

# 九泰聚鑫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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏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 2021 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.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<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 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>50</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	58
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>62</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>66</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.....	66

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	九泰聚鑫混合型证券投资基金	
基金简称	九泰聚鑫混合	
基金主代码	008757	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 7 月 8 日	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	300,243,058.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	九泰聚鑫混合 A	九泰聚鑫混合 C
下属分级基金的交易代码:	008757	008758
报告期末下属分级基金的份额总额	50,686,502.63 份	249,556,555.98 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置策略方面通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中股票、债券和现金类大类资产的配置比例。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，预测未来市场变动趋势。并通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。本基金债券投资策略包括利率预期策略、收益率曲线策略、优化配置策略、久期控制策略、现金流管理策略及套利策略。本基金的投资策略还包括股票投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等。
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	本基金为混合型证券投资基金，一般情况下其预期收益和风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

### 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	华夏银行股份有限公司
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	95577
传真	010-57383867	010-85238680

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 22 号 (100005)
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	北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005)
邮政编码	100020	100005
法定代表人	卢伟忠	李民吉

## 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

## 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	九泰聚鑫混合 A	九泰聚鑫混合 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	4,239,281.40	17,162,847.77
本期利润	3,816,419.27	13,781,089.74
加权平均基金份额本期利润	0.0595	0.0528
本期加权平均净值利润率	5.39%	4.79%
本期基金份额净值增长率	5.39%	5.29%
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	4,828,908.96	23,221,277.24
期末可供分配基金份额利润	0.0953	0.0931
期末基金资产净值	57,750,238.39	283,774,665.19
期末基金份额净值	1.1394	1.1371
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	13.94%	13.71%

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 2021 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

九泰聚鑫混合 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	0.71%	0.30%	-0.54%	0.25%	1.25%	0.05%
过去三个月	4.13%	0.35%	2.07%	0.30%	2.06%	0.05%
过去六个月	5.39%	0.48%	1.74%	0.40%	3.65%	0.08%
自基金合同生效起至今	13.94%	0.43%	6.09%	0.38%	7.85%	0.05%

