九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

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3月28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3月23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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	九泰锐华定增混合
场内简称	九泰锐华
基金主代码	168106
基金运作方式	上市契约型开放式 本基金在基金合同生效后设置两年的封闭期，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两年后的年度对应日的前一个工作日。本基金封闭期内不开放申购、赎回业务，但本基金A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A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类基金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类基金份额上市交易。
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	453,817,156.89份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016-06-16
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：	168106　168107
报告期末下属分级基金的份额总额	32,802,053.92份　421,015,102.97份

2.2 基金产品说明

投资目标	基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，精选具有估值优势的公司股票进行投资，力争获取超额业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	（一）封闭期内，通过对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，在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主题并实施主动投资，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。 （二）本基金封闭期届满后，通过深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，精选具有估值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。
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	陈沛	阮劲松
	联系电话	010-57383799	010-66270109
	电子邮箱	chenpei@jtamc.com	juruansong@cbhb.com.cn
客户服务电话		400-628-0606	4008888811/96641
传真		010-57383766	022-58314791

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住所

3.1 主要会计数据和财务指标

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年		2016年12月19日(基金合同生效日)-2016年12月31日		2015年	
	九泰锐华定增混合A	九泰锐华定增混合C	九泰锐华定增混合A	九泰锐华定增混合C	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	-142,048.59	-3,890,849.94	18,681.70	170,729.67	-	-
本期利润	-1,950,386.24	-27,005,339.04	18,681.70	170,729.67	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0595	-0.0641	0.0006	0.0004	-	-
本期基金份额净值增长率	-5.95%	-6.41%	0.06%	0.04%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0589	-0.0637	0.0006	0.0004	-	-
期末基金资产净值	30,870,349.38	394,180,493.60	32,829,735.62	421,185,832.64	-	-
期末基金份额净值	0.9411	0.9363	1.0006	1.0004	-	-

注：1、所述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要低于所列数字；

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（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即12 月 31 日；

4、本基金基金合同生效日为2016年12月19日，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

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

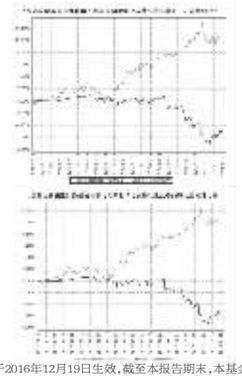
九泰锐华定增混合A

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
过去三个月	-4.48%	0.44%	2.70%	0.48%	-7.18%	-0.04%
过去六个月	-5.88%	0.38%	5.69%	0.42%	-11.57%	-0.04%
过去一年	-5.95%	0.30%	12.15%	0.39%	-18.10%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-5.89%	0.29%	11.96%	0.38%	-17.85%	-0.09%

九泰锐华定增混合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
过去三个月	-4.60%	0.44%	2.70%	0.48%	-7.30%	-0.04%
过去六个月	-6.11%	0.38%	5.69%	0.42%	-11.80%	-0.04%
过去一年	-6.41%	0.30%	12.15%	0.39%	-18.56%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-6.37%	0.29%	11.96%	0.38%	-18.33%	-0.09%

