九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2015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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	九泰天宝混合
基金主代码	000892
交易代码	000892
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2015年7月23日
报告期末基金份额总额	2,403,905,938.45份
投资目标	通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理,在有效控制组合风险的前提下,力争为投资者获取长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金重点关注在中国经济结构优化、产业结构升级或技术创新过程中成长性确定且估值合理的上市公司,价值被严重低估的传统行业的上市公司,以及上市公司事件驱动带来的投资机会。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进行大类资产配置;通过定性分析方法和定量分析方法相结合的策略进行股票投资;通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势进行债券投资。
业绩比较基准	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,属于较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	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	九泰天宝混合A / 九泰天宝混合C
下属分级基金的交易代码	000892 / 002028
报告期末下属分级基金的份额总额	2,368,954.79份 / 2,401,536,983.66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)	
	九泰天宝混合A	九泰天宝混合C
1. 本期已实现收益	39,856.95	24,467,308.31
2. 本期利润	30,305.64	16,398,814.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0067
4. 期末基金资产净值	2,504,738.33	2,520,396,716.43
5. 期末基金份额净值	1.057	1.049

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

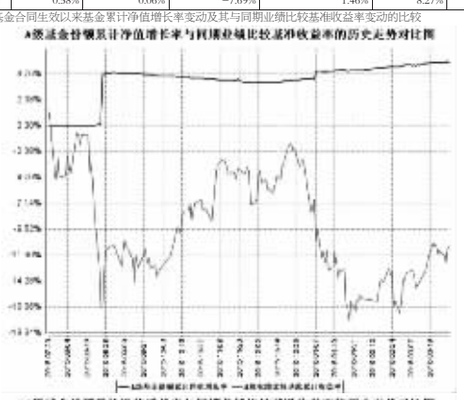
九泰天宝混合A

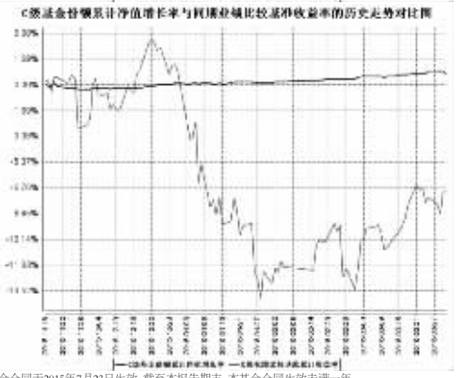
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.34%	0.10%	-7.69%	1.46%	9.03%	-1.36%

九泰天宝混合C

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	0.58%	0.06%	-7.69%	1.46%	8.27%	-1.40%

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7月23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		
王玥晰	基金经理	2015年8月3日	-	8	经济系金融经济学硕士,中国籍,金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

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。本季度,天宝基金以做绝对收益的思路,分析各大市场的风险收益水平,进行大类资产配置。我们积极参与了新股申购,辅以货币市场工具的配置。报告期内,天宝基金的流动性没有出现异常,满足了投资者正常的申购及赎回要求。我们把保证资产的安全性放在首位,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

截止本报告期末本基金A类份额净值为1.057元,本报告期基金份额净值A类增长率为1.34%,业绩比较基准收益率为-7.69%;截止本报告期末本基金C类份额净值为1.049元,本报告期基金份额净值C类增长率为0.58%,业绩比较基准收益率为-7.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内持续59个交易日出现持有人低于200人的情形,基金管理人拟通过持续营销等方式尽快解决;本报告期内未出现基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	25,843,020.74	0.90
	其中:股票	25,843,020.74	0.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,426,988,124.30	84.71
	其中:债券	2,426,988,124.30	84.71
	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	260,850,533.57	9.10
	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	137,599,453.41	4.80
8	其他资产	13,661,669.57	0.48
9	合计	2,864,942,801.59	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	174,048.00	0.01
B	采矿业	242,992.13	0.01
C	制造业	11,886,155.65	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	171,328.00	0.01
E	建筑业	509,698.48	0.02
F	批发和零售业	971,881.10	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	37,098.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	242,604.00	0.01
J	金融业	10,287,205.13	0.41
K	房地产业	278,454.00	0.01
L	租赁和商务服务业	183,000.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	242,009.25	0.01
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	616,547.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	25,843,020.74	1.02

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	601328	交通银行	460,162	2,563,102.34	0.10
2	601398	工商银行	563,200	2,416,128.00	0.10
3	000651	格力电器	79,600	1,529,912.00	0.06
4	600016	民生银行	165,321	1,506,074.31	0.06
5	600036	招商银行	91,148	1,466,571.32	0.06
6	601988	中国银行	287,500	977,500.00	0.04
7	000858	五粮液	30,800	865,788.00	0.03
8	002024	苏宁云商	61,800	707,610.00	0.03
9	002415	海康威视	22,100	681,122.00	0.03
10	002450	康得新	18,900	623,511.00	0.02

