九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

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
报告送出日期:2016年4月20日

§1 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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月19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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	九泰锐智定增混合
场内简称	九泰锐智
基金主代码	168101
交易代码	168101
基金运作方式	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、赎回结果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。
基金合同生效日	2015年8月14日
报告期末基金份额总额	360,234,916.74份
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。
投资策略	在基金合同生效后前五年内(含第五年),本基金通过对宏观经济、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。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。
业绩比较基准	在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5.8%;转为上市开放式基金(LOF)后,本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-1,199,623.87
2.本期利润	12,024,473.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0334
4.期末基金资产净值	391,647,689.94
5.期末基金份额净值	1.087

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.本期已实现收益指资产管理计划本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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损益;

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	3.13%	0.64%	1.34%	0.02%	1.79%	0.62%

3.2.2 自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.本基金合同于2015年8月14日生效,截至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

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基金合同有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘开运	基金经理	2015年8月14日	-	5	金融学硕士,中国籍。5年证券从业经验,具有基金从业资格。多年股权投资与行业研究经验,历任毕马威华振会计师事务所审计助理,昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理,合伙人助理。2014年6月加入九泰基金管理有限公司担任基金经理。

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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,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 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。

4.3.2 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(债券回购、股指期货除外)。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

九泰锐智定增基金自成立以来,始终保持积极进取,同时严格控制投资风险的态度展开投资运作。九泰锐智定增基金专注于定增投资,将80%以上非现金资产投资定向增发项目。在项目选择方面,坚持选取行业前景广阔、公司基本面扎实的上市公司进行定增投资,在获取定增折价收益的同时,最大程度上分享企业中长期快速发展带来的价值提升。截至2016年3月31日,九泰锐智定增基金已经完成对赣锋锂业(002460)、安控科技(300370)、天赐材料(002709)、柳州医药(603368)、网宿科技(300017)五个定增项目的投资。五个定增项目合计投资金额1.38亿元,累计浮盈9660.5万元,平均浮盈为70.00%。九泰锐智定增基金将继续锁定优质定增投资标的,择机参与定增投资,力争为投资者获取较高的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末本基金份额净值为1.087元;本报告期本基金份额净值增长率为3.13%,同期业绩比较基准收益率为1.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	190,281,418.19	48.46
	其中:股票	190,281,418.19	48.46
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	170,000,000.00	43.30
	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	6,781,981.64	1.73
8	其他资产	25,564,601.33	6.51
9	合计	392,628,001.16	100.00

5.2 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	126,755,515.11	32.36
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	30,227,944.40	7.72
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	30,184,306.68	7.71
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	3,113,652.00	0.80
S	综合	-	-
	合计	190,281,418.19	48.58

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

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	002460	赣锋锂业	1,241,721	46,601,789.13	11.90
2	002709	天赐材料	800,000	43,200,000.00	11.03
3	603368	柳州医药	542,692	30,227,944.40	7.72
4	300017	网宿科技	682,594	30,184,306.68	7.71
5	300370	安控科技	1,626,016	23,447,150.72	5.99
6	600703	三安光电	240,761	4,733,361.26	1.21
7	002466	天齐锂业	14,500	2,433,100.00	0.62
8	002527	新时达	121,300	1,983,255.00	0.51
9	600136	道博股份	30,400	1,834,944.00	0.47
10	300124	汇川技术	40,300	1,540,669.00	0.39

5.4 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。

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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,333.63
2	应收证券清算款	25,499,996.28
3	应收股利	-
4	应收利息	40,271.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,564,601.33

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转债券。

5.11.5 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	002460	赣锋锂业	46,601,789.13	11.90	非公开发行
2	002709	天赐材料	43,200,000.00	11.03	非公开发行
3	603368	柳州医药	30,227,944.40	7.72	非公开发行
4	300017	网宿科技	30,184,306.68	7.71	非公开发行
5	300370	安控科技	23,447,150.72	5.99	非公开发行

5.11.6 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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	360,234,916.74
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	360,234,916.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报期没有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

2、《九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、注册登记协议

5、法律意见书

6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处;其余备查文件存放在基金管理人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅,也可按工本费购买复印件。

