九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要

2016年第2号

基金管理人：九泰基金管理有限公司
基金托管人：中国银河证券股份有限公司

【重要提示】

本基金的募集申请经中国证监会2015年4月1日证监许可【2015】511号文注册。本基金的基金合同于2015年8月14日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本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。

本基金基金合同生效后前五年内（含第五年）仅对场外基金份额每年受限开放一次申购赎回业务，且申购赎回业务采取"以申定赎"原则，发生申购赎回份额部分确认时，采取"按比例确认"原则。固可能出现在基金合同生效后前五年内，基金份额持有人连续提出申购赎回申请但无法完全确认或完全无法确认的情况。基金份额持有人在每年受限开放日无法全部赎回或全部无法赎回时，可以将基金份额进行跨系统转托管到场内交易。在场内交易过程中，可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失。

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；尤其在基金合同生效前五年内（含第五年），本基金以参与投资定向增发股票为主要投资目标，公募基金参与定向增发股票投资需采取摊余成本发进行估值，固本基金基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值。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，属于高风险收益特征的证券投资基金品种。本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。因此，中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年8月14日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日（财务数据未经审计）。

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：北京市西城区广宁伯街2号金泽大厦西区6层
设立日期：2014年7月3日
法定代表人：卢伟忠
组织形式：有限责任公司
注册资本：2亿元人民币
存续期限：持续经营
联系电话：010-52601666
传真：010-52601699
联系人：王海滨
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。现任昆吾九鼎投资管理有限公司董事、副总经理，九州证券股份有限公司董事长，九泰基金管理有限公司董事长。
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。
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。现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司董事长。
陈晓红女士，工学博士，独立董事。曾任中南工业大学管理工程系副院长，日本东京工业大学高级访问学者，中南大学商学院名誉院长兼教授（学术）委员会主任、校长助理。现任中南大学商学院院长，教授，中国管理学会副理事长。
徐艳女士，经济学博士，独立董事。曾任长春税务学院金融系国际金融教研室主任，海国投工业开发股份有限公司投资部经理，现任海南大学MBA教育中心主任职务，院学位委员会委员、院学术委员会委员等职务。
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，重庆大学经济与工商管理学院教师，现任重庆大学经济与工商管理学院EMBA中心主任职务。
2、监事会成员
古志鹏先生，大学本科，监事。曾任毕马威会计师事务所经理助理，中国科学院中国科学传播研究所业务主管，昆吾九鼎投资管理有限公司吉林业务部负责人、东北业务大区总经理。现任同创九鼎投资管理集团股份有限公司董事会秘书。
刘开运先生，金融学硕士，监事。曾任毕马威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基金经理。
3、公司高级管理人员
卢伟忠先生，简历如上。
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。
王彦斌先生，经济学硕士，董事会秘书。曾任中国建设银行邯郸市分行科员，平安证券有限责任公司科员，银华基金管理有限公司业务主管，信达澳银基金管理有限公司基金运营中心副总经理、监察稽核总监，九泰基金管理有限公司总经理。现任九泰基金管理有限公司董事会秘书。
谢海波先生，经济学硕士，督察长。曾任南宁铁路局助理工程师，广西斯壮股份有限公司投资部负责人，中国证监会广西监管局主任科员、副处长，中国证监会青海监管局局长助理，九泰基金管理有限公司管委会委员。现任九泰基金管理有限公司督察长。
吴祖尧先生，工学硕士，总经理助理。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总经理助理。
严军先生，工商管理硕士，总经理助理。曾任天津证券深圳营业部电脑部总经理，渤海证券电子商务部银证通中心总经理，博时基金管理有限公司运维主管，信达澳银基金管理有限公司运营总监。现任九泰基金管理有限公司总经理助理。
郑立昌先生，工商管理硕士，总经理助理。曾任立信会计师事务所北京总部高级审计经理，昆吾九鼎投资管理有限公司风险控制部负责人。现任九泰基金管理有限公司总经理助理。
