618,052.33	4.28
91	601186	中国铁建	13,545,892.48	4.25
92	600569	安阳钢铁	13,492,080.37	4.24
93	600785	新华百货	13,457,763.39	4.23
94	600677	航天通信	13,433,987.19	4.22
95	002338	奥普光电	13,380,447.82	4.20
96	600582	天地科技	13,352,342.53	4.19
97	000157	中联重科	13,304,318.21	4.18
98	002015	霞客环保	13,252,857.09	4.16
99	603609	禾丰牧业	13,081,881.38	4.11
100	600742	一汽富维	13,077,358.24	4.11
101	600028	中国石化	13,055,147.49	4.10
102	600269	赣粤高速	13,007,792.47	4.08
103	000488	晨鸣纸业	13,002,220.89	4.08
104	000863	三湘印象	12,911,649.62	4.05
105	000822	山东海化	12,887,278.02	4.05
106	300082	奥克股份	12,847,758.04	4.03
107	002214	大立科技	12,810,013.78	4.02

108	002554	惠博普	12,633,729.81	3.97
109	002026	山东威达	12,626,580.04	3.97
110	300102	乾照光电	12,599,298.46	3.96
111	600978	宜华生活	12,568,349.68	3.95
112	300138	晨光生物	12,513,523.27	3.93
113	600755	厦门国贸	12,496,511.57	3.92
114	000829	天音控股	12,448,313.15	3.91
115	600229	城市传媒	12,282,071.52	3.86
116	603599	广信股份	12,215,915.18	3.84
117	000878	云南铜业	12,115,931.84	3.80
118	600271	航天信息	12,026,182.45	3.78
119	601567	三星医疗	12,016,840.34	3.77
120	002712	思美传媒	11,999,784.09	3.77
121	002637	赞宇科技	11,850,521.57	3.72
122	002661	克明面业	11,755,958.83	3.69
123	300293	蓝英装备	11,656,118.49	3.66
124	002354	天神娱乐	11,649,817.75	3.66
125	600502	安徽水利	11,575,705.65	3.64
126	600203	福日电子	11,574,696.90	3.63
127	600335	国机汽车	11,543,700.18	3.63
128	601100	恒立液压	11,447,239.31	3.59
129	000417	合肥百货	11,408,946.96	3.58
130	002061	浙江交科	11,238,496.59	3.53
131	002472	双环传动	11,168,367.41	3.51
132	002533	金杯电工	11,163,310.45	3.51
133	000400	许继电气	11,121,243.83	3.49
134	600664	哈药股份	11,077,927.71	3.48
135	600051	宁波联合	11,022,209.74	3.46
136	600183	生益科技	10,968,216.68	3.44
137	002649	博彦科技	10,882,091.40	3.42
138	000338	潍柴动力	10,875,808.00	3.42
139	000905	厦门港务	10,873,136.99	3.41
140	000926	福星股份	10,817,819.14	3.40
141	002352	顺丰控股	10,789,233.67	3.39
142	002237	恒邦股份	10,660,445.90	3.35
143	002182	云海金属	10,640,877.99	3.34
144	002666	德联集团	10,615,815.60	3.33
145	000401	冀东水泥	10,464,371.66	3.29

146	002209	达意隆	10,404,188.71	3.27
147	600998	九州通	10,399,529.64	3.27
148	000581	威孚高科	10,378,265.00	3.26
149	002540	亚太科技	10,372,458.72	3.26
150	000919	金陵药业	10,372,093.69	3.26
151	002601	龙蟠佰利	10,263,975.92	3.22
152	300121	阳谷华泰	10,158,631.11	3.19
153	002394	联发股份	10,067,036.08	3.16
154	000909	数源科技	9,927,203.58	3.12
155	600389	江山股份	9,907,220.57	3.11
156	000759	中百集团	9,893,073.64	3.11
157	000929	兰州黄河	9,865,661.45	3.10
158	300071	华谊嘉信	9,839,911.57	3.09
159	601137	博威合金	9,795,894.28	3.08
160	002420	毅昌股份	9,773,199.17	3.07
161	600984	建设机械	9,772,280.73	3.07
162	600268	国电南自	9,733,376.28	3.06
163	002462	嘉事堂	9,666,238.64	3.04
164	002068	黑猫股份	9,610,466.70	3.02
165	600580	卧龙电气	9,606,898.54	3.02
166	300448	浩云科技	9,525,391.84	2.99
167	600713	南京医药	9,477,510.87	2.98
168	000498	山东路桥	9,296,913.43	2.92
169	600567	山鹰纸业	9,259,323.66	2.91
170	000554	泰山石油	9,230,019.07	2.90
171	600997	开滦股份	9,139,030.36	2.87
172	002574	明牌珠宝	9,110,075.14	2.86
173	002648	卫星石化	9,103,397.23	2.86
174	603223	恒通股份	8,911,674.71	2.80
175	000402	金融街	8,745,773.49	2.75
176	600668	尖峰集团	8,714,818.58	2.74
177	002133	广宇集团	8,710,063.00	2.74
178	300158	振东制药	8,697,887.48	2.73
179	000010	美丽生态	8,666,783.14	2.72
180	002171	楚江新材	8,662,181.52	2.72
181	300451	创业软件	8,653,872.09	2.72
182	000011	深物业 A	8,652,128.84	2.72
183	300164	通源石油	8,616,129.62	2.71