九泰基金管理有限公司
2016年4月20日

九泰日添金货币市场基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31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
报告送出日期:2016年4月20日

§1 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 2016年4月19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。

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 2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	九泰日添金货币	
基金主代码	001842	
交易代码	001842	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2015年12月8日	
报告期末基金份额总额	734,686,588.16份	
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金根据对利率尤其是短期利率变动的预测,采用定性和定量分析的方法,构建稳健的投资组合。具体策略包括:类属配置策略、现金流管理策略、久期控制策略、银行存款投资策略。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期收益和风险低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	九泰日添金货币A	九泰日添金货币B
下属分级基金的交易代码	001842	001843
报告期末下属分级基金的份额总额	138,636,890.42份	596,049,697.74份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)	
	九泰日添金货币A	九泰日添金货币B
1. 本期已实现收益	90,541.42	9,253,400.12
2.本期利润	90,541.42	9,253,400.12
3.期末基金资产净值	138,636,890.42	596,049,697.74

注:1、本基金收益分配是按日结转份额;

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)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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

九泰日添金货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7048%	0.0068%	0.3357%	0.0000%	0.3691%	0.0068%

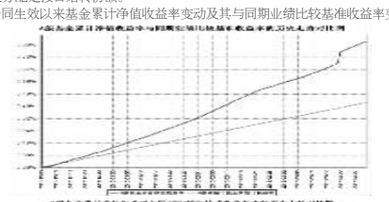
注:本基金收益分配是按日结转份额。

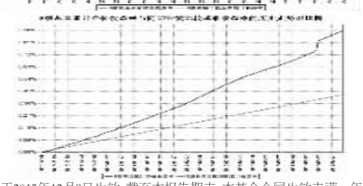
九泰日添金货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7620%	0.0068%	0.3357%	0.0000%	0.4263%	0.0068%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2015年12月8日生效,截至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

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,截至本报告期末基金尚未完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王明晰	基金经理	2015年12月8日	-	8	经济系金融经济学硕士,中国籍,全国银行间同业拆解市场本币交易员,具有基金从业资格。历任诺安基金管理有限公司债券交易员,基金经理助理,诺安货币市场基金A/B基金经理(2013年7月31日至2015年1月6日)。2015年6月加入九泰基金管理有限公司担任基金经理。

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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,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 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。

4.3.2 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(债券回购、股指期货除外)。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

进入一季度,稳增长是宏观调控的重点,财政发力,信贷扩张,工业企业利润结束数月的下滑态势,市场对经济企稳的预期转好。受到猪周期、春节因素以及恶略天气导致运输成本和蔬菜价格上涨的影响,CPI走高。市场资金面整体保持平稳宽松,受到MPA考核规则的影响,季末的资金面有所收紧。基本面因素和资金面因素,叠加监管层调查债市委外杠杆消息的影响,债券收益率在本季度末出现调整。做为"现金管理工具",日添金货币市场基金始终把产品的流动性管理放在首位。本季度,日添金货币市场基金的流动性没有出现异常,满足了投资者正常的申购、赎回要求及多次大额赎回申请。九泰日添金货币市场基金灵活运用债券回购和银行存款等货币市场工具,使资产具有较强的流动性。九泰日添金货币市场基金注重资产的安全性,兼顾内外部评级数据,严控信用风险。产品在报告期内取得正收益,超越业绩比较基准。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值A类增长率为0.7048%,业绩比较基准收益率为0.3357%;本报告期基金份额净值B类增长率为0.7620%,业绩比较基准收益率为0.3357%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	固定收益投资	189,889,915.48	25.8300
	其中:债券	189,889,915.48	25.8300
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	383,501,935.25	52.1700
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	152,180,609.35	20.7000
4	其他资产	9,519,541.41	1.3000
5	合计	735,092,001.49	100.0000

