

# 九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告

2018 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 7 月 18 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“九泰久稳混合”）由九泰久稳保本混合型证券投资基金转型而来。自 2018 年 5 月 3 日起，九泰久稳混合转型正式生效，并自该日起《九泰久稳保本混合型证券投资基金基金合同》失效且《九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

本报告中财务资料未经审计。

自 2018 年 5 月 3 日起原九泰久稳保本混合型证券投资基金转型为九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金。原九泰久稳保本混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 5 月 2 日止，九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 5 月 3 日（基金合同生效日）起至 2018 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	九泰久稳混合
基金主代码	002453
交易代码	002453
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 3 日
报告期末基金份额总额	80,225,295.48 份
投资目标	本基金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	本基金将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以及价值被严重低估的传统行业的上市公司的投资机会。同时，本基金还关注上市公司事

	件驱动带来的投资机会（如资产重组、并购、再融资、重大技术革新、重大产品创新、重大经营模式创新等）。本基金采用定量分析方法和定性分析方法相结合的策略进行股票投资，并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以及对资本市场趋势的判断，结合主要大类资产的相对估值，合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例，适时进行动态调整。	
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，属于中等风险收益特征的证券投资基金品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	九泰久稳混合 A	九泰久稳混合 C
下属分级基金的交易代码	002453	002454
报告期末下属分级基金的份额总额	60,495,801.68 份	19,729,493.80 份

转型前：

基金简称	九泰久稳保本混合
基金主代码	002450
交易代码	002453
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 22 日
报告期末基金份额总额	161,923,370.20 份
投资目标	通过运用投资组合保险技术，为投资者提供保本周期到期时保本金额安全的保证，并在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用基于 VaR 的风险乘数全程可变的 CPPI 策略（恒定比例组合保险策略）。基金管理人主要通过数量分析，根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数（即风险乘数），动态调整稳健资产与风险资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现投资组合的保本增值目标。同时，本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，确定具体的投资券种选择，积极寻找各种可能的套利和价值增长机会。
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准：两年期银行定期存款收

	益率（税后）	
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	九泰久稳保本混合 A	九泰久稳保本混合 C
下属分级基金的交易代码	002453	002454
报告期末下属分级基金的份额总额	121, 187, 754. 88 份	40, 735, 615. 32 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年5月3日—2018年6月30日）	
	九泰久稳混合 A	九泰久稳混合 C
1. 本期已实现收益	-43, 426. 21	-45, 918. 18
2. 本期利润	-79, 765. 85	-57, 703. 87
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0011	-0. 0025
4. 期末基金资产净值	62, 924, 552. 05	20, 157, 135. 57
5. 期末基金份额净值	1. 040	1. 022

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（不含公允价值变动损益）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。

#### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年4月1日—2018年5月2日）	
	九泰久稳保本混合 A	九泰久稳保本混合 C
1. 本期已实现收益	723, 371. 39	127, 681. 05
2. 本期利润	1, 027, 208. 14	212, 982. 50
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0020	0. 0015
4. 期末基金资产净值	126, 179, 167. 97	41, 720, 059. 68
5. 期末基金份额净值	1. 041	1. 024

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（不含公允价值变动损益）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。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 本报告期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

