

# 九泰天利量化股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 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。本中期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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注 .....	23
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
7.3 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 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
7.6 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 .....	50
7.7 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 .....	50
7.8 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 .....	50
7.9 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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
8.3 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 .....	52
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
10.2 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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</b>
11.1 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 .....	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	九泰天利量化股票型证券投资基金	
基金简称	九泰天利量化	
基金主代码	011589	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 10 月 12 日	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,483,823.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C
下属分级基金的交易代码:	011589	011590
报告期末下属分级基金的份额总额	3,479,337.01 份	2,004,486.62 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用量化多策略模型，寻找具备长期投资价值的优秀企业，同时有效控制组合风险，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金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以及对资本市场趋势的判断，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长期回报。</p> <p>本基金采用量化多策略进行股票投资。量化多策略体系的理念主要有两个：一方面寻找长期具备投资价值的优质企业，获取超越指数的收益；另一方面使用多个策略并依照当时市场情况进行轮动，在一定程度上可以分散风险。</p> <p>本基金投资策略还包括债券投资策略、股指期货投资策略等。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，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、混合型基金。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛
	联系电话	010-57383999
	电子邮箱	chenpei@jtamc.com
客户服务电话	400-628-0606	95511-3
传真	010-57383867	0755-82080387
注册地址	北京市丰台区丽泽路 18 号	广东省深圳市罗湖区深南东路

	院 1 号楼 801-16 室	5047 号
办公地址	北京市朝阳区安立路 30 号 仰山公园 2 号楼 1 栋西侧一 层、二层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	100020	518001
法定代表人	严军	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	<a href="http://www.jtamc.com">http://www.jtamc.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所或办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 2 号楼 1 栋西侧一层、二层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-1,758,981.25	1,009,570.14
本期利润	69,872.75	1,575,505.75
加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.0496
本期加权平均净值利润率	1.12%	5.81%
本期基金份额净值增长率	-0.23%	-0.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	-1,223,830.09	-715,714.85
期末可供分配基金份额利润	-0.3517	-0.3571
期末基金资产净值	2,813,370.82	1,607,202.98
期末基金份额净值	0.8086	0.8018
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-19.14%	-19.82%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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2023年6月30日。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

九泰天利量化 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.43%	0.91%	-0.77%	0.89%	-0.66%	0.02%
过去三个月	-4.31%	0.77%	-5.10%	0.78%	0.79%	-0.01%
过去六个月	-0.23%	0.83%	2.20%	0.75%	-2.43%	0.08%
过去一年	-10.27%	1.05%	-6.65%	0.91%	-3.62%	0.14%



自基金合同生效起至今	-19.14%	1.16%	-14.54%	1.10%	-4.60%	0.06%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