184	000565	渝三峡 A	8,549,816.04	2.68
185	000513	丽珠集团	8,525,087.55	2.68
186	600674	川投能源	8,512,988.83	2.67
187	600419	天润乳业	8,443,490.01	2.65
188	600385	山东金泰	8,424,556.44	2.65
189	600057	象屿股份	8,410,730.93	2.64
190	600552	凯盛科技	8,408,338.20	2.64
191	000551	创元科技	8,305,699.49	2.61
192	600987	航民股份	8,241,096.49	2.59
193	000593	大通燃气	8,234,019.83	2.59
194	600661	新南洋	8,221,729.89	2.58
195	300047	天源迪科	8,194,780.42	2.57
196	000631	顺发恒业	8,180,269.38	2.57
197	002449	国星光电	8,146,579.33	2.56
198	600188	兖州煤业	8,112,262.50	2.55
199	600285	羚锐制药	8,087,517.08	2.54
200	300233	金城医药	8,054,616.26	2.53
201	002507	涪陵榨菜	8,053,052.41	2.53
202	002385	大北农	8,032,481.58	2.52
203	601668	中国建筑	8,030,554.00	2.52
204	600327	大东方	8,026,015.94	2.52
205	002164	宁波东力	8,013,291.83	2.52
206	300193	佳士科技	7,994,032.00	2.51
207	002627	宜昌交运	7,925,429.11	2.49
208	603883	老百姓	7,902,967.13	2.48
209	002006	精功科技	7,902,321.88	2.48
210	002629	仁智股份	7,885,101.53	2.48
211	000070	特发信息	7,859,430.00	2.47
212	600734	实达集团	7,787,542.60	2.45
213	600644	乐山电力	7,774,205.17	2.44
214	000890	法尔胜	7,754,943.12	2.44
215	000985	大庆华科	7,745,951.69	2.43
216	300058	蓝色光标	7,733,980.44	2.43
217	600056	中国医药	7,729,630.97	2.43
218	002146	荣盛发展	7,712,162.96	2.42
219	600695	绿庭投资	7,709,244.43	2.42
220	600452	涪陵电力	7,697,049.48	2.42
221	600475	华光股份	7,676,207.32	2.41

222	000800	一汽轿车	7,578,634.70	2.38
223	600896	览海投资	7,533,805.72	2.37
224	002458	益生股份	7,434,193.55	2.33
225	300094	国联水产	7,378,739.43	2.32
226	000726	鲁泰 A	7,317,415.79	2.30
227	300182	捷成股份	7,306,915.68	2.29
228	600597	光明乳业	7,271,467.84	2.28
229	600280	中央商场	7,182,749.00	2.26
230	600853	龙建股份	7,156,966.07	2.25
231	601006	大秦铁路	7,127,163.57	2.24
232	002279	久其软件	7,118,717.72	2.24
233	002092	中泰化学	7,048,731.04	2.21
234	300038	梅泰诺	7,008,738.05	2.20
235	600736	苏州高新	6,990,902.58	2.20
236	000422	湖北宜化	6,947,619.81	2.18
237	300080	易成新能	6,946,726.58	2.18
238	000023	深天地 A	6,850,551.59	2.15
239	300241	瑞丰光电	6,848,259.45	2.15
240	000952	广济药业	6,715,110.26	2.11
241	600626	申达股份	6,663,752.80	2.09
242	000667	美好置业	6,648,830.89	2.09
243	300063	天龙集团	6,623,170.00	2.08
244	002366	台海核电	6,622,339.66	2.08
245	000066	中国长城	6,570,856.98	2.06
246	000016	深康佳 A	6,557,304.92	2.06
247	600105	永鼎股份	6,538,844.90	2.05
248	000835	长城动漫	6,537,993.42	2.05
249	600780	通宝能源	6,499,400.20	2.04
250	000034	神州数码	6,433,247.04	2.02
251	002726	龙大肉食	6,424,616.11	2.02
252	000159	国际实业	6,406,968.44	2.01
253	600367	红星发展	6,404,863.40	2.01
254	600585	海螺水泥	6,374,807.31	2.00
255	300323	华灿光电	6,374,555.62	2.00
256	600969	郴电国际	6,373,274.56	2.00