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	50,090,000.00	1.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	347,405,000.00	13.77
	其中:政策性金融债	149,905,000.00	5.94
4	企业债券	579,384,124.30	22.96
5	企业短期融资券	1,390,175,000.00	55.10
6	中期票据	59,934,000.00	2.38
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,426,988,124.30	96.20

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1621012	16济南农商二级01	2,000,000	197,500,000.00	7.83
2	139004	16闽产专	1,000,000	101,120,000.00	4.01
3	150222	15国开22	1,000,000	100,030,000.00	3.96
4	011699392	16南汇SCP002	1,000,000	99,940,000.00	3.96
5	011699397	16揚产业SCP002	1,000,000	99,940,000.00	3.96

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

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

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	593,594.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,893,124.51
5	应收申购款	174,950.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,661,669.57

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	000651	格力电器	1,529,912.00	0.06	重大事项停牌

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

项目	九泰天宝混合A	九泰天宝混合C
报告期期初基金份额总额	7,326,557.78	2,488,075,445.20
报告期期间基金总申购份额	293,727.30	-
减:报告期期间基金总赎回份额	5,251,330.29	86,538,461.54
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	2,368,954.79	2,401,536,983.66

§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天宝灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

2、《九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

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

九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2015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	九泰天富改革混合
基金主代码	001305
交易代码	001305
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2015年6月10日
报告期末基金份额总额	1,907,606,732.75份
投资目标	本基金在严格控制投资风险的前提下,力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金专注投资于改革新动力主题,主要包括在全面深化改革进程中,能够受益于经济、政治、文化、社会、生态文明等各项体制改革的优质企业。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进行大类资产配置;定性分析方法和定量分析方法相结合的策略进行股票投资;通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势进行债券投资。
业绩比较基准	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	本基金为混合型证券投资基金,一般情况下其预期风险与预期收益水平高于债券型基金、货币市场基金,低于股票型基金,属于中高风险收益特征的证券投资基金。
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	-367,936,327.39
2.本期利润	-361,089,738.58
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1882
4.期末基金资产净值	1,451,151,864.59
5.期末基金份额净值	0.761

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	-19.73%	2.38%	-7.69%	1.46%	-12.04%	0.92%

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6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。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		
吴祖尧	基金经理	2015年12月9日	-	21	清华大学铸造专业硕士,中国籍,具有基金从业资格。21年金融证券从业经验,历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。2014年5月加入九泰基金管理有限公司任总经理助理。
黄祥斌	基金经理	2015年12月8日	-	9	武汉大学产业经济学硕士,中国籍,具有基金从业资格。9年证券从业经历,历任信达证券股份有限公司研究开发中心首席策略分析师、资产管理部研究员,益民基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理、投资部基金经理,信达证券首席策略分析师、投资经理。2015年8月加入九泰基金管理有限公司任基金经理。
刘开运	基金经理	2015年7月16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

2016年一季度A股市场大幅动荡,其中一月份沪指下跌22.65%,创下自2008年10月后的最大单月跌幅,外因是美联储加息预期加剧全球资本波动,内因是人民币阶段性贬值压力加大,令市场担忧人民币资产价格重估。二月份随着美联储加息预期有所弱化,全球风险资产震荡趋稳,人民币汇率也出现反弹,市场情绪舒缓,沪指小幅下跌1.8%。三月份全球市场出现回暖,在国内,伴随着投资者对于稳增长政策、通胀预期、美联储加息等事件的关注,A股市场震荡上行,沪指上涨11.75%。最终2016年一季度的沪指以下跌14.97%告终;大市值股票相对跌幅较小,创业板和小市值股票波动剧烈。

虽然全球资本市场动荡带来较大风险,但本基金也注意到全社会利率中枢下降、管理层持续推进供给侧改革等因素,均有望为A股带来积极影响;本着谨慎乐观的投资策略,我们保持了相对中性的股票仓位,持股一方面集中在具有防御性质的券商、医药、食品饮料等行业,另一方面也精选具有良好成长性的TMT类个股。

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0.761元;本报告期本基金份额净值增长率为-19.73%,同期业绩比较基准收益率为-7.69%。

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	1,157,971,864.55	75.01
	其中:股票	1,157,971,864.55	75.01
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	180,000,000.00	11.66
	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	202,982,383.44	13.15
8	其他资产	2,796,144.64	0.18
9	合计	1,543,750,392.63	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	483,301,419.62	33.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,800,000.00	0.33
E	建筑业	9,741,234.48	0.67
F	批发和零售业	29,734,508.21	2.05
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	141,087,328.18	9.72
J	金融业	352,309,843.35	24.28
K	房地产业	71,448,913.08	4.92
L	租赁和商务服务业	18,300,000.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	14,672,000.00	1.01
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	32,576,617.63	2.24
S	综合	-	-
	合计	1,157,971,864.55	79.80

