

九泰久鑫债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信情的说明

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、安全高效的治理理念和运用基金资产,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

报告期内,本公司所管理的投资组合,在参与的交易公开竞价交易中,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2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 报告期内本基金投资策略和运作分析

报告期内,经济下行逐步成为市场共识,债市市场继续走牛,股市市场继续走熊。本基金作为“二级债基”,重点投资于债券资产。本基金把债券资产的安全性放在首位,综合考虑外部评级和信用评级,严控信用风险。本基金继续密切关注经济基本面和政策面的变化以及资金面的走向,判断各大类资产的价格走势,把握投资机会。

4.5 报告期内基金的投资表现和运作分析

截至本报告期末本基金类别份额净值为0.927元,本报告期基金份额净值增长率为-6.49%;截至本报告期末本基金类别份额净值为0.929元,本报告期基金份额净值增长率为-6.64%;同期业绩比较基准收益率为0.22%。

4.6 报告期内基金持有人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5000万元的情形。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

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:2019年1月21日

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2019年1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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 九泰久鑫债券; 基金代码, 001942; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年12月18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, 14,327,964,099份

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年10月1日至2018年12月31日); 九泰久鑫债券A; 九泰久鑫债券C

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

4 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限, 说明

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定,表中任职日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

九泰日添金货币市场基金

2018年第四季度报告

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信情的说明

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、安全高效的治理理念和运用基金资产,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

报告期内,本公司所管理的投资组合,在参与的交易公开竞价交易中,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3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 报告期内本基金投资策略和运作分析

报告期内,经济下行逐步成为市场共识,债市市场继续走牛,股市市场继续走熊。本基金作为“现金管理工具”,投资于流动性较高的资产。本基金把流动性放在首位,兼顾了投资者的申购、赎回及大额申购需求。本基金灵活运用债券和货币市场工具,使组合具有较好的流动性。本基金把流动性放在首位,兼顾经济基本面和政策面的变化以及资金面的走向,判断债券和货币资产走势,把握投资机会。

4.5 报告期内基金的投资表现和运作分析

截至本报告期末本基金类别份额净值为0.6119元,本报告期基金份额净值增长率为0.3403%;截至本报告期末本基金类别份额净值为0.6222元,本报告期基金份额净值增长率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人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5000万元的情形。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

基金管理人:九泰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月21日

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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 九泰日添金货币; 基金代码, 001942; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年12月18日; 基金管理人, 九泰基金管理有限公司; 基金托管人, 中国建设银行股份有限公司; 报告期末基金份额总额, 202,898,007,638份

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年10月1日至2018年12月31日); 九泰日添金货币A; 九泰日添金货币B

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

4 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限, 说明

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定,表中任职日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

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:2019年1月21日

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2019年1月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 九泰日添金货币; 基金代码, 001942; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年12月18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, 202,898,007,638份

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年10月1日至2018年12月31日); 九泰日添金货币A; 九泰日添金货币B

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

4 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限, 说明

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定,表中任职日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信情的说明

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、安全高效的治理理念和运用基金资产,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

报告期内,本公司所管理的投资组合,在参与的交易公开竞价交易中,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2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 报告期内本基金投资策略和运作分析

报告期内,美股指数整体下行,A股市场窄幅震荡。中美贸易摩擦展开新一轮谈判,市场对经济前景的担忧得到缓解。中央经济工作会议强调了积极的财政政策要加力提效,稳健的货币政策要松紧适度,从政策层面给予市场一定信心。本基金在报告期内进行了相对均衡的行业配置,选股方向以稳健价值和长期成长类的股票为主。

4.5 报告期内基金的投资表现和运作分析

截至本报告期末本基金类别份额净值为0.8822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-6.22%。

4.6 报告期内基金持有人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5000万元的情形。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

基金管理人:九泰基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月21日

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。
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 九泰锐诚混合; 基金代码, 001942; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年12月18日; 基金管理人, 九泰基金管理有限公司; 基金托管人, 中国光大银行股份有限公司; 报告期末基金份额总额, 214,679,286.42份

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年10月1日至2018年12月31日); 九泰锐诚混合A; 九泰锐诚混合B

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

4 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限, 说明

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定,表中任职日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

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:2019年1月21日

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2019年1月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 九泰久鑫债券; 基金代码, 001942; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2016年12月18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, 14,327,964,099份

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年10月1日至2018年12月31日); 九泰久鑫债券A; 九泰久鑫债券C

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

4 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理日期, 证券从业年限, 说明

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定,表中任职日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

注:本基金合同于2016年12月18日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已满一年,距建仓期结束已逾一年。

2.根据基金合同的规定,自本基金合同生效之日起60个工作日内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 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债券投资明细

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贵金属投资明细

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五名权证投资明细

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十名资产支持证券投资明细

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衍生品投资明细

5.9 报告期末投资组合报告附注

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体