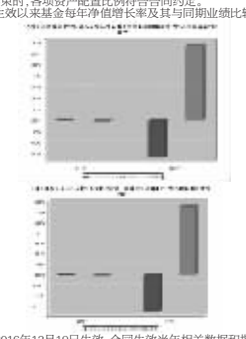
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.本基金合同于2016年12月19日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束尚不满1年。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2016年12月19日生效，合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2016 年12月19日）至本报告期末未发生利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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【2014】650号文批准，于2014年7月3日正式成立，现注册资本2亿元人民币，其中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和九州证券股份有限公司分别占注册资本26%、25%、25%和24%的股权。截至本报告期末（2017年12月31日），基金管理人共管理17只开放式证券投资基金，包括九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金、九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金、九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金、九泰日添金货币市场基金、九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金、九泰久稳保本混合型证券投资基金、九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金、九泰久利灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金、九泰久鑫债券型证券投资基金、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金、九泰久益灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐诚定增灵活配置混合型证券投资基金、九泰鸿祥服务升级混合型证券投资基金，证券投资基金规模约为143.97亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘开运	基金经理、定增投资中心总经理、股票投资增收券组执行投资总监	2016 年 12 月 19日	-	6	金融学硕士，中国籍，具有基从业资格，6年证券从业经验，多年股权投资与行业研究经验，历任华马威华控股有限公司投资经理，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，现任特殊投资策略增业券组（股票）执行投资总监，九泰天盈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2016年7月16日），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），九泰锐富事件驱动定期开放灵活配置混合型证券投资基金（2016年8月30日至今），九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金（2016年12月19日至今），九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金（2017年3月24日至今）的基金经理。
张鹏程	执方量化投资部副总监、基金经理	2017 年 11 月 16日	-	7	清华大学统计专业硕士，北京大学理学学士，中国籍，具有基金从业资格，7年证券从业经验。曾任博时基金管理有限公司ETF及量化投资组基金经理助理，量化分析师，通联数据股份公司首席投资顾问，投资经理。清华大学统计专业硕士，北京大学理学学士，中国籍，具有基金从业资格，7年证券从业经验。曾任博时基金管理有限公司ETF及量化投资组基金经理助理，量化分析师，通联数据股份公司首席投资顾问，投资经理。2016年4月加入九泰基金任执方量化投资部副总监，九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金（2017年11月16日至今）的基金经理。

注：上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

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、安全高效的原则管理和运用基金资产，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对投票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及投标、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，公平交易制度，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内控控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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投资组的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年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。

4.3.3 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交易所公开竞价的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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年，全球经济持续复苏，全球股票市场稳中向好，国内股市方面，上证综指上涨6.56%，万得全A上涨4.93%。本年度，基金在政策和合同允许的范围内开展投资运作，整体运行情况较为平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末本基金A类份额净值为0.9411元，本报告期基金份额净值A类增长率为-5.95%，业绩比较基准收益率为12.15%；截止本报告期末本基金C类份额净值为0.9363元，本报告期基金份额净值C类增长率为-6.41%，业绩比较基准收益率为12.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年，全球经济复苏态势大概率仍将延续，国内在供给侧改革的支持下，体现了较强韧性，正在向着高质量发展的目标迈进。A股上市公司作为各个行业的领先企业，有望取得良好表现。符合政策导向，产业发展向好，价格合理或低估的行业是良好的投资方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确了基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，健全了估值决策体系。本基金管理人在具体的基金估值业务执行上，在遵守中国证监会相关规定和基金合同的同时，参考了行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，以确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制定的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。对下属管理的不同基金持有的具有相同特征的同一投资品种的估值原则、程序及技术保持一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。

本基金管理人设立了由督察长、估值业务分管高管、研究业务分管高管、风险管理部、研究发展部、基金运营部等部门负责人组成的基金估值委员会，负责制定或完善估值政策、估值程序，定期复核和审阅估值程序和技术的适用性，以确保相关估值程序和技术不存在重大缺陷。委员会成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和负责本基金审计业务的会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。托管人在复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格之前，应认真审阅基金管理人采用的估值原则及技术。当对估值原则及技术有异议时，托管人有义务要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人当发生改变估值技术、导致基金资产净值的变化在0.25%以上的情况时，将所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。此外，会计师事务所出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程的各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。同时与中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十七部分中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2017年12 月31 日，九泰锐华定增混合A 期末可供分配利润为-1,931,704.54元（其中：九泰锐华定增混合A 的未分配利润已实现部分为-123,366.89 元，未分配利润未实现部分为-1,808,337.65）；九泰锐华定增混合C 期末可供分配利润为-26,834,609.37元（其中：九泰锐华定增混合C 的未分配利润已实现部分为 -3,720,120.27元，未分配利润未实现部分为-23,114,489.10元）。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，渤海银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人在存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于九泰基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产：		
银行存款	6,821,790.57	83,490,136.60
结算备付金	13,049,835.89	-
存出保证金	70,879.65	-
交易性金融资产	159,888,654.43	-
其中：股票投资	159,888,654.43	-
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	246,000,000.00	290,000,000.00
应收证券清算款	31,210.96	80,872,386.74
应收利息	266,277.62	18,153.79
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	426,128,649.12	454,380,677.13
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	642,680.23	267,873.58
应付托管费	89,261.14	37,204.67
应付销售服务费	165,569.27	69,030.62
应付交易费用	30,305.50	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,000.00	-
负债合计	1,077,806.14	374,108.87
所有者权益：		
实收基金	453,817,156.89	453,817,156.89
未分配利润	-28,766,313.91	189,411.37
所有者权益合计	425,050,842.98	454,006,568.26
负债和所有者权益总计	426,128,649.12	454,380,677.13

