

九泰久弘灵活配置混合型证券投资基金招 募说明书摘要

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

二零二零年一月

重要提示

本基金的募集申请经中国证监会 2019 年 7 月 25 日证监许可【2019】1369 号文注册。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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。根据《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构可以基于基金产品风险等级划分方法的变化，对本基金的风险等级进行重新评估并基于评估结果更新本基金的风险等级，风险等级的评估更新不改变本基金的实质

性风险收益特征,但由于基金管理人或销售机构基金产品风险等级划分方法的变化,本基金的风险等级表述可能有相应变化,具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。本基金可投资资产支持证券,也可投资股指期货等金融衍生品,另外本基金还面临资产配置的风险,可能增加本基金总体风险水平。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金的投资范围为国内依法发行上市交易的股票(包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票),债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券),债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、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)。

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。

本基金可投资于科创板股票,会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、科创板企业退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等,具体参见本招募说明书第十六部分风险揭示章节。

本基金可根据投资策略需要或市场环境变化,选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板,基金资产并非必然投资于科创板。

投资有风险,投资者投资本基金时应认真阅读招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,自《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》实施之日起一年后开始执行。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人的基本情况

名称：九泰基金管理有限公司

住所：北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 8 号楼 A 栋 101-120 室、201-222 室

法定代表人：卢伟忠

组织形式：有限责任公司

注册资本：3 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：010-57383999

联系人：韩炳光

股权结构：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、九州证券股份有限公司出资分别占注册资本的 26%、25%、25%和 24%的股权。

二、主要人员情况

1、董事会成员

吴强先生，管理学硕士，董事长。曾任万联证券投行部业务经理，宏源证券资本市场部副总经理，安信证券投行部业务副总裁，国信证券投行业务部总经理助理，九州证券股份有限公司董事长。现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司董事、副总经理，九泰基金管理有限公司董事长。

吴刚先生，管理学硕士，董事。曾任闽发证券投资银行部项目经理，中国证监会机构监管部副处长、处长。现任拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司执行董事、总经理，同创九鼎投资管理集团股份有限公司董事长等职务。

卢伟忠先生，金融学硕士，董事、法定代表人，总经理。曾任金瑞期货研究员，安信证券股指期货 IB 业务专员，安信期货办公室主任，安信期货 IB 业务部总经理，安信证券资产管理部产品总监，安信乾盛常务副总经理。现任九泰基金管理有限公司董事、法定代表人，总经理。

袁小文女士，高级管理人员工商管理硕士，独立董事。曾任广东万通期货公司副总经理，浙江金马期货公司常务副总，长城伟业期货经纪有限公司（后更名为华泰长城期货有限公司）副总经理，华泰长城期货有限公司总经理，中信证券股份有限公司下属子公司执行副董事长，中信期货有限公司董事长，现任阳富教育咨询服务（深圳）有限公司董事长职务。

徐艳女士，经济学博士，教授，独立董事。曾任海国投工业开发股份有限公司投资部经理，海南大学经济管理学院金融系系主任，海南大学 MBA 教育中心主任，现任海南大学管理学院教授。

陈耿先生，经济学博士，教授，独立董事。曾任青岛崂山区政府（高科技开发区）职员，重庆大学工商管理博士后科研站博士后，现任重庆大学经济与工商管理学院教师，担任重庆大学经济与工商管理学院高管培训中心(EDP)主任职务。

2、监事成员

徐磊磊先生，工商管理硕士，监事。曾任昆吾九鼎投资管理有限公司行政助理、行政经理，同创九鼎投资管理集团股份有限公司监事，现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司证券事务代表。

刘开运先生，金融学硕士，监事。曾任毕马威华振会计师事务所审计师，昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理、合伙人助理。现任九泰基金管理有限公司定增投资中心总经理、致远权益投资部总经理兼执行投资总监、基金经理。

3、公司高级管理人员

卢伟忠先生，简历同上。

王玉女士，涉外经济本科，副总经理。曾任陕西群力子弟学校教师，北京思拓克斯商贸有限公司经理助理，太平洋人寿保险北京分公司营销业务部经理、海淀支公司总经理、分公司党委委员、副总经理，国风共创管理咨询有限公司总经理。现任九泰基金管理有限公司副总经理。

吴祖尧先生，工学硕士，副总经理。曾任中国信达信托投资公司证券研究部副经理，中国银河证券研究中心研究主管、董事总经理，中国银河证券投行内核小组成员，中国银河证券投资顾问部董事总经理，中国银河证券投资决策委员会委员。现任九泰基金管理有限公司副总经理。