九泰久稳混合 A

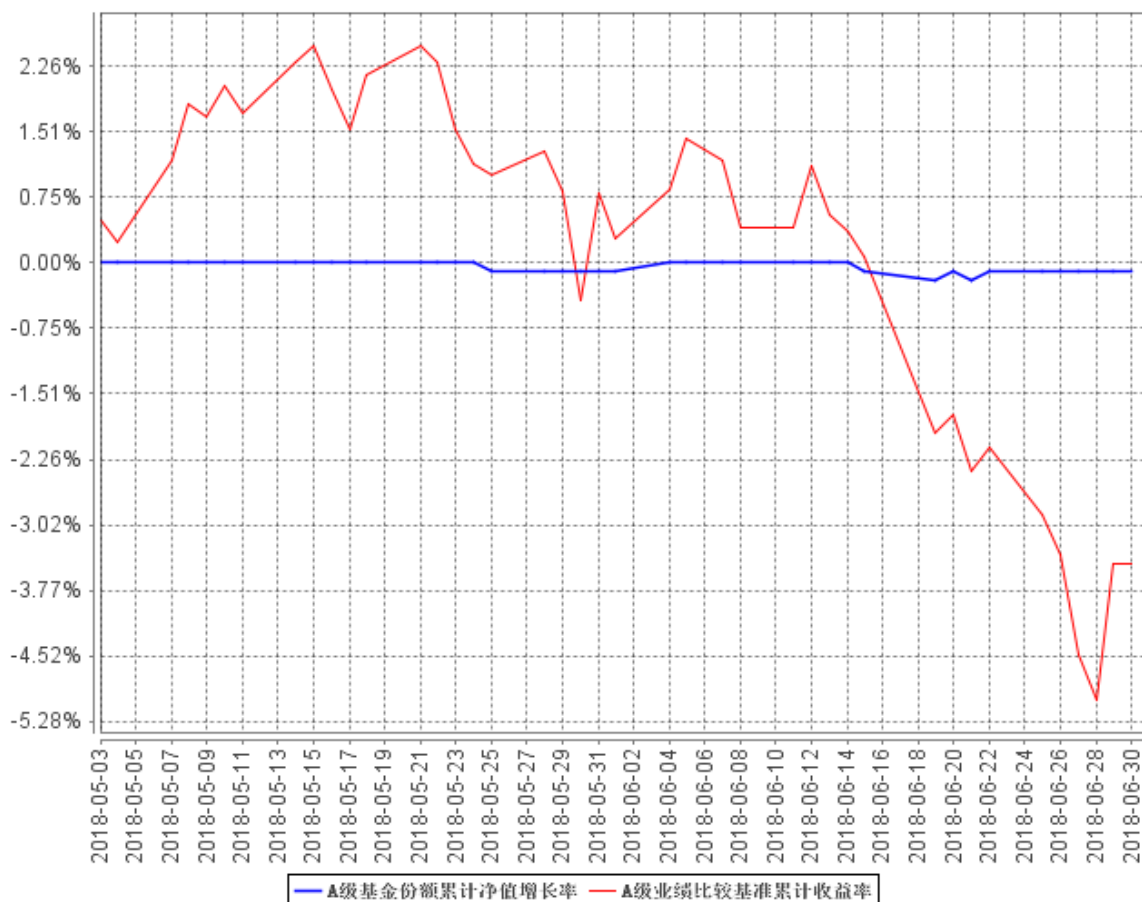
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.5.3-2018.6.30	-0.10%	0.04%	-3.47%	0.69%	3.37%	-0.65%

