

九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告



注:1.本基金合同于2016年9月26日生效,截至本报告期末,本基金合同生效已逾一年,相关业绩指标已具有一年可比性。
2.根据基金合同的约定,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。本基金在报告期期末,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理、或基金经理小组的简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
王明	基金经理	2016年9月26日	8	清华大学工学硕士,中国科技大学工学硕士,曾任中国工商银行总行资产管理部副经理,2015年8月加入九泰基金管理有限公司,曾任九泰基金定增主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年9月26日至今担任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》等法律法规及基金合同,按照诚实信用、勤勉尽责的原则和运用基金资产,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《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,未发现异常交易行为。

4.4 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,报告期内本公司所管理的投资组合未发生异常公开竞价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5%的情况。

4.5 报告期内基金投资策略和运作分析

截至本报告期末,本基金份额净值为1.0756元,本报告期基金份额净值增长率为68.7%,同期业绩比较基准收益率为25.2%。报告期内本基金持有人人数或基金份额净值预警说明:本基金报告期内未发生持续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5000万元的情况。

5.1 报告期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	296,000,594.86	81.77
2	固定收益	296,000,594.86	81.77
3	衍生品投资	-	-
4	金融衍生品	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	65,775,633.38	18.17
8	其他资产	204,119.23	0.06
9	合计	361,803,347.47	100.00

5.2 报告期内按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、医药	31,617,773.28	4.78
B	制造业	204,951,205.12	35.89
C	金融、地产	12,776,670.45	3.64
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应	32,028,840.31	6.87
E	建筑业	6,000,000.00	0.87
F	采矿业	1,015,492.77	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	6,180,920.70	1.71
H	信息技术	-	-
I	房地产业、建筑业和基础设施业	-	-
J	金融业	-	-
K	制造业	-	-
L	其他行业	-	-
M	科学、技术和研发业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	其他	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
合计		296,000,594.86	81.90

5.3 报告期内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	600099	华友钴业	1,210,000	11,930,600.00	6.45
2	600912	华鲁恒升	2,388,000	11,653,440.00	6.30
3	600325	山东黄金	1,050,000	11,550,000.00	6.24
4	600012	招商局港口	1,677,000	11,508,240.00	6.22
5	002138	顺络电子	549,000	11,441,160.00	6.18
6	000046	中金黄金	1,404,400	11,403,720.00	6.16
7	600071	凤凰传媒	570,000	11,245,100.00	6.09
8	600132	银河证券	500,000	11,205,000.00	5.98
9	002370	中国软件	1,889,500	10,676,205.00	5.77
10	000033	荣信股份	239,970	10,004,672.01	5.73

5.4 报告期内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	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	9,982,000.00	5.39
4	企业债	9,982,000.00	5.39
5	资产支持证券	-	-
6	可转债	-	-
7	可分离债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	39,515,000.00	21.35

5.5 报告期内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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.6 报告期内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

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	9,982,000.00	5.39
4	企业债	9,982,000.00	5.39
5	资产支持证券	-	-
6	可转债	-	-
7	可分离债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	39,515,000.00	21.35

5.7 报告期内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

序号	贵金属名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	黄金现货	-	-
2	铂金现货	-	-
3	白银现货	-	-
4	铜现货	-	-
5	其他	-	-
6	合计	-	-

5.8 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.9 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.10 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.11 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.12 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.13 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.14 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.15 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.16 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.17 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.18 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.19 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.20 报告期内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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170468	17国债08	100,000	9,982,000.00	5.39
2	111718205	17年国开债0205	100,000	9,770,000.00	5.28
3	111719186	17年国开债0186	100,000	9,765,000.00	5.28
4	0117100473	17TF1703	50,000	5,000,000.00	2.70
5	111714509	17年国开债0159	50,000	4,988,000.00	2.70

5.21 报告期内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

4.2 管理人对本报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《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