陈沛先生，法学硕士，督察长。曾任广州大学松田学院教师、平安证券有限

责任公司合规专员、安信证券股份有限公司董事会办公室股权管理专员、安信基金管理有限责任公司监察稽核部法律主管、泰达宏利基金管理有限公司监察稽核部负责人。现任九泰基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

何昕先生，中国人民大学经济学硕士，中国籍，具有基金从业资格，5年证券从业经历，历任泰康之家投资有限公司产业研究员，2016年9月加入九泰基金，现任中正和权益投资部基金经理，九泰久益灵活配置混合型证券投资基金（2018年8月21日至今）的基金经理。

5、公募投资决策委员会成员

本公司公募投资决策委员会成员包括：吴祖尧先生（委员会主席）、刘勇先生、刘开运先生、刘心任先生。

吴祖尧先生，25年金融证券从业经验。历任中国信达信托投资公司证券研究部副经理，中国银河证券研究中心研究主管、董事总经理，中国银河证券投行内核小组成员，中国银河证券投资顾问部董事总经理，中国银河证券投资决策委员会委员。2014年加入九泰基金管理有限公司，现任副总经理，曾任九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金（2015年12月9日至2018年6月5日）、九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金（2016年9月26日至2018年6月5日）的基金经理。

刘勇先生，北京大学金融数学系学士、硕士，中国籍，具有基金从业资格，10年证券从业经验。历任博时基金固定收益部研究员、博时基金固定收益部基金经理助理。2015年5月加入九泰基金管理有限公司，曾任九泰久鑫债券型证券投资基金（2018年11月26日至2019年3月22日）的基金经理，现任绝对收益部副总经理，九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（2018年10月31日至今）、九泰日添金货币市场基金（2018年11月26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，2018年11月26日至今）的基金经理。

刘开运先生，金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格，9年证券从业经验。曾任毕马威华振会计师事务所审计师，昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理、合伙人助理。2014年7月加入九泰基金管理有限公司，曾任九泰天富改革

新动力灵活配置混合型证券投资基金（2015年7月16日至2016年7月16日）、九泰盈华量化灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金、原九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金，2016年12月19日至2018年11月6日）的基金经理，现任定增投资中心总经理、致远权益投资部总经理兼执行投资总监，九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金（2015年8月14日至今）、九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（2016年2月4日至今）、九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金（2016年8月11日至今）、九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，2016年8月30日至今）、九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原九泰锐诚定增灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金，2017年3月24日至今）的基金经理。

刘心任先生，北京大学经济学硕士，中国籍，9年证券从业经验，具有基金从业资格。曾任广发基金管理有限公司研究员。2015年5月加入九泰基金管理有限公司，曾任九泰久利灵活配置混合型证券投资基金（2016年11月15日至2018年12月4日）的基金经理；现任研究发展部总监兼定增投资中心副总经理，九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（2018年11月30日至今）的基金经理。

6、公司董事长吴强先生与公司董事吴刚先生系兄弟关系。除此以外，上述人员之间无近亲属关系。

三、基金管理人的职责

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别

管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定各类基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制基金季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

四、基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制体系

为保证公司规范化运作,有效地防范和化解经营风险,促进公司诚信、合法、有效经营,保障基金份额持有人利益,维护公司及公司股东的合法权益,本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

1、公司的内部控制目标

- (1) 确保合法合规经营;
- (2) 防范和化解风险;
- (3) 提高经营效率;
- (4) 保护基金份额持有人和股东的合法权益。

2、公司内部控制遵循的原则

(1) 健全性原则

风险管理必须涵盖公司各个部门和各个岗位,并渗透到各项业务过程和业务环节,包括各项业务的决策、执行、监督、反馈等环节。

(2) 有效性原则

通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护风险管理制度的有效执行。

(3) 独立性原则

公司各机构、部门和岗位确保相对独立并承担各自的风险控制职责。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作须分离。督察长和监察稽核部对公司风险控制制度的执行情况进行检查和监督。

(4) 相互制约原则

公司在制度安排、组织机构的设计、部门和岗位设置上形成权责分明、相互制约的机制,从而建立起不同岗位之间的制衡体系,消除内部风险控制中的盲点,强化监察稽核部对业务的监督检查功能。

(5) 成本效益原则

公司将运用科学化的经营管理方法,并充分发挥各机构、部门及员工的工作积极性,尽量降低经营成本,提高经营效益,保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

（6）适时性原则

风险管理应具有前瞻性，并且必须随着国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变和公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化及时进行相应的修改和完善。

（7）内控优先原则

内控制度具有高度的权威性，所有员工必须严格遵守，自觉形成风险防范意识；执行内控制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；公司业务的发展必须建立在内控制度完善并稳固的基础之上。