九泰久稳混合 C

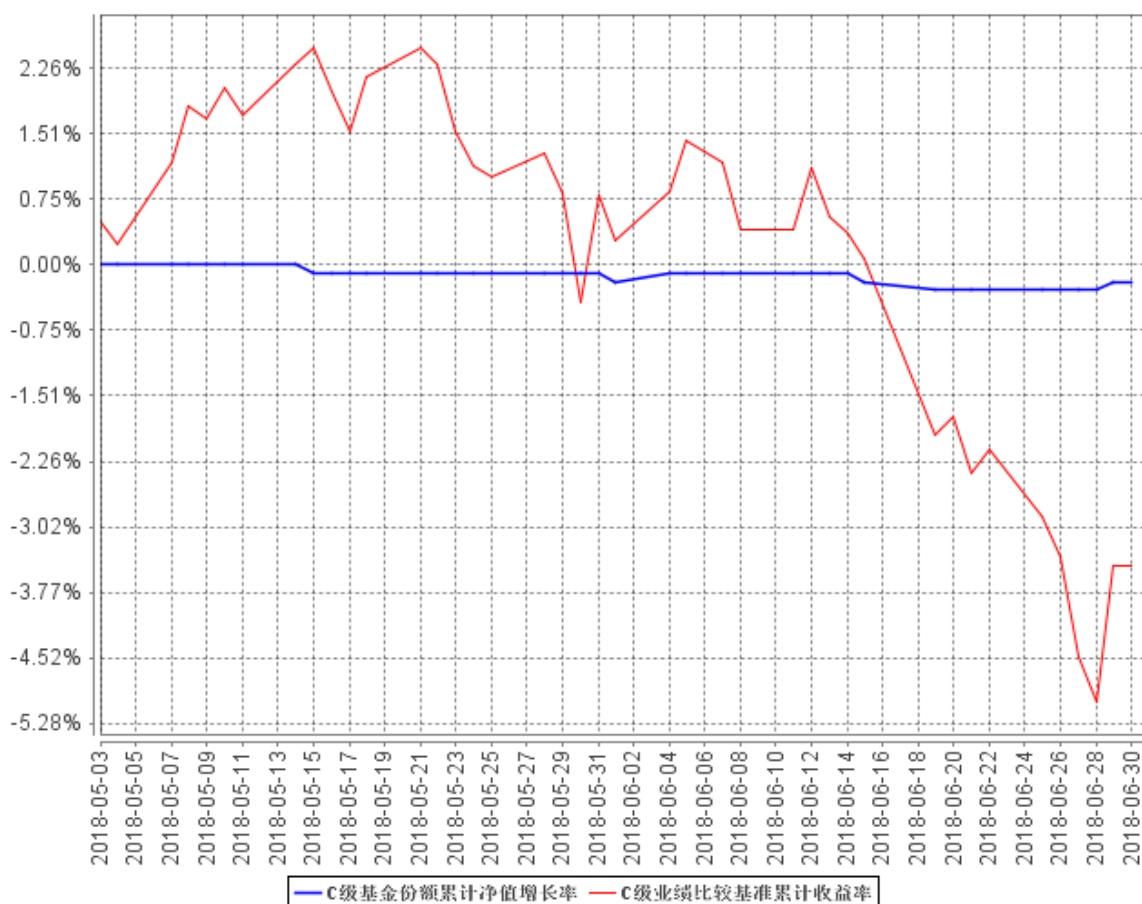
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.5.3-2018.6.30	-0.20%	0.04%	-3.47%	0.69%	3.27%	-0.65%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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. 本基金于 2018 年 5 月 3 日正式转型，基金合同于 2018 年 5 月 3 日正式生效，截止本报告期末，本基金合同生效尚未满一年。

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。截止报告期末本基金尚未完成建仓。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 本报告期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

##### 九泰久稳保本混合 A

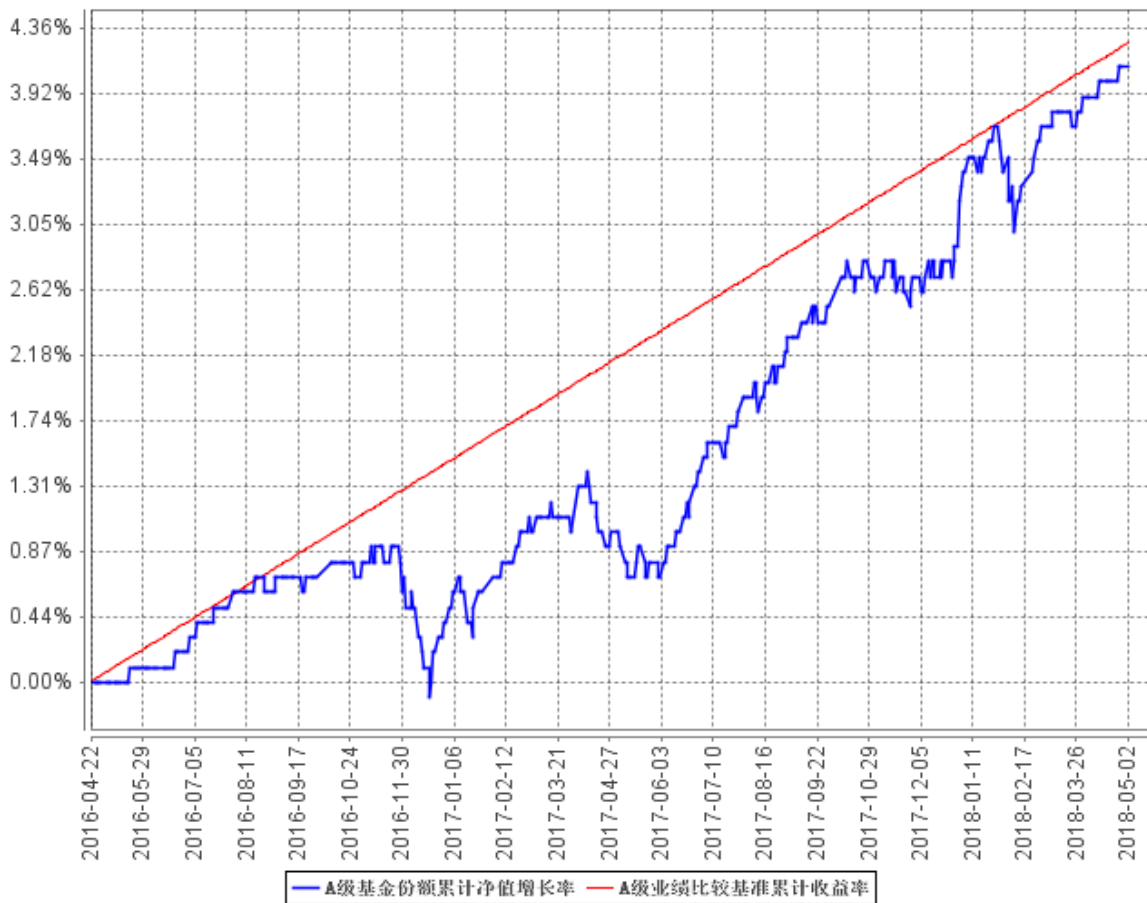
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.4.1-2018.5.2	0.19%	0.03%	0.18%	0.01%	0.01%	0.02%