## 九泰天利量化 C

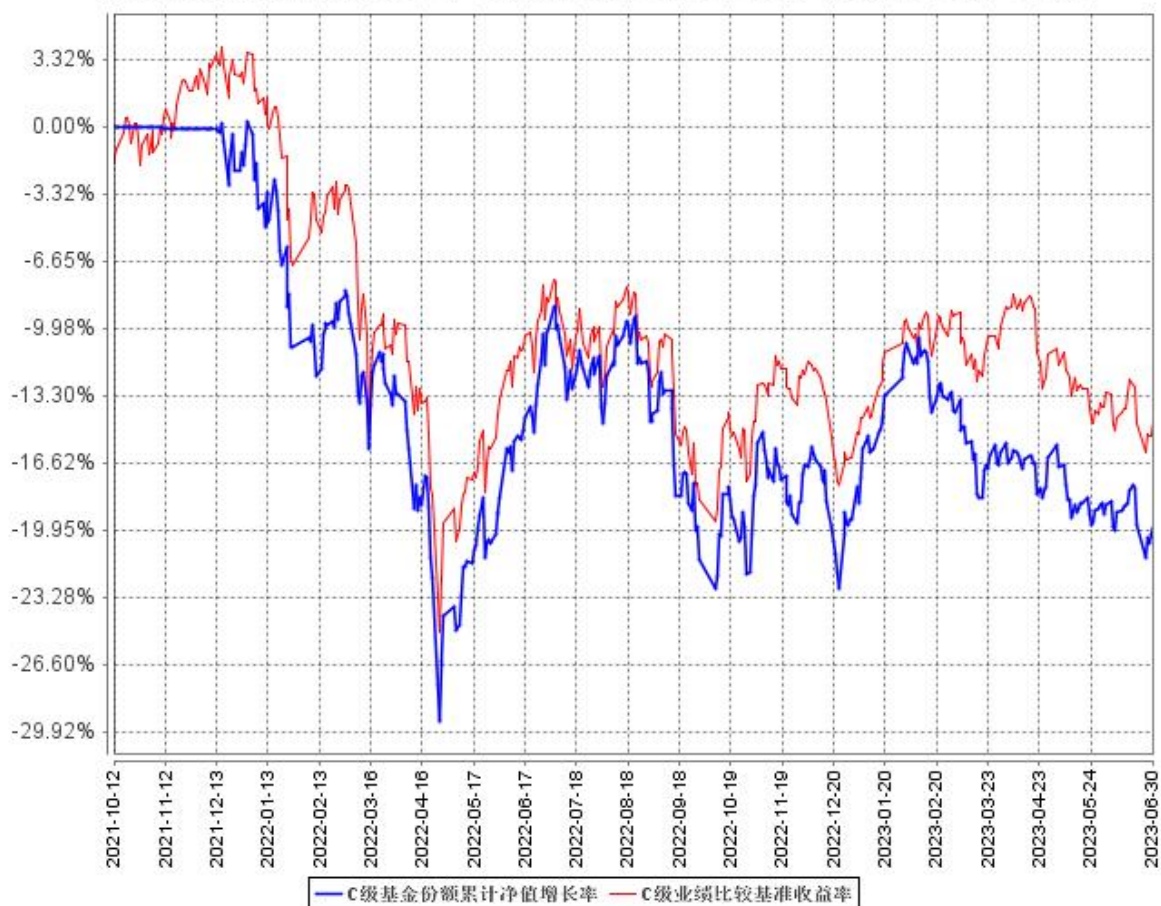
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.46%	0.91%	-0.77%	0.89%	-0.69%	0.02%
过去三个月	-4.42%	0.77%	-5.10%	0.78%	0.68%	-0.01%
过去六个月	-0.47%	0.83%	2.20%	0.75%	-2.67%	0.08%
过去一年	-10.70%	1.05%	-6.65%	0.91%	-4.05%	0.14%
自基金合同生效起至今	-19.82%	1.16%	-14.54%	1.10%	-5.28%	0.06%

### 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

A级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



C级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 2021 年 10 月 12 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. 根据基金合同的约定，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约定。

## § 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，注册地位于北京市，目前设立有上海分公司及深圳分公司。

公司优先发展公募基金业务，创新拓展私募资产管理业务，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，发展特色产品线，打造差异化的竞争优势。公司秉承长期投资、价值投资的经营理念，建立有效的公司治理和激励约束机制。

公司旗下拥有较为完整的公募基金产品线，覆盖股票型、混合型、货币型等产品类别，以定开式、开放式、上市LOF等不同模式运作，有效满足广大投资者不同的投资理财需求。

#### 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		
赵睿	基金经理	2023年4月12日	-	10	数学硕士，10年证券从业经验，曾任上海桐昇通惠资产管理有限公司高级研究员。2016年4月加入九泰基金管理有限公司，曾任玖方量化投资部资深研究员、投资经理，现任玖方量化投资部基金经理，具有基金从业资格。
杨飞	基金经理	2021年12月2日	2023年4月13日	7	金融学硕士，7年证券从业经历。历任思高方达基金服务（加拿大）基金分析部总监、汇丰银行投资银行部副总经理、桐湾投资管理咨询（上海）有限公司量化投研部投资总监、联储证券有限责任公司资产管理部投资总监、大同证券上海资产管理分公司副总经理兼投资总监。2021年10月加入九泰基金管理有限公司，曾任九

					章量化投资部总经理、基金经理，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--------------------------

注：

- 1、证券从业的含义遵从监管部门和行业协会的相关规定。
- 2、基金经理的“任职日期”为基金合同生效日或公司相关公告中披露的聘任日期，“离任日期”为公司相关公告中披露的解聘日期。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金未发生基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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）的半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。

