

九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 20 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 16 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、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 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	79
8.6 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.....	79

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	79
8.8 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贵金属投资明细	79
8.9 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	80
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	80
§9 基金份额持有人信息	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	82
§10 开放式基金份额变动	83
§ 11 重大事件揭示	84
11.1 基金份额持有人大会决议	84
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
11.4 基金投资策略的改变	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.8 其他重大事件	86
§12 影响投资者决策的其他重要信息	89
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
§13 备查文件目录	91
13.1 备查文件目录	91
13.2 存放地点	91
13.3 查阅方式	91

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	九泰久兴灵活配置混合
基金主代码	001839
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 20 日
基金管理人	九泰基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	217,739,037.08 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中国债券总指数收益率×70%
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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	曾麓燕
	联系电话	010-57383999	021-52629999-212040
	电子邮箱	chenpei@jtamc.com	zengluyan@cib.com.cn
客户服务电话		400-628-0606	95561
传真		010-57383966	021-62535823
注册地址		北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室	福州市湖东路 154 号
办公地址		北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 8 号楼 A 栋 101-120 室、201-222 室	上海市银城路 167 号 4 楼
邮政编码		100020	200041

法定代表人	卢伟忠	陶以平（代）
-------	-----	--------

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	九泰基金管理有限公司	北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 8 号楼 A 栋 101-120 室、201-222 室

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年 1 月 20 日 (基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	54,126,018.94	-27,522,126.33	15,207,352.46
本期利润	71,323,589.07	-36,996,469.27	13,662,555.02
加权平均基金份额本期利润	0.3792	-0.2400	0.0683
本期加权平均净值利润率	38.38%	-25.86%	6.69%
本期基金份额净值增长率	51.33%	-24.95%	6.82%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	15,849,309.66	-36,009,607.21	3,657,745.61
期末可供分配基金份额利润	0.0728	-0.2360	0.0183
期末基金资产净值	239,504,470.88	116,591,432.00	203,755,684.24
期末基金份额净值	1.100	0.764	1.018
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	21.32%	-19.83%	6.82%

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、本基金基金合同于 2017 年 1 月 20 日生效，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

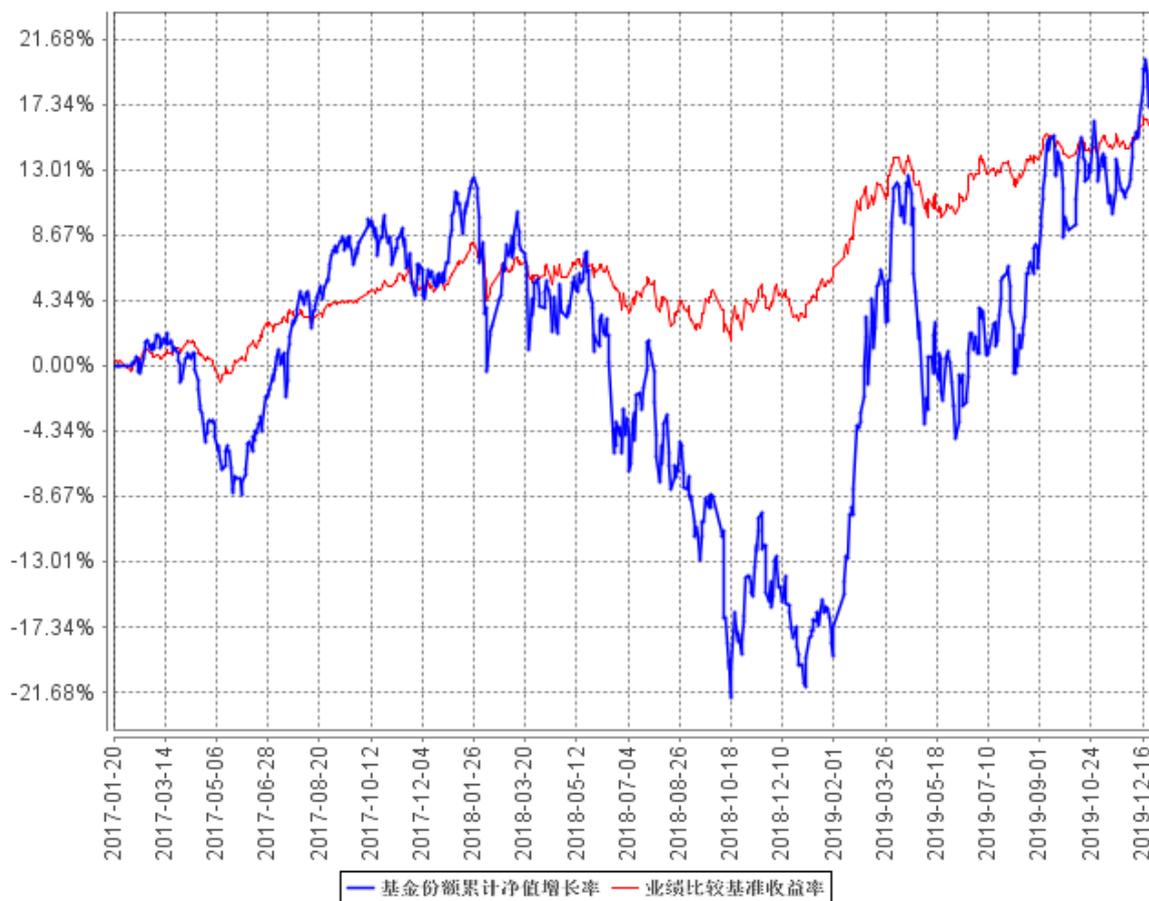
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11.28%	0.92%	3.22%	0.22%	8.06%	0.70%
过去六个月	20.31%	1.08%	4.19%	0.25%	16.12%	0.83%

过去一年	51.33%	1.40%	13.48%	0.36%	37.85%	1.04%
自基金合同生效起至今	21.32%	1.23%	17.46%	0.33%	3.86%	0.90%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

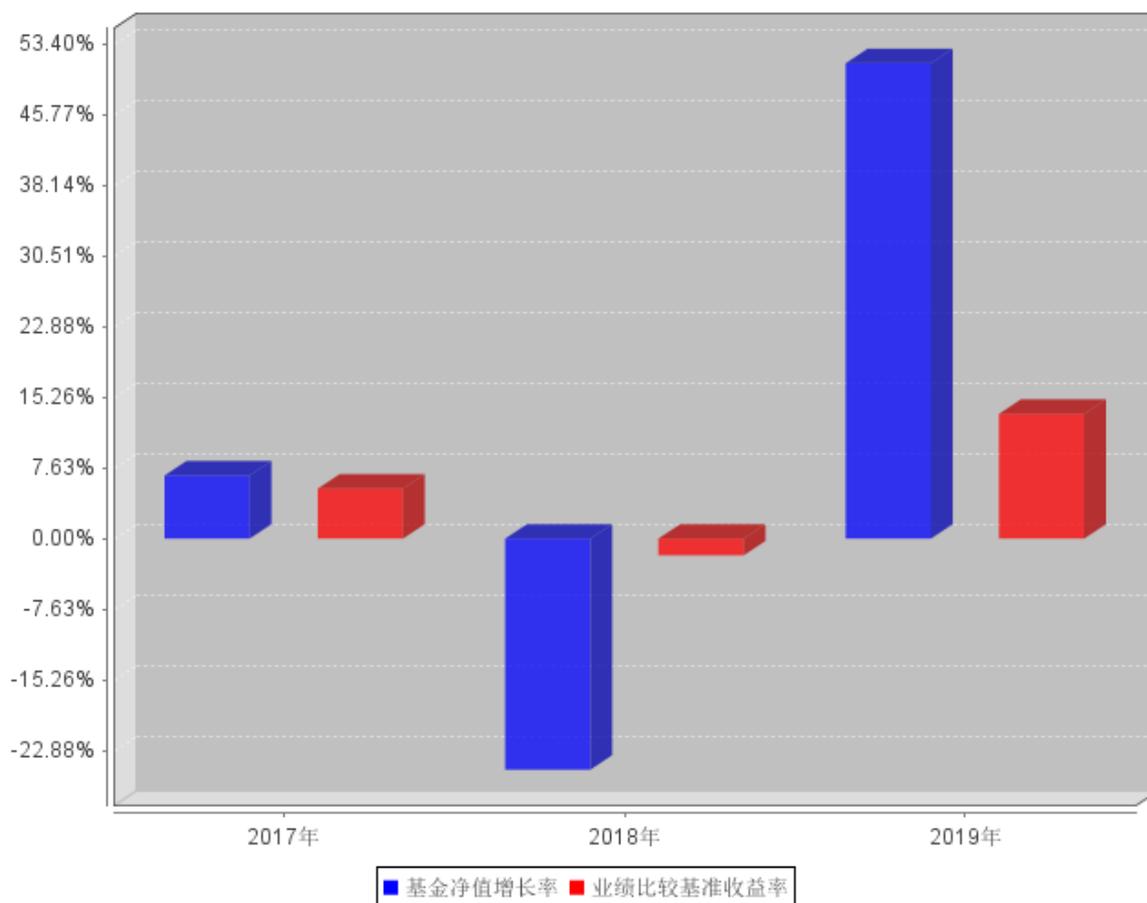


注：1. 本基金合同于 2017 年 1 月 20 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束已满一年。

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

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对比图



注：本基金合同于 2017 年 1 月 20 日生效，合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019	0.5300	9,339,721.60	2,417,821.73	11,757,543.33	除息日：2019年10月16日
2018	-	-	-	-	2018年度未分配收益
2017	0.5000	10,004,901.46	0.94	10,004,902.40	除息日：2017年12月15日
合计	1.0300	19,344,623.06	2,417,822.67	21,762,445.73	

§ 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3亿元人民币，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。

九泰基金坚持“持有人利益优先”和“风控第一”原则，以“大资管”时代金融资本市场改革发展为契机，积极推动业务和产品创新，不断探索新的商业模式，打造九泰基金差异化的竞争优势。

作为首家PE投资管理机构发起设立的公募基金管理公司，九泰基金将延续股东方的长期投资、价值投资的经营理念，在公募行业建立有效的公司治理和激励约束机制，引入私募合伙人创业文化和经营理念，培育企业内生发展动力，以“平台”思维和“跨界”理念打造不同于传统公募基金的业务发展模式。

截至本报告期末（2019年12月31日），基金管理人共管理15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、九泰久稳灵活配置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，九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF），九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金，九泰盈华量化灵活配置混合型证券投资基金（LOF），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，九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金（LOF），九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金，证券投资基金规模约为64.53亿元。

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		
孟亚强	基金经理	2017年2月10日	-	10	南开大学保险精算硕士，中国籍，具有基金从业资格。10年证券从业经历。历任博时基金

					管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理。2015年8月加入九泰基金管理有限公司，曾任九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金（原九泰久稳保本混合型证券投资基金，2016年6月7日至2018年11月26日）的基金经理，现任九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金（2016年6月7日至今）、九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金（2016年12月26日至今）、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金（2017年2月10日至今）、九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金（2017年8月16日至2020年3月23日）的基金经理。
李响	基金经理	2019年12月25日	-	9	中国科学技术大学硕士，中国籍，具有基金从业资格。9年证券从业经验。先后就职于博时基金、交银施罗德基金及南方基金。2015年6月加入九泰基金管理有限公司，曾任绝对收益部投资经理，现任九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金（2019年12月25日至今）、九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金（2019年12月25日至今）的基金经理。

注：1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职

日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

2、截止本报告披露日前，孟亚强已于 2020 年 3 月 23 日离任九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理，详情请查阅相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、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、交易执行的内部控制，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管理的不同投资组合，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

本报告期内，本公司所管理的投资组合，在参与的交易所公开竞价交易中，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的 5%的情况共出现了 2 次，未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

