九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金
2021 年中期报告

2021 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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，投资者在做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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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.....6

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

§3 主要财务指标和基金净值表现.....8

3.1 主要会计数据和财务指标.....8

3.2 基金净值表现.....8

§4 管理人报告.....11

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遵规守信情况的说明.....12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....13

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

§5 托管人报告.....16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....16

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....17

6.1 资产负债表.....17

6.2 利润表.....18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....19

6.4 报表附注.....20
§7 投资组合报告.....39
7.1 期末基金资产组合情况.....39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....39
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.....40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....47
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.....47
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.....47
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.....47
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.....47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....48
7.12 投资组合报告附注.....48
§8 基金份额持有人信息.....50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....50
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.....50
§9 开放式基金份额变动.....51
§10 重大事件揭示.....52
10.1 基金份额持有人大会决议.....52
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.....52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....52
10.4 基金投资策略的改变.....52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....52
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.....52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....52
10.8 其他重大事件.....53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....55
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.....55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....55
§12 备查文件目录.....56
12.1 备查文件目录.....56
12.2 存放地点.....56
12.3 查阅方式.....56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	九泰天宝混合	
基金主代码	000892	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 23 日	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,871,827.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C
下属分级基金的交易代码：	000892	002028
报告期末下属分级基金的份额总额	5,859,688.44 份	12,139.11 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理，在有效控制组合风险的前提下，力争为投资者获取长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金重点关注在中国经济结构优化、产业结构升级或技术创新过程中成长性确定且估值合理的上市公司、价值被严重低估的传统行业的上市公司，以及上市公司事件驱动带来的投资机会。通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析进行大类资产配置；通过定性分析方法和定量分析方法相结合的策略进行股票投资；通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势进行债券投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	秦一楠
	联系电话	010-57383999	010-66060069
	电子邮箱	chenpei@jtamc.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-628-0606	95599
传真		010-57383867	010-68121816
注册地址		北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市朝阳区安立路 30 号	北京市西城区复兴门内大街 28

	仰山公园 2 号楼 1 栋西侧一层、二层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100020	100031
法定代表人	卢伟忠	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jtamc.com
基金中期报告备置地点	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
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	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,913,370.20	6,311.14
本期利润	1,346,805.82	-5,761.76
加权平均基金份额本期利润	0.2895	-0.2782
本期加权平均净值利润率	18.18%	-17.02%
本期基金份额净值增长率	13.52%	13.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	4,076,784.99	8,401.20
期末可供分配基金份额利润	0.6957	0.6921
期末基金资产净值	9,936,473.43	20,540.31
期末基金份额净值	1.696	1.692
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	88.57%	80.54%

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 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

九泰天宝混合 A

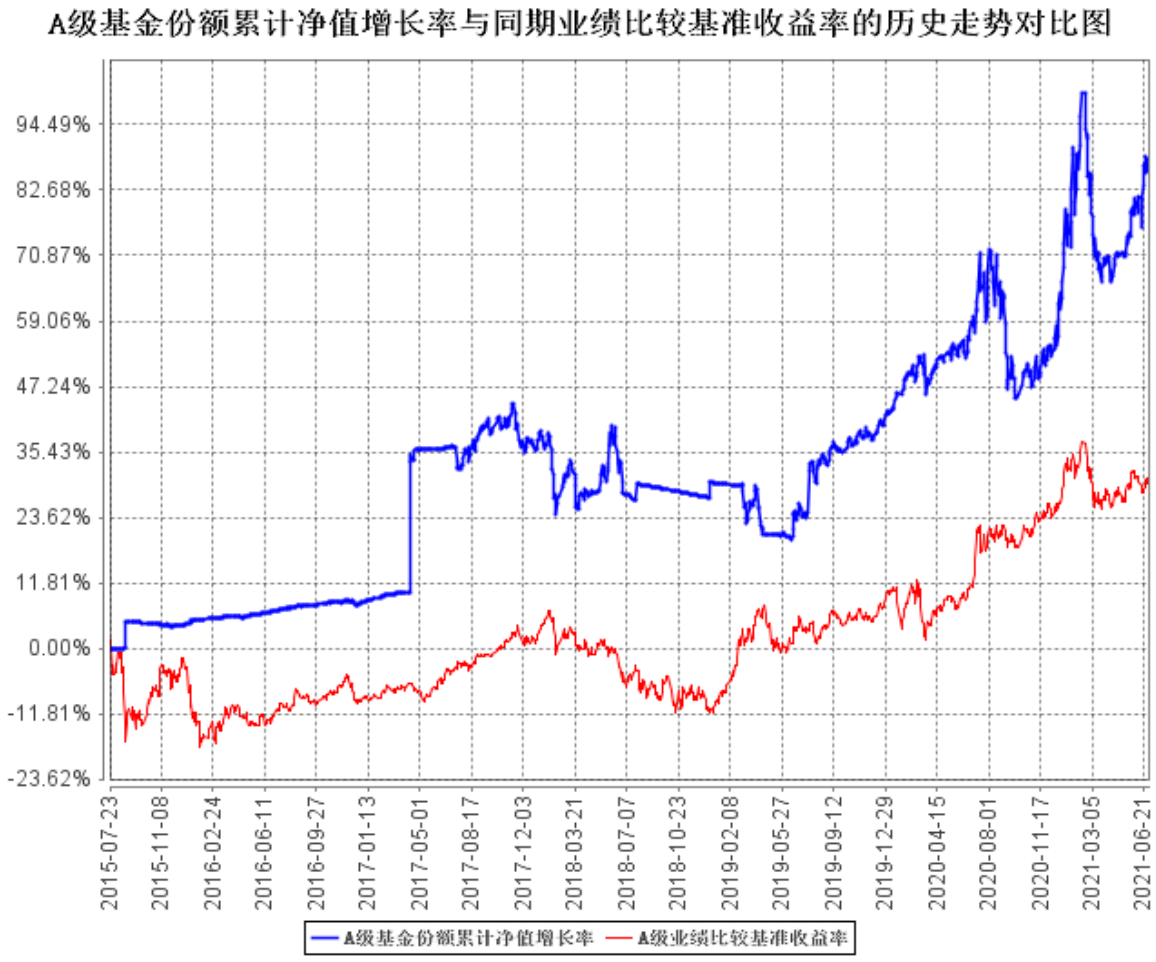
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.08%	1.31%	-1.17%	0.48%	6.25%	0.83%
过去三个月	11.21%	0.98%	2.71%	0.59%	8.50%	0.39%
过去六个月	13.52%	1.53%	1.22%	0.79%	12.30%	0.74%
过去一年	17.94%	1.42%	16.33%	0.79%	1.61%	0.63%
过去三年	47.35%	0.96%	36.44%	0.81%	10.91%	0.15%
自基金合同生效起至今	88.57%	0.97%	30.29%	0.82%	58.28%	0.15%