（8）防火墙原则

公司在敏感岗位如：基金投资、交易执行、基金清算岗位之间，基金会计和公司会计之间、会计与出纳之间等等，在物理上和制度上设置严格的防火墙进行隔离，以控制风险。

3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。监察稽核部定期对公司制度、内部控制方式、方法和执行情况实行持续的检验，并出具专项报告。

4、内控监控防线

为体现职责明确、相互制约的原则，公司根据基金管理业务的特点，设立顺序递进、权责分明、严密有效的三道监控防线：

（1）建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责，各业务均制定详尽的操作流程，各岗位人员上岗前必须以书面形式声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责；

（2）建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督的责任；

(3) 建立以督察长、监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

5、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

(1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

(3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

(4) 交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；建立了交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善了相关的安全设施；集中交易室对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立了科学的投资交易绩效评价体系。

（5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制重点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

（6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

（7）监察稽核

公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，配备了充足的人员，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

6、基金管理人关于内部控制制度声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部控制制度。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：浙商银行股份有限公司

住所：杭州市萧山区鸿宁路 1788 号

办公地址：杭州市萧山区鸿宁路 1788 号

法定代表人：沈仁康

注册日期：1993 年 04 月 16 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】

91 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 17,959,696,778 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2013】1519 号

联系人：邵骏超

电话：0571-876598652、主要人员情况

沈仁康先生，浙商银行党委书记、董事长、执行董事。硕士研究生。沈先生曾任浙江省青田县委常委、副县长，县委副书记、代县长、县长；浙江省丽水市副市长，期间兼任丽水经济开发区管委会党工委书记，并同时担任浙江省丽水市委常委；浙江省丽水市委副书记，期间兼任市委政法委书记；浙江省衢州市委副书记、代市长、市长。

徐仁艳先生，浙商银行党委副书记、执行董事、行长。研究生、高级会计师、注册税务师。徐先生曾任中国人民银行浙江省分行会计处财务科副科长、科长、会计处副处长，中国人民银行杭州中心支行会计财务处副处长、处长，中国人民银行杭州中心支行党委委员、副行长

二、发展概况及财务状况

浙商银行是中国银保监会批准的 12 家全国性股份制商业银行之一，总行设在浙江省杭州市，是唯一一家总部位于浙江的全国性股份制商业银行，2004 年 8 月 18 日正式开业，2016 年 3 月 30 日在香港联交所上市（股份代号：2016）。截

至 2018 年末，浙商银行在全国 16 个省（直辖市）和香港特别行政区设立了 242 家分支机构，实现了对长三角、环渤海、珠三角以及部分中西部地区的有效覆盖。2017 年 4 月 21 日，首家控股子公司一浙银租赁正式开业。2018 年 4 月 10 日，香港分行正式开业，国际化战略布局进一步提速。

开业以来，浙商银行立足浙江，稳健发展，已成为一家基础扎实、效益优良、成长迅速、风控完善的优质商业银行。截至 2019 年 6 月 30 日，浙商银行总资产 17372.69 亿元，客户存款余额 10499.45 亿元，客户贷款及垫款总额 9327.02 亿元，较上年末分别增长 5.50%、7.71%、7.80%；不良贷款率 1.37%，资产质量保持同业领先水平。在英国《银行家》（The Banker）杂志“2018 年全球银行 1000 强（Top 1000 World Banks 2018）”榜单上，按一级资本位列第 111 位，较上年上升 20 位；按总资产位列第 100 位，较上年上升 9 位。中诚信国际给予浙商银行金融机构评级中最高等级 AAA 主体信用评级。

2019 年上半年，本集团紧紧围绕“两最”总目标，转变发展方式、调整优化结构、强化客户基础、防范化解风险、提升经营绩效。2019 年上半年，本集团实现归属于本行股东的净利润 75.28 亿元，同比增长 16.07%，年化平均总资产收益率 0.91%，年化平均权益回报率 16.03%。营业收入 225.74 亿元，同比增长 21.39%，其中：利息净收入 159.51 亿元，同比增长 37.10%；非利息净收入 66.23 亿元，同比下降 4.87%。营业费用 60.64 亿元，同比增长 8.84%，成本收入比 25.80%。计提信用减值损失 77.65 亿元，同比增长 52.90%。所得税费用 11.20 亿元，同比下降 22.03%。

三、托管业务部的部门设置及员工情况

浙商银行资产托管部是总行独立的一级管理部门，根据业务条线下设业务管理中心、营销中心、运营中心（外包业务中心）、监督中心，保证了托管业务前、中、后台的完整与独立。截至 2019 年 6 月 30 日，资产托管部从业人员共 38 名。