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

2019 年全年市场表现良好，本基金组合风险暴露介于中证 1000 和中证 500 之间，其中超配盈利质量因子和反转因子，在实际归因分析中，盈利质量因子选股表现较好。在具体操作中，除了继续保持成长风格的暴露，我们逐步减弱了动量因子选股的作用，直接结果是业绩优秀的行业龙头股票比例逐渐降低。未来组合会加大超配反转因子，力争充分获取技术类因子的稳健收益。在行业配置中，由于价值因子持续表现不佳，中游建材、化工、银行等行业持续低配，组合整体超配农林牧渔等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.100 元；本报告期基金份额净值增长率为 51.33%，业绩比较基准收益率为 13.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2020 年，在国内房地产投资和销售下行压力较大、制造业企业产能扩张意愿不强、海外全球经济继续下行限制外需等因素叠加的背景下，经济增速或面临新一轮换挡，预计中长期内未来经济增速中枢可能会下一个台阶，但增速换挡的过程是相对缓和的。在本轮盈利下行周期中，A 股已经进行了较为充分业绩修复，预计 2020 年 A 股盈利将会逐渐走出底部，在货币政策方面预计仍将延续温和放松基调，降准、公开市场操作与降息三者仍将有机结合起来，虽然整体盈利增速难以在短期内实现较大幅度的好转，但是部分中下游行业以及新兴产业会存在结构性的盈利改善，从而实现盈利的缓慢复苏。这与 2012-2013 年所经历的经济增速换挡具有相似之处，并且均伴随着新一代通讯技术的到来。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，本基金管理人从合法、合规、为持有人创造价值出发，依照公司内部控制的整体要求，持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司在投资管理、研究支持、证券交易、基金运营、市场销售、客户服务、反洗钱、员工投资行为管理等多方面制订有

相应制度，并进行及时的修订更新，持续完善公司合规制度建设；通过开展合规咨询、合规审查、合规培训、合规考试、合规问责等形式，不断提升员工的合规守法意识；通过对业务部门专兼职合规管理员的培训和考核，强化业务合规管理，将合规管理内置到前台业务中。在风险控制方面，持续推动风险控制前置，对新产品和新业务的风险控制方面加强布局，加强防控风险，保护持有人利益；持续加强投资风险监控工作，通过人员培训、系统建设、流程梳理等手段不断提高风险监控能力，把控投资风险；加强绩效评价工作频率和质量，积极促进投研业务水平提高。在监察稽核方面，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展各项业务的专项稽核，对于发现的问题及时提出整改要求并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本基金管理人将不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以基金持有人利益最大化为原则，持续防控风险。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金合同中第十六部分对基金利润分配原则的约定，本基金于 2019 年 10 月 16 日进行了利润分配，分配总金额为 11,757,543.33 元。

本基金截至 2019 年 12 月 31 日，期末可供分配收益为 15,849,309.66 元。其中：未分配利润已实现部分为 15,849,309.66 元，未分配利润未实现部分为 5,916,124.14 元。

4.9 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 万元的情形。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(20)第 P01393 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金全体持有人：
审计意见	<p>我们审计了九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>九泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我</p>

	<p>们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	杨丽 杨婧
会计师事务所的地址	中国·上海
审计报告日期	2020 年 4 月 16 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	9,866,393.42	1,153,306.37
结算备付金		2,973,469.47	665,825.20
存出保证金		590,985.25	49,601.18
交易性金融资产	7.4.7.2	226,663,694.08	114,881,084.56
其中：股票投资		222,661,294.08	108,238,978.06
基金投资		-	-
债券投资		4,002,400.00	6,642,106.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,744,882.26	41,983.73
应收利息	7.4.7.5	94,557.15	263,461.45
应收股利		-	-
应收申购款		224.68	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		241,934,206.31	117,055,262.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,448,353.06	-
应付赎回款		51,597.95	-
应付管理人报酬		161,116.85	82,684.81
应付托管费		40,279.22	20,671.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	543,086.65	221,474.50
应交税费		6,236.87	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,064.83	139,000.00
负债合计		2,429,735.43	463,830.49
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	217,739,037.08	152,601,039.21
未分配利润	7.4.7.10	21,765,433.80	-36,009,607.21
所有者权益合计		239,504,470.88	116,591,432.00
负债和所有者权益总计		241,934,206.31	117,055,262.49

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.100 元，基金份额总额为 217,739,037.08 份。

7.2 利润表

会计主体：九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		78,596,468.79	-33,072,068.68
1. 利息收入		288,875.83	378,292.71
其中：存款利息收入	7.4.7.11	181,647.78	65,012.98
债券利息收入		106,287.78	279,525.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		940.27	33,754.41
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		61,106,601.64	-23,976,068.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	59,185,595.01	-26,041,649.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-38,576.98	2,356.70
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	560,533.98	-
股利收益	7.4.7.16	1,399,049.63	2,063,224.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	17,197,570.13	-9,474,342.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,421.19	49.58
减：二、费用		7,272,879.72	3,924,400.59

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1, 479, 649. 88	1, 143, 146. 46
2. 托管费	7.4.10.2.2	369, 912. 58	285, 786. 52
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5, 213, 057. 38	2, 317, 120. 95
5. 利息支出		-	877. 19
其中：卖出回购金融资产支出		-	877. 19
6. 税金及附加		2, 018. 09	69. 47
7. 其他费用	7.4.7.20	208, 241. 79	177, 400. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		71, 323, 589. 07	-36, 996, 469. 27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		71, 323, 589. 07	-36, 996, 469. 27

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	152, 601, 039. 21	-36, 009, 607. 21	116, 591, 432. 00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	71, 323, 589. 07	71, 323, 589. 07
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）	65, 137, 997. 87	-1, 791, 004. 73	63, 346, 993. 14
其中：1. 基金申购款	72, 989, 074. 73	-1, 114, 394. 32	71, 874, 680. 41
2. 基金赎回款	-7, 851, 076. 86	-676, 610. 41	-8, 527, 687. 27
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）	-	-11, 757, 543. 33	-11, 757, 543. 33
五、期末所有者权益（基金净值）	217, 739, 037. 08	21, 765, 433. 80	239, 504, 470. 88
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	200,097,938.63	3,657,745.61	203,755,684.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-36,996,469.27	-36,996,469.27
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）	-47,496,899.42	-2,670,883.55	-50,167,782.97
其中：1. 基金申购款	261,897.76	1,550.51	263,448.27
2. 基金赎回款	-47,758,797.18	-2,672,434.06	-50,431,231.24
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）	152,601,039.21	-36,009,607.21	116,591,432.00

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：

<u>卢伟忠</u>	<u>严军</u>	<u>荣静</u>
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

九泰久兴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[2015]1950 号文《关于准予九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册,由九泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关规定和《九泰久兴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 2017 年 1 月 17 日向社会公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限为不定期,募集期间净认购资金总额为人民币 200,072,685.24 元,在募集期间产生的利息为人民币 0.00 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 200,072,685.24 元,折合 200,072,685.24 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 2017 年 1 月 20 日生效。本基金的基金管理人和注册登记机构均为九泰基金管理有限公

司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰久兴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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票(包含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、超短期融资券、短期融资券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货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×30%+中国债券总指数收益率×70%。

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行业实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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度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。

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、资产支持证券和交易所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。对于发行时明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，基金管理人的估值委员会认为必要时，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代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与其成本的差额入账；
- (6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；
- (7) 资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认；
- (8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；
- (9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司

代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告 [2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资

基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税

[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	9,866,393.42	1,153,306.37
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	9,866,393.42	1,153,306.37

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	216,512,914.33	222,661,294.08	6,148,379.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,002,400.00	4,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	4,002,400.00	4,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	220,510,914.33	226,663,694.08	6,152,779.75
项目	上年度末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	119,232,417.54	108,238,978.06	-10,993,439.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,642,106.50	-25,700.90
	银行间市场	-	-
	合计	6,642,106.50	-25,700.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	125,900,224.94	114,881,084.56	-11,019,140.38

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	3,160,080.00	-	-	
其中：股指期货	3,160,080.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	3,160,080.00	-	-	

项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义金 额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在股指期货采用当日无负债结算制度下，结算准备金已包括本基金于 2019 年 12 月 31 日所持的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融资产项下的股指期货投资与相关结算所得的持仓损益之间抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,919.85	422.64
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	830.94	329.67
应收债券利息	88,349.59	262,684.50
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	456.77	24.64
合计	94,557.15	263,461.45

注：其他指应收结算保证金利息和未占用的期货保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	543,086.65	221,474.50
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	543,086.65	221,474.50

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	64.83	-
应付证券出借违约金	-	-
预提信息披露费	120,000.00	80,000.00
预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提中债登帐户维护费	4,500.00	4,500.00
预提上清所帐户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	179,064.83	139,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	152,601,039.21	152,601,039.21
本期申购	72,989,074.73	72,989,074.73
本期赎回（以“-”号填列）	-7,851,076.86	-7,851,076.86
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	217,739,037.08	217,739,037.08

注：本期申购中包含红利再投资和转换入份额及金额，本期赎回中包含转换出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-24,197,067.99	-11,812,539.22	-36,009,607.21
本期利润	54,126,018.94	17,197,570.13	71,323,589.07
本期基金份额交易产生的变动数	-2,322,097.96	531,093.23	-1,791,004.73
其中：基金申购款	-1,822,817.36	708,423.04	-1,114,394.32
基金赎回款	-499,280.60	-177,329.81	-676,610.41
本期已分配利润	-11,757,543.33	-	-11,757,543.33
本期末	15,849,309.66	5,916,124.14	21,765,433.80

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	144,693.31	49,716.93
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	29,565.13	14,382.14
其他	7,389.34	913.91
合计	181,647.78	65,012.98

注：其他包括结算保证金利息收入、直销申购款利息收入和未占用的期货保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	2,338,602,298.65	1,035,316,287.94
减：卖出股票成本总额	2,279,416,703.64	1,061,357,937.21
买卖股票差价收入	59,185,595.01	-26,041,649.27

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,230,638.26	16,076,803.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,965,807.40	15,603,835.03
减：应收利息总额	303,407.84	470,611.69
买卖债券差价收入	-38,576.98	2,356.70

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间收益金额 2018年1月1日至2018年12月31 日
国债期货投资收益	-	-
股指期货投资收益	560,533.98	-
合计	560,533.98	-

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,399,049.63	2,063,224.54
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,399,049.63	2,063,224.54

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
1. 交易性金融资产	17,171,920.13	-9,474,342.94
——股票投资	17,141,819.23	-9,472,030.53

——债券投资	30,100.90	-2,312.41
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	25,650.00	-
——权证投资	-	-
——股指期货投资	25,650.00	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	17,197,570.13	-9,474,342.94

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
基金赎回费收入	3,421.19	49.58
合计	3,421.19	49.58

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	5,210,290.59	2,317,120.95
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
股指期货交易费用	2,766.79	-
合计	5,213,057.38	2,317,120.95

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00

信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	1,041.79	1,200.00
其他	1,200.00	1,200.00
中债登帐户维护费	18,000.00	22,500.00
上清所帐户维护费	18,000.00	22,500.00
合计	208,241.79	177,400.00

注：其他为上清所查询费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

新型冠状病毒肺炎(以下简称“新冠肺炎”)疫情于2020年1月在全国范围爆发以来,对新冠肺炎疫情的防控工作正在全国范围内持续进行。本基金管理人将切实贯彻落实由中国人民银行、财政部、中国银行保险监督管理委员会、证监会和国家外汇管理局共同发布的《关于进一步强化金融支持防控新型冠状病毒感染肺炎疫情的通知》的各项要求,强化金融对疫情防控工作的支持。

新冠肺炎疫情将影响全球经济前景和企业经营,其影响程度将取决于疫情防控的情况、持续时间以及各项调控政策的实施。本基金管理人将继续密切关注新冠肺炎疫情发展情况,评估和积极应对疫情可能对本基金财务状况、经营成果等方面产生的影响。