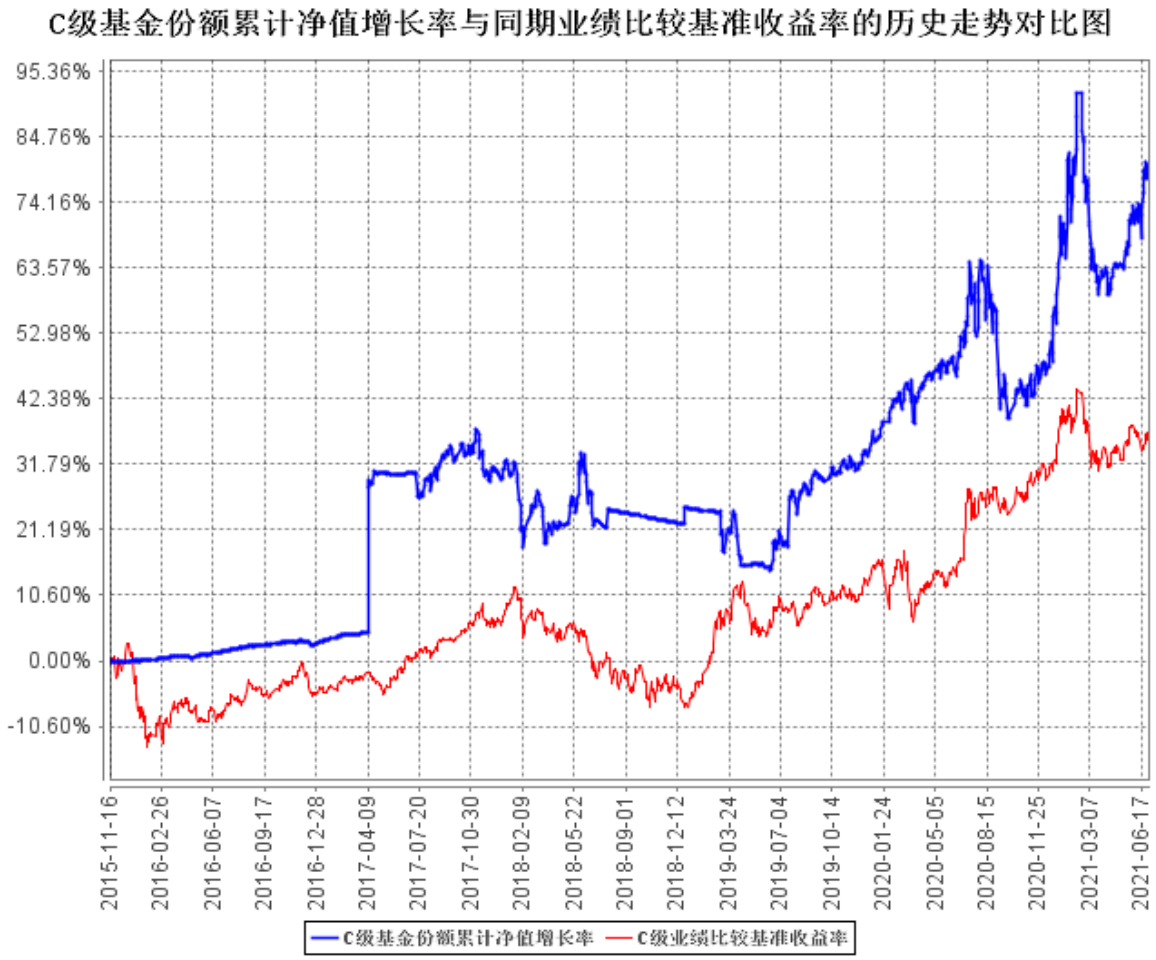
九泰天宝混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.03%	1.31%	-1.17%	0.48%	6.20%	0.83%
过去三个月	11.10%	0.98%	2.71%	0.59%	8.39%	0.39%
过去六个月	13.33%	1.53%	1.22%	0.79%	12.11%	0.74%
过去一年	17.66%	1.42%	16.33%	0.79%	1.33%	0.63%
过去三年	48.16%	0.96%	36.44%	0.81%	11.72%	0.15%
自基金合同生效起至今	80.54%	1.01%	36.43%	0.75%	44.11%	0.26%