4、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，5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。现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日至今）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）、九泰锐富事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（2016年2月4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）、张勇先生、黄祥斌先生、李永兴先生、刘开运先生。
吴祖尧先生，同上。
张勇先生，经济学硕士，基金经理。15年证券从业经验，历任南京市商业银行信贷员、债券交易员，博时基金管理有限公司债券交易员、基金经理助理、固定收益部副总经理、固定收益总部现金管理组投资总监、博时现金收益证券投资基金基金经理（2006年7月至2015年5月）、博时策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2009年8月至2015年5月）、博时稳定价值债券投资基金基金经理（2010年8月至2014年2月）、博时安盈债券型证券投资基金基金经理（2013年4月至2015年5月）、博时宏观回报债券型证券投资基金基金经理（2014年2月至2015年5月）、博时天天增利货币市场基金（2014年8月至2015年6月）基金经理、博时现金宝货币市场基金（2014年9月至2015年6月）基金经理、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金（2014年9月至2015年6月）基金经理、博时保证金实时交易型货币市场基金（2014年11月至2015年6月）基金经理。现任九泰基金管理有限公司总裁助理兼绝对收益部总经理。
黄祥斌先生，产业经济学硕士，基金经理。10年证券从业经历，历任信达证券首席策略分析师，益民基金管理有限公司基金经理助理、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2013年12月至2015年8月）。2015年8月加入九泰基金管理有限公司任基金经理，权益投资总监。
李永兴先生，经济学硕士，中国籍，具有基金从业资格，10年证券从业经验。曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员，基金经理助理，交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金（2012年3月至2015年6月）、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金（2014年5月至2015年6月）基金经理。2015年12月加入九泰基金管理有限公司。
刘开运先生，金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格，5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。现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日至今）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）、九泰锐富事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（2016年2月4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。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人的基本情况
1、基本情况
名称：中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：陈有安
成立时间：2007年1月26日
注册资本：953725.8757万元人民币
基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】629号
组织形式：股份有限公司
存续期间：持续经营
联系电话：95551
联系人：李蔚
中国银河证券股份有限公司是中国证券行业领先的综合性金融服务提供商，提供经纪、销售和交易、投资银行等综合证券服务。2007年1月26日，公司经中国证监会批准，由中国银河金融控股有限责任公司作为主发起人，联合4家国内机构投资者共同发起正式成立。中央汇金投资有限责任公司为公司实际控制人。公司本部设在北京，注册资本为人民币953725.8757万元。公司于2013年5月22日在香港联合交易所上市，控股股东为中国银河金融控股有限责任公司。
2、主要人员情况
银河证券托管部管理团队具有十年以上银行、公募基金、证券清算等金融从业经验，骨干员工从公司原有运营部门抽调，可为客户提供更多安全高效的资金保管、产品核算及产品估值等服务。
3、基金托管业务经营情况
银河证券托管部于2014年1月正式成立，在经证券监管部门批准获得托管资格后已可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度，同时秉承公司"忠诚、包容、创新、卓越"的企业精神，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。