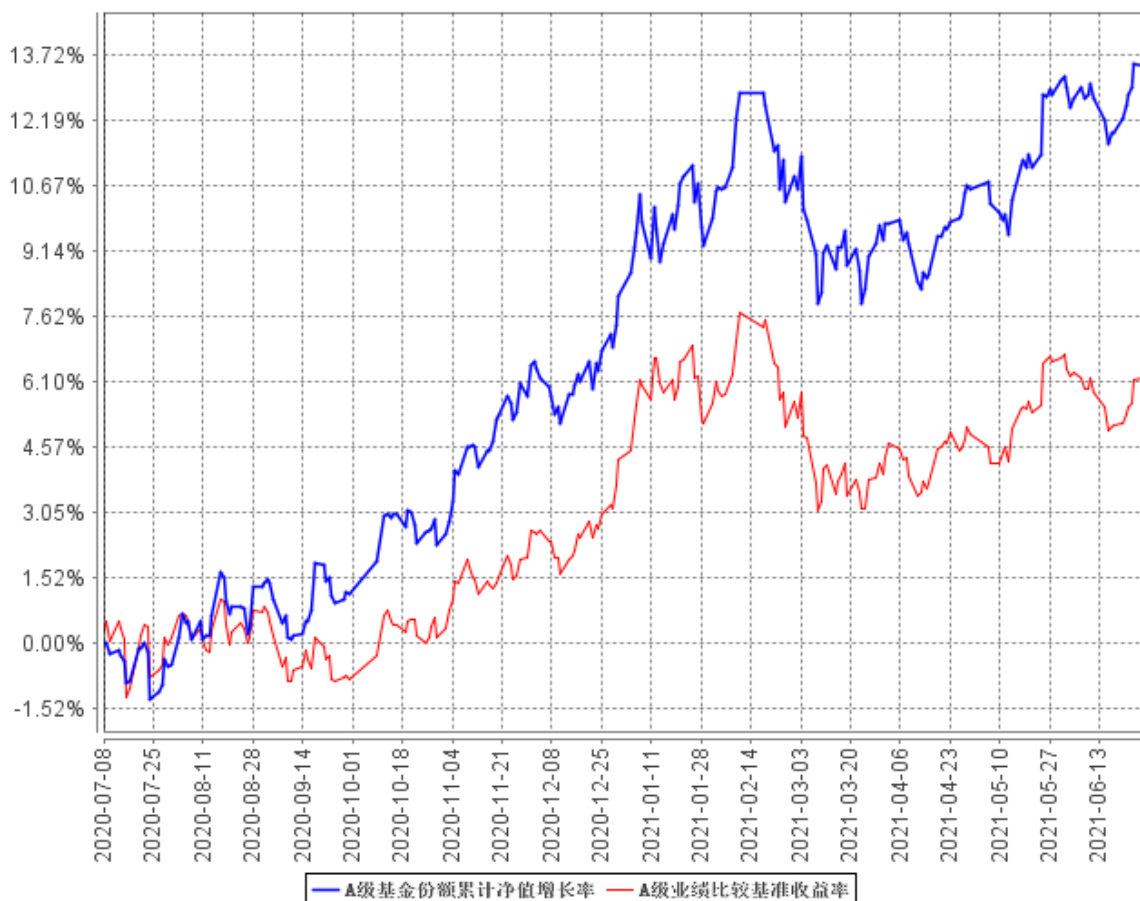


九泰聚鑫混合 C

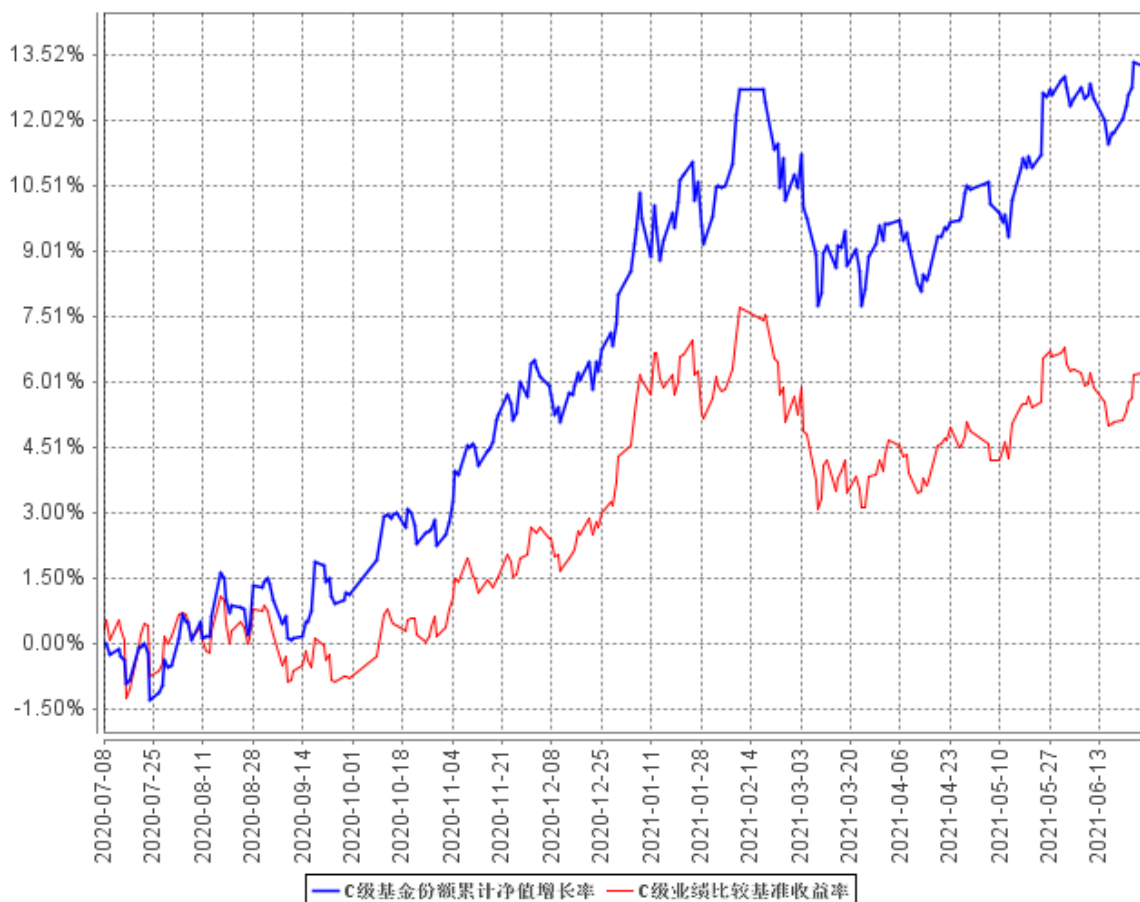
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.69%	0.30%	-0.54%	0.25%	1.23%	0.05%
过去三个月	4.07%	0.35%	2.07%	0.30%	2.00%	0.05%
过去六个月	5.29%	0.48%	1.74%	0.40%	3.55%	0.08%
自基金合同生效起至今	13.71%	0.43%	6.09%	0.38%	7.62%	0.05%

