九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:九泰基金管理有限公司
基金托管人:渤海银行股份有限公司
送出日期:2018年8月25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。本半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。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月22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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

自2018年6月15日起原九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金转型为九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金,九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金报告期自2018年6月15日(基金合同生效日)起至2018年6月30日止,原九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金报告期自2018年1月1日起至2018年6月14日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金名称	九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	九泰锐华混合
基金主代码	161036
基金运作方式	契约型 本基金延续变更注册前九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金的运作方式,采用封闭式运作,封闭期起始之日为本基金基金合同生效之日,结束之日为受变注册前九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金合同约束的最早开放申购、赎回业务的一个工作日。本基金封闭期内不开放申购、赎回业务,但本基金入类份额可上市交易。 封闭期届满后,本基金转为上市开放式基金(LOF),并更名为九泰锐华混合灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。本基金入类份额接受场内、场外申购与赎回等业务,并继续上市交易。本基金C类份额接受场外申购与赎回等业务,在符合相关法律法规和交易所规定的上市条件下,基金管理人在履行适当程序后,可安排C类份额上市交易,具体详见基金管理人发布的相关业务公告。
基金合同生效日	2018年6月15日
基金管理人	九泰基金管理有限公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	463,817,156.89份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所(若有)	深圳证券交易所
上市日期(若有)	2017-06-14
下属分级基金的基金简称	九泰锐华混合A 九泰锐华混合C
下属分级基金的交易代码	161036 161037
报告期末下属分级基金的份额总额	32,802,063.92份 421,015,102.97份

2.1 基金基本情况(转型前)

基金名称	九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	九泰锐华灵活配置混合
基金主代码	161036
基金运作方式	契约型。本基金在基金合同生效日设置两年的封闭期,封闭期起始之日为基金合同生效日,结束之日为基金合同生效日满两年后的年度对应的前一个工作日。本基金封闭期内不开放申购、赎回业务,但本基金入类基金份额可上市交易。 封闭期届满后,本基金转为上市开放式基金(LOF),并更名为九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。本基金类基金份额接受场内、场外申购与赎回等业务,并继续上市交易。本基金C类份额接受场外申购与赎回等业务,在符合相关法律法规和交易所规定的上市条件下,基金管理人在履行适当程序后,可安排C类份额上市交易,具体详见基金管理人发布的相关业务公告。
基金合同生效日	2016年12月19日
基金管理人	九泰基金管理有限公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	463,817,156.89份
基金合同存续期	2016-12-19至2018-6-14
下属分级基金的基金简称	九泰锐华定增混合A 九泰锐华定增混合C
下属分级基金的交易代码	161106 161107
报告期末下属分级基金的份额总额	32,802,063.92份 421,015,102.97份

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	本基金主要通过量化模型方法,精选股票进行投资,在严格控制风险的前提下,力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在股票投资过程中主要采用量化投资模型,指导构建投资组合,强调数量纪律,力争在控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债总指数(总值)财富指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、低于股票型基金,属于中高风险中高预期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	渤海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈琳	阮艳
	联系电话	010-57351999	010-66270109
	电子邮箱	chenlin@jtamc.com	juruan@bohb.com.cn
客户服务电话		400-628-0606	4008888811/95541
传真		010-57351966	022-58314791
注册地址		北京市丰台区丽泽路18号院1号楼801-16室	天津市河东区海河东路218号
办公地址		北京市朝阳区安定路30号阳山公园8号楼A幢101-120室,201-222室	天津市河东区海河东路218号
邮政编码		100029	300012
法定代表人		齐伟忠	李伏安

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办公场所

§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

转型后

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	九泰锐华混合A	九泰锐华混合C
本期已实现收益	331,148.07	4,134,469.73
本期利润	-5,104.42	-149,653.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0002	-0.0004
本期加权平均净值利润率	-0.02%	-0.04%
本期基金份额净值增长率	-0.01%	-0.04%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月30日	
期末可供分配利润	-2,493,902.06	-34,971,729.00
期末可供分配基金份额利润	-0.07610	-0.08311
期末基金资产净值	30,308,153.86	386,043,373.97
期末基金份额净值	0.9240	0.9169
3.1.3 累计期末指标	2018年6月30日	
基金份额累计净值增长率	-0.01%	-0.04%

转型前

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年6月14日	
	九泰锐华定增混合A	九泰锐华定增混合C
本期已实现收益	-463,460.72	-9,348,315.95
本期利润	-467,093.16	-7,987,466.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0170	-0.0190
本期加权平均净值利润率	-1.83%	-2.06%
本期基金份额净值增长率	-1.81%	-2.03%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月14日	
期末可供分配利润	-2,488,797.64	-34,822,076.88
期末可供分配基金份额利润	-0.07589	-0.08327
期末基金资产净值	30,313,286.28	386,193,027.09
期末基金份额净值	0.9241	0.9173
3.1.3 期末本期末	2018年6月14日	
基金份额累计净值增长率	-7.59%	-8.27%

3.2 基金净值表现(转型后)

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

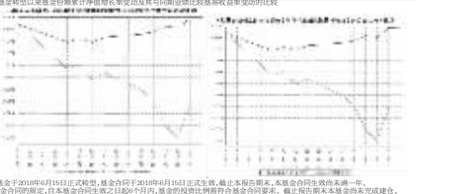
九泰锐华混合A

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
自基金合同生效起至今	-0.01%	0.34%	-3.81%	0.93%	3.80%	-0.59%

九泰锐华混合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
自基金合同生效起至今	-0.04%	0.34%	-3.81%	0.93%	3.77%	-0.59%

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



注:1.本基金于2016年6月15日正式成立,截止本报告期末,本基金合同生效还满一年,本基金过于2018年6月15日实现转型。
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 基金管理人及基金经理简况

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【2004】156号文批准,于2004年7月3日正式成立,现注册资本2亿元人民币,其中总持九泰锐华管理有限公司,间接持九泰锐华管理有限公司,后更名为九泰锐华管理有限公司)和间接持有九泰锐华管理有限公司的九泰锐华股份有限公司分别持有公司股份的比例为:九泰锐华管理有限公司持有公司股份的比例为:九泰锐华管理有限公司持有公司股份的比例为:九泰锐华管理有限公司