##### 4.3.2 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。

## 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

2023 年上半年各主流宽基指数先涨后跌，2023 年一季度，伴随疫情管控措施的优化，市场情绪乐观，对经济复苏期望较高，但是随后的高频经济数据恢复速度不及市场预期，市场出现调整。本基金采用量化模型进行投资操作，2023 年上半年小幅跑输本基金基准中证 500 指数。本基金采用两类量化模型进行投资操作：行业轮动模型、多因子选股模型。在报告期内，行业轮动模型出现调整，上半年行业间轮动较快，缺乏热点行业，本基金采用的行业模型中价格动量和基本面动量因子出现回撤；多因子选股策略在报告期内表现稳定，基本面动量、价值因子表现较强，这是因为经济弱复苏背景下投资者对企业基本面的安全边际更为关注。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末九泰天利量化 A 基金份额净值为 0.8086 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.23%；截至本报告期末九泰天利量化 C 基金份额净值为 0.8018 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.47%；同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年的经济复苏力度略低于市场预期，显示出经济复苏是相对漫长的过程，但从各类经济高频数据来看，经济确实处于复苏过程中。自疫情管控放松以来，经济领域利好政策频出，下半年随着各项经济政策的落地，经济复苏的趋势或将持续，上市公司的基本面有望得到改善；流动性上来说，2023 年下半年，伴随全球主流经济体加息步入尾声，2023 年下半年全球资本市场流动性有望提升，这也有利于 A 股市场流动性修复。具体到行业来看，消费和地产相关行业是当前稳经济的重要抓手，而人工智能可能会为经济增长带来新动能，这些行业在 2023 年下半年可能存在投资机会。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

平、合理。

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规、基金合同及基金的实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金出现超过连续 60 个工作日（2023 年 3 月 24 日-2023 年 6 月 30 日）基金资产净值低于

5000 万元的情形，已向中国证监会报告并提出解决方案；未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：九泰天利量化股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	895,617.10	1,518,062.65
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,594,487.00	57,311,966.31
其中：股票投资		3,594,487.00	53,945,274.67
基金投资		-	-
债券投资		-	3,366,691.64
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,490.26	232.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,496,594.36	58,830,261.60
<b>负债和净资产</b>			
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,698.96	75,495.76
应付托管费		646.62	5,033.03
应付销售服务费		1,148.21	22,389.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	64,526.77	130,000.00
负债合计		76,020.56	232,918.38
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	5,483,823.63	72,692,843.90
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-1,063,249.83	-14,095,500.68
净资产合计		4,420,573.80	58,597,343.22
负债和净资产总计		4,496,594.36	58,830,261.60

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，九泰天利量化 A 份额净值为人民币 0.8086 元，九泰天利量化 C 份额净值为人民币 0.8018 元；基金份额总额为 5,483,823.63 份，九泰天利量化 A 份额 3,479,337.01 份，九泰天利量化 C 份额 2,004,486.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：九泰天利量化股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,042,111.87	-1,326,494.61
1.利息收入		3,199.65	66,301.96
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,199.65	15,369.33
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	50,932.63
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-358,397.97	-4,447,300.14
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-430,427.44	-4,892,633.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	12,994.98	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	59,034.49	445,333.62
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,394,789.61	3,052,617.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	2,520.58	1,886.45
<b>减：二、营业总支出</b>		396,733.37	588,640.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	248,420.73	387,955.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,561.38	25,863.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	67,284.49	110,354.91
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	64,466.77	64,466.77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,645,378.50	-1,915,135.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,645,378.50	-1,915,135.55
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,645,378.50	-1,915,135.55

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：九泰天利量化股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末 净资产（基金 净值）	72,692,843.90	-	-14,095,500.68	58,597,343.22
加：会计政策 变更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初 净资产（基金 净值）	72,692,843.90	-	-14,095,500.68	58,597,343.22
三、本期增减 变动额（减少 以“-”号填列）	-67,209,020.27	-	13,032,250.85	-54,176,769.42
（一）、综合 收益总额	-	-	1,645,378.50	1,645,378.50
（二）、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）	-67,209,020.27	-	11,386,872.35	-55,822,147.92
其中：1.基金 申购款	177,075.97	-	-28,029.41	149,046.56
2.基金赎回款	-67,386,096.24	-	11,414,901.76	-55,971,194.48
（三）、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）				
（四）、其他 综合收益结 转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末 净资产（基金 净值）	5,483,823.63	-	-1,063,249.83	4,420,573.80
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末 净资产（基金 净值）	54,927,816.88	-	137,980.00	55,065,796.88
加：会计政策 变更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初 净资产（基金 净值）	54,927,816.88	-	137,980.00	55,065,796.88
三、本期增减 变动额（减少 以“-”号填列）	18,459,540.66	-	-7,605,135.13	10,854,405.53
（一）、综合	-	-	-1,915,135.55	-1,915,135.55