注：本基金自 2015 年 11 月 14 日起新增 C 类份额，自 C 类份额增加日至本报告期末，部分期间 C 类份额为 0，C 类份额为 0 期间按照 A 类份额净值作为参考净值进行计算。

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





注：1.本基金合同于 2015 年 7 月 23 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。

3.本基金自 2015 年 11 月 14 日起新增 C 类份额，自 C 类份额增加日至本报告期末，部分期间 C 类份额为 0，C 类份额为 0 期间按照 A 类份额净值作为参考净值进行计算。

§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（2021 年 6 月 30 日），基金管理人共管理 33 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、九泰锐智事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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（LOF）、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、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金、九泰科盈价值灵活配置混合型证券投资基金、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金、九泰科鑫策略精选灵活配置混合型证券投资基金、九泰久信量化股票型证券投资基金、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金、九泰动态策略灵活配置混合型证券投资基金、九泰聚鑫混合型证券投资基金、九泰久睿量化股票型证券投资基金、九泰科新优享灵活配置混合型证券投资基金、九泰行业优选灵活配置混合型证券投资基金、九泰久嘉纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、九泰锐和 18 个月定期开放混合型证券投资基金、九泰锐升 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、九泰久元量化股票型证券投资基金、九泰久福量化股票型证券投资基金、九泰量化新兴产业混合型证券投资基金、九泰久慧混

合型证券投资基金。证券投资基金规模约为 118.59 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		
何昕	基金经理	2020 年 7 月 20 日	-	6	中国人民大学经济学硕士，中国籍，具有基金从业资格，6 年证券从业经历，历任泰康之家（北京）投资有限公司产业研究员，2016 年 9 月加入九泰基金，曾任研究发展部研究员，现任中正和权益投资部基金经理，九泰久益灵活配置混合型证券投资基金（2018 年 8 月 21 日至今）、九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 7 月 20 日至今）、九泰科新优享灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 12 月 9 日至今）、九泰行业优选灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 12 月 9 日至今）的基金经理。

注：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。

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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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。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

2021 年上半年宏观经济出现了较大变化，GDP 增速、社融增速及通胀高位波动，导致了大类资产的大幅波动。本基金依旧以配置权益资产为主，并逐步加大了高景气成长性股票的权重，该策略取得了一定的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 1.696 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.52%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.692 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.33%；同期业绩比较基准收益率为 1.22%。

注：本基金自 2015 年 11 月 14 日起新增 C 类份额，自 C 类份额增加日至本报告期末，部分期间 C 类份额为 0，C 类份额为 0 期间按照 A 类份额净值作为参考净值进行计算。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着经济强势期逐渐消退，预计下半年的市场或将呈现结构性行情，本基金将继续以权益资产配置为主，努力精选符合宏观环境的优质公司进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确了基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，健全了估值决策体系。本基金管理人在具体的基金估值业务执行上，在遵守中国证监会相关规定

和基金合同的同时，参考了行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，以确保基金估值的公平、合理。

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规、基金合同及基金的实际运作情况，本基金于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（2020 年 3 月 25 日-2021 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—九泰基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，九泰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，九泰基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	578,279.99	853,958.68
结算备付金		202,363.13	31,680.28
存出保证金		15,948.67	17,870.58
交易性金融资产	6.4.7.2	9,219,816.78	8,918,571.78
其中：股票投资		9,219,816.78	8,918,571.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	38,963.65
应收利息	6.4.7.5	183.81	204.83
应收股利		-	-
应收申购款		1,447.83	1,727.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,018,040.21	9,862,977.23
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 6 月 30 日**	**上年度末 2020 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	179,931.96
应付赎回款		8,032.23	8,937.30
应付管理人报酬		6,323.01	6,137.61
应付托管费		1,185.57	1,150.82
应付销售服务费		3.86	4.89
应付交易费用	6.4.7.7	11,676.83	5,983.72
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	33,804.97	29,013.78
负债合计		61,026.47	231,160.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,871,827.55	6,446,632.97
未分配利润	6.4.7.10	4,085,186.19	3,185,184.18
所有者权益合计		9,957,013.74	9,631,817.15
负债和所有者权益总计		10,018,040.21	9,862,977.23