浙商银行资产托管部遵照法律法规要求，根据业务的发展模式、运营方式以及内部控制、风险防范等各方面发展的需要，制定了一系列完善的内部管理制度，包括业务管理、操作规程、基金会计核算、清算管理、信息披露、内部稽核监控、内控与风险防范、信息系统管理、保密与档案管理、重大可疑情况报告及应急处理等制度，系统性地覆盖了托管业务开展的方方面面，能够有效地控制、防范托

管业务的政策风险、操作风险和经营风险。

四、基金托管业务经营情况

中国证监会、银监会于 2013 年 11 月 13 日核准浙商银行开办证券投资基金托管业务，批准文号：证监许可[2013]1519 号。

截至 2019 年 6 月 30 日，浙商银行托管证券投资基金 73 只，规模合计 1499.94 亿元，且目前已经与数十家公募基金管理公司达成托管合作意向。

五、基金托管人内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

浙商银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门设置了监督稽核团队，配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

3、内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作、顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

4、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，

对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

(1) 九泰基金管理有限公司直销中心

住所：北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 8 号楼 A 栋 109 室

法定代表人：卢伟忠

联系人：潘任会

电话：010-57383818

传真：010-57383894

邮箱：service@jtamc.com

公司网址：<http://www.jtamc.com/>

(2) 九泰基金管理有限公司电子交易平台

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

网址：<http://www.jtamc.com/>

2、其他销售机构

本基金暂无其他销售机构，基金管理人可根据有关法律、法规的要求，调整本基金的销售机构。

二、登记机构

名称：九泰基金管理有限公司

住所：北京市丰台区丽泽路18号院1号楼801-16室

办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园8号楼A栋101-120室、201-222室

法定代表人：卢伟忠

电话：010-57383999

传真：010-57383966

联系人：齐永哲

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层

负责人：朱小辉

电话：010-57763888

传真：010-57763777

经办律师：吴冠雄、李晗

联系人：李晗

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区延安东路222号30楼

负责人：曾顺福

联系人：杨婧

联系电话：021-61418888

传真电话：021-63350003

经办注册会计师：杨丽、杨婧

第四部分 基金的名称

九泰久弘灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式/混合型证券投资基金

第六部分 基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期、稳定增值，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为国内依法发行上市交易的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券），债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、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）。

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。

本基金的投资组合比例为：

股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行

适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分 基金的投资策略

1、大类资产配置策略

本基金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，并在基金合同投资范围约定的范围下适时进行动态调整。

本基金的股票投资组合比例将按照沪深 300 指数 PE(TTM)估值水平进行调整。本基金的具体资产配置比例如下：

(1) 当沪深 300 指数的 PE(TTM)估值处于历史后 20%分位，本基金股票资产占基金资产的比例为 50%-95%。

(2) 当沪深 300 指数的 PE(TTM)估值处于历史前 20%分位，本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-45%。

(3) 除上述两种情况以外，本基金股票资产占基金资产的比例 30%-75%。

上述资产配置比例的方法，是指将沪深 300 指数发布至最近一个交易日的可取值的每日 PE (TTM) 估值按从高到低排序，最高数值记为 100%分位，最低数值记为 0%分位，通过观察最近一个交易日的 PE (TTM) 估值在全部数值中所处的分位，来确定本基金股票资产占基金资产的比例。

基金管理人应当自上述条件触发之日的下一工作日起 10 个工作日内将本基金股票资产比例调整至符合上述比例范围。

2、股票投资策略

本基金采用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。

本基金的股票定性分析方法采用深度价值挖掘和多层立体投资分析体系。在灵活的类别资产配置的基础上，本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；

自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。

在定性分析的基础上，本基金的股票定量分析方法将分析备选股票的估值指标（如 PE、PB、PE/G、PS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等）、现金流量指标和其他财务指标，再通过比较市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平，并参考国际市场估值水平，来评估备选股票价值提升带来的投资机会。

经过严格的定性分析和定量分析，最终确定股票投资组合，并适时进行投资组合调整。

3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券资产投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

5、股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

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，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并

在招募说明书更新或相关公告中公告。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中债总指数收益率*30%

沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人与基金托管人协商一致，可以变更业绩比较基准，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定媒介及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

第十一部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C 类基金份额的销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、公证费、律师费、仲裁费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券/期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、证券/期货等账户开户费用、账户维护费用、银行间账户开立、查询及交易费用等；

10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费（含税）

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 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。

2、基金托管人的托管费（含税）

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，

顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人在月初三个工作日内出具销售服务费划款指令，基金托管人根据基金管理人的销售服务费划款指令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。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

九泰基金管理有限公司

2020年1月20日