收益总额				
(二)、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)	18,459,540.66	-	-5,689,999.58	12,769,541.08
其中：1.基金申购款	20,582,066.26	-	-5,867,146.91	14,714,919.35
2.基金赎回款	-2,122,525.60	-	177,147.33	-1,945,378.27
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	73,387,357.54	-	-7,467,155.13	65,920,202.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
严军

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
荣静

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
荣静

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

九泰天利量化股票型证券投资基金(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[2021]第 42 号文准予募集注册并公开发售,由基金管理人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《九泰天利量化股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起,于 2021 年 7 月 5 日起至 2021 年 9 月 30 日止向社会公开募集。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。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 236,725,377.53 元(其中,A 类基金份额净认购金额为人民币 12,221,809.04 元,折合 12,221,809.04 份基金份额;C 类基金份额净认购金额为人民币 224,503,568.49 元,折合 224,503,568.49 份基金份额),在募集期间产生的利息为人民币 85,669.08 元(其中,A 类基金份额产生的利息为人民币 5,151.17 元,C 类基金份额产生的利息为人民币 80,517.91 元),以上实收基金(本息)合计为人民币 236,811,046.61 元,折合 236,811,046.61 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,并出具了编号为[2021]京会兴验字第 69000009 号验资报告。经向中国证监会备案,基金合同于 2021 年 10 月 12 日正式生效。本基金的基金管理人为九泰基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰天利量化股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市交易的股票(包含主板、中小板、创业板股票及其他中国证监会核准或注册发行的股票)、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、短期融资券、超短期融资券、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)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、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为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会

计准则” ) 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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; 2018年1月1日起, 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，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	439,963.21
等于：本金	439,862.19
加：应计利息	101.02
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	455,653.89
等于：本金	455,608.49
加：应计利息	45.40
减：坏账准备	-
合计：	895,617.10

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,672,837.71	-	3,594,487.00	-78,350.71
贵金属投资- 金交所黄金合 约	-	-	-	-
债 券	交易所 市场	-	-	-
	银行间 市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,672,837.71	-	3,594,487.00	-78,350.71

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.5 债权投资**

无。

**6.4.7.6 其他债权投资**

无。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

无。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
其他	60.00
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	39,671.58
合计	64,526.77

注：其他为已收到但尚未确认的股票分红。

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

九泰天利量化 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,969,081.51	7,969,081.51

本期申购	70,618.84	70,618.84
本期赎回(以“-”号填列)	-4,560,363.34	-4,560,363.34
- 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	3,479,337.01	3,479,337.01

金额单位：人民币元

九泰天利量化 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,723,762.39	64,723,762.39
本期申购	106,457.13	106,457.13
本期赎回(以“-”号填列)	-62,825,732.90	-62,825,732.90
- 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	2,004,486.62	2,004,486.62

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

九泰天利量化 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-908,571.48	-601,769.23	-1,510,340.71
本期利润	-1,758,981.25	1,828,854.00	69,872.75
本期基金份额交易产生的变动数	1,443,722.64	-669,220.87	774,501.77
其中：基金申购款	-18,548.83	6,400.48	-12,148.35
基金赎回款	1,462,271.47	-675,621.35	786,650.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,223,830.09	557,863.90	-665,966.19

单位：人民币元

九泰天利量化 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,708,798.99	-4,876,360.98	-12,585,159.97
本期利润	1,009,570.14	565,935.61	1,575,505.75
本期基金份额交易产生的变动数	5,983,514.00	4,628,856.58	10,612,370.58
其中：基金申购款	-17,866.93	1,985.87	-15,881.06
基金赎回款	6,001,380.93	4,626,870.71	10,628,251.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-715,714.85	318,431.21	-397,283.64

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,211.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	988.35
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	3,199.65

### 6.4.7.14 股票投资收益

#### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	146,114,465.80
减：卖出股票成本总额	146,301,971.50
减：交易费用	242,921.74
买卖股票差价收入	-430,427.44

**6.4.7.15 债券投资收益****6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	14,742.21
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,747.23
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,994.98

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,930,523.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,800,695.00
减：应计利息总额	131,433.15
减：交易费用	142.23
买卖债券差价收入	-1,747.23

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	59,034.49
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	59,034.49

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,394,789.61
——股票投资	2,394,594.61
——债券投资	195.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
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	2,394,789.61

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,520.58
合计	2,520.58

**6.4.7.22 信用减值损失**

无。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	64,466.77

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 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。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。



**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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
平安银行股份有限公司	基金托管人