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北京直销中心
办公地址：北京市西城区华远北街2号通港大厦812-818
电话：010-83369933
传真：010-52601225
邮箱：service@jtamc.com
网址：www.jtamc.com
联系人：潘任会
（2）九泰基金管理有限公司电子交易平台
网址：https://trade.jtamc.com
2、代销机构
1）中国银河证券股份有限公司
注册地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：陈有安
客户服务电话：95551或4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn
2）华泰证券股份有限公司
注册地址南京市江东中路228号
法定代表人：周易
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
3) 中信建投证券股份有限公司
注册地址北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
客户服务电话：95587/4008-888-108
网址：www.csc108.com
4) 信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
客户服务电话：95321
网址：www.cindasc.com
5）国都证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常喆
网址：www.guodu.com
客户服务电话：400-818-8118
6）大同证券有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾馆15号桐城中央21层
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12，F13
法定代表人：董祥
网址：www.dtsbc.com.cn
客户服务电话：400-712-1212
7）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层
法定代表人：宫少林
网址：www.newone.com.cn
客户服务电话：95565
8）东莞证券股份有限公司
注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号
办公地址：广州省东莞市莞城区可园南路一号22楼
法定代表人：张运勇
网址：www.dgzq.com.cn
客户服务电话：95328
9）联讯证券股份有限公司
注册地址：：惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址：惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三，四层
法定代表人：徐刚
网址：www.lxzq.com.cn
客户服务电话：95564
10）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼，28层A02单元
法定代表人：王连志
网址：www.essence.com.cn
客户服务电话：95517
11）华龙证券股份有限公司
注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号文化大厦21楼
法定代表人：李晓安
网址：www.hlzqgs.com
客户服务电话：95368/400-6898888
12) 华西证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号
办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号
法定代表人：杨炯洋
网址：www.hx168.com.cn
客户服务电话：95584/4008-888-818
13）首创证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区德胜门外大街115号
办公地址：北京市西城区德胜门外大街115号
法定代表人：吴涛
网址：www.sczq.com.cn
客户服务电话：400-620-0620
14）华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12-18层
法定代表人：祝献忠
网址：www.hrsec.com.cn
客户服务电话：95390/400-898-9999
15）国金证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号
办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人：冉云
网址：www.gjzq.com.cn
客户服务电话：95310
16）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号40层
法定代表人：李梅
网址：www.sywg.com
客户服务电话：95523
17）申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐天山区文艺路233号宏源大厦8楼
法定代表人：李季
网址：www.hysec.com
客户服务电话：400-800-0562
18）平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：谢永林
网址：www.stock.pingan.com
客户服务电话：95511
19）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址： 上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人：其实
联系人： 潘世友
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
20）杭州数米基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人：陈柏青
联系人：韩爱彬
客户服务电话：4000-766-123
传真： 0571-26697013
网址： www.fund123.cn
21）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺路18号
法定代表人：凌顺平
联系人：吴强
客户服务电话：4008-773-772
传真：0571-86800423
网址：www.5ifund.com
22）深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
客户服务电话：4006-788-887
传真：0755-33227951
网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com
23）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
客户服务电话：400-700-9665
传真：021-68596916
网址：www.ehowbuy.com
24）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：李兴春
联系人：曹怡晨
客服电话：400-067-6266
电话：86-021-50583533
传真：86-021-50583633
网址：www.leadfund.com.cn
25）上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法定代表人：燕斌
联系人：兰敏
客户服务电话：4000-466-788
传真： 021-52975270
网址：www.66zichan.com
26）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：刘洋
客户服务电话：4009200022
电话：010-85650628
传真：010-65884788
网址：www.hexun.com
27）深圳新兰德投资咨询有限公司
注册地址： 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：杨懿
联系人：文雯
客户服务电话：400-166-1188
传真：010-83363072
网址： 8.jrj.com.cn
28）北京增财基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
法定代表人：罗细安
联系人：李皓
客户服务电话：010-67000988
传真：010-67000988-6000
网址：www.zcvc.com.cn；www.zengcaiwang.com
29）一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A座2208
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：段京璐
客户服务电话：400-001-1566
传真：010-88312099
网址：www.yilucaifu. com
30）诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人：汪静波
联系人：张裕
客户服务电话：400-821-5399
传真：021-38509777
网址：www.noah-fund.com
31）北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008
法定代表人：赵荣春
联系人：崔丁元
客服服务电话：400-893-6885
传真：010-57569671
网址：www.qianjing.com
32）上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼
法定代表人：鲍东华
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
客户服务电话：4008-219-031
网址：www.lufunds.com
33）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
客户服务电话：020-89629066
传真：020-89629011
网址：www.yingmi.cn
34）北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼2层
法定代表人：董浩
联系人：姜颖
客户服务电话：400-068-1176
传真：010-65951887
网址：www.jimufund.com
35）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址：上海市虹梅路1801号凯科国际大厦7楼
法定代表人：金佶
联系人：陈云卉
客户服务电话：4008202819
传真：021-33323837
网址：http://www.chinapnr.com/
36）中证金牛（北京）投资咨询有限公司（金牛理财网）
注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人：钱昊旻
联系人：孙雯
客户服务电话：4008909998
传真：010-59336500
网址：www.jnlc.com
37）深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人：齐小贺
联系人：杨涛
客户服务电话：0755-83999907
传真：0755-83999926
网址：www.jinqianwo.cn
38）大泰金石投资管理有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15层
法定代表人：袁顾明
联系人：朱真卿
客户服务电话：400-928-2266
传真：021-20324199
网址：www.dtfunds.com
39）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人：申健
联系人：印强明
客户服务电话：021-20219931
传真：021-20219923
网址：8.gw.com.cn
40）湘财证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人：林俊波
联系人：李欣
客户服务电话：400-888-1551
传真：021-68865680
网址：www.xcsc.com
41）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：葛佳蕊
客户服务电话：4006-433-389
传真：021-63332523
网址：www.lingxianfund.com
3、场内销售机构：本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位经深圳证券交易所确认后也可代理场内基金份额的发售。
基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行公告义务。
二、登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：010-59378982
传真：010-58598907
联系人：程爽
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）北京分所
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城西二办公楼8层10室
北京分所负责人：崔劲
联系人：张军峰
联系电话：010-8512 5195、186-1131-0500
传真电话：010-8518 1218
经办注册会计师：郭新华、张军峰