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.6300
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	- / -
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	77.0000	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	21.7600	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		98.7600	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	129,844,371.80	17.6700
	其中:政策性金融债	129,844,371.80	17.6700
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,045,543.68	8.1700
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	189,889,915.48	25.8500
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160401	16农发01	500,000	49,955,054.95	6.8000
2	160204	16国开04	500,000	49,881,600.28	6.7900
3	041669002	16新兴CP001	300,000	30,034,835.73	4.0900
4	041651014	16西矿股CP001	300,000	30,010,707.95	4.0800
5	150206	15国开06	300,000	30,007,716.57	4.0800

注:本基金本报告期末仅持有5只债券。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0993%
报告期内偏离度的最低值	-0.0005%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0277%

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

5.8.2

本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期限超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日资产净值20%的情况。

5.8.3

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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,280,802.98
4	应收申购款	7,238,738.43
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,519,541.41

5.8.5 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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	九泰日添金货币A	九泰日添金货币B
报告期期初基金份额总额	153,383.19	2,853,448,059.04
报告期期间基金总申购份额	208,220,377.41	1,232,374,504.33
报告期期间基金总赎回份额	69,736,870.18	3,489,772,865.63
报告期期末基金份额总额	138,636,890.42	596,049,697.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报期没有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予九泰日添金货币市场基金募集注册的文件

2、《九泰日添金货币市场基金基金合同》

3、《九泰日添金货币市场基金托管协议》

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

7、证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处;其余备查文件存放在基金管理人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅,也可按工本费购买复印件。

九泰基金管理有限公司
2016年4月20日

九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31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
报告送出日期:2016年4月20日

§1 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 2016年4月18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。

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 2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	九泰久盛量化先锋混合
基金主代码	001897
交易代码	001897
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2015年11月10日
报告期末基金份额总额	199,865,872.85份
投资目标	采用多策略量化模型,在有效控制组合风险的前提下,力争获取超越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	本基金是混合型基金,主要目的是在市场中找出具有投资价值的标的,实现资产的长期保值增值,投资主要依托于量化多策略体系平台来实现。本基金采用量化多策略进行股票投资。量化多策略体系的理念主要有两个:一方面可以获取超越指数的额外收益,另一方面多策略轮动在一定程度上也可以分散风险。多策略体系在架构上主要包括策略和策略配置两个层次,在具体的多策略上,主要包含因子策略、事件驱动策略以及技术分析策略,而策略配置模型是根据市场变化,识别市场的当前的主要矛盾,根据主要矛盾配置相适应的策略,保证模型永远站在市场的风口上。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中等风险收益特征的证券投资基金品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-27,069,536.18
2.本期利润	-29,728,811.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1437
4.期末基金资产净值	181,852,705.43
5.期末基金份额净值	0.910

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;

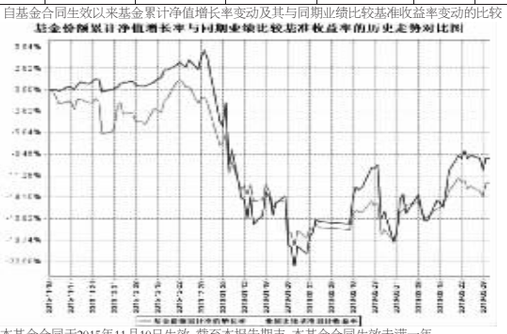
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-12.58%	3.05%	-10.71%	1.94%	-1.87%	1.11%

3.2.2 自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.本基金合同于2015年11月10日生效,截至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

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,截至本报告期末基金尚未完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王明晰	基金经理	2015年11月10日	-	8	经济系金融经济学硕士,中国籍,全国银行间同业拆解市场本币交易员,8年证券从业经验,具有基金从业资格。历任诺安基金管理有限公司债券交易员,基金经理助理,诺安货币市场基金A/B基金经理(2013年7月31日至2015年1月6日)。2015年6月加入九泰基金管理有限公司担任基金经理。

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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,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 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。

4.3.2 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(债券回购、股指期货除外)。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自成立之后,始终按照量化多策略模型操作,所有的股票买卖全部来自于模型给出的结果,从目前运行的情况看,模型有效的选取了最适应当前市场的风格,

并配置了相应的股票策略,自去年9月中旬以来,小盘风格大行其道,以TMT行业为代表的创业板行情出现大幅反弹,并开始占据市场主导地位,这种风