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，九泰天宝混合 A 基金份额净值 1.696 元，基金份额总额 5,859,688.44 份；九泰天宝混合 C 基金份额净值 1.692 元，基金份额总额 12,139.11 份。九泰天宝混合份额总额合计为 5,871,827.55 份。

6.2 利润表

会计主体：九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,510,674.84	2,464,227.75
1.利息收入		11,514.59	437,462.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,547.96	15,807.27
债券利息收入		-	321,751.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,966.63	99,903.01
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,067,067.08	7,931,303.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,027,758.84	7,984,419.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	58,835.34
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	39,308.24	-111,951.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-578,637.28	-5,917,403.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	10,730.45	12,865.22
减：二、费用		169,630.78	444,471.30
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	29,625.63	123,072.51
2．托管费	6.4.10.2.2	5,554.79	23,076.11
3．销售服务费	6.4.10.2.3	40.77	27,386.52
4．交易费用	6.4.7.19	88,542.35	143,150.90
5．利息支出		-	20,704.50
其中：卖出回购金融资产支出		-	20,704.50
6．税金及附加		-	16.67
7．其他费用	6.4.7.20	45,867.24	107,064.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,341,044.06	2,019,756.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,341,044.06	2,019,756.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	6,446,632.97	3,185,184.18	9,631,817.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,341,044.06	1,341,044.06
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）	-574,805.42	-441,042.05	-1,015,847.47
其中：1.基金申购款	2,926,153.40	1,710,954.56	4,637,107.96
2.基金赎回款	-3,500,958.82	-2,151,996.61	-5,652,955.43
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）	5,871,827.55	4,085,186.19	9,957,013.74
项目	**上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	110,263,140.86	29,557,665.98	139,820,806.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,019,756.45	2,019,756.45
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）	-106,952,542.99	-30,126,711.33	-137,079,254.32
其中：1.基金申购款	4,083,354.39	1,400,276.49	5,483,630.88
2.基金赎回款	-111,035,897.38	-31,526,987.82	-142,562,885.20
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）	3,310,597.87	1,450,711.10	4,761,308.97

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：

卢伟忠	严军	荣静
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系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》、《九泰天宝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”)及其他有关法律法规的规定，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[2014]1135 号文注册并公开发行。本基金为契约型开放式证券投资

基金，存续期限为不定期。首次设立募集基金份额为 215,255,863.06 份，经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)验证。基金合同于 2015 年 7 月 23 日正式生效。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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《关于九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，本基金管理人九泰基金管理有限公司经与本基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定于 2015 年 11 月 14 日起增设本基金的 C 类基金份额，增设的 C 类基金份额不收取投资者认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

根据《九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(2015 年修订)，本基金根据销售服务费、赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同及《九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票)，债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

6.4.2 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。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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，对受让方不再缴纳印花税。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	578,279.99
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：	578,279.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,183,668.65	9,219,816.78	36,148.13
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		9,183,668.65	9,219,816.78	36,148.13

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	95.52
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	81.90
应收债券利息	-
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	6.39
合计	183.81

注：其他是指应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	11,676.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,676.83

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.78
应付证券出借违约金	-
预提审计费	24,795.19
预提中债登账户维护费	4,500.00
预提上清所账户维护费	4,500.00
合计	33,804.97

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

九泰天宝混合 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,428,833.95	6,428,833.95
本期申购	2,762,847.57	2,762,847.57

本期赎回(以"-"号填列)	-3,331,993.08	-3,331,993.08
- 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	5,859,688.44	5,859,688.44

金额单位：人民币元

九泰天宝混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,799.02	17,799.02
本期申购	163,305.83	163,305.83
本期赎回(以"-"号填列)	-168,965.74	-168,965.74
- 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	12,139.11	12,139.11

注：本期申购中包含转换入份额及金额，赎回中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

九泰天宝混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,400,667.57	-1,224,260.92	3,176,406.65
本期利润	1,913,370.20	-566,564.38	1,346,805.82
本期基金份额交易产生的变动数	223,371.60	-669,799.08	-446,427.48
其中：基金申购款	2,648,151.34	-1,059,315.34	1,588,836.00
基金赎回款	-2,424,779.74	389,516.26	-2,035,263.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,537,409.37	-2,460,624.38	4,076,784.99

单位：人民币元

九泰天宝混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,185.07	1,592.46	8,777.53
本期利润	6,311.14	-12,072.90	-5,761.76

本期基金份额交易产生的变动数	-3,398.49	8,783.92	5,385.43
其中：基金申购款	125,864.83	-3,746.27	122,118.56
基金赎回款	-129,263.32	12,530.19	-116,733.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,097.72	-1,696.52	8,401.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,438.80
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	995.07
其他	114.09
合计	5,547.96

注：其他包括结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	54,212,563.09
减：卖出股票成本总额	52,184,804.25
买卖股票差价收入	2,027,758.84

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	39,308.24
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	39,308.24

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-578,637.28
——股票投资	-578,637.28
——债券投资	-
——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	-578,637.28

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,730.44
基金转换费收入	0.01
合计	10,730.45

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	88,542.35
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	-
合计	88,542.35

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	600.00
银行汇划费	2,472.05
帐户维护费	18,000.00
合计	45,867.24