截至财务报表批准日,本基金除上述事项外无其他需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
九泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人
九州证券股份有限公司	基金管理人的股东
拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司	基金管理人的股东
同创九鼎投资管理集团股份有限公司	基金管理人的股东
昆吾九鼎投资管理有限公司	基金管理人的股东
九泰基金销售(北京)有限公司	基金管理人的全资子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,479,649.88	1,143,146.46
其中：支付销售机构的客户维护费	7,001.72	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	369,912.58	285,786.52

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	9,866,393.42	144,693.31	1,153,306.37	49,716.93

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019年 10月16 日	-	2019年 10月 16日	0.5300	9,339,721.60	2,417,821.73	11,757,543.33	
合计	-	-		0.5300	9,339,721.60	2,417,821.73	11,757,543.33	

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688078	龙软科技	2019 年 12 月 20 日	2020 年 6 月 30 日	新股流通受限	21.59	41.95	2,811	60,689.49	117,921.45	-
688081	兴图新科	2019 年 12 月 26 日	2020 年 7 月 6 日	新股流通受限	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
688128	中国电研	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 6 日	新股流通受限	18.79	17.52	9,027	169,617.33	158,153.04	-
688181	八亿时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股流通受限	43.98	43.98	3,169	139,372.62	139,372.62	-
688188	柏楚电子	2019 年 7 月 31 日	2020 年 2 月 10 日	新股流通受限	68.58	152.09	7,847	538,147.26	1,193,450.23	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，通过摇号抽签方式抽取公募产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金和合格境外机构投资者资金中 10%的账户，中签账户的基金管理人承诺中签账户获配股份锁定，持有期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资、资产支持证券投资及股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人建立了董事会及风险控制委员会、总经理、风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部以及相关业务部门构成的风险管理架构体系。董事会负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度。董事会下设风险控制委员会，风险控制委员会负责对公司经营管理与资产组合运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查；总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险管理委员会，负责审议公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等，重点是公司的合规控制和投资的风险控制；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资（未包含国债、政策性金融债、央行票据和同业存单）。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

于本报告期末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资（未包含国债、政策性金融债、央行票据和同业存单）。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

综上所述，本基金在本报告期内流动性良好，无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12 月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,866,393.42	-	-	-	-	-	9,866,393.42
结算备付金	2,973,469.47	-	-	-	-	-	2,973,469.47
存出保证金	590,985.25	-	-	-	-	-	590,985.25
交易性金融资产	4,002,400.00	-	-	-	-	-222,661,294.08	226,663,694.08
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,744,882.26	1,744,882.26
应收利息	-	-	-	-	-	94,557.15	94,557.15
应收申购款	-	-	-	-	-	224.68	224.68
资产总计	17,433,248.14	-	-	-	-	-224,500,958.17	241,934,206.31
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,448,353.06	1,448,353.06
应付赎回款	-	-	-	-	-	51,597.95	51,597.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	161,116.85	161,116.85
应付托管费	-	-	-	-	-	40,279.22	40,279.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	543,086.65	543,086.65

应交税费	-	-	-	-	-	6,236.87	6,236.87
其他负债	-	-	-	-	-	179,064.83	179,064.83
负债总计	-	-	-	-	-	2,429,735.43	2,429,735.43
利率敏感度缺口	17,433,248.14	-	-	-	-	-222,071,222.74	239,504,470.88
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,153,306.37	-	-	-	-	-	1,153,306.37
结算备付金	665,825.20	-	-	-	-	-	665,825.20
存出保证金	49,601.18	-	-	-	-	-	49,601.18
交易性金融资产	2,574,286.50	-4,067,820.00	-	-	-	-108,238,978.06	114,881,084.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-	41,983.73	41,983.73
应收利息	-	-	-	-	-	263,461.45	263,461.45
资产总计	4,443,019.25	-4,067,820.00	-	-	-	-108,544,423.24	117,055,262.49
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	82,684.81	82,684.81
应付托管费	-	-	-	-	-	20,671.18	20,671.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	221,474.50	221,474.50
其他负债	-	-	-	-	-	139,000.00	139,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	463,830.49	463,830.49
利率敏感度缺口	4,443,019.25	-4,067,820.00	-	-	-	-108,080,592.75	116,591,432.00

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于报告期末及上年度末持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	222,661,294.08	92.97	108,238,978.06	92.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,002,400.00	1.67	6,642,106.50	5.70
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	226,663,694.08	94.64	114,881,084.56	98.53

注：由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	沪深 300 指数上涨 5%	12,062,564.21	5,351,629.14
沪深 300 指数下跌 5%	-12,062,564.21	-5,351,629.14	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项及其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 220,956,872.57 元，属于第二层次的余额为人民币 4,148,350.66 元，属于第三层次的余额为人民币 1,558,470.85 元(2018 年 12 月 31 日：第一层次的余额为人民币 108,188,832.26 元，属于第二层次的余额为人民币 6,692,252.30 元，无属于第三层次的余额)。

本基金持有的金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层次的余额为人民币 1,558,470.85 元；本报告期因购入带锁定期的科创板股票转入第三层次的金额为人民币 768,454.08 元，无转出第三层次的金额，计入公允价值变动损益的金额为人民币 790,016.77 元。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允

价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	222,661,294.08	92.03
	其中：股票	222,661,294.08	92.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,002,400.00	1.65
	其中：债券	4,002,400.00	1.65
	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	-	-
	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	12,839,862.89	5.31
8	其他各项资产	2,430,649.34	1.00
9	合计	241,934,206.31	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,181,662.50	3.00
B	采矿业	7,119,986.00	2.97
C	制造业	141,072,381.34	58.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,677,536.25	2.37
E	建筑业	2,823,084.00	1.18
F	批发和零售业	8,336,510.00	3.48
G	交通运输、仓储和邮政业	5,645,247.00	2.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,782,036.18	10.35
J	金融业	2,756,398.00	1.15
K	房地产业	7,096,428.00	2.96
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	158,153.04	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,452,044.04	0.61

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,857,545.00	1.19
Q	卫生和社会工作	1,435,420.00	0.60
R	文化、体育和娱乐业	4,266,862.73	1.78
S	综合	-	-
	合计	222,661,294.08	92.97

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688111	金山办公	14,659	2,402,610.10	1.00
2	300116	坚瑞沃能	829,300	1,625,428.00	0.68
3	002105	信隆健康	255,900	1,509,810.00	0.63
4	002123	梦网集团	78,100	1,494,053.00	0.62
5	002194	武汉凡谷	76,800	1,486,080.00	0.62
6	300019	硅宝科技	145,600	1,473,472.00	0.62
7	002531	天顺风能	232,600	1,470,032.00	0.61
8	600267	海正药业	148,000	1,466,680.00	0.61
9	000403	双林生物	45,300	1,463,190.00	0.61
10	603315	福鞍股份	120,300	1,461,645.00	0.61
11	600720	祁连山	116,000	1,455,800.00	0.61
12	000565	渝三峡 A	269,450	1,452,335.50	0.61
13	601163	三角轮胎	94,800	1,450,440.00	0.61
14	603519	立霸股份	103,500	1,450,035.00	0.61
15	603008	喜临门	93,700	1,449,539.00	0.61
16	603606	东方电缆	132,000	1,449,360.00	0.61
17	002458	益生股份	51,100	1,448,685.00	0.60
18	002607	中公教育	81,000	1,448,280.00	0.60
19	300167	迪威迅	265,900	1,446,496.00	0.60
20	002909	集泰股份	125,700	1,445,550.00	0.60
21	603136	天目湖	54,300	1,445,466.00	0.60
22	002234	民和股份	45,400	1,444,174.00	0.60
23	603160	汇顶科技	7,000	1,444,100.00	0.60
24	300218	安利股份	181,600	1,441,904.00	0.60

25	002360	同德化工	267,200	1,440,208.00	0.60
26	002478	常宝股份	243,100	1,439,152.00	0.60
27	002381	双箭股份	169,800	1,438,206.00	0.60
28	300487	蓝晓科技	39,400	1,438,100.00	0.60
29	000885	城发环境	130,800	1,437,492.00	0.60
30	002869	金溢科技	22,000	1,437,260.00	0.60
31	000529	广弘控股	209,800	1,437,130.00	0.60
32	600961	株冶集团	172,900	1,436,799.00	0.60
33	002248	华东数控	181,100	1,436,123.00	0.60
34	300062	中能电气	264,900	1,435,758.00	0.60
35	000655	金岭矿业	259,600	1,435,588.00	0.60
36	603737	三棵树	17,800	1,435,570.00	0.60
37	600763	通策医疗	14,000	1,435,420.00	0.60
38	002803	吉宏股份	54,200	1,435,216.00	0.60
39	300552	万集科技	17,000	1,434,800.00	0.60
40	300498	温氏股份	42,700	1,434,720.00	0.60
41	601677	明泰铝业	124,400	1,434,332.00	0.60
42	600794	保税科技	375,400	1,434,028.00	0.60
43	002609	捷顺科技	166,900	1,433,671.00	0.60
44	300248	新开普	174,600	1,433,466.00	0.60
45	002782	可立克	135,100	1,433,411.00	0.60
46	002443	金洲管道	213,300	1,433,376.00	0.60
47	600871	石化油服	634,200	1,433,292.00	0.60
48	600846	同济科技	153,900	1,432,809.00	0.60
49	300092	科新机电	196,500	1,432,485.00	0.60
50	000913	钱江摩托	130,100	1,432,401.00	0.60
51	601808	中海油服	74,600	1,432,320.00	0.60
52	300251	光线传媒	121,300	1,431,340.00	0.60
53	300163	先锋新材	388,800	1,430,784.00	0.60
54	000838	财信发展	445,600	1,430,376.00	0.60
55	000573	粤宏远 A	462,800	1,430,052.00	0.60
56	300559	佳发教育	48,800	1,429,840.00	0.60
57	600778	友好集团	263,200	1,429,176.00	0.60
58	601918	新集能源	441,100	1,429,164.00	0.60
59	603041	美思德	82,800	1,429,128.00	0.60
60	002746	仙坛股份	91,750	1,428,547.50	0.60
61	002555	三七互娱	53,000	1,427,290.00	0.60
62	600727	鲁北化工	201,300	1,427,217.00	0.60
63	002124	天邦股份	113,700	1,426,935.00	0.60

64	600452	涪陵电力	77,325	1,426,646.25	0.60
65	300114	中航电测	125,300	1,425,914.00	0.60
66	600693	东百集团	272,600	1,425,698.00	0.60
67	300443	金雷股份	101,900	1,425,581.00	0.60
68	000755	山西路桥	360,900	1,425,555.00	0.60
69	002299	圣农发展	59,200	1,425,536.00	0.60
70	002016	世荣兆业	164,500	1,424,570.00	0.59
71	000933	神火股份	259,600	1,422,608.00	0.59
72	002315	焦点科技	74,400	1,422,528.00	0.59
73	002024	苏宁易购	140,700	1,422,477.00	0.59
74	000049	德赛电池	34,900	1,421,826.00	0.59
75	002111	威海广泰	90,900	1,421,676.00	0.59
76	002463	沪电股份	64,000	1,421,440.00	0.59
77	002161	远望谷	149,913	1,421,175.24	0.59
78	000993	闽东电力	193,600	1,421,024.00	0.59
79	002916	深南电路	10,000	1,421,000.00	0.59
80	300130	新国都	80,600	1,420,978.00	0.59
81	300640	德艺文创	171,200	1,420,960.00	0.59
82	300059	东方财富	90,100	1,420,877.00	0.59
83	002031	巨轮智能	717,500	1,420,650.00	0.59
84	300041	回天新材	140,100	1,420,614.00	0.59
85	600984	建设机械	137,500	1,420,375.00	0.59
86	603819	神力股份	102,100	1,420,211.00	0.59
87	600469	风神股份	288,600	1,419,912.00	0.59
88	000973	佛塑科技	305,900	1,419,376.00	0.59
89	000708	中信特钢	61,900	1,419,367.00	0.59
90	601058	赛轮轮胎	317,500	1,419,225.00	0.59
91	603906	龙蟠科技	134,500	1,417,630.00	0.59
92	002606	大连电瓷	246,102	1,417,547.52	0.59
93	300471	厚普股份	155,700	1,416,870.00	0.59
94	300129	泰胜风能	291,400	1,416,204.00	0.59
95	000612	焦作万方	327,800	1,416,096.00	0.59
96	300205	天喻信息	129,200	1,416,032.00	0.59
97	000966	长源电力	304,500	1,415,925.00	0.59
98	601012	隆基股份	57,000	1,415,310.00	0.59
99	600728	佳都科技	150,880	1,415,254.40	0.59
100	600880	博瑞传播	354,527	1,414,562.73	0.59
101	300209	天泽信息	99,100	1,414,157.00	0.59
102	000751	锌业股份	437,800	1,414,094.00	0.59