### 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 2020 年 7 月 8 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效不满一年，距建仓期结束不满一年。

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，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人，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		
吴祖尧	基金经理、副总经理	2020 年 7 月 8 日	-	26	清华大学工学硕士，中国籍，具有基金从业资格，26 年金融证券从业经验。曾任中国信达信托投资公司证券研究部副经理，中国银河证券研究中心研究主管、董事总经理，中国银河证券投行内核小组成员，中国银河证券投资顾问部董事总经理，中国银河证券投资决策委员会委员。2014 年加入九泰基金管理有限公司，曾任九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金（2015 年 12 月 9 日至 2018 年 6 月 5 日）、九泰泰富定增主题灵活配置混合型证券投资基金（2016 年 9 月 26 日至 2018 年 6 月 5 日）的基金经理，现任副总经理，九泰科盈价值灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 3 月 12 日至今）、九泰科鑫策略精选灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 5 月 14 日至今）、九泰动态策略灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 6 月 18 日至今）、九泰聚鑫混合型证券投资基金（2020 年 7 月 8 日至今）、九泰科新优享灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 8 月 17 日至今）、九泰行业优选灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 8 月 18 日至今）的基金经理。

袁多武	基金经理	2020 年 7 月 24 日	-	6	复旦大学经济学硕士，中国籍，具有基金从业资格，6 年证券从业经验。曾任中国长江三峡集团公司国际投资部业务主管，2015 年 5 月加入九泰基金管理有限公司，曾任产业投资部先进制造行业组执行投资总监、科技创新投资部高端装备行业执行总监、投资经理，现任战略投资部基金经理，九泰聚鑫混合型证券投资基金（2020 年 7 月 24 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，股票市场宽幅震荡，结构分化和风格切换明显，总体市场主线围绕全球经济复苏、高景气高成长行业、碳中和等三条主线展开。在股票投资方面，本基金主要从自下而上的角度精选个股，严格执行价值投资，通过深入研究，寻找有较高质量增长能力的公司，力争在低估时买入，获取企业价值增长的长期回报。组合中优质稳健类型的股票占比较大。在本报告期内，本基金侧重配置于兼具成长性和性价比的股票，这些股票主要分布在金融、顺周期、消费、新能源、军工、计算机、电子、通信等行业。在精选个股的基础上，本基金以分散投资、均衡配置、动态调整的策略，来降低净值的波动和控制回撤。债券投资方面，由于债券市场处于小幅震荡向上的环境中，在权衡机会与风险下，本基金逐步拉长债券的久期，均衡配置短久期和长久期利率债。

##### 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 1.1394 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.39%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.1371 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.29%；同期业绩比较基准收益率为 1.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体而言，我们认为目前是一个货币平衡偏松、信用较弱、经济边际减弱的组合。展望未来，大概率会出现更加宽松的财政与货币政策。在中国经济边际放缓但具韧性、政策预期向好的背景下，权益市场或将具有配置机会，并出现明显的结构分化和风格转换。

#### 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种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，本基金托管人严格遵守《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，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，九泰聚鑫混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。



## § 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：九泰聚鑫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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,556,465.10	2,571,804.35
结算备付金		793,356.19	3,433,315.87
存出保证金		91,726.80	206,404.27
交易性金融资产	6.4.7.2	322,216,620.87	195,634,673.89
其中：股票投资		128,479,234.17	122,175,551.39
基金投资		-	-
债券投资		193,737,386.70	73,459,122.50
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	11,000,000.00	120,000,000.00
应收证券清算款		1,241,197.84	2,209,069.41
应收利息	6.4.7.5	2,327,967.67	1,433,250.45
应收股利		-	-
应收申购款		247,348.67	197.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		342,474,683.14	325,488,715.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		464,870.30	700,757.14
应付管理人报酬		223,534.44	220,344.64
应付托管费		55,883.59	55,086.15
应付销售服务费		46,241.14	37,928.61
应付交易费用	6.4.7.7	68,889.50	146,702.10
应交税费		134.74	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	90,225.85	55,613.20
负债合计		949,779.56	1,216,431.84
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	300,243,058.61	300,156,547.16
未分配利润	6.4.7.10	41,281,844.97	24,115,736.28
所有者权益合计		341,524,903.58	324,272,283.44
负债和所有者权益总计		342,474,683.14	325,488,715.28

