

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:2017年10月25日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事、监事、经理保证报告文本不存在虚假记载、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的规定，于2017年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，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运用基金资产，但不保证本基金一定盈利。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。

本基金合同自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 九泰久稳保本混合型证券投资基金

基金代码 0002403

交易代码 0002403

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 919,307,680.02份

投资目标 通过运用保本机制，确保基金安全保值，并在本息安全的前提下力争获得超越业绩基准的收益。

本基金将利用其对冲机制，通过投资于固定收益类资产，实现对冲，从而在保本的前提下，力争获得超越业绩基准的收益。

本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率*50%+中证国债指数收益率*50%。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

九泰久稳保本混合型基金

1.本期已实现收益 8,061,000.00

2.本期利润 8,546,504.01

3.加权平均基金份额本期利润 0.0074

4.期末基金资产净值 919,455,609.01

5.期末基金份额净值 1.001

注:1.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.2 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.3 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.4 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.5 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.6 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.7 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.8 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.9 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.10 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.11 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.12 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.13 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.14 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.15 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.16 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.17 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.18 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.19 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.20 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.21 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.22 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.23 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.24 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.25 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.26 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.27 基金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

九泰久稳保本混合型基金

阶段 净值增长 率 (%) 净值增长 率 (%) 业绩比较基 准收益率 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.00% 0.00% 0.02% 0.00% 0.00% 0.00%

3.2.28 基金合同生效以来基金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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平将低于所示数值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)和相关