103	002015	协鑫能科	268,300	1,413,941.00	0.59
104	300043	星辉娱乐	275,600	1,413,828.00	0.59
105	300491	通合科技	108,600	1,412,886.00	0.59
106	300690	双一科技	55,900	1,412,593.00	0.59
107	002452	长高集团	295,500	1,412,490.00	0.59
108	300417	南华仪器	33,500	1,412,025.00	0.59
109	000042	中洲控股	130,000	1,411,800.00	0.59
110	600063	皖维高新	359,900	1,410,808.00	0.59
111	300192	科斯伍德	100,600	1,410,412.00	0.59
112	002379	宏创控股	392,800	1,410,152.00	0.59
113	300719	安达维尔	120,300	1,409,916.00	0.59
114	600731	湖南海利	195,200	1,409,344.00	0.59
115	002621	美吉姆	128,700	1,409,265.00	0.59
116	300697	电工合金	93,620	1,408,981.00	0.59
117	600609	金杯汽车	355,700	1,408,572.00	0.59
118	002660	茂硕电源	160,600	1,408,462.00	0.59
119	002214	大立科技	132,900	1,407,411.00	0.59
120	002318	久立特材	150,000	1,407,000.00	0.59
121	002045	国光电器	115,300	1,405,507.00	0.59
122	300543	朗科智能	60,600	1,405,314.00	0.59
123	300200	高盟新材	111,900	1,404,345.00	0.59
124	002182	云海金属	151,600	1,402,300.00	0.59
125	600510	黑牡丹	208,900	1,399,630.00	0.58
126	300702	天宇股份	27,900	1,398,348.00	0.58
127	600779	水井坊	27,000	1,397,250.00	0.58
128	002163	中航三鑫	250,500	1,390,275.00	0.58
129	600532	宏达矿业	368,600	1,389,622.00	0.58
130	002669	康达新材	104,200	1,381,692.00	0.58
131	600449	宁夏建材	123,700	1,380,492.00	0.58
132	002326	永太科技	139,200	1,378,080.00	0.58
133	603036	如通股份	127,900	1,369,809.00	0.57
134	600058	五矿发展	170,500	1,367,410.00	0.57
135	300703	创源文化	112,800	1,355,856.00	0.57
136	300214	日科化学	163,200	1,354,560.00	0.57
137	002511	中顺洁柔	106,700	1,350,822.00	0.56
138	300253	卫宁健康	90,150	1,350,447.00	0.56
139	600866	星湖科技	303,700	1,348,428.00	0.56
140	600798	宁波海运	378,700	1,348,172.00	0.56
141	600307	酒钢宏兴	653,500	1,346,210.00	0.56

142	002697	红旗连锁	178,300	1,346,165.00	0.56
143	002221	东华能源	173,400	1,345,584.00	0.56
144	002112	三变科技	196,100	1,341,324.00	0.56
145	600745	闻泰科技	14,500	1,341,250.00	0.56
146	002732	燕塘乳业	60,900	1,338,582.00	0.56
147	300433	蓝思科技	96,700	1,336,394.00	0.56
148	300546	雄帝科技	46,200	1,335,642.00	0.56
149	601628	中国人寿	38,300	1,335,521.00	0.56
150	300360	炬华科技	105,100	1,329,515.00	0.56
151	002677	浙江美大	99,500	1,329,320.00	0.56
152	300440	运达科技	163,800	1,321,866.00	0.55
153	300550	和仁科技	47,400	1,321,038.00	0.55
154	300033	同花顺	12,000	1,309,320.00	0.55
155	300709	精研科技	13,200	1,288,980.00	0.54
156	688188	柏楚电子	7,847	1,193,450.23	0.50
157	002802	洪汇新材	27,500	557,975.00	0.23
158	688128	中国电研	9,027	158,153.04	0.07
159	688181	八亿时空	3,169	139,372.62	0.06
160	688078	龙软科技	2,811	117,921.45	0.05
161	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.04
162	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
163	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
164	600135	乐凯胶片	1,100	7,821.00	0.00
165	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00
166	002518	科士达	80	853.60	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600618	氯碱化工	11,007,474.29	9.44
2	002518	科士达	10,117,508.47	8.68
3	601677	明泰铝业	8,829,180.84	7.57
4	600469	风神股份	8,822,195.65	7.57
5	002099	海翔药业	8,704,262.19	7.47
6	002315	焦点科技	8,646,135.00	7.42

7	300118	东方日升	8,610,691.80	7.39
8	000828	东莞控股	8,269,237.59	7.09
9	300215	电科院	8,122,904.99	6.97
10	002234	民和股份	7,992,978.00	6.86
11	300218	安利股份	7,917,160.38	6.79
12	600328	兰太实业	7,513,738.09	6.44
13	603606	东方电缆	7,335,421.16	6.29
14	600566	济川药业	6,901,147.38	5.92
15	002274	华昌化工	6,880,928.97	5.90
16	600866	星湖科技	6,857,397.20	5.88
17	000969	安泰科技	6,604,674.00	5.66
18	300088	长信科技	6,573,124.30	5.64
19	600720	祁连山	6,477,245.00	5.56
20	603600	永艺股份	6,453,568.50	5.54
21	603300	华铁应急	6,260,202.40	5.37
22	300550	和仁科技	6,250,408.20	5.36
23	300502	新易盛	6,082,832.00	5.22
24	601811	新华文轩	6,027,986.00	5.17
25	600731	湖南海利	6,009,046.00	5.15
26	002458	益生股份	5,996,617.50	5.14
27	600452	涪陵电力	5,965,720.93	5.12
28	600570	恒生电子	5,964,059.07	5.12
29	600587	新华医疗	5,959,912.00	5.11
30	600794	保税科技	5,945,046.87	5.10
31	002587	奥拓电子	5,876,299.28	5.04
32	000655	金岭矿业	5,867,987.71	5.03
33	300303	聚飞光电	5,837,974.60	5.01
34	600802	福建水泥	5,836,990.13	5.01
35	002154	报喜鸟	5,826,995.10	5.00
36	000157	中联重科	5,775,822.00	4.95
37	300396	迪瑞医疗	5,769,560.80	4.95
38	600984	建设机械	5,729,946.56	4.91
39	002607	中公教育	5,728,654.00	4.91
40	600727	鲁北化工	5,698,050.55	4.89
41	600273	嘉化能源	5,632,176.70	4.83
42	002755	奥赛康	5,629,644.30	4.83

43	300628	亿联网络	5,592,273.00	4.80
44	300559	佳发教育	5,554,286.32	4.76
45	300483	沃施股份	5,532,881.95	4.75
46	002478	常宝股份	5,504,717.00	4.72
47	002283	天润曲轴	5,492,767.00	4.71
48	300417	南华仪器	5,450,955.00	4.68
49	300657	弘信电子	5,435,302.50	4.66
50	000589	贵州轮胎	5,414,971.46	4.64
51	300192	科斯伍德	5,397,676.00	4.63
52	300487	蓝晓科技	5,361,110.00	4.60
53	300735	光弘科技	5,331,516.40	4.57
54	002328	新朋股份	5,314,062.10	4.56
55	300019	硅宝科技	5,299,298.00	4.55
56	002697	红旗连锁	5,227,808.80	4.48
57	002600	领益智造	5,181,308.00	4.44
58	600862	中航高科	5,169,789.00	4.43
59	600282	南钢股份	5,161,408.00	4.43
60	000878	云南铜业	5,139,383.63	4.41
61	300702	天宇股份	5,138,715.64	4.41
62	601336	新华保险	5,100,728.79	4.37
63	300428	四通新材	5,096,465.80	4.37
64	600173	卧龙地产	5,090,696.60	4.37
65	000966	长源电力	5,084,242.00	4.36
66	600745	闻泰科技	5,083,583.12	4.36
67	000011	深物业 A	5,053,498.99	4.33
68	300709	精研科技	5,046,712.00	4.33
69	300511	雪榕生物	5,039,785.91	4.32
70	603869	新智认知	5,022,832.00	4.31
71	600189	吉林森工	4,966,759.80	4.26
72	300397	天和防务	4,957,560.00	4.25
73	300114	中航电测	4,934,715.87	4.23
74	600249	两面针	4,927,486.14	4.23
75	000973	佛塑科技	4,876,767.00	4.18
76	002090	金智科技	4,875,082.00	4.18
77	300401	花园生物	4,861,634.50	4.17
78	603160	汇顶科技	4,848,050.00	4.16

79	002795	永和智控	4,828,663.00	4.14
80	603855	华荣股份	4,805,795.48	4.12
81	600728	佳都科技	4,787,140.60	4.11
82	002803	吉宏股份	4,770,034.00	4.09
83	002454	松芝股份	4,768,950.71	4.09
84	600880	博瑞传播	4,746,373.65	4.07
85	002262	恩华药业	4,714,637.16	4.04
86	300389	艾比森	4,706,672.92	4.04
87	603508	思维列控	4,700,246.13	4.03
88	600371	万向德农	4,673,915.79	4.01
89	603496	恒为科技	4,649,165.02	3.99
90	300092	科新机电	4,646,996.00	3.99
91	600763	通策医疗	4,627,347.00	3.97
92	000049	德赛电池	4,557,792.00	3.91
93	002463	沪电股份	4,552,031.81	3.90
94	002161	远望谷	4,551,858.67	3.90
95	600229	城市传媒	4,545,799.78	3.90
96	300280	紫天科技	4,542,322.00	3.90
97	600455	博通股份	4,524,598.00	3.88
98	002105	信隆健康	4,517,535.00	3.87
99	600757	长江传媒	4,465,723.51	3.83
100	002712	思美传媒	4,459,491.94	3.82
101	600211	西藏药业	4,445,456.78	3.81
102	600716	凤凰股份	4,401,152.74	3.77
103	002909	集泰股份	4,384,866.44	3.76
104	002150	通润装备	4,377,287.60	3.75
105	002199	东晶电子	4,353,662.00	3.73
106	300209	天泽信息	4,349,103.30	3.73
107	300443	金雷股份	4,341,557.00	3.72
108	603585	苏利股份	4,340,490.08	3.72
109	002884	凌霄泵业	4,337,054.20	3.72
110	600810	神马股份	4,335,335.40	3.72
111	002796	世嘉科技	4,328,164.00	3.71
112	601168	西部矿业	4,317,981.00	3.70
113	300467	迅游科技	4,307,351.51	3.69
114	002452	长高集团	4,293,884.00	3.68