注：1、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，九泰聚鑫混合 A 类基金份额净值人民币 1.1394 元，九泰聚鑫混合 C 类基金份额净值人民币 1.1371 元；基金份额总额 300,243,058.61 份，其中九泰聚鑫混合 A 类基金份额 50,686,502.63 份，九泰聚鑫混合 C 类基金份额 249,556,555.98 份。

2、本基金合同生效日为 2020 年 7 月 8 日，2020 年度实际报告期为 2020 年 7 月 8 日至 2020 年 12 月 31 日。

## 6.2 利润表

会计主体：九泰聚鑫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
<b>一、收入</b>		20,219,461.73	-
1.利息收入		2,569,590.24	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	132,759.01	-
债券利息收入		1,592,471.40	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		844,359.83	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		21,388,873.26	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,168,789.09	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,315.67	-
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	1,213,768.50	-
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	-3,804,620.16	-

“-”号填列)			
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	65,618.39	-
<b>减：二、费用</b>		2,621,952.72	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,425,404.86	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	356,351.12	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	285,750.59	-
4. 交易费用	6.4.7.19	461,111.63	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		31.96	-
7. 其他费用	6.4.7.20	93,302.56	-
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		17,597,509.01	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		17,597,509.01	-

注：本基金合同生效日为2020年7月8日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：九泰聚鑫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)	300,156,547.16	24,115,736.28	324,272,283.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,597,509.01	17,597,509.01
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)	86,511.45	-431,400.32	-344,888.87

其中：1.基金申购款	80,063,464.66	7,550,374.00	87,613,838.66
2.基金赎回款	-79,976,953.21	-7,981,774.32	-87,958,727.53
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）	300,243,058.61	41,281,844.97	341,524,903.58
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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金合同生效日为 2020 年 7 月 8 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无上年度可比期间。

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

九泰聚鑫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  
第 20 页 共 67 页

称“中国证监会”)证监许可[2019]第 2800 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《九泰聚鑫混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起,于 2020 年 6 月 3 日起至 2020 年 7 月 3 日止向社会公开募集。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。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 230,301,788.94 元(其中,A 类基金份额净认购金额为人民币 96,555,140.58 元,折合 96,555,140.58 份基金份额;C 类基金份额净认购金额为人民币 133,746,648.36 元,折合 133,746,648.36 份基金份额),在募集期间产生的利息为人民币 89,128.50 元(其中,A 类基金份额产生的利息为人民币 51,560.50 元,C 类基金份额产生的利息为人民币 37,568.00 元),以上实收基金(本息)合计为人民币 230,390,917.44 元,折合 230,390,917.44 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[2020]京会兴验字第 69000014 号验资报告。经向中国证监会备案,基金合同于 2020 年 7 月 8 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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰聚鑫混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资对象主要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(包括主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括同业存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债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:沪深 300 指数收益率 $\times$ 30%+中国债券总指数收益率 $\times$ 70%。

#### 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以及相关规定(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	4,556,465.10
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：	4,556,465.10

### 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	117,193,439.83	128,479,234.17	11,285,794.34
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	52,922,344.68	52,814,386.70
	银行间市场	140,677,060.00	140,923,000.00
	合计	193,599,404.68	193,737,386.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	310,792,844.51	322,216,620.87	11,423,776.36

### 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

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	11,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	11,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 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	749.55
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	629.40
应收债券利息	2,324,703.01
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,848.54
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	37.17
合计	2,327,967.67

注：其他指应收保证金利息。

#### 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	67,414.50
银行间市场应付交易费用	1,475.00
合计	68,889.50



## 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	1,423.29
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	24,795.19
预提账户维护费	4,500.00
合计	90,225.85

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

九泰聚鑫混合 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	90,387,338.85	90,387,338.85
本期申购	1,160,432.17	1,160,432.17
本期赎回(以“-”号填列)	-40,861,268.39	-40,861,268.39
- 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	50,686,502.63	50,686,502.63