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	5,440,686,562.05
卖出股票收入（成交）总额	5,208,692,443.65

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,815,000.00	4.56
	其中：政策性金融债	29,815,000.00	4.56
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）	33,176.22	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,848,176.22	4.57

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	170410	17 农发 10	100,000	9,947,000.00	1.52
2	170413	17 农发 13	100,000	9,940,000.00	1.52
3	170311	17 进出 11	100,000	9,928,000.00	1.52
4	128021	兄弟转债	334	33,176.22	0.01

注：本基金本报告期仅持有上述四只债券。

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

无。

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	本基金利用股指期货进行多头套保，一方面是为了应对由于基金的大额赎回带来的对基金净值的影响，另一方面因为股指期货长期折价，主力股指期货当月到期后折价会收敛，可以享受折价带来的超额收益。
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					1,090,760.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-28,800.00

注：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，本基金少量参与股指期货交易，主要是用来调节组合头寸。

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

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。

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	403,807.44
2	应收证券清算款	35,073,643.84
3	应收股利	-
4	应收利息	293,980.44
5	应收申购款	205,363.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,976,795.31

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

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
九泰久盛	10,225	63,165.33	335,222,529.42	51.90%	310,642,972.42	48.10%

量化混合 A						
九泰久盛量化混合 C	206	16,677.48	4,724.34	0.14%	3,430,835.90	99.86%
合计	10,431	62,247.25	335,227,253.76	51.63%	314,073,808.32	48.37%

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。

9.3 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	九泰久盛量化混合 A	268,301.44	0.0415%
	九泰久盛量化混合 C	-	-
	合计	268,301.44	0.0413%

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。

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	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	九泰久盛量化混合 A	0~10
	九泰久盛量化混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	九泰久盛量化混合 A	0
	九泰久盛量化混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰久盛量化混合 A	九泰久盛量化混合 C
基金合同生效日（2015 年 11 月 10 日）基金份额总额	388,036,526.34	-

本报告期期初基金份额总额	288,597,546.14	-
本报告期基金总申购份额	1,036,165,229.99	54,845,305.96
减:本报告期基金总赎回份额	678,897,274.29	51,409,745.72
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"- "填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	645,865,501.84	3,435,560.24

注: 1、自 2017 年 5 月 16 日起, 本基金分设两类基金份额: A 类基金份额和 C 类基金份额, 详情请查阅相关公告;

2、总申购份额含转换入和红利再投资份额, 总赎回份额含转换出份额。

§ 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无重大人事变动。

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 50,000.00 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	
天风证券		22,975,904,638.57	27.96%	2,771,472.33	30.73%	-
中信证券		21,654,101,439.62	15.54%	931,160.32	10.33%	-

兴业证券	2	1,117,897,489.44	10.50%	1,041,096.24	11.54%	-
联讯证券	2	1,051,215,327.15	9.88%	978,999.48	10.86%	-
安信证券	2	959,268,758.91	9.01%	893,377.61	9.91%	-
东方财富证券	2	937,843,200.83	8.81%	873,414.83	9.69%	-
东兴证券	2	674,897,520.20	6.34%	628,526.83	6.97%	-
华泰证券	2	562,258,425.56	5.28%	523,631.81	5.81%	-
国信证券	2	387,378,587.19	3.64%	205,816.76	2.28%	-
川财证券	2	320,921,107.58	3.02%	170,504.54	1.89%	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	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
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	54,000,000.00	62.79%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	1,030,652.60	99.89%	8,000,000.00	9.30%	-	-
安信证券	-	-	24,000,000.00	27.91%	-	-
东方财富证券	1,120.00	0.11%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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、个股分析的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：新增天风证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；新增华泰证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；新增方正证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；新增中银国际证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；新增安信证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；新增东方财富证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；新增东兴证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；新增华西证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；新增大同证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个。

(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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		或者 超过 20% 的时间 区间					
机构	1	2017 年 12 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日	0.00	295,901,238.70	-	295,901,238.70	45.57%
	2	2017 年 07 月 24 日至 2017 年 08 月 01 日; 2017 年 09 月 05 日至 2017 年 09 月 06 日	52,769,569.04	88,931,715.37	141,701,284.41	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、出现巨额赎回的风险</p> <p>(1) 机构投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。中小其他投资者的小额赎回申请也可能面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。</p> <p>(2) 当连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。</p> <p>(3) 基金管理人可能被迫抛售证券以应对巨额赎回的需要，可能影响基金的收益水平。</p> <p>2、基金规模过小导致基金合同终止的风险</p> <p>根据基金合同的约定，基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，无须召开基金份额持有人大会。机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5,000 万元情形，届时本基金存在基金合同终止的风险。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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》。

本基金于 2017 年 12 月 25 日发布了《九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金分红公告》详见官网及指定报刊。

九泰基金管理有限公司
2018 年 3 月 28 日