注：其他指上清所查询费用。

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

截至财务报表批准日，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

中国农业银行股份有限公司	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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,625.63	123,072.51
其中：支付销售机构的客户维护费	13,181.50	2,314.54

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.8%÷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前 3 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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,554.79	23,076.11

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷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前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	1.30	1.30
合计	-	1.30	1.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	27,386.52	27,386.52
合计	-	27,386.52	27,386.52

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年费率为 0.20%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国农业银行股份有限公司	578,279.99	4,438.80	350,520.11	11,098.64

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国农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。

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

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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

本基金报告期末未持有因认购新发/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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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。本基金的投资范围主要包括股票、债券、权证及资产支持证券等。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有效控制组合风险的前提下，力争为投资者获取长期稳健的投资回报。

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公司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、结算备付金、存出保证金等。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 2021 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	578,279.99	-	-	-	-	-	578,279.99
结算备付金	202,363.13	-	-	-	-	-	202,363.13
存出保证金	15,948.67	-	-	-	-	-	15,948.67
交易性金融资产	-	-	-	-	-	9,219,816.78	9,219,816.78
应收利息	-	-	-	-	-	183.81	183.81
应收申购款	-	-	-	-	-	1,447.83	1,447.83
资产总计	796,591.79	-	-	-	-	9,221,448.42	10,018,040.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,032.23	8,032.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,323.01	6,323.01
应付托管费	-	-	-	-	-	1,185.57	1,185.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3.86	3.86
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,676.83	11,676.83
其他负债	-	-	-	-	-	33,804.97	33,804.97
负债总计	-	-	-	-	-	61,026.47	61,026.47
利率敏感度缺口	796,591.79	-	-	-	-	9,160,421.95	9,957,013.74
上年度末 2020 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	853,958.68	-	-	-	-	-	853,958.68
结算备付金	31,680.28	-	-	-	-	-	31,680.28
存出保证金	17,870.58	-	-	-	-	-	17,870.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,918,571.78	8,918,571.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-	38,963.65	38,963.65
应收利息	-	-	-	-	-	204.83	204.83
应收申购款	-	-	-	-	-	1,727.43	1,727.43
资产总计	903,509.54	-	-	-	-	8,959,467.69	9,862,977.23
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	179,931.96	179,931.96

应付赎回款	-	-	-	-	-	8,937.30	8,937.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,137.61	6,137.61
应付托管费	-	-	-	-	-	1,150.82	1,150.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4.89	4.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,983.72	5,983.72
其他负债	-	-	-	-	-	29,013.78	29,013.78
负债总计	-	-	-	-	-	231,160.08	231,160.08
利率敏感度缺口	903,509.54	-	-	-	-	8,728,307.61	9,631,817.15

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

本基金于报告期末及上年度末未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	9,219,816.78	92.60	8,918,571.78	92.59
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	9,219,816.78	92.60	8,918,571.78	92.59

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（ 2021 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数上涨 5%	552,203.81	526,496.65
	沪深 300 指数下跌 5%	-552,203.81	-526,496.65

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 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和其他金融负债，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 2021 年 6 月 30 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 9,219,816.78 元，无属于第二层和第三层次的余额。(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 8,524,431.00 元，无属于第二层次的余额，属于第三层次的余额为人民币 394,140.78 元)。

(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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第三层次的余额；本报告期无转入第三层次的金额，转出第三层次的金额为 635,803.74 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币 335,802.83 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。

§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	9,219,816.78	92.03
	其中：股票	9,219,816.78	92.03
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	780,643.12	7.79
8	其他各项资产	17,580.31	0.18
9	合计	10,018,040.21	100.00

7.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,915,746.12	69.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,064.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	117,786.00	1.18
J	金融业	1,693,174.00	17.00
K	房地产业	2,381.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,659.00	0.16

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	165,033.66	1.66
R	文化、体育和娱乐业	307,973.00	3.09
S	综合	-	-
	合计	9,219,816.78	92.60

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	000001	平安银行	24,500	554,190.00	5.57
2	002271	东方雨虹	8,100	448,092.00	4.50
3	002867	周大生	21,900	432,963.00	4.35
4	603833	欧派家居	2,900	411,684.00	4.13
5	002142	宁波银行	10,500	409,185.00	4.11
6	000661	长春高新	1,000	387,000.00	3.89
7	000568	泸州老窖	1,600	377,504.00	3.79
8	300627	华测导航	10,640	362,930.40	3.64
9	002810	山东赫达	7,000	330,120.00	3.32
10	300767	震安科技	3,940	327,217.00	3.29
11	300122	智飞生物	1,700	317,441.00	3.19
12	600809	山西汾酒	700	313,600.00	3.15
13	600702	舍得酒业	1,400	299,292.00	3.01
14	300957	贝泰妮	1,100	298,859.00	3.00
15	600036	招商银行	5,200	281,788.00	2.83
16	600926	杭州银行	18,000	265,500.00	2.67
17	688169	石头科技	200	252,200.00	2.53
18	300760	迈瑞医疗	500	240,025.00	2.41
19	000799	酒鬼酒	800	204,480.00	2.05
20	300363	博腾股份	2,400	201,888.00	2.03
21	300014	亿纬锂能	1,900	197,467.00	1.98
22	002511	中顺洁柔	7,000	192,850.00	1.94
23	300725	药石科技	1,200	190,692.00	1.92