**6.4.10 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。

**6.4.10.1 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的交易。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	248,420.73	387,955.53
其中：支付销售机构的客户维护费	13,901.11	16,807.64

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，由基金托管人复核后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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,561.38	25,863.73

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支取，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。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	58,232.01	58,232.01
合计	-	58,232.01	58,232.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	99,580.21	99,580.21
合计	-	99,580.21	99,580.21

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给本基金登记机构，并由登记机构代为支付给 C 类基金份额销售机构。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 个工作日或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### **6.4.10.3 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。

#### **6.4.10.4 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**

##### **6.4.10.4.1 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。

##### **6.4.10.4.2 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的情况。

#### **6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

##### **6.4.10.5.1 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。

##### **6.4.10.5.2 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**

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	439,963.21	2,211.30	1,058,638.08	2,169.56

注：本基金的上述银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.7 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.8 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。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	300	1,974.01	2,091.00	-

### 6.4.12.3 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。

### 6.4.12.4 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。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，一般情况下其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金的投资范围主要包括股票、债券、股指期货等。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。

### 6.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人在商业银行开立的托管账户，投资其他银行存款由基金管理人根据投资制度审慎选择存款银行，与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主要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。

#### **6.4.13.2.1 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，本基金未持有短期信用评级的债券（不含国债、政策性金融债、央行票据和同业存单）。

#### **6.4.13.2.2 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，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 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，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

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

#### **6.4.13.2.5 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，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 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，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 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 6.4.12 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。

#### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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、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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30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	895,617.10	-	-	-	-	-	895,617.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,594,487.00	3,594,487.00
应收申购款	-	-	-	-	-	6,490.26	6,490.26
资产总计	895,617.10	-	-	-	-	3,600,977.26	4,496,594.36
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,698.96	9,698.96
应付托管费	-	-	-	-	-	646.62	646.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,148.21	1,148.21
其他负债	-	-	-	-	-	64,526.77	64,526.77
负债总计	-	-	-	-	-	76,020.56	76,020.56
利率敏感度缺口	895,617.10	-	-	-	-	3,524,956.70	4,420,573.80
上年度末 2022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	1,518,062.65	-	-	-	-	-	1,518,062.65
交易性金融资产	3,366,691.64	-	-	-	-	53,945,274.67	57,311,966.31
应收申购款	-	-	-	-	-	232.64	232.64
资产总计	4,884,754.29	-	-	-	-	53,945,507.31	58,830,261.60
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	75,495.76	75,495.76
应付托管费	-	-	-	-	-	5,033.03	5,033.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,389.59	22,389.59
其他负债	-	-	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	232,918.38	232,918.38



利率敏感度缺口	4,884,754.29	-	-	-	-53,712,588.93	58,597,343.22
---------	--------------	---	---	---	----------------	---------------

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量不变		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率下降25个基点	0.00	323.23
市场利率上升25个基点	0.00	-323.17	

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	3,594,487.00	81.31	53,945,274.67	92.06
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	3,366,691.64	5.75
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	3,594,487.00	81.31	57,311,966.31	97.81

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。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	162,211.46	1,664,138.25
	沪深 300 指数下跌 5%	-162,211.46	-1,664,138.25

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

**6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具****6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3,592,396.00	53,945,274.67
第二层次	2,091.00	3,366,691.64
第三层次	-	-
合计	3,594,487.00	57,311,966.31

**6.4.14.2.2 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。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产、各类应付款项及卖出回购金融资产款，其账面价值接近于公允价值。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	3,594,487.00	79.94
	其中：股票	3,594,487.00	79.94
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	-	-
	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	895,617.10	19.92
8	其他各项资产	6,490.26	0.14
9	合计	4,496,594.36	100.00

注：银行存款中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	15,320.00	0.35
B	采矿业	5,575.00	0.13
C	制造业	1,988,556.00	44.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	199,724.00	4.52
E	建筑业	26,286.00	0.59
F	批发和零售业	114,951.00	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	112,871.00	2.55
H	住宿和餐饮业	67,744.00	1.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	506,112.00	11.45
J	金融业	382,621.00	8.66
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	174,727.00	3.95
S	综合	-	-
	合计	3,594,487.00	81.31