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	600158	中体产业	3,249,898	66,492,913.08	4.58
2	601377	兴业证券	5,499,920	48,344,296.80	3.33
3	600037	歌华有线	2,900,000	45,965,000.00	3.17
4	002008	大族激光	1,899,781	42,270,127.25	2.91
5	601555	东吴证券	3,100,000	41,571,000.00	2.86
6	600369	西南证券	4,600,000	39,146,000.00	2.70
7	300224	正海磁材	1,999,715	36,594,784.50	2.52
8	600958	东方证券	1,700,000	34,527,000.00	2.38
9	601099	太平洋	4,000,000	27,600,000.00	1.90
10	600999	招商证券	1,500,000	26,835,000.00	1.85

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	2,758,787.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,257.49
5	应收申购款	99.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,796,144.64

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换债券。

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	300224	正海磁材	36,594,784.50	2.52	重大事项停牌

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	1,935,220,925.90
报告期期间基金总申购份额	8,167,442.87
减:报告期期间基金总赎回份额	35,781,636.02
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	1,907,606,732.75

§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天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

2、《九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

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

证券代码:603898 证券简称:好莱客 公告编号:临2016-030

广州好莱客创意家居股份有限公司
关于使用闲置募集资金及自有资金购买理财产品的进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

重要内容提示:

●投资标的名称:蕴通财富?日增利86天、利多多对公结构性存款产品-公司16JG284期、“蕴通财富?日增利”S款

●投资标的类型:保证收益型、保本浮动收益型

●投资金额:本次对外投资总金额为28,092万元,其中募集资金12,000万元,自有资金16,092万元。(募集资金不超过1.2亿元,自有资金不超过3.5亿元,资金额度在决议有效期内可以滚动使用)

一、对外投资概述

(一)对外投资的基本情况

日前,公司与交通银行股份有限公司广州前进支行签署了《交通银行“蕴通财富?日增利86天”理财产品协议》及《交通银行“蕴通财富?日增利”S款理财产品协议》,与上海浦东发展银行股份有限公司广州天河支行签署了《利多多对公结构性存款产品合同》,基本情况如下:

序号	公司	受托方	资金来源	投资标的名称	投资金额(万元)	起息日	到息日	期限(天)	预期年化收益率(%)
1	广州好莱客创意家居股份有限公司	交通银行股份有限公司广州前进支行	自有资金	蕴通财富?日增利86天	11,000	2016.4.19	2016.7.14	86	3.10%
2	广州好莱客创意家居股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司广州天河支行	自有资金	利多多对公结构性存款产品-公司16JG284期	5,092	2016.4.20	2016.7.20	91	3.00%
3	广州好莱客创意家居股份有限公司	交通银行股份有限公司广州前进支行	募集资金	“蕴通财富?日增利”S款	12,000	2016.4.15	—	—	见附注

附注:上表中“蕴通财富?日增利”S款理财产品预期年化收益率与存续天数的关系如下:存续天数小于7天,则预期年化收益率为1.80%;存续天数为7天(含)-14天,则预期年化收益率为2.50%;存续天数为14天(含)-30天,则预期年化收益率为2.90%;存续天数为30天(含)-90天,则预期年化收益率为3.00%;存续天数为90天(含)以上,则预期年化收益率为3.10%。

(二)公司内部履行的审批程序

公司第二届董事会第十三次会议、第二届监事会第十次会议审议通过了《关于使用闲置自有资金购买理财产品的议案》及《关于使用闲置募集资金购买理财产品的议案》,同意公司及公司控股子公司在不影响募集资金投资计划正常进行及保障公司正常经营运作和资金需求的前提下,对最高额度不超过4.7亿元的闲置募集资金及自有资金进行现金管理,购买安全性高、流动性好、保本型等金融机构理财产品(其中:闲置募集资金最高额度不超过1.2亿元、闲置自有资金最高额度不超过3.5亿元)。资金额度在决议有效期内可以滚动使用。具体内容参见2016年4月9日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)上的《广州好莱客创意家居股份有限公司关于使用闲置自有资金购买理财产品的公告》(公告编号:临2016-016)、《广州好莱客创意家居股份有限公司关于使用闲置募集资金购买理财产品的公告》(公告编号:临2016-017)。

(三)本次投资不属于关联交易和重大资产重组事项。

二、投资协议主体的基本情况

公司购买理财产品的交易对方为公司开户银行,交易对方与公司不存在产权、业务、资产、债权债务、人员等方面的其它关系。

三、对外投资合同的主要内容

(一)交通银行“蕴通财富·日增利86天”理财产品协议

1.投资情况:本次对外投资标的“蕴通财富·日增利86天”为保证收益型理财产品,涉及总金额为11,000万元(自有资金);对外投资期限为86天(2016年04月19日至2016年07月14日);预期年化收益率为3.10%。

2.产品风险评级:本次理财产品为极低风险产品(1R)(本评级为银行内部评级),总体风险程度极低,收益波动极小,对本金的正常兑付和预期收益的实现有充分的把握。

3.适用法