24	300251	光线传媒	17,300	187,013.00	1.88
25	601601	中国太保	6,300	182,511.00	1.83
26	601966	玲珑轮胎	3,900	170,586.00	1.71
27	002353	杰瑞股份	2,900	129,630.00	1.30
28	300144	宋城演艺	7,200	120,960.00	1.21
29	002648	卫星石化	2,976	116,629.44	1.17
30	002920	德赛西威	1,000	110,080.00	1.11
31	300369	绿盟科技	6,400	102,080.00	1.03
32	603516	淳中科技	4,700	100,110.00	1.01
33	002139	拓邦股份	5,500	98,945.00	0.99
34	600346	恒力石化	3,700	97,088.00	0.98
35	300015	爱尔眼科	1,167	82,833.66	0.83
36	600763	通策医疗	200	82,200.00	0.83
37	300896	爱美客	100	78,888.00	0.79
38	300146	汤臣倍健	2,100	69,090.00	0.69
39	600436	片仔癀	100	44,830.00	0.45
40	688363	华熙生物	98	27,230.28	0.27
41	603486	科沃斯	100	22,808.00	0.23
42	002791	坚朗五金	100	19,405.00	0.19
43	300496	中科创达	100	15,706.00	0.16
44	603259	药明康德	100	15,659.00	0.16
45	300274	阳光电源	100	11,506.00	0.12
46	300595	欧普康视	100	10,355.00	0.10
47	002541	鸿路钢构	100	5,835.00	0.06
48	603456	九洲药业	100	4,858.00	0.05
49	300920	润阳科技	100	3,368.00	0.03
50	603008	喜临门	100	3,301.00	0.03
51	600171	上海贝岭	100	3,043.00	0.03
52	000002	万科 A	100	2,381.00	0.02
53	600900	长江电力	100	2,064.00	0.02
54	601636	旗滨集团	100	1,856.00	0.02

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	300014	亿纬锂能	1,413,210.00	14.67

2	300767	震安科技	1,308,346.00	13.58
3	300957	贝泰妮	1,303,252.00	13.53
4	600809	山西汾酒	1,068,633.00	11.09
5	300896	爱美客	1,057,950.00	10.98
6	600926	杭州银行	983,061.00	10.21
7	603259	药明康德	975,091.00	10.12
8	300627	华测导航	970,860.60	10.08
9	002812	恩捷股份	970,755.00	10.08
10	300274	阳光电源	905,991.00	9.41
11	300750	宁德时代	900,736.00	9.35
12	601012	隆基股份	896,636.00	9.31
13	002867	周大生	893,367.00	9.28
14	603833	欧派家居	871,096.00	9.04
15	002541	鸿路钢构	862,076.00	8.95
16	000001	平安银行	840,929.00	8.73
17	600176	中国巨石	836,656.00	8.69
18	600438	通威股份	757,287.00	7.86
19	600893	航发动力	742,244.00	7.71
20	601601	中国太保	699,546.00	7.26
21	688363	华熙生物	697,093.42	7.24
22	000568	泸州老窖	686,688.00	7.13
23	002142	宁波银行	681,405.00	7.07
24	603008	喜临门	621,888.00	6.46
25	603501	韦尔股份	616,479.00	6.40
26	002353	杰瑞股份	592,132.00	6.15
27	300015	爱尔眼科	584,633.00	6.07
28	688526	科前生物	579,336.47	6.01
29	002624	完美世界	558,418.00	5.80
30	002439	启明星辰	543,452.00	5.64
31	603799	华友钴业	532,599.00	5.53
32	002372	伟星新材	532,071.00	5.52
33	300595	欧普康视	529,269.60	5.50
34	601966	玲珑轮胎	527,194.00	5.47
35	603486	科沃斯	511,784.00	5.31
36	000661	长春高新	510,306.00	5.30
37	002709	天赐材料	482,262.00	5.01

38	000786	北新建材	476,484.00	4.95
39	002493	荣盛石化	472,128.27	4.90
40	002271	东方雨虹	468,360.00	4.86
41	603185	上机数控	466,910.00	4.85
42	002460	赣锋锂业	462,371.00	4.80
43	300280	紫天科技	459,716.00	4.77
44	603456	九洲药业	459,071.00	4.77
45	300725	药石科技	458,948.00	4.76
46	002960	青鸟消防	453,205.00	4.71
47	000516	国际医学	446,842.00	4.64
48	000002	万科 A	442,129.00	4.59
49	002920	德赛西威	431,834.00	4.48
50	601636	旗滨集团	425,606.00	4.42
51	000301	东方盛虹	422,504.00	4.39
52	600036	招商银行	412,880.00	4.29
53	000799	酒鬼酒	398,554.00	4.14
54	300369	绿盟科技	390,918.00	4.06
55	601311	骆驼股份	390,319.00	4.05
56	601166	兴业银行	387,786.00	4.03
57	300251	光线传媒	386,110.00	4.01
58	000157	中联重科	384,595.00	3.99
59	600346	恒力石化	380,934.00	3.95
60	300760	迈瑞医疗	367,380.00	3.81
61	002563	森马服饰	348,840.00	3.62
62	002064	华峰化学	345,757.00	3.59
63	002938	鹏鼎控股	343,425.00	3.57
64	300122	智飞生物	340,056.00	3.53
65	002304	洋河股份	337,425.00	3.50
66	002810	山东赫达	336,220.00	3.49
67	603613	国联股份	332,772.00	3.45
68	300413	芒果超媒	317,880.00	3.30
69	601100	恒立液压	297,384.00	3.09
70	600031	三一重工	295,776.00	3.07
71	600900	长江电力	285,760.00	2.97
72	600702	舍得酒业	283,662.00	2.95
73	603330	上海天洋	281,958.20	2.93