### 7.2.2 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股票。

### 7.3 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	002926	华西证券	15,700	130,467.00	2.95
2	002373	千方科技	9,300	126,852.00	2.87
3	600066	宇通客车	7,300	107,602.00	2.43
4	600050	中国联通	20,900	100,320.00	2.27
5	601236	红塔证券	12,800	95,360.00	2.16
6	002422	科伦药业	3,200	94,976.00	2.15
7	603027	千禾味业	4,300	90,816.00	2.05
8	300433	蓝思科技	7,400	87,024.00	1.97
9	000338	潍柴动力	6,900	85,974.00	1.94
10	002737	葵花药业	3,500	85,190.00	1.93
11	603369	今世缘	1,500	79,200.00	1.79
12	002518	科士达	1,900	76,019.00	1.72
13	600011	华能国际	7,800	72,228.00	1.63
14	300144	宋城演艺	5,600	69,440.00	1.57
15	600754	锦江酒店	1,600	67,744.00	1.53
16	601766	中国中车	9,900	64,350.00	1.46
17	300146	汤臣倍健	2,600	62,348.00	1.41
18	600060	海信视像	2,300	56,925.00	1.29
19	000768	中航西飞	2,000	53,500.00	1.21
20	002625	光启技术	3,400	51,884.00	1.17
21	601728	中国电信	9,100	51,233.00	1.16

22	300133	华策影视	7,100	50,339.00	1.14
23	600312	平高电气	4,000	49,560.00	1.12
24	000596	古井贡酒	200	49,476.00	1.12
25	600329	达仁堂	1,100	49,379.00	1.12
26	002600	领益智造	7,100	49,061.00	1.11
27	600637	东方明珠	6,200	48,484.00	1.10
28	603317	天味食品	3,300	48,213.00	1.09
29	600026	中远海能	3,700	46,768.00	1.06
30	600674	川投能源	3,100	46,655.00	1.06
31	600933	爱柯迪	1,900	44,251.00	1.00
32	603719	良品铺子	1,700	42,517.00	0.96
33	000729	燕京啤酒	3,300	41,151.00	0.93
34	600528	中铁工业	4,100	40,508.00	0.92
35	600418	江淮汽车	3,200	40,288.00	0.91
36	002739	万达电影	3,200	40,128.00	0.91
37	601333	广深铁路	9,900	39,204.00	0.89
38	000921	海信家电	1,400	37,730.00	0.85
39	300114	中航电测	700	34,405.00	0.78
40	600909	华安证券	7,300	34,091.00	0.77
41	600633	浙数文化	2,000	32,420.00	0.73
42	000027	深圳能源	4,800	31,632.00	0.72
43	600166	福田汽车	9,100	30,940.00	0.70
44	002939	长城证券	3,800	30,894.00	0.70
45	600562	国睿科技	1,800	29,160.00	0.66
46	300316	晶盛机电	400	28,360.00	0.64
47	002158	汉钟精机	1,100	27,456.00	0.62
48	600570	恒生电子	600	26,574.00	0.60
49	300136	信维通信	1,300	26,104.00	0.59
50	601567	三星医疗	2,000	25,260.00	0.57
51	600717	天津港	5,600	24,808.00	0.56
52	002531	天顺风能	1,600	24,368.00	0.55
53	600886	国投电力	1,900	24,035.00	0.54
54	600864	哈投股份	4,700	24,017.00	0.54
55	002236	大华股份	1,200	23,700.00	0.54
56	300212	易华录	700	23,261.00	0.53
57	603927	中科软	600	23,136.00	0.52
58	002603	以岭药业	900	23,121.00	0.52
59	000617	中油资本	3,000	21,690.00	0.49
60	002434	万里扬	2,400	21,480.00	0.49