115	300200	高盟新材	4,270,920.76	3.66
116	600598	北大荒	4,258,512.61	3.65
117	600198	大唐电信	4,253,379.00	3.65
118	603609	禾丰牧业	4,230,984.00	3.63
119	002810	山东赫达	4,225,199.28	3.62
120	002195	二三四五	4,199,922.00	3.60
121	002782	可立克	4,191,379.00	3.59
122	601218	吉鑫科技	4,189,525.58	3.59
123	300059	东方财富	4,152,344.00	3.56
124	600261	阳光照明	4,146,029.88	3.56
125	300130	新国都	4,142,336.60	3.55
126	300481	濮阳惠成	4,135,233.00	3.55
127	603026	石大胜华	4,134,793.00	3.55
128	000923	河钢资源	4,128,485.65	3.54
129	300723	一品红	4,114,430.69	3.53
130	300033	同花顺	4,114,381.00	3.53
131	000779	甘咨询	4,111,749.00	3.53
132	000517	荣安地产	4,105,261.00	3.52
133	002112	三变科技	4,095,962.00	3.51
134	300253	卫宁健康	4,092,902.80	3.51
135	300461	田中精机	4,092,385.40	3.51
136	002591	恒大高新	4,083,551.00	3.50
137	600695	绿庭投资	4,078,813.29	3.50
138	000718	苏宁环球	4,075,185.85	3.50
139	600609	金杯汽车	4,071,192.91	3.49
140	002326	永太科技	4,065,168.05	3.49
141	603444	吉比特	4,048,433.00	3.47
142	300014	亿纬锂能	4,047,710.00	3.47
143	600510	黑牡丹	4,028,513.17	3.46
144	300660	江苏雷利	4,024,725.86	3.45
145	002511	中顺洁柔	4,021,180.48	3.45
146	000601	韶能股份	4,013,937.00	3.44
147	002177	御银股份	4,009,873.00	3.44
148	300283	温州宏丰	3,991,132.00	3.42
149	002732	燕塘乳业	3,988,451.00	3.42
150	600781	ST 辅仁	3,985,899.00	3.42

151	300082	奥克股份	3,984,006.00	3.42
152	600426	华鲁恒升	3,957,924.00	3.39
153	002852	道道全	3,918,821.52	3.36
154	601058	赛轮轮胎	3,907,816.40	3.35
155	300012	华测检测	3,895,094.10	3.34
156	002318	久立特材	3,885,559.00	3.33
157	300690	双一科技	3,878,573.20	3.33
158	603298	杭叉集团	3,848,887.53	3.30
159	600287	江苏舜天	3,845,248.75	3.30
160	600100	同方股份	3,835,260.00	3.29
161	002498	汉缆股份	3,834,957.82	3.29
162	603669	灵康药业	3,829,415.96	3.28
163	300571	平治信息	3,827,162.98	3.28
164	603886	元祖股份	3,788,079.00	3.25
165	002738	中矿资源	3,761,200.00	3.23
166	603089	正裕工业	3,746,245.90	3.21
167	603871	嘉友国际	3,745,469.32	3.21
168	300719	安达维尔	3,743,461.00	3.21
169	600097	开创国际	3,739,129.33	3.21
170	603328	依顿电子	3,723,362.00	3.19
171	600710	苏美达	3,705,989.14	3.18
172	002272	川润股份	3,705,912.06	3.18
173	601888	中国国旅	3,703,212.36	3.18
174	000683	远兴能源	3,697,263.20	3.17
175	000425	徐工机械	3,696,695.00	3.17
176	601599	鹿港文化	3,690,015.81	3.16
177	300107	建新股份	3,687,195.00	3.16
178	300219	鸿利智汇	3,686,332.71	3.16
179	600965	福成股份	3,678,707.16	3.16
180	002916	深南电路	3,674,586.00	3.15
181	002669	康达新材	3,655,171.00	3.14
182	002641	永高股份	3,653,681.97	3.13
183	002605	姚记科技	3,644,659.00	3.13
184	002399	海普瑞	3,636,062.00	3.12
185	603688	石英股份	3,628,530.50	3.11
186	300034	钢研高纳	3,619,323.00	3.10

187	300546	雄帝科技	3,609,021.50	3.10
188	600662	强生控股	3,597,098.00	3.09
189	000790	泰合健康	3,590,892.50	3.08
190	600961	株冶集团	3,584,885.50	3.07
191	600063	皖维高新	3,581,610.99	3.07
192	600580	卧龙电驱	3,578,506.00	3.07
193	600202	哈空调	3,571,451.00	3.06
194	002555	三七互娱	3,563,896.19	3.06
195	603519	立霸股份	3,553,850.80	3.05
196	300515	三德科技	3,546,224.98	3.04
197	000739	普洛药业	3,525,599.80	3.02
198	300162	雷曼光电	3,502,000.00	3.00
199	300131	英唐智控	3,490,521.00	2.99
200	002655	共达电声	3,484,563.65	2.99
201	300189	神农科技	3,483,920.50	2.99
202	002295	精艺股份	3,478,318.50	2.98
203	603313	梦百合	3,469,106.80	2.98
204	600070	浙江富润	3,464,138.80	2.97
205	002082	万邦德	3,463,808.00	2.97
206	600801	华新水泥	3,457,375.00	2.97
207	002381	双箭股份	3,443,406.50	2.95
208	600985	淮北矿业	3,404,350.71	2.92
209	601100	恒立液压	3,401,243.95	2.92
210	600366	宁波韵升	3,397,231.40	2.91
211	000411	英特集团	3,391,540.94	2.91
212	603979	金诚信	3,388,369.22	2.91
213	000573	粤宏远 A	3,387,858.00	2.91
214	002416	爱施德	3,385,442.69	2.90
215	600643	爱建集团	3,379,509.00	2.90
216	300040	九洲电气	3,369,181.42	2.89
217	000822	山东海化	3,355,390.04	2.88
218	300498	温氏股份	3,328,708.00	2.86
219	600563	法拉电子	3,320,079.26	2.85
220	600865	百大集团	3,310,548.32	2.84
221	002203	海亮股份	3,302,848.00	2.83
222	600260	凯乐科技	3,284,650.00	2.82

223	002353	杰瑞股份	3,269,614.38	2.80
224	002189	中光学	3,266,837.96	2.80
225	601003	柳钢股份	3,258,888.32	2.80
226	002653	海思科	3,248,824.78	2.79
227	600271	航天信息	3,240,471.00	2.78
228	603968	醋化股份	3,239,634.00	2.78
229	002489	浙江永强	3,238,144.00	2.78
230	600699	均胜电子	3,227,020.60	2.77
231	300637	扬帆新材	3,219,936.60	2.76
232	603661	恒林股份	3,216,986.53	2.76
233	600507	方大特钢	3,215,023.00	2.76
234	600995	文山电力	3,207,863.10	2.75
235	603528	多伦科技	3,201,903.00	2.75
236	000951	中国重汽	3,194,239.63	2.74
237	000528	柳工	3,194,058.50	2.74
238	000036	华联控股	3,190,210.30	2.74
239	300058	蓝色光标	3,188,282.00	2.73
240	603906	龙蟠科技	3,169,553.00	2.72
241	300031	宝通科技	3,165,535.73	2.72
242	000627	天茂集团	3,163,206.00	2.71
243	000565	渝三峡 A	3,161,960.00	2.71
244	600319	ST 亚星	3,146,193.00	2.70
245	000155	川能动力	3,145,454.73	2.70
246	600784	鲁银投资	3,111,758.06	2.67
247	002117	东港股份	3,111,581.05	2.67
248	300233	金城医药	3,099,418.64	2.66
249	600779	水井坊	3,090,063.19	2.65
250	300686	智动力	3,087,457.00	2.65
251	603882	金域医学	3,086,141.00	2.65
252	600058	五矿发展	3,083,701.70	2.64
253	300638	广和通	3,071,735.00	2.63
254	000650	仁和药业	3,071,581.00	2.63
255	000993	闽东电力	3,055,704.69	2.62
256	002443	金洲管道	3,055,317.00	2.62
257	002606	大连电瓷	3,052,351.04	2.62
258	002462	嘉事堂	3,045,186.98	2.61

259	000910	大亚圣象	3,032,623.36	2.60
260	000717	韶钢松山	3,032,020.00	2.60
261	300275	梅安森	3,028,526.90	2.60
262	603099	长白山	3,019,832.70	2.59
263	002449	国星光电	3,018,909.20	2.59
264	300682	朗新科技	3,015,659.00	2.59
265	000612	焦作万方	3,011,327.45	2.58
266	600252	中恒集团	3,006,614.00	2.58
267	002087	新野纺织	3,004,109.53	2.58
268	600136	当代明诚	2,995,897.00	2.57
269	002194	武汉凡谷	2,994,840.00	2.57
270	600532	宏达矿业	2,994,557.00	2.57
271	002015	协鑫能科	2,983,737.22	2.56
272	000962	东方钨业	2,981,792.32	2.56
273	002048	宁波华翔	2,974,637.84	2.55
274	603538	美诺华	2,957,549.37	2.54
275	300175	朗源股份	2,946,918.00	2.53
276	300640	德艺文创	2,946,086.50	2.53
277	600490	鹏欣资源	2,940,503.00	2.52
278	300179	四方达	2,939,193.00	2.52
279	600117	西宁特钢	2,936,396.82	2.52
280	002666	德联集团	2,936,158.00	2.52
281	002746	仙坛股份	2,927,522.25	2.51
282	600259	广晟有色	2,927,400.76	2.51
283	603801	志邦家居	2,925,802.00	2.51
284	601002	晋亿实业	2,919,872.00	2.50
285	300116	坚瑞沃能	2,911,585.00	2.50
286	000630	铜陵有色	2,900,850.90	2.49
287	600581	八一钢铁	2,891,338.00	2.48
288	002045	国光电器	2,891,096.00	2.48
289	002221	东华能源	2,890,272.64	2.48
290	002531	天顺风能	2,885,940.59	2.48
291	600405	动力源	2,882,886.47	2.47
292	001696	宗申动力	2,877,827.00	2.47
293	600307	酒钢宏兴	2,869,721.27	2.46
294	002841	视源股份	2,868,934.00	2.46

295	000005	世纪星源	2,868,458.00	2.46
296	002214	大立科技	2,867,642.68	2.46
297	603800	道森股份	2,863,421.00	2.46
298	600395	盘江股份	2,861,121.00	2.45
299	300129	泰胜风能	2,856,479.00	2.45
300	600166	福田汽车	2,854,724.48	2.45
301	002321	华英农业	2,847,487.00	2.44
302	000063	中兴通讯	2,837,139.00	2.43
303	600793	宜宾纸业	2,834,388.22	2.43
304	002341	新纶科技	2,825,598.00	2.42
305	002664	长鹰信质	2,824,468.00	2.42
306	000708	中信特钢	2,822,784.00	2.42
307	002379	宏创控股	2,821,750.00	2.42
308	600082	海泰发展	2,821,696.00	2.42
309	603036	如通股份	2,818,968.00	2.42
310	600792	云煤能源	2,818,579.00	2.42
311	002851	麦格米特	2,810,563.00	2.41
312	603086	先达股份	2,809,636.98	2.41
313	002084	海鸥住工	2,808,943.90	2.41
314	300074	华平股份	2,806,596.00	2.41
315	002299	圣农发展	2,804,687.00	2.41
316	600107	美尔雅	2,804,332.00	2.41
317	002367	康力电梯	2,802,162.00	2.40
318	300291	华录百纳	2,801,456.72	2.40
319	000987	越秀金控	2,801,438.00	2.40
320	601163	三角轮胎	2,790,284.00	2.39
321	000733	振华科技	2,787,982.00	2.39
322	002524	光正集团	2,787,802.00	2.39
323	601900	南方传媒	2,785,496.00	2.39
324	600826	兰生股份	2,778,539.64	2.38
325	300384	三联虹普	2,776,937.00	2.38
326	600987	航民股份	2,776,838.08	2.38
327	600467	好当家	2,774,612.15	2.38
328	601968	宝钢包装	2,771,513.00	2.38
329	600250	南纺股份	2,767,911.00	2.37
330	300580	贝斯特	2,756,233.00	2.36