74	600496	精工钢构	275,334.00	2.86
75	300347	泰格医药	272,359.00	2.83
76	600779	水井坊	272,324.00	2.83
77	002415	海康威视	266,655.00	2.77
78	603288	海天味业	264,978.00	2.75
79	603345	安井食品	263,760.00	2.74
80	300496	中科创达	263,356.00	2.73
81	600660	福耀玻璃	262,620.00	2.73
82	603416	信捷电气	251,644.00	2.61
83	603605	珀莱雅	248,712.00	2.58
84	600760	中航沈飞	246,930.00	2.56
85	300146	汤臣倍健	243,651.00	2.53
86	688169	石头科技	242,800.00	2.52
87	002027	分众传媒	230,537.00	2.39
88	600309	万华化学	223,567.00	2.32
89	600436	片仔癀	221,381.00	2.30
90	000651	格力电器	219,296.00	2.28
91	300124	汇川技术	214,720.00	2.23
92	603218	日月股份	213,300.00	2.21
93	002557	洽洽食品	213,194.00	2.21
94	002597	金禾实业	212,715.00	2.21
95	600519	贵州茅台	211,656.00	2.20
96	603678	火炬电子	208,420.00	2.16
97	300363	博腾股份	200,458.00	2.08
98	002511	中顺洁柔	195,935.00	2.03
99	600171	上海贝岭	195,034.00	2.02
100	601318	中国平安	194,009.00	2.01

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300014	亿纬锂能	1,512,276.00	15.70
2	300274	阳光电源	1,236,261.00	12.84
3	600926	杭州银行	1,204,654.00	12.51
4	300957	贝泰妮	1,088,978.00	11.31

5	300896	爱美客	1,081,874.00	11.23
6	002541	鸿路钢构	1,074,759.00	11.16
7	601012	隆基股份	1,058,852.08	10.99
8	300767	震安科技	1,056,233.00	10.97
9	603259	药明康德	1,040,412.80	10.80
10	600438	通威股份	1,006,204.00	10.45
11	603185	上机数控	901,318.00	9.36
12	603501	韦尔股份	884,695.00	9.19
13	002812	恩捷股份	874,856.00	9.08
14	300750	宁德时代	871,171.00	9.04
15	601966	玲珑轮胎	862,672.00	8.96
16	600346	恒力石化	803,788.00	8.35
17	600809	山西汾酒	795,497.00	8.26
18	600176	中国巨石	780,332.00	8.10
19	000568	泸州老窖	773,857.00	8.03
20	688363	华熙生物	732,983.00	7.61
21	600893	航发动力	715,146.00	7.42
22	002493	荣盛石化	700,793.00	7.28
23	601601	中国太保	696,603.00	7.23
24	300627	华测导航	689,208.00	7.16
25	002648	卫星石化	687,680.80	7.14
26	601899	紫金矿业	674,983.00	7.01
27	603008	喜临门	664,439.00	6.90
28	000157	中联重科	636,003.00	6.60
29	688526	科前生物	606,014.41	6.29
30	002064	华峰化学	586,734.00	6.09
31	000002	万科 A	584,392.00	6.07
32	300015	爱尔眼科	571,467.00	5.93
33	002439	启明星辰	569,988.00	5.92
34	603799	华友钴业	568,688.00	5.90
35	002372	伟星新材	566,696.00	5.88
36	603486	科沃斯	564,364.00	5.86
37	300595	欧普康视	544,409.40	5.65
38	002624	完美世界	511,806.00	5.31
39	002460	赣锋锂业	506,087.00	5.25
40	002415	海康威视	505,290.00	5.25
41	002353	杰瑞股份	504,108.00	5.23
42	002867	周大生	504,011.00	5.23