##### 九泰久稳保本混合 C

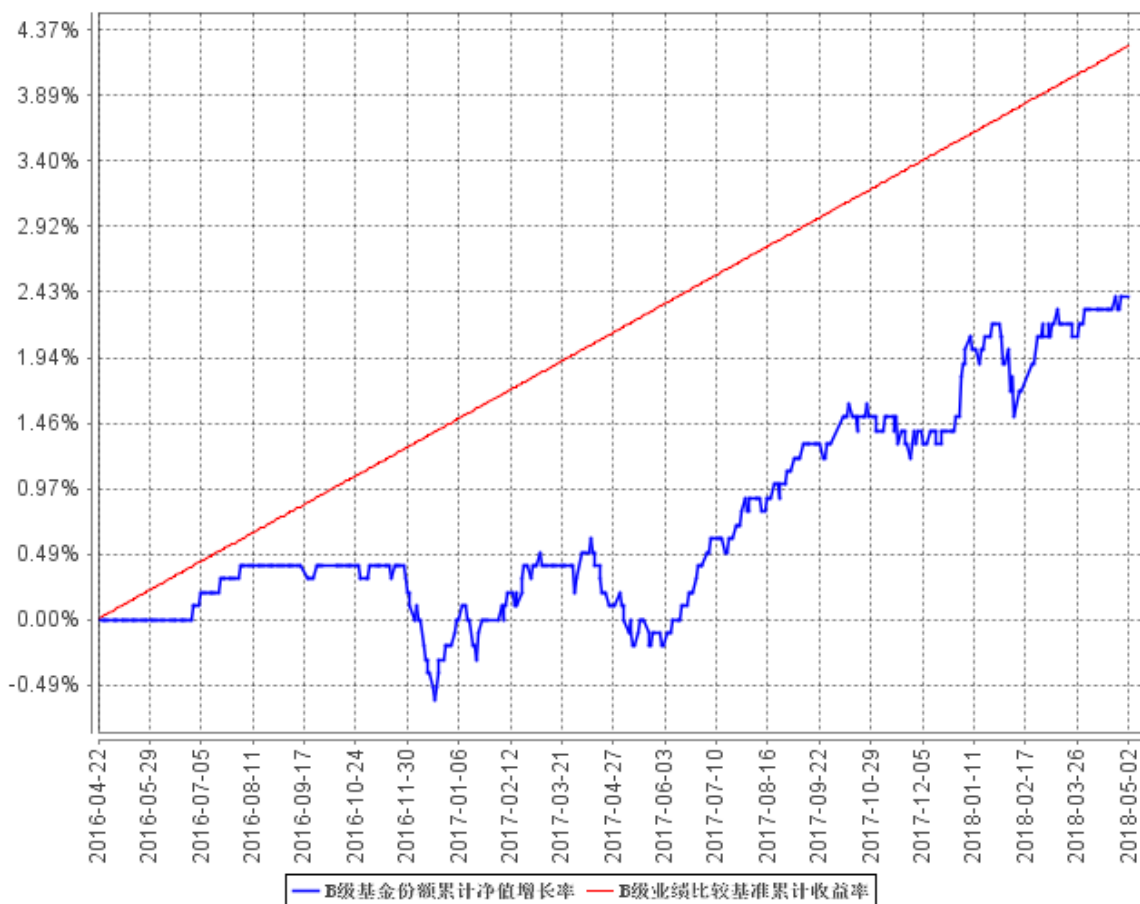
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.4.1-2018.5.2	0.20%	0.04%	0.18%	0.01%	0.02%	0.03%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