第四部分 基金的名称

九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金的运作方式

契约型，本基金在基金合同生效后五年内（含第五年）以参与投资定向增发股票为主要投资目标，场内份额不开放申购、赎回业务，但可上市交易；场外份额每年定期开放一次申购、赎回业务，基金管理人可采取部分确认的方式确保申购、赎回结束后本基金的总份额基本保持不变。本基金合同生效后第五个年度对日起，本基金转为上市开放式基金（LOF），并更名为九泰锐智事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF），接受场内、场外申购与赎回等业务，并继续上市交易。本基金运作过程中，开放跨系统转托管业务，不开放系统内转托管业务。

第六部分 基金的投资目标

基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，在基金合同生效后五年内（含第五年），通过对定向增发项目的深入研究，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资；本基金转为上市开放式基金（LOF）后，通过深入挖掘国内经济增长和结构转型所带来的事件性投资机会，精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越各阶段业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。

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（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，权证，股指期货，货币市场工具，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。本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及基金合同禁止投资的投资工具。
本基金的投资组合比例为：
基金合同生效后五年内（含第五年），股票资产占基金资产的比例为0%-95%；非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于80%；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，本基金的期货交易账户内应当保持不低于期货交易保证金一倍的现金。
本基金转为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例为0%-95%；投资事件驱动类公司的证券占非现金资产的比例不低于80%；非公开发行股票资产占基金资产的比例不超过20%；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，本基金的期货交易账户内应当保持不低于期货交易保证金一倍的现金， 同时本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
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