43	603456	九洲药业	492,111.00	5.11
44	601636	旗滨集团	461,755.00	4.79
45	000301	东方盛虹	456,883.00	4.74
46	000786	北新建材	455,663.00	4.73
47	002960	青鸟消防	444,922.70	4.62
48	000516	国际医学	442,758.00	4.60
49	000001	平安银行	441,354.00	4.58
50	603833	欧派家居	432,563.00	4.49
51	300751	迈为股份	428,400.00	4.45
52	002709	天赐材料	426,267.00	4.43
53	600519	贵州茅台	416,132.00	4.32
54	002970	锐明技术	402,085.00	4.17
55	601311	骆驼股份	398,341.00	4.14
56	601166	兴业银行	386,637.00	4.01
57	002563	森马服饰	372,008.00	3.86
58	300280	紫天科技	359,774.00	3.74
59	002142	宁波银行	357,444.00	3.71
60	002920	德赛西威	348,181.00	3.61
61	600779	水井坊	337,243.00	3.50
62	603613	国联股份	337,050.00	3.50
63	002938	鹏鼎控股	324,909.00	3.37
64	002304	洋河股份	318,515.00	3.31
65	600036	招商银行	314,065.00	3.26
66	300369	绿盟科技	306,870.00	3.19
67	600031	三一重工	294,863.94	3.06
68	600183	生益科技	294,200.00	3.05
69	600900	长江电力	290,982.00	3.02
70	603288	海天味业	279,474.00	2.90
71	601888	中国中免	278,720.00	2.89
72	601100	恒立液压	278,268.00	2.89
73	300725	药石科技	268,500.00	2.79
74	002410	广联达	265,588.00	2.76
75	300347	泰格医药	263,337.00	2.73
76	300413	芒果超媒	256,540.00	2.66
77	603345	安井食品	253,500.00	2.63
78	603330	上海天洋	253,281.00	2.63
79	600660	福耀玻璃	249,459.00	2.59
80	300496	中科创达	248,124.00	2.58

81	601567	三星医疗	243,705.00	2.53
82	603416	信捷电气	237,534.00	2.47
83	600760	中航沈飞	234,000.00	2.43
84	603180	金牌厨柜	232,371.00	2.41
85	603605	珀莱雅	225,292.00	2.34
86	600496	精工钢构	224,949.00	2.34
87	002027	分众传媒	222,369.00	2.31
88	000799	酒鬼酒	217,488.00	2.26
89	603678	火炬电子	211,081.00	2.19
90	600171	上海贝岭	204,947.00	2.13
91	000651	格力电器	204,844.00	2.13
92	300251	光线传媒	197,600.00	2.05
93	603218	日月股份	193,855.00	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	53,064,686.53
卖出股票收入（成交）总额	54,212,563.09

注：本项中 7.4.1、7.4.2 和 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。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

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。

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之一平安银行股份有限公司在本报告编制日前一年内出现被监管部门处罚的情形：

2021 年 5 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对平安银行股份有限公司作出了行政处罚（云银保监罚决字〔2021〕34 号），主要内容为：利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险;固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资;流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单;固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品。中国银行保险监督管理委员会云南监管局对该银行罚款人民币 210 万元。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，其他九名证券发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、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	15,948.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	183.81
5	应收申购款	1,447.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,580.31

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的情况。

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
九泰天宝混合 A	537	10,911.90	73.58	0.00%	5,859,614.86	100.00%
九泰天宝混合 C	7	1,734.16	-	0.00%	12,139.11	100.00%
合计	544	10,793.80	73.58	0.00%	5,871,753.97	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	九泰天宝混合 A	25,305.58	0.4319%
	九泰天宝混合 C	-	-
	合计	25,305.58	0.4310%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	九泰天宝混合 A	0~10
	九泰天宝混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	九泰天宝混合 A	0
	九泰天宝混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰天宝混合 A	九泰天宝混合 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 23 日）基金份额总额	215,255,863.06	-
本报告期期初基金份额总额	6,428,833.95	17,799.02
本报告期基金总申购份额	2,762,847.57	163,305.83
减:本报告期基金总赎回份额	3,331,993.08	168,965.74
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	5,859,688.44	12,139.11

注：基金总申购份额含转换入份额、基金总赎回份额含转换出份额。

§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、本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

二、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门有重大人事变动：
2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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、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

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梳理，及时报送了整改方案并予以落实。除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
安信证券	2	107,277,249.62	100.00%	24,814.20	100.00%	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	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、个股分析的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：无；

（2）本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

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
安信证券	-	-	62,200,000.00	100.00%	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-

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	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	规定网站	2021 年 1 月 11 日
2	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（九泰天宝混合 A 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2021 年 1 月 11 日
3	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（九泰天宝混合 C 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2021 年 1 月 11 日

4	九泰基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2021 年 1 月 22 日
5	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	规定网站	2021 年 1 月 22 日
6	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	公司网站	2021 年 2 月 9 日
7	九泰基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	规定报刊	2021 年 3 月 31 日
8	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	规定网站	2021 年 3 月 31 日
9	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与其申购费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和规定网站	2021 年 4 月 17 日
10	九泰基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2021 年 4 月 22 日
11	九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定网站	2021 年 4 月 22 日
12	九泰基金管理有限公司关于终止深圳市小牛基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证监会规定报刊和规定网站	2021 年 4 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
个人	1	20210113 至 20210427	862,819.79	0.00	0.00	862,819.79	14.69%
	2	20210125 至 20210207	672,037.80	0.00	0.00	672,037.80	11.45%
	3	20210125 至 20210207 、20210428 至 20210630	673,064.14	1,949,612.02	0.00	2,622,676.16	44.67%
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。

九泰基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日