B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 2016 年 4 月 22 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合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2018年5月2日	9	南开大学保险精算硕士，中国籍，具有基金从业资格。9 年证券从业经历。历任博时基金管理有限公司研究员、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）、九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金（原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。
王玥晰	基金经理	2016 年 4 月 22 日	2018 年 5 月 2 日	10	理学硕士，中国籍，具有基金从业资格，10 年证券从业经验。历任诺安基金管理有限公司债券交易员，诺安基金管理有限公司基金经理助理，诺安货币市场基金 A/B 基金经理（2013 年 7 月至 2015 年 1 月）。2015 年 4 月加入九泰基金管理有限公司，曾任九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金（2015 年 11 月 10 日至 2017 年 7 月 31 日），现任九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（2015 年 8 月 3 日至今）、九泰日添金货币市场基金（2015 年 12 月 8 日至今）、九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金（原九泰

					久稳保本混合型证券投资基金，2016 年 4 月 22 日至今)、九泰久利灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 11 月 7 日至今)、九泰久鑫债券型证券投资基金(2016 年 12 月 19 日至今)、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 20 日至今)、九泰久益灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 25 日至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	---

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟亚强	基金经理	2018 年 5 月 3 日	-	9	南开大学保险精算硕士，中国籍，具有基金从业资格。9 年证券从业经历。历任博时基金管理有限公司研究员、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)、九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金(原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。
王玥晰	基金经理	2018年5月3日	-	10	理学硕士, 中国籍, 具有基金从业资格, 10年证券从业经验。历任诺安基金管理有限公司债券交易员, 诺安基金管理有限公司基金经理助理, 诺安货币市场基金 A/B 基金经理(2013年7月至2015年1月)。2015年4月加入九泰基金管理有限公司, 曾任九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2015年11月10日至2017年7月31日), 现任九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金(2015年8月3日至今)、九泰日添金货币市场基金(2015年12月8日至今)、九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金(原九泰久稳保本混合型证券投资基金, 2016年4月22日至今)、九泰久利灵活配置混合型证券投资基金(2016年11月7日至今)、九泰久鑫债券型证券投资基金(2016年12月19日至今)、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017年1月20日至今)、九泰久益灵活配置混合型证券投资基金

					(2017 年 1 月 25 日至今) 的基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 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组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的季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

本报告期内，本公司所管理的投资组合，在参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的情况共出现了 1 次，未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，金融去杠杆力度不减，信用收缩明显；信用风险上升，企业现金流恶化，经济下行风险加大；中美贸易战反复拉锯，市场资金风险厌恶度上升。股市大幅震荡调整，债券收益率区间震荡。报告期内，本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。本基金把保证资产的安全性放在首位，在参考外部评级的基础上，进行严谨的内部评级筛选，严格把控信用风险。报告期内，本基金由保本型基金转型为灵活配置混合型基金，后续将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。本基金将继续密切关注经济基本面和政策面的变化以及资金面的动向，判断债券收益率走势，把握投资机会。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金自 2018 年 5 月 3 日转型，转型前最后一日 A 类份额净值 1.041 元，本报告期内截止转型前 A 类份额净值增长率为 0.19%，业绩比较基准收益率为 0.18%；转型前最后一日 C 类份额净值为 1.024 元，本报告期内截止转型前 C 类份额净值增长率为 0.20%，业绩比较基准收益率为 0.18%。转型后截至本报告期末，A 类份额净值 1.040 元，转型后截至本报告期末，A 类份额净值增长率为-0.10%，业绩比较基准收益率为-3.47%；转型后截至本报告期末，转型后最后一日本基金 C 类份额净值为 1.022 元，转型后截至本报告期末 C 类份额净值增长率为-0.20%，业绩比较基准收益率为-3.47%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