60	601519	大智慧	3,000	21,480.00	0.49
61	002011	盾安环境	1,500	20,745.00	0.47
62	603032	德新科技	600	20,724.00	0.47
63	000829	天音控股	2,200	19,888.00	0.45
64	002429	兆驰股份	3,600	19,800.00	0.45
65	300002	神州泰岳	1,400	19,600.00	0.44
66	600161	天坛生物	700	19,005.00	0.43
67	600850	电科数字	800	18,872.00	0.43
68	600498	烽火通信	900	18,333.00	0.41
69	000063	中兴通讯	400	18,216.00	0.41
70	600728	佳都科技	2,600	18,018.00	0.41
71	600578	京能电力	4,600	17,986.00	0.41
72	601933	永辉超市	5,600	17,528.00	0.40
73	601908	京运通	2,800	16,940.00	0.38
74	601618	中国中冶	4,200	16,674.00	0.38
75	300672	国科微	200	16,670.00	0.38
76	002299	圣农发展	800	15,320.00	0.35
77	601928	凤凰传媒	1,300	14,820.00	0.34
78	603083	剑桥科技	200	12,578.00	0.28
79	600755	厦门国贸	1,600	12,384.00	0.28
80	002500	山西证券	2,200	12,276.00	0.28
81	600827	百联股份	800	10,696.00	0.24
82	002461	珠江啤酒	1,200	10,572.00	0.24
83	601717	郑煤机	800	9,960.00	0.23
84	002605	姚记科技	200	9,286.00	0.21
85	002484	江海股份	400	8,516.00	0.19
86	300418	昆仑万维	200	8,056.00	0.18
87	600398	海澜之家	1,100	7,568.00	0.17
88	600363	联创光电	200	7,420.00	0.17
89	002568	百润股份	200	7,270.00	0.16
90	002867	周大生	400	7,112.00	0.16
91	000860	顺鑫农业	200	6,738.00	0.15
92	601028	玉龙股份	600	6,450.00	0.15
93	600039	四川路桥	600	5,886.00	0.13
94	601319	中国人保	1,000	5,840.00	0.13
95	601958	金铂股份	500	5,575.00	0.13
96	600655	豫园股份	800	5,488.00	0.12
97	002139	拓邦股份	400	5,220.00	0.12
98	601601	中国太保	200	5,196.00	0.12

99	002100	天康生物	600	4,950.00	0.11
100	600021	上海电力	400	4,308.00	0.10
101	600869	远东股份	600	3,312.00	0.07
102	000155	川能动力	200	2,880.00	0.07
103	600271	航天信息	200	2,738.00	0.06
104	002563	森马服饰	400	2,488.00	0.06
105	600502	安徽建工	400	2,112.00	0.05
106	601298	青岛港	300	2,091.00	0.05
107	600201	生物股份	200	1,902.00	0.04
108	600170	上海建工	600	1,614.00	0.04
109	002966	苏州银行	200	1,310.00	0.03

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	002603	以岭药业	2,490,611.00	4.25
2	600537	亿晶光电	2,222,071.00	3.79
3	300118	东方日升	2,096,392.64	3.58
4	600536	中国软件	1,965,543.50	3.35
5	603290	斯达半导	1,864,025.00	3.18
6	002738	中矿资源	1,459,375.00	2.49
7	603127	昭衍新药	1,438,402.00	2.45
8	300759	康龙化成	1,325,939.57	2.26
9	002371	北方华创	1,270,167.00	2.17
10	300014	亿纬锂能	1,237,300.00	2.11
11	300274	阳光电源	1,213,975.00	2.07
12	002045	国光电器	1,205,641.00	2.06
13	002517	恺英网络	1,179,606.00	2.01
14	300199	翰宇药业	1,166,871.00	1.99
15	601696	中银证券	1,094,709.00	1.87
16	002422	科伦药业	1,079,741.00	1.84
17	600547	山东黄金	1,067,051.00	1.82
18	688186	广大特材	1,011,406.79	1.73
19	300438	鹏辉能源	875,569.00	1.49



20	300311	任子行	793,871.00	1.35
----	--------	-----	------------	------

#### 7.4.2 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	300274	阳光电源	3,203,677.00	5.47
2	002603	以岭药业	2,734,612.00	4.67
3	002371	北方华创	2,512,110.00	4.29
4	002738	中矿资源	2,370,377.00	4.05
5	002812	恩捷股份	2,190,170.90	3.74
6	603613	国联股份	2,179,919.00	3.72
7	600536	中国软件	2,122,444.00	3.62
8	600537	亿晶光电	2,079,826.00	3.55
9	688063	派能科技	2,025,363.48	3.46
10	300118	东方日升	1,807,509.16	3.08
11	600438	通威股份	1,785,992.00	3.05
12	300763	锦浪科技	1,782,574.00	3.04
13	600026	中远海能	1,726,036.00	2.95
14	603290	斯达半导	1,668,821.00	2.85
15	688390	固德威	1,658,750.79	2.83
16	002045	国光电器	1,485,349.00	2.53
17	300363	博腾股份	1,465,252.00	2.50
18	002517	恺英网络	1,352,338.00	2.31
19	603127	昭衍新药	1,264,806.00	2.16
20	002594	比亚迪	1,234,117.00	2.11
21	600547	山东黄金	1,223,140.00	2.09
22	300498	温氏股份	1,207,553.00	2.06
23	003022	联泓新科	1,196,094.00	2.04
24	600521	华海药业	1,179,603.00	2.01