331	300155	安居宝	2,752,079.00	2.36
332	603699	纽威股份	2,752,063.00	2.36
333	600657	信达地产	2,751,657.95	2.36
334	603966	法兰泰克	2,745,972.00	2.36
335	002846	英联股份	2,735,710.40	2.35
336	002052	同洲电子	2,731,579.82	2.34
337	603711	香飘飘	2,731,019.00	2.34
338	300236	上海新阳	2,730,524.12	2.34
339	000719	中原传媒	2,729,853.68	2.34
340	600020	中原高速	2,729,662.68	2.34
341	600269	赣粤高速	2,728,383.01	2.34
342	300394	天孚通信	2,726,310.32	2.34
343	300198	纳川股份	2,724,730.00	2.34
344	000543	皖能电力	2,724,123.00	2.34
345	300471	厚普股份	2,713,952.00	2.33
346	600798	宁波海运	2,710,703.50	2.32
347	600768	宁波富邦	2,709,450.28	2.32
348	002094	青岛金王	2,698,613.93	2.31
349	300345	红宇新材	2,697,286.00	2.31
350	002698	博实股份	2,688,567.06	2.31
351	300440	运达科技	2,687,232.00	2.30
352	300360	炬华科技	2,686,745.00	2.30
353	300572	安车检测	2,680,775.40	2.30
354	002014	永新股份	2,675,642.50	2.29
355	300432	富临精工	2,673,237.00	2.29
356	002350	北京科锐	2,667,206.50	2.29
357	002246	北化股份	2,666,974.00	2.29
358	600255	梦舟股份	2,662,788.00	2.28
359	002571	德力股份	2,661,043.00	2.28
360	300205	天喻信息	2,655,136.00	2.28
361	601918	新集能源	2,653,641.00	2.28
362	300106	西部牧业	2,650,100.50	2.27
363	300353	东土科技	2,648,500.00	2.27
364	601118	海南橡胶	2,647,391.00	2.27
365	300703	创源文化	2,646,651.11	2.27
366	000930	中粮科技	2,645,128.10	2.27

367	002182	云海金属	2,642,474.00	2.27
368	300157	恒泰艾普	2,642,377.00	2.27
369	600327	大东方	2,640,973.70	2.27
370	000099	中信海直	2,640,815.50	2.27
371	300214	日科化学	2,636,953.00	2.26
372	000526	紫光学大	2,633,645.00	2.26
373	300390	天华超净	2,631,778.60	2.26
374	000999	华润三九	2,627,190.68	2.25
375	000576	广东甘化	2,623,874.48	2.25
376	600257	大湖股份	2,616,750.38	2.24
377	002731	萃华珠宝	2,615,339.60	2.24
378	300025	华星创业	2,613,529.00	2.24
379	002406	远东传动	2,609,326.48	2.24
380	603776	永安行	2,592,504.30	2.22
381	000850	华茂股份	2,591,642.00	2.22
382	600031	三一重工	2,587,029.24	2.22
383	300552	万集科技	2,579,874.00	2.21
384	002300	太阳电缆	2,577,158.70	2.21
385	600790	轻纺城	2,576,268.76	2.21
386	000932	华菱钢铁	2,572,732.00	2.21
387	300259	新天科技	2,571,940.40	2.21
388	002423	中粮资本	2,569,194.00	2.20
389	603988	中电电机	2,569,140.48	2.20
390	000811	冰轮环境	2,565,693.50	2.20
391	002626	金达威	2,565,460.52	2.20
392	600486	扬农化工	2,554,659.05	2.19
393	300132	青松股份	2,547,171.00	2.18
394	002749	国光股份	2,544,527.14	2.18
395	603045	福达合金	2,543,835.30	2.18
396	603586	金麒麟	2,529,384.00	2.17
397	600828	茂业商业	2,522,419.84	2.16
398	002346	柘中股份	2,515,694.90	2.16
399	601616	广电电气	2,514,792.00	2.16
400	000616	海航投资	2,504,194.00	2.15
401	603118	共进股份	2,502,417.40	2.15
402	600636	三爱富	2,484,115.00	2.13

403	600765	中航重机	2,478,176.92	2.13
404	600888	新疆众和	2,473,508.05	2.12
405	600481	双良节能	2,472,197.80	2.12
406	002435	长江健康	2,465,231.80	2.11
407	600182	S 佳通	2,463,278.45	2.11
408	600737	中粮糖业	2,451,658.32	2.10
409	600051	宁波联合	2,443,545.03	2.10
410	002111	威海广泰	2,437,352.90	2.09
411	002540	亚太科技	2,436,691.00	2.09
412	300554	三超新材	2,432,708.44	2.09
413	002430	杭氧股份	2,426,966.00	2.08
414	002687	乔治白	2,414,630.00	2.07
415	603859	能科股份	2,408,143.00	2.07
416	000042	中洲控股	2,407,142.00	2.06
417	000885	城发环境	2,406,285.00	2.06
418	000759	中百集团	2,403,338.64	2.06
419	002402	和而泰	2,402,493.00	2.06
420	300543	朗科智能	2,397,135.00	2.06
421	000731	四川美丰	2,392,682.00	2.05
422	603766	隆鑫通用	2,385,772.00	2.05
423	603181	皇马科技	2,384,623.80	2.05
424	000695	滨海能源	2,380,955.48	2.04
425	002637	赞宇科技	2,380,233.00	2.04
426	000862	银星能源	2,368,625.50	2.03
427	002425	凯撒文化	2,367,936.00	2.03
428	600067	冠城大通	2,366,224.05	2.03
429	600531	豫光金铅	2,363,694.40	2.03
430	601019	山东出版	2,363,407.21	2.03
431	002011	盾安环境	2,354,260.00	2.02
432	600068	葛洲坝	2,347,071.00	2.01
433	002020	京新药业	2,342,398.00	2.01

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600618	氯碱化工	11,261,733.54	9.66
2	002099	海翔药业	10,441,844.97	8.96
3	002518	科士达	10,096,493.78	8.66
4	601677	明泰铝业	9,587,371.86	8.22
5	300118	东方日升	9,289,738.99	7.97
6	300215	电科院	8,243,298.00	7.07
7	000828	东莞控股	8,190,231.48	7.02
8	300088	长信科技	8,062,657.77	6.92
9	600469	风神股份	8,014,019.58	6.87
10	002315	焦点科技	7,573,257.00	6.50
11	600328	兰太实业	7,565,506.98	6.49
12	600426	华鲁恒升	7,496,378.43	6.43
13	600566	济川药业	7,011,180.94	6.01
14	603600	永艺股份	6,934,897.20	5.95
15	002274	华昌化工	6,863,760.99	5.89
16	002234	民和股份	6,859,336.00	5.88
17	300303	聚飞光电	6,758,231.70	5.80
18	603609	禾丰牧业	6,735,876.13	5.78
19	300502	新易盛	6,711,206.00	5.76
20	300218	安利股份	6,696,589.50	5.74
21	000969	安泰科技	6,693,158.38	5.74
22	600570	恒生电子	6,463,717.70	5.54
23	603606	东方电缆	6,293,273.37	5.40
24	600587	新华医疗	6,256,402.49	5.37
25	603300	华铁应急	6,253,353.80	5.36
26	601811	新华文轩	6,124,055.98	5.25
27	002587	奥拓电子	6,086,581.50	5.22
28	300628	亿联网络	5,935,608.00	5.09
29	300396	迪瑞医疗	5,924,358.48	5.08
30	600801	华新水泥	5,909,671.81	5.07
31	000157	中联重科	5,887,010.02	5.05
32	600802	福建水泥	5,834,907.84	5.00
33	002755	奥赛康	5,805,642.46	4.98
34	000910	大亚圣象	5,797,051.60	4.97

35	300657	弘信电子	5,769,087.30	4.95
36	002154	报喜鸟	5,744,830.22	4.93
37	000589	贵州轮胎	5,722,068.84	4.91
38	002600	领益智造	5,615,638.00	4.82
39	600273	嘉化能源	5,534,763.86	4.75
40	300735	光弘科技	5,482,335.89	4.70
41	002328	新朋股份	5,455,846.30	4.68
42	300483	沃施股份	5,433,348.81	4.66
43	300397	天和防务	5,433,263.76	4.66
44	603869	新智认知	5,386,990.99	4.62
45	002283	天润曲轴	5,377,994.07	4.61
46	600866	星湖科技	5,352,908.00	4.59
47	300428	四通新材	5,337,466.40	4.58
48	600282	南钢股份	5,321,719.68	4.56
49	600031	三一重工	5,288,652.18	4.54
50	002195	二三四五	5,288,170.72	4.54
51	600720	祁连山	5,285,942.08	4.53
52	002795	永和智控	5,240,778.00	4.49
53	600260	凯乐科技	5,224,199.00	4.48
54	000878	云南铜业	5,217,396.35	4.47
55	300511	雪榕生物	5,203,521.55	4.46
56	600173	卧龙地产	5,086,866.41	4.36
57	601336	新华保险	5,071,909.22	4.35
58	600810	神马股份	5,041,431.70	4.32
59	600371	万向德农	4,980,243.30	4.27
60	000011	深物业 A	4,962,884.94	4.26
61	300550	和仁科技	4,945,367.80	4.24
62	002458	益生股份	4,938,539.90	4.24
63	600862	中航高科	4,932,219.00	4.23
64	600710	苏美达	4,927,976.65	4.23
65	600189	吉林森工	4,900,300.96	4.20
66	600249	两面针	4,784,209.64	4.10
67	603855	华荣股份	4,759,544.86	4.08
68	601058	赛轮轮胎	4,709,923.20	4.04
69	600452	涪陵电力	4,707,362.21	4.04
70	002090	金智科技	4,697,357.59	4.03
71	300401	花园生物	4,686,966.76	4.02
72	600731	湖南海利	4,686,099.05	4.02

73	300014	亿纬锂能	4,676,692.00	4.01
74	300417	南华仪器	4,665,025.00	4.00
75	603496	恒为科技	4,663,036.81	4.00
76	002262	恩华药业	4,660,288.72	4.00
77	603508	思维列控	4,641,580.40	3.98
78	002150	通润装备	4,639,705.19	3.98
79	600455	博通股份	4,634,603.98	3.98
80	002430	杭氧股份	4,624,235.86	3.97
81	002810	山东赫达	4,596,639.68	3.94
82	002454	松芝股份	4,557,363.23	3.91
83	600987	航民股份	4,556,309.05	3.91
84	600727	鲁北化工	4,548,974.05	3.90
85	000415	渤海租赁	4,544,291.00	3.90
86	600229	城市传媒	4,494,470.43	3.85
87	603026	石大胜华	4,483,809.48	3.85
88	601567	三星医疗	4,483,293.01	3.85
89	000655	金岭矿业	4,467,368.00	3.83
90	600794	保税科技	4,449,689.68	3.82
91	300389	艾比森	4,436,187.92	3.80
92	600261	阳光照明	4,427,644.00	3.80
93	002796	世嘉科技	4,400,732.78	3.77
94	600211	西藏药业	4,387,058.71	3.76
95	002712	思美传媒	4,381,119.99	3.76
96	600984	建设机械	4,378,070.10	3.76
97	601168	西部矿业	4,372,602.92	3.75
98	002478	常宝股份	4,369,020.00	3.75
99	000517	荣安地产	4,365,565.86	3.74
100	002884	凌霄泵业	4,356,156.64	3.74
101	002605	姚记科技	4,344,304.00	3.73
102	600598	北大荒	4,335,152.69	3.72
103	002607	中公教育	4,331,998.00	3.72
104	300280	紫天科技	4,323,216.92	3.71
105	600757	长江传媒	4,313,323.08	3.70
106	300481	濮阳惠成	4,305,070.00	3.69
107	601003	柳钢股份	4,298,009.10	3.69
108	300702	天宇股份	4,291,329.84	3.68
109	002803	吉宏股份	4,272,513.00	3.66
110	603585	苏利股份	4,264,884.20	3.66