转型后：

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	661,764.00	0.78
	其中：股票	661,764.00	0.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,102,500.00	11.98
	其中：债券	10,102,500.00	11.98
	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	29,760,284.64	35.29
	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	43,299,423.95	51.35
8	其他资产	504,325.59	0.60
9	合计	84,328,298.18	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	539,616.00	0.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	122,148.00	0.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	661,764.00	0.80

### 5.2.2 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沪港通股票。

### 5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000666	经纬纺机	33,600	539,616.00	0.65
2	600701	*ST 工新	16,200	122,148.00	0.15

注：本基金本报告期末仅持有上述两只股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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	10,102,500.00	12.16
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,102,500.00	12.16

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	041772010	17 北京桑德 CP002	50,000	5,063,500.00	6.09
2	011772034	17 中成 SCP003	50,000	5,039,000.00	6.07

注：本基金本报告期末仅持有上述两只债券。

### 5.6 报告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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1

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。

#### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	21,018.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	483,306.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	504,325.59

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000666	经纬纺机	539,616.00	0.65	重大事项流通受限
2	600701	*ST 工新	122,148.00	0.15	重大事项流通受限

### 5.11.6 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。

## 转型前：

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,737,896.00	0.73
	其中：股票	1,737,896.00	0.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	235,590,305.18	99.22
8	其他资产	125,317.75	0.05
9	合计	237,453,518.93	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,588,532.00	0.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	149,364.00	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,737,896.00	1.04

### 5.2.2 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沪港通投资股票。

## 5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化学	24,100	878,204.00	0.52
2	000666	经纬纺机	33,600	614,544.00	0.37
3	600701	工大高新	16,200	149,364.00	0.09
4	002601	龙麟佰利	5,200	95,784.00	0.06

注：本基金本报告期末仅持有上述四只股票。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1

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。

##### 5.11.2

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。

##### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	22,652.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	102,665.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	125,317.75

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600309	万华化学	878,204.00	0.52	重大事项流通受限
2	000666	经纬纺机	614,544.00	0.37	重大事项流通受限
3	600701	工大高新	149,364.00	0.09	重大事项流通受限

#### 5.11.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	九泰久稳混合 A	九泰久稳混合 C
基金合同生效日（2018年5月3日） 基金份额总额	121,187,754.88	40,735,615.32
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	1,439.22	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	60,693,392.42	21,006,121.52
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	60,495,801.68	19,729,493.80

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

### § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	九泰久稳保本混合 A	九泰久稳保本混合 C
----	------------	------------

报告期期初基金份额总额	616,080,089.35	175,082,788.08
报告期期间基金总申购份额	1,274.56	39.13
减:报告期期间基金总赎回份额	494,893,609.03	134,347,211.89
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	121,187,754.88	40,735,615.32

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额包含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型后)

本报告期内基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型后)

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本报告期内基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

九泰久稳保本混合型证券投资基金第一个保本周期于 2018 年 4 月 23 日到期，根据基金合同约定，本公司于 2018 年 4 月 16 日发布了《九泰久稳保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》、《关于九泰久稳保本混合型证券投资基金修订基金合同的公告》以及转型后的基金合同、托管协议和招募说明书。2018 年 5 月 3 日，《九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。

## § 9 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予九泰久稳保本混合型证券投资基金（转型前）募集注册的文件
- 2、《九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、报告期内九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 10.2 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。

### 10.3 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  
2018 年 7 月 18 日