（一）本基金在基金合同生效后五年内（含第五年），通过对宏观经济，行业分析轮动效应与定向增发项目优势的深入研究的基础上，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线，形成以定向增发为核心的投资策略。
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。
2、定向增发股票投资策略
本基金从估值水平和发展前景两个角度出发，分析不同类别的定向增发项目对企业基本面与所处行业的影响。采取定性和定量分析相结合的方法对影响上市公司定向增发项目未来的价值进行全面的分析，精选股价受益或未能充分体现定向增发项目发展潜力的股票，在严格控制投资组合风险与收益的前提下，对行业进行优化配置和动态调整。
本基金的股票定量分析方法将在现有定向增发项目的基础之上，分析市场现有定向增发项目中各行业公司的估值指标（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，从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司，作为本基金的备选定向增发股票；再通过分析备选股票所代表的公司的资产收益率、资产周转率等变量的时间序列，以及通过对市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平的比较，并参考国际市场估值水平来评估其投资价值。
在定量分析的基础上，本基金的股票定性分析方法采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系，从定向增发项目的目的、定向增发对象结构、定向增发项目类别，并结合基金管理人的股票研究平台和产业投资平台，多层面地分析备选定增增发项目所对应的公司的业务环节的竞争优势和劣势，分析定向增发项目对公司未来的影响，公司管理方面的优势和劣势，分析定向增发项目对所处行业的波特五力结构与上下游产业的影响。
经过严格的定量分析和定性分析，最终确定股票投资组合，并适时进行投资组合调整。
本基金将定向增发根据其本身的性质，发行对象，项目类别，对企业的实际影响细化为如下几个方面：
（1）大股东主导的定向增发投资
大股东主导的定向增发项目包括集团公司整体上市，实际控制人资产注入，公司间资产置换重组中发行对象包含大股东或者大股东关联方，以及融资收购资产中收购大股东资产的几种定向增发项目。从根本上来说，此类项目不仅改变公司的资产结构，同时也会对企业未来在生产、经营、管理等多个方面产生影响。本基金通过定性和定量方法对大股东的增资目的、增发资产的质量等方面，对定向增发项目可能带来的影响进行模拟分析，挑选具有绝对或相对估值吸引力的公司股票，再通过分析和评估股权变化，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。
（2）项目融资类定向增发投资
项目融资类的定向增发项目为定向增发项目中最常见的类别，目前市场上近一半的定向增发项目为项目融资类。
项目融资类的定向增发项目的特点在于公司在融资项目完成后，无法在短期显现其盈利能力。在项目完工后，公司的财务绩效逐步体现，公司盈利能力逐步改善。同时，募集资金的规模，机构投资者的认购比例对公司财务表现有一定的影响。
本基金对项目融资类定向增发项目将详细评估项目具体投资方向， 预测其对企业基本面指标的影响，将通过筛选与分析业绩变化情况，自下而上评估，结合公司基本面情况，择优选取成长性好，安全边际高的公司进行投资。
（3）非大股东方参与资产重组的定向增发投资
通过定向增发项目实现资产重组是企业与其他主体对企业资产的分布状态进行重新组合、调整、配置的过程，或对设在企业资产上的权利进行重新配置的过程。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。
由于此类资产重组为非大股东方参与，通常会对公司带来正面影响，本基金将关注资产重组类定向增发项目对增发公司业务范围、行业地位与市场份额的变化，通过定量与定性分析在市场上收集公开的事件信息，对事件影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。
（4）融资收购非大股东方资产的定向增发投资
对于融资收购非大股东方资产的定向增发项目，长期来看，公司能够通过定向增发项目中收归的资产实现企业基本面指标的优化，通过上下游产业并购、合并同业竞争对手或跨行业并购实现公司主营业务的拓展，减少公司运营成本或大幅提升市场占有量来重组企业现有资源，提升经营业绩。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。
本基金将着重关注此类定向增发项目对增发公司业务范围、行业地位与市场份额的变化，通过定量与定性分析在市场上收集公开的事件信息，对事件影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。
（5）壳公司重组的定向增发投资
由于A股市场上市公司的稀缺性，壳公司重组类的定向增发对壳公司的基本面产生重大改变。其具体运作模式为非上市公司购买壳收购目标成为上市公司，本基金在投资壳公司重组的定向增发项目时，会考察借壳公司过往业绩，股东情况，业务前景，壳公司资产负债剥离情况等一系列财务与基本面指标，并结合行业分析与估值，挑选具有吸引力能够带来长期稳定收益的股票。
本基金将深入研究不同类别的定向增发项目在不同期限内对公司基本面的影响， 分析基本面变化，在一年期定增与三年期定增项目中根据定向增发项目类别择优参加，尽可能获取定向增发项目给投资者带来的超额收益。
3、债券投资策略
本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素的基础上，构建债券投资组合。本基金将运用多种策略配置非投资于定向增发项目的基金资产，在保持久期匹配的情况下，尽可能提高闲置资金的收益率。
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、中小企业私募债券投资策略
中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量， 综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。
6、权证投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。