111	603444	吉比特	4,247,108.00	3.64
112	601218	吉鑫科技	4,246,111.10	3.64
113	300461	田中精机	4,197,316.68	3.60
114	300019	硅宝科技	4,183,440.00	3.59
115	300723	一品红	4,168,206.48	3.58
116	601717	郑煤机	4,152,076.19	3.56
117	000718	苏宁环球	4,146,866.92	3.56
118	600716	凤凰股份	4,141,672.00	3.55
119	300467	迅游科技	4,139,570.00	3.55
120	002591	恒大高新	4,116,389.92	3.53
121	603886	元祖股份	4,115,652.43	3.53
122	300559	佳发教育	4,112,497.67	3.53
123	300283	温州宏丰	4,109,058.19	3.52
124	300660	江苏雷利	4,071,880.76	3.49
125	000923	河钢资源	4,042,211.21	3.47
126	002498	汉缆股份	4,023,211.00	3.45
127	002272	川润股份	4,013,946.08	3.44
128	000779	甘咨询	4,002,559.70	3.43
129	000601	韶能股份	3,998,533.00	3.43
130	002199	东晶电子	3,995,608.67	3.43
131	600366	宁波韵升	3,991,159.60	3.42
132	300192	科斯伍德	3,983,093.68	3.42
133	300082	奥克股份	3,981,056.67	3.41
134	000650	仁和药业	3,967,805.00	3.40
135	300012	华测检测	3,967,084.34	3.40
136	002697	红旗连锁	3,965,248.30	3.40
137	002177	御银股份	3,956,028.00	3.39
138	300131	英唐智控	3,947,532.00	3.39
139	300487	蓝晓科技	3,926,525.00	3.37
140	000951	中国重汽	3,923,517.00	3.37
141	600782	新钢股份	3,914,732.00	3.36
142	002852	道道全	3,909,464.43	3.35
143	600198	大唐电信	3,900,431.36	3.35
144	300034	钢研高纳	3,868,732.00	3.32
145	600097	开创国际	3,861,737.00	3.31
146	600745	闻泰科技	3,840,573.41	3.29
147	603328	依顿电子	3,832,503.65	3.29
148	601599	鹿港文化	3,817,308.12	3.27

149	603160	汇顶科技	3,805,464.88	3.26
150	300189	神农科技	3,789,278.00	3.25
151	600695	绿庭投资	3,782,429.98	3.24
152	600100	同方股份	3,777,700.00	3.24
153	002738	中矿资源	3,775,134.00	3.24
154	000683	远兴能源	3,774,690.01	3.24
155	601888	中国国旅	3,756,358.00	3.22
156	603669	灵康药业	3,755,598.42	3.22
157	603298	杭叉集团	3,754,986.86	3.22
158	000739	普洛药业	3,739,390.00	3.21
159	600287	江苏舜天	3,739,060.51	3.21
160	603089	正裕工业	3,734,574.88	3.20
161	300040	九洲电气	3,733,282.00	3.20
162	300709	精研科技	3,730,342.00	3.20
163	002653	海思科	3,717,867.14	3.19
164	000719	中原传媒	3,704,405.32	3.18
165	002641	永高股份	3,701,842.16	3.18
166	600781	ST 辅仁	3,700,999.00	3.17
167	603871	嘉友国际	3,695,098.32	3.17
168	000790	泰合健康	3,683,298.42	3.16
169	300571	平治信息	3,682,616.65	3.16
170	300033	同花顺	3,680,560.30	3.16
171	300515	三德科技	3,672,547.18	3.15
172	002082	万邦德	3,663,010.00	3.14
173	000425	徐工机械	3,653,807.00	3.13
174	600965	福成股份	3,649,192.20	3.13
175	601100	恒立液压	3,640,588.07	3.12
176	002048	宁波华翔	3,639,395.00	3.12
177	002161	远望谷	3,611,550.00	3.10
178	300114	中航电测	3,602,927.78	3.09
179	300162	雷曼光电	3,602,747.00	3.09
180	300107	建新股份	3,597,905.60	3.09
181	600202	哈空调	3,583,524.00	3.07
182	603688	石英股份	3,569,336.50	3.06
183	600580	卧龙电驱	3,565,358.61	3.06
184	600062	华润双鹤	3,563,644.83	3.06
185	000966	长源电力	3,559,398.00	3.05
186	600070	浙江富润	3,555,113.31	3.05

187	002353	杰瑞股份	3,549,702.87	3.04
188	002399	海普瑞	3,545,880.00	3.04
189	002449	国星光电	3,541,188.00	3.04
190	300219	鸿利智汇	3,535,063.88	3.03
191	601233	桐昆股份	3,533,239.64	3.03
192	600985	淮北矿业	3,525,056.64	3.02
193	002295	精艺股份	3,510,426.08	3.01
194	002416	爱施德	3,509,999.06	3.01
195	300175	朗源股份	3,474,591.00	2.98
196	600319	ST 亚星	3,467,954.54	2.97
197	000822	山东海化	3,465,316.27	2.97
198	000411	英特集团	3,461,069.72	2.97
199	600662	强生控股	3,453,458.72	2.96
200	000973	佛塑科技	3,432,967.00	2.94
201	002655	共达电声	3,429,266.00	2.94
202	600880	博瑞传播	3,428,151.99	2.94
203	603979	金诚信	3,406,705.40	2.92
204	002463	沪电股份	3,382,799.00	2.90
205	600643	爱建集团	3,378,478.72	2.90
206	000528	柳工	3,347,776.05	2.87
207	603968	醋化股份	3,347,040.95	2.87
208	000627	天茂集团	3,334,193.00	2.86
209	600420	现代制药	3,323,644.90	2.85
210	600567	山鹰纸业	3,320,149.00	2.85
211	002203	海亮股份	3,316,987.58	2.84
212	002489	浙江永强	3,312,546.00	2.84
213	000036	华联控股	3,303,767.66	2.83
214	600728	佳都科技	3,302,482.36	2.83
215	600563	法拉电子	3,297,283.20	2.83
216	600995	文山电力	3,293,289.14	2.82
217	603086	先达股份	3,292,923.20	2.82
218	600507	方大特钢	3,273,393.50	2.81
219	300275	梅安森	3,265,205.00	2.80
220	000049	德赛电池	3,255,494.00	2.79
221	002105	信隆健康	3,244,668.00	2.78
222	300058	蓝色光标	3,241,066.00	2.78
223	603313	梦百合	3,238,654.09	2.78
224	603661	恒林股份	3,235,774.09	2.78

225	603099	长白山	3,231,953.11	2.77
226	002189	中光学	3,218,398.00	2.76
227	000789	万年青	3,218,132.00	2.76
228	600387	海越能源	3,216,218.52	2.76
229	300092	科新机电	3,214,889.00	2.76
230	600865	百大集团	3,213,583.96	2.76
231	300233	金城医药	3,208,968.44	2.75
232	600699	均胜电子	3,204,707.21	2.75
233	002452	长高集团	3,195,988.00	2.74
234	300638	广和通	3,186,379.00	2.73
235	000932	华菱钢铁	3,181,955.40	2.73
236	300179	四方达	3,180,808.00	2.73
237	000155	川能动力	3,179,071.65	2.73
238	000717	韶钢松山	3,168,977.11	2.72
239	300031	宝通科技	3,158,054.00	2.71
240	603528	多伦科技	3,151,237.00	2.70
241	600271	航天信息	3,147,387.28	2.70
242	300200	高盟新材	3,141,288.00	2.69
243	002841	视源股份	3,140,137.32	2.69
244	600763	通策医疗	3,134,841.00	2.69
245	300637	扬帆新材	3,128,537.90	2.68
246	300686	智动力	3,120,599.00	2.68
247	000063	中兴通讯	3,120,198.00	2.68
248	002117	东港股份	3,109,320.13	2.67
249	300432	富临精工	3,106,565.20	2.66
250	002087	新野纺织	3,106,179.80	2.66
251	600623	华谊集团	3,106,055.10	2.66
252	688009	中国通号	3,078,603.67	2.64
253	002664	长鹰信质	3,071,673.00	2.63
254	002462	嘉事堂	3,070,446.00	2.63
255	600596	新安股份	3,049,743.00	2.62
256	002909	集泰股份	3,046,859.92	2.61
257	300209	天泽信息	3,046,060.00	2.61
258	002555	三七互娱	3,040,997.00	2.61
259	603801	志邦家居	3,037,467.79	2.61
260	000987	越秀金控	3,036,923.00	2.60
261	603882	金城医学	3,035,470.00	2.60
262	600784	鲁银投资	3,035,052.36	2.60

263	600657	信达地产	3,031,262.00	2.60
264	601601	中国太保	3,029,964.46	2.60
265	600057	厦门象屿	3,018,932.45	2.59
266	000962	东方钨业	3,016,960.07	2.59
267	603800	道森股份	3,002,852.00	2.58
268	000862	银星能源	3,000,041.00	2.57
269	300682	朗新科技	2,989,366.00	2.56
270	600252	中恒集团	2,982,331.50	2.56
271	600117	西宁特钢	2,982,004.78	2.56
272	603538	美诺华	2,980,656.60	2.56
273	002524	光正集团	2,968,522.00	2.55
274	000526	紫光学大	2,966,347.00	2.54
275	300198	纳川股份	2,961,527.00	2.54
276	002394	联发股份	2,945,058.00	2.53
277	600107	美尔雅	2,941,910.00	2.52
278	002084	海鸥住工	2,939,292.20	2.52
279	600737	中粮糖业	2,930,368.00	2.51
280	300106	西部牧业	2,918,285.92	2.50
281	300059	东方财富	2,912,137.00	2.50
282	002846	英联股份	2,911,165.80	2.50
283	002318	久立特材	2,902,017.60	2.49
284	600793	宜宾纸业	2,896,881.92	2.48
285	002321	华英农业	2,895,087.00	2.48
286	300236	上海新阳	2,886,514.67	2.48
287	002052	同洲电子	2,880,054.00	2.47
288	000630	铜陵有色	2,879,497.20	2.47
289	000733	振华科技	2,873,842.00	2.46
290	300074	华平股份	2,873,402.00	2.46
291	300580	贝斯特	2,866,919.44	2.46
292	002626	金达威	2,866,043.00	2.46
293	601900	南方传媒	2,864,182.00	2.46
294	600136	当代明诚	2,856,204.00	2.45
295	002666	德联集团	2,854,735.00	2.45
296	600510	黑牡丹	2,850,544.00	2.44
297	600581	八一钢铁	2,850,118.00	2.44
298	000676	智度股份	2,849,084.58	2.44
299	600166	福田汽车	2,843,298.00	2.44
300	601002	晋亿实业	2,839,993.00	2.44