注：1.报告截止日2017年12月31日，九泰锐华定增混合A份额净值为人民币0.9411元，九泰锐华定增混合C份额净值为人民币0.9363元；基金分额总额为453,817,156.89份，九泰锐华定增混合A份额32,802,053.92份，九泰锐华定增混合C份额421,015,102.97份。

2.本基金基金合同生效日为2016年12月19日，上年度可比期间为2016年12月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日止。

7.2 利润表

会计主体：九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	-17,397,893.72	563,920.24
1.利息收入	9,746,892.10	563,920.24
其中：存款利息收入	574,943.02	61,000.94
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	9,171,949.08	502,919.30
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-2,221,969.07	-
其中：股票投资收益	-2,560,603.24	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	338,644.17	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-24,922,826.75	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	11,557,831.56	374,508.87
1. 管理人报酬	8,054,192.14	267,873.58
2. 托管费	1,118,637.78	37,204.67
3. 销售服务费	2,075,169.94	69,030.62
4. 交易费用	94,831.70	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	215,000.00	400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-28,955,725.28	189,411.37
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-28,955,725.28	189,411.37

注：本基金基金合同生效日为2016年12月19日，上年度可比期间为2016年12月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日止。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	453,817,156.89	189,411.37	454,006,568.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-28,955,725.28	-28,955,725.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	453,817,156.89	-28,766,313.91	425,050,842.98

项目	上年度可比期间 2016年12月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	453,817,156.89	-	453,817,156.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	189,411.37	189,411.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	453,817,156.89	189,411.37	454,006,568.26

注：本基金基金合同生效日为2016年12月19日，上年度可比期间为2016年12月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

卢伟忠　　严军　　荣静
基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2120号文《关于准予九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册，由九泰基金管理公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关规定和《九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起，于2016年11月7日至2016年12月12日向社会公开募集。本基金为契约型，存续期限为不定期。在基金合同生效后设置两年的封闭期，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两年后的年度对日的前一个工作日。本基金封闭期内不开放申购、赎回业务，但本基金A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A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类基金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类基金份额上市交易。募集期间净认购资金总额为人民币453,490,454.47元(其中，A类基金份额净认购金额为人民币32,784,125.24元，折合32,784,125.24份基金份额；C类基金份额净认购金额为人民币420,706,329.23元，折合420,706,329.23份基金份额)，在募集期间产生的利息为人民币326,761.70元(其中，A类基金份额产生的利息为人民币17,987.96元，C类基金份额产生的利息为人民币308,773.74元)，以上实收基金(本息)合计为人民币453,817,156.89元，折合453,817,156.89份基金份额。上述募集资金已经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)验证。经向中国证监会备案后，基金合同于2016年12月19日生效。本基金的基金管理人为九泰基金管理有限公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，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、企业债、公司债、次级债、可转换债券含分离交易可转债)、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、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)。本基金的业绩比较基准是：沪深300指数收益率×60%+中债总指数(总值)财富指数收益率×40%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金会计业务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2017年12月31日及2016年12月31日的财务状况和2017年度及2016年12月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。上年度可比期间为2016年12月19日(基金合同生效日)至2016 年12 月31 日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债)，并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款和应收款项。

(2)金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款和应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及收到的全部股利和利息计入相关损益。贷款和应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和中小企业私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值；

(2)对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值估值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。对于发行时附确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值；

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件时，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值小组认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认，于期末全额转入“未分配利润”。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率，在实际持有期间内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额