7、股指期货的投资策略
本基金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。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。
（二）本基金转为上市开放式基金（LOF）后，在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上， 深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件，将事件性因素作为投资的主线，形成以事件驱动为核心的投资策略。
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，并适时进行动态调整。
2、股票投资策略
本基金从估值水平和发展前景两个角度出发，注重事件性因素对行业影响的分析。采取定性和定量分析相结合的方法对影响上市公司当前及未来价值的事件性因素进行全面的分析，精选股价受益或未能充分体现事件影响的股票，在严格控制投资组合风险与收益的前提下，对行业进行优化配置和动态调整。
本基金的股票定量分析方法将分析各行业公司的估值指标（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，从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司，作为本基金的备选股票；再通过分析备选股票所代表的公司的资产收益率、资产周转率等变量的时间序列，以及通过对市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平的比较，并参考国际市场估值水平来评估其投资价值。
在定量分析的基础上，本基金的股票定性分析方法采用深度价值挖掘和多层面立体投资分析体系，并结合基金管理人的股票研究平台， 多层面地分析备选股票所对应的公司的业务环节的竞争优势和劣势，分析公司治理和公司管理方面的优势和劣势，分析公司所处行业的波特五力结构、行业历史及行业变革力量。
经过严格的定量分析和定性分析，最终确定股票投资组合，并适时进行投资组合调整。
本基金将影响个股估值的事件驱动因素归纳为如下几个方面：
（1）股权变动，包括定向增发、增持与回购等
公司股权的变动不仅仅直接改变公司的资产结构，同时也会对企业未来在生产、经营、管理等多个方面产生影响。本基金通过定性和定量方法对股权变动可能带来的影响进行模拟分析，挑选具有绝对或相对估值吸引力的公司股票，再通过分析和评估股权变化，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。
定向增发是指公司向符合条件的少数特定投资者非公开发行股份的行为，以促进公司行业整合和产业升级，拓宽融资渠道，提高兼并效率。
股份增持包括股东增持和高管增持， 其中股东增持是指公司股东及其一致行动人增持股份行为；高管增持是指公司高管及其一致行动人增持股份的行为；股份回购是指公司按一定的程序购回发行或流通在外的本公司股份的行为。
其他股权变化事件包括但不限于公司通过增发、发行可转换债券等方式在证券市场上进行的融资；其对公司的发展起到了较大的推动作用。
（2）业绩预告与超预期
根据交易所规定，公司预计年度经营业绩将出现下列情形之一的，应当在会计年度结束后一个月内进行业绩预告，预计中期和第三季度业绩将出现下列情形之一的，可以进行业绩预告：净利润为负值；净利润与上年同期相比上升或者下降50%以上；实现扭亏为盈。业绩超预期是指公司披露的实际业绩显著超越过去3个月券商等研究机构的预测平均数的情况。
此两种情况都显示公司经营上出现显著变化，本基金将通过筛选与分析业绩变化情况，自下而上评估，结合公司基本面情况，择优选取成长性好，安全边际高的公司进行投资。
（3）资产重组，包括重组、注入与并购
资产重组是企业与其他主体对企业资产的分布状态进行重新组合、调整、配置的过程，或对设在企业资产上的权利进行重新配置的过程。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。
本基金在市场上收集公开的事件信息，对事件影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。
（4）高分红及高转送
分红指公司以现金分红方式将盈余公积和当期应付利润的部分或全部发放给股东，是股东分享公司红利的重要方式，高分红是指公司分红比例较高的股票。高转送是实施较高比例的送股或者转股的股票。
本基金将通过筛选、分析和评估高分红，高转送股票；结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。
（5）股权激励
股权激励包括员工持股、股票期权等不同形式，使企业经营者与所有者利益一致，利润与风险共担；起到改善公司治理，提升公司运营效率的作用。
本基金将对采用股权激励的公司进行调研，综合分析公司基本面、预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。
（6）其他影响公司的重大因素
其他事件包括但不限于公司发布对预期业绩及行业造成极大影响的重要产品或重大合同公告；有影响上下游公司的重大事项发生；公司遭遇重大危机；管理层发生重大变更等。此类事件会对公司的运营造成深远的影响，继而影响其市场估值。
本基金将通过筛选、分析和评估发生重大变动的股票，结合其预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。
3、债券投资策略
本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素的基础上，构建债券投资组合。本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略等多种策略进行债券投资。
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、权证投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。
6、股指期货的投资策略
本基金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。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