301	603776	永安行	2,831,774.60	2.43
302	002014	永新股份	2,831,751.00	2.43
303	603699	纽威股份	2,830,556.00	2.43
304	002020	京新药业	2,827,513.01	2.43
305	600082	海泰发展	2,822,315.05	2.42
306	300253	卫宁健康	2,821,403.24	2.42
307	002326	永太科技	2,820,945.31	2.42
308	300443	金雷股份	2,819,474.00	2.42
309	601616	广电电气	2,814,713.44	2.41
310	600259	广晟有色	2,814,469.00	2.41
311	000005	世纪星源	2,813,876.00	2.41
312	600405	动力源	2,809,195.40	2.41
313	002511	中顺洁柔	2,807,998.72	2.41
314	000042	中洲控股	2,805,593.36	2.41
315	600792	云煤能源	2,801,383.00	2.40
316	300384	三联虹普	2,800,200.00	2.40
317	002851	麦格米特	2,797,858.69	2.40
318	600395	盘江股份	2,786,119.99	2.39
319	300353	东土科技	2,785,747.00	2.39
320	600826	兰生股份	2,778,887.52	2.38
321	300130	新国都	2,777,994.00	2.38
322	600050	中国联通	2,759,220.00	2.37
323	002571	德力股份	2,755,464.65	2.36
324	002367	康力电梯	2,752,587.00	2.36
325	300291	华录百纳	2,752,361.00	2.36
326	600609	金杯汽车	2,750,689.19	2.36
327	300572	安车检测	2,742,670.00	2.35
328	002782	可立克	2,741,687.50	2.35
329	600760	中航沈飞	2,741,165.00	2.35
330	002112	三变科技	2,736,937.00	2.35
331	600490	鹏欣资源	2,736,814.00	2.35
332	603118	共进股份	2,735,804.80	2.35
333	603711	香飘飘	2,735,293.00	2.35
334	603966	法兰泰克	2,719,130.44	2.33
335	002246	北化股份	2,718,175.00	2.33
336	600269	赣粤高速	2,717,003.59	2.33
337	002146	荣盛发展	2,716,275.30	2.33
338	300394	天孚通信	2,713,380.08	2.33

339	002698	博实股份	2,713,023.30	2.33
340	600768	宁波富邦	2,709,862.59	2.32
341	601968	宝钢包装	2,705,609.00	2.32
342	002731	萃华珠宝	2,702,177.80	2.32
343	300554	三超新材	2,699,111.60	2.32
344	601908	京运通	2,695,951.00	2.31
345	300345	红宇新材	2,691,666.00	2.31
346	000543	皖能电力	2,687,874.00	2.31
347	000999	华润三九	2,687,305.08	2.30
348	600255	梦舟股份	2,687,213.98	2.30
349	600582	天地科技	2,685,591.37	2.30
350	600467	好当家	2,682,824.00	2.30
351	002423	中粮资本	2,680,096.39	2.30
352	600257	大湖股份	2,678,828.00	2.30
353	002732	燕塘乳业	2,678,653.00	2.30
354	300155	安居宝	2,676,941.80	2.30
355	603598	引力传媒	2,668,926.00	2.29
356	600063	皖维高新	2,659,333.00	2.28
357	600250	南纺股份	2,654,584.88	2.28
358	601607	上海医药	2,650,785.00	2.27
359	600888	新疆众和	2,642,235.90	2.27
360	600327	大东方	2,640,935.79	2.27
361	000731	四川美丰	2,639,026.00	2.26
362	603586	金麒麟	2,638,077.00	2.26
363	002300	太阳电缆	2,634,663.00	2.26
364	601118	海南橡胶	2,634,203.81	2.26
365	000930	中粮科技	2,628,614.96	2.25
366	603988	中电电机	2,621,833.65	2.25
367	000890	法尔胜	2,615,288.00	2.24
368	600828	茂业商业	2,614,221.72	2.24
369	002435	长江健康	2,611,652.90	2.24
370	002094	青岛金王	2,608,643.68	2.24
371	300259	新天科技	2,595,478.00	2.23
372	000695	滨海能源	2,586,786.44	2.22
373	002350	北京科锐	2,583,677.98	2.22
374	000576	广东甘化	2,575,009.52	2.21
375	000099	中信海直	2,574,287.00	2.21
376	300157	恒泰艾普	2,572,694.11	2.21

377	001696	宗申动力	2,568,032.34	2.20
378	002456	欧菲光	2,566,786.46	2.20
379	603859	能科股份	2,559,206.51	2.20
380	000811	冰轮环境	2,556,474.95	2.19
381	603045	福达合金	2,554,912.60	2.19
382	600481	双良节能	2,547,045.00	2.18
383	601019	山东出版	2,545,049.51	2.18
384	002749	国光股份	2,542,417.08	2.18
385	300132	青松股份	2,518,246.00	2.16
386	600020	中原高速	2,507,763.00	2.15
387	600486	扬农化工	2,499,244.00	2.14
388	002341	新纶科技	2,494,724.00	2.14
389	002637	赞宇科技	2,494,067.87	2.14
390	002406	远东传动	2,492,550.00	2.14
391	000616	海航投资	2,492,100.71	2.14
392	000850	华茂股份	2,491,471.93	2.14
393	300025	华星创业	2,487,759.00	2.13
394	600351	亚宝药业	2,484,593.12	2.13
395	600182	S 佳通	2,480,168.99	2.13
396	600790	轻纺城	2,478,433.40	2.13
397	300390	天华超净	2,474,812.20	2.12
398	002402	和而泰	2,473,604.00	2.12
399	000965	天保基建	2,472,073.78	2.12
400	300690	双一科技	2,461,253.00	2.11
401	000759	中百集团	2,457,099.89	2.11
402	300719	安达维尔	2,456,049.50	2.11
403	600765	中航重机	2,449,540.87	2.10
404	002346	柘中股份	2,441,688.00	2.09
405	600829	人民同泰	2,440,784.83	2.09
406	601828	美凯龙	2,440,026.43	2.09
407	002540	亚太科技	2,438,728.00	2.09
408	002832	比音勒芬	2,426,659.25	2.08
409	600068	葛洲坝	2,423,382.00	2.08
410	300446	乐凯新材	2,387,974.00	2.05
411	600051	宁波联合	2,355,484.00	2.02
412	300586	美联新材	2,343,005.00	2.01
413	002011	盾安环境	2,341,882.00	2.01
414	002746	仙坛股份	2,341,313.80	2.01

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,376,697,200.43
卖出股票收入（成交）总额	2,338,602,298.65

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,002,400.00	1.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,002,400.00	1.67

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	40,000	4,002,400.00	1.67

注：本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC2001	IC2001	3	3,160,080.00	25,650.00	本基金利用股指期货进行多头套保,是为了应对由于基金的大额赎回而带来的对基金净值的影响。
公允价值变动总额合计（元）					25,650.00
股指期货投资本期收益（元）					560,533.98
股指期货投资本期公允价值变动（元）					25,650.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内,本基金按照基金合同约定进行股指期货投资,少量参与股指期货交易,主要是用来调节组合头寸。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。报告期内,本基金未参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中,未发生超出基金合同规定的备选股票库的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	590,985.25
2	应收证券清算款	1,744,882.26
3	应收股利	-
4	应收利息	94,557.15
5	应收申购款	224.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,430,649.34

8.12.4 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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
287	758,672.60	213,746,659.00	98.17%	3,992,378.08	1.83%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	106,003.96	0.0487%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年1月20日）基金份额总额	200,072,685.24
本报告期期初基金份额总额	152,601,039.21
本报告期基金总申购份额	72,989,074.73
减:本报告期基金总赎回份额	7,851,076.86
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	217,739,037.08

注：基金总申购份额包含红利再投资和转换入份额，基金总赎回份额包含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期基金管理人无重大人事变动。
- 2、本报告期基金托管人专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元。截至本报告期末，该会计师事务所已向本基金提供三年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2019 年 12 月，基金管理人因租用办公场所未取得营业执照变更登记，受到北京市朝阳区市场监督管理局 1 万元人民币的行政罚款，公司已按期缴纳罚款并在进行相应整改。本报告期内，基金管理人的高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
中国国际金 融公司	2	2,248,235,177.23	47.85%	1,194,483.47	50.08%	-
海通证券	2	1,583,549,506.42	33.70%	816,831.45	34.25%	-

东莞证券	2	866,656,251.44	18.45%	373,809.28	15.67%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 券商经纪人经营行为规范、风险管理健全，在业内有较好的声誉；
- (2) 具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 券商经纪人具有较强的研究支持能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告。

2、本公司租用券商交易单元的程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单经公募基金业务投资决策委员会审批，同意后与被选择的证券经营机构签订相关协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订协议时，要明确签定协议双方的公司名称、协议有效期、佣金率、双方的权利义务等。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：新增东莞证券股份有限公司 2 个交易单元；
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融公司	275,122.36	6.39%	2,400,000.00	100.00%	-	-
海通证券	4,027,162.70	93.61%	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证监会规定报刊和公司网站	2019 年 1 月 21 日
2	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构并参与其申购费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和公司网站	2019 年 3 月 5 日
3	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	公司网站	2019 年 3 月 6 日
4	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要	证监会规定报刊和公司网站	2019 年 3 月 6 日
5	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告	公司网站	2019 年 3 月 28 日
6	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	证监会规定报刊和公司网站	2019 年 3 月 28 日
7	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构并参与其申购费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和公司网站	2019 年 4 月 2 日
8	九泰基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	证监会规定报刊和公司网站	2019 年 4 月 17 日
9	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证监会规定报刊和公司网站	2019 年 4 月 20 日
10	九泰基金管理有限公司关于注册资本变更的公告	证监会规定报刊和公司网站	2019 年 6 月 6 日
11	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相	证监会规定报刊和公司网站	2019 年 6 月 21 日

	关风险揭示的公告		
12	九泰基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份信息的公告	证监会规定报刊和公司网站	2019年6月27日
13	九泰基金2019年06月30日基金资产净值公告	公司网站	2019年6月30日
14	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证监会规定报刊和公司网站	2019年7月2日
15	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证监会规定报刊和公司网站	2019年7月5日
16	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证监会规定报刊和公司网站	2019年7月17日
17	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金2019年第2季度报告	证监会规定报刊和公司网站	2019年7月17日
18	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	证监会规定报刊和公司网站	2019年8月15日
19	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告	公司网站	2019年8月23日
20	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告摘要	证监会规定报刊和公司网站	2019年8月23日
21	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	规定网站	2019年9月4日
22	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要	证监会规定报刊和规定网站	2019年9月4日
23	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金分红公告	证监会规定报刊和规定网站	2019年10月15日
24	九泰基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和	2019年10月16日

	基金增加销售机构的公告	规定网站	
25	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	规定网站	2019 年 10 月 22 日
26	九泰基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定报刊	2019 年 10 月 22 日
27	九泰基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告	证监会规定报刊和规定网站	2019 年 12 月 18 日
28	关于九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	证监会规定报刊和规定网站	2019 年 12 月 27 日
29	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	规定网站	2019 年 12 月 27 日
30	九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要	证监会规定报刊和规定网站	2019 年 12 月 27 日
31	九泰基金管理有限公司关于提请投资者及时更新相关信息的公告	证监会规定报刊和规定网站	2019 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190102 至 20191231	152,299,000.00	0.00	0.00	152,299,000.00	69.95%
	2	20190707 至 20191231	0.00	47,851,366.52	0.00	47,851,366.52	21.98%

产品特有风险

1、净值大幅波动的风险

由于本基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此当投资者大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。

2、出现巨额赎回的风险

该机构投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。在单个基金份额持有人的赎回申请超过基金总份额 50%以上的情形下，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期办理。其他中小投资者的小额赎回申请也可能面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。

3、基金规模过小导致基金合同终止的风险

根据基金合同的约定，基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，本基金合同终止，无须召开基金份额持有人大会。机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金份额持有人数量连续 60 个工作日不满 200 人或本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5,000 万元情形，届时本基金存在基金合同终止的风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经九泰基金管理有限公司 2019 年第一次股东会审议通过，基金管理人股东按现有股权比例向公司同比例增资人民币 1 亿元，增资完成后，公司注册资本由人民币 2 亿元增加至人民币 3 亿元，股东及股东出资比例均保持不变，已于 2019 年 5 月 31 日完成工商变更登记。

2019 年 10 月 15 日,九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金就 2019 年度第一次分红事项进行公告,每 10 份基金份额分红 0.530 元,于 10 月 18 日发放红利。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 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。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，网址为 www.jtamc.com

九泰基金管理有限公司

2020 年 4 月 20 日