#### 7.4.3 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	93,556,589.22
卖出股票收入（成交）总额	146,114,465.80

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 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。

## 7.5 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。

## 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

**7.12.2 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。

**7.12.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,490.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,490.26

**7.12.4 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。

**7.12.5 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。

**7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
九泰天利量化 A	101	34,448.88	-	-	3,479,337.01	100.00%
九泰天利量化 C	148	13,543.83	-	-	2,004,486.62	100.00%
合计	249	22,023.39	-	-	5,483,823.63	100.00%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	九泰天利量化 A	11.19	0.0003%
	九泰天利量化 C	10.03	0.0005%
	合计	21.22	0.0004%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	九泰天利量化 A	0
	九泰天利量化 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	九泰天利量化 A	0
	九泰天利量化 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C
基金合同生效日（2021 年 10 月 12 日）基金份额总额	12,226,960.21	224,584,086.40
本报告期期初基金份额总额	7,969,081.51	64,723,762.39
本报告期基金总申购份额	70,618.84	106,457.13
减：本报告期基金总赎回份额	4,560,363.34	62,825,732.90
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	3,479,337.01	2,004,486.62

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

- 一、本报告期基金管理人无重大人事变动。
- 二、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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、本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计的会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 2 月 13 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会
受到的具体措施类型	责令改正，并处罚款；时任董事长及有关高级管理人员被处以警告、暂停基金从业资格、并处罚款。
受到稽查或处罚等措施的原因	通过九泰久利参与五家上市公司保底定增，利用基金财产为基金份额持有人以外的人牟取利益。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司诚恳接受监管处罚并高度重视，在监管部门的指导下，做好风险化解工作，与股东进行全面业务及风险隔离，对各项问题进行了全面整改。公司主动与监管部门沟通，积极落实各项整改措施，充分保障基金持有人利益。公司将持续提高规范公司运作水平，严格遵守相关法律规定，切实维护广大投资者利益。
其他	相关责任人员均已离任

措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及有关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 4 月 7 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	责令整改；相关高级管理人员被出具警示函。
受到稽查或处罚等措施的原因	固有资金持有高流动性资产比例未达标；基金持有流动性资产比例未达标；交易内控管理相关制度未有效执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	本报告期内，基金管理人收到监管机构责令改正的行政监管措施。对此公司高度重视，对相关问题进行了全面整改，已将整改落实情况报送监管机构。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
中泰证券	2	239,411,855.47	100.00%	95,906.28	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制；基金管理人该券商之间不存在关联关系。

### 10.7.2 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
中泰证券	6,999,920.00	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 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	九泰基金 2022 年 12 月 31 日基金资产净值公告	公司官网	2023 年 1 月 1 日
2	九泰基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2023 年 1 月 20 日
3	九泰天利量化股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	规定网站	2023 年 1 月 20 日
4	九泰基金管理有限公司公告	规定报刊和规定网站	2023 年 2 月 15 日
5	九泰基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	规定报刊	2023 年 3 月 31 日
6	九泰天利量化股票型证券投资基金 2022 年年度报告	规定网站	2023 年 3 月 31 日
7	关于九泰天利量化股票型证券投资基金基金经理变更的公告	规定报刊和规定网站	2023 年 4 月 14 日
8	九泰天利量化股票型证券投资基金招募说明书更新	规定网站	2023 年 4 月 14 日
9	九泰天利量化股票型证券投资基金（九泰天利量化 A 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2023 年 4 月 14 日
10	九泰天利量化股票型证券投资基金（九泰天利量化 C 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2023 年 4 月 14 日
11	九泰基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2023 年 4 月 21 日
12	九泰天利量化股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	规定网站	2023 年 4 月 21 日
13	九泰基金管理有限公司关于警惕不法分子冒用本公司名义进行非法活动的重要提示	规定报刊和规定网站	2023 年 6 月 14 日
14	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	规定报刊和规定网站	2023 年 6 月 30 日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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
产品	1	20230101 至 20230323	20,002,700.00	0.00	20,002,700.00	0.00	0.00%
	2	20230101 至 20230323	27,088,840.84	0.00	27,088,840.84	0.00	0.00%

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当持有基金份额比例较高的投资者集中赎回时，极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，进而引发基金的流动性风险。
- 2、当持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。
- 3、当投资者持有基金份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响。
- 4、若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 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。

### 12.3 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](http://www.jtamc.com)。

九泰基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日