第九部分 基金的业绩比较基准

1、基金合同生效后五年内（含第五年），本基金业绩比较基准为年化收益率5.5%。
本基金为混合型基金，力争在基金合同生效后五年内（含第五年）为投资者提供稳定的绝对回报，因此，本基金采取年化收益率5.5%，作为本基金业绩比较基准，能够较好反应本基金的产品特性及风险收益特征。
2、本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金业绩比较基准为：
沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
本基金股票投资部分选取沪深300指数作为业绩比较基准，该指数能够较为全面地反映中国股票市场的状况；债券投资部分选择中国债券总指数作为业绩比较基准，该指数能够较为全面地反映中国固定收益市场的状况，具有广泛的市场代表性。
3、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，属于高风险收益特征的证券投资基金品种。

第十一部分 基金投资组合报告

九泰基金管理公司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。
基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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。
本投资组合报告所载数据截至 2016年6 月30日，本报告中所列财务数据未经审计。
1.1 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	359,009,337.89	73.92
	其中：股票	359,009,337.89	73.92
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	36,567,799.05	7.53
8	其他资产	90,071,107.64	18.55
9	合计	485,648,244.58	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	293,071,526.65	60.49
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	31,877,728.08	6.58
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	31,494,887.16	6.50
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	2,565,196.00	0.53
S	综合	–	–
	合计	359,009,337.89	74.10

1.3 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	002709	天赐材料	2,000,000	99,180,000.00	20.47
2	002460	赣锋锂业	2,483,442	69,387,369.48	14.32
3	603601	再升科技	1,000,000	32,390,000.00	6.69
4	603368	柳州医药	542,692	31,877,728.08	6.58
5	300017	网宿科技	682,594	31,494,887.16	6.50
6	300370	安控科技	3,252,032	30,959,344.64	6.39
7	002706	良信电器	1,417,848	28,342,781.52	5.85
8	002425	凯撒股份	1,010,663	21,870,747.32	4.51
9	600703	三安光电	240,761	4,807,997.17	0.99
10	002527	新时达	121,300	1,916,540.00	0.40

1.4 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。
1.5 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。
1.6 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。
1.7 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。
1.8 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。
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
报告期内，本基金未参与股指期货交易。
1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
报告期内，本基金未参与股指期货交易。
1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.10.1 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。
1.10.2 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。
1.10.3 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。
1.11 投资组合报告附注
1.11.1 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。
1.11.2 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。
1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,387.44
2	应收证券清算款	90,044,800.01
3	应收股利	–
4	应收利息	13,704.81
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	7,215.38
8	其他	–
9	合计	90,071,107.64

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金报告期末未持有可转换债券。
1.11.5 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	002709	天赐材料	99,180,000.00	20.47	非公开发行
2	002460	赣锋锂业	69,387,369.48	14.32	非公开发行
3	603601	再升科技	32,390,000.00	6.69	非公开发行
4	603368	柳州医药	31,877,728.08	6.58	非公开发行
5	300017	网宿科技	31,494,887.16	6.50	非公开发行
6	300370	安控科技	30,959,344.64	6.39	非公开发行
7	002706	良信电器	28,342,781.52	5.85	非公开发行
8	002425	凯撒股份	21,870,747.32	4.51	非公开发行

1.11.6 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，分项之和和合计项之前可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
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

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
过去三个月	23.74%	1.06%	1.32%	0.01%	22.42%	1.05%

第十三部分 基金费用与税收

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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券、期货交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、证券账户开户费用、账户维护费用；
9、基金的上市费和年费；
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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的2.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：
$H = E \times 2.0\% \div$ 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提，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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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
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：
$H = E \times 0.25\% \div$ 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。
上述"一、基金费用的种类中第3－10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。
四、费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒介上公告。
五、基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求， 对本基金管理人于2016年3月29日刊登的本基金原招募说明书（《九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新2016年第1号》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要补充和更新的内容如下：
1、在"三、基金管理人"中，对基金管理人的基本情况进行了更新；
2、在"四、基金托管人"中，对基金托管人的基本情况进行了更新；
3、在"五、相关服务机构"中，更新了相关服务机构的内容，各新增代销机构均在指定媒体上公告列示；
4、在"六、基金的募集与基金合同的生效"中，新增了基金募集的数据内容；
5、在"八、基金份额的运作方式、申购与赎回"中，更新了相关内容；
6、在"九、基金的投资"中，新增了"基金投资组合报告"的内容，数据内容截止时间为2016年6月30日；
7、在"十一、基金的业绩"部分，更新过去三个月的基金业绩；
8、在"二十三、其他应披露事项"部分，根据相关公告的内容进行了更新。

九泰基金管理有限公司
2016年9月27日