金额单位：人民币元

九泰聚鑫混合 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	209,769,208.31	209,769,208.31
本期申购	78,903,032.49	78,903,032.49
本期赎回(以“-”号填列)	-39,115,684.82	-39,115,684.82
- 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	249,556,555.98	249,556,555.98
-----	----------------	----------------

注：本期申购中包含转换入份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

九泰聚鑫混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,542,392.86	4,786,384.27	7,328,777.13
本期利润	4,239,281.40	-422,862.13	3,816,419.27
本期基金份额交易产生的变动数	-1,952,765.30	-2,128,695.34	-4,081,460.64
其中：基金申购款	57,575.35	66,045.85	123,621.20
基金赎回款	-2,010,340.65	-2,194,741.19	-4,205,081.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,828,908.96	2,234,826.80	7,063,735.76

单位：人民币元

九泰聚鑫混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,686,412.10	11,100,547.05	16,786,959.15
本期利润	17,162,847.77	-3,381,758.03	13,781,089.74
本期基金份额交易产生的变动数	372,017.37	3,278,042.95	3,650,060.32
其中：基金申购款	2,705,904.95	4,720,847.85	7,426,752.80
基金赎回款	-2,333,887.58	-1,442,804.90	-3,776,692.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,221,277.24	10,996,831.97	34,218,109.21

#### 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	18,989.91
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	109,064.35
其他	4,704.75
合计	132,759.01

注：其他包括结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

**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	151,029,912.43
减：卖出股票成本总额	130,861,123.34
买卖股票差价收入	20,168,789.09

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	6,315.67
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	6,315.67

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	45,423,640.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	44,846,181.83
减：应收利息总额	571,142.87
买卖债券差价收入	6,315.67

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13.5 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	1,213,768.50
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	1,213,768.50

**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	-3,804,620.16
——股票投资	-3,840,456.87
——债券投资	35,836.71
——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	-3,804,620.16

**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	65,618.39
合计	65,618.39

### 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	459,636.63
银行间市场交易费用	1,475.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	461,111.63

### 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	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	93,302.56

## 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

华夏银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
------------	--------------

#### 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

本基金本报告期内无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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	1,425,404.86	-
其中：支付销售机构的客户维护费	113,667.52	-

注：1、本基金合同于 2020 年 7 月 8 日生效，无上年度可比期间；

2、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

基金管理费每日计提，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核对一致后，由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基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	356,351.12	-

注：1、本基金合同于 2020 年 7 月 8 日生效，无上年度可比期间；

2、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

基金托管费每日计提，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核对一致后，由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提取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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 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		
	九泰聚鑫混合 A	九泰聚鑫混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	256,484.39	256,484.39
华夏银行股份有限公司	-	19,529.12	19,529.12
合计	-	276,013.51	276,013.51
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		
	九泰聚鑫混合 A	九泰聚鑫混合 C	合计
合计	-	-	-

注：1、本基金合同于 2020 年 7 月 8 日生效，无上年度可比期间；

2、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 0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由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提取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按照相关合同规定支付给基金

销售机构等。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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金报告期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

本基金于本报告期末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
华夏银行股份有限公司	4,556,465.10	18,989.91	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏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

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。本基金于 2020 年 7 月 8 日成立，基金合同于 2020 年 7 月 8 日生效，无上年度可比期间数据。



**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内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（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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002752	昇兴股份	2021年3月19日	2021年9月22日	非公开发行流通受限	5.19	5.45	578,035	3,000,001.65	3,150,290.75	-
300232	洲明科技	2021年4月22日	2021年10月26日	非公开发行流通受限	7.90	8.57	37,975	300,002.50	325,445.75	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300702	天宇股份	2021年1月18日	2021年7月20日	非公开发行流通受限	80.95	34.49	6,739	303,076.80	232,428.11	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	412	10,135.20	67,156.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月	新股流通	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-

		日	月 7 日	受限						
300929	华骐 环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股 流通 受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300931	通用 电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股 流通 受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰 股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股 流通 受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易 购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股 流通 受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极 光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股 流通 受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识 科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股 流通 受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞 生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股 流通 受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖 智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 流通 受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡 龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 流通 受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中 生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股 流通 受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固 特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月	新股 流通	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-

		日	月 3 日	受限						
300952	恒辉 安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股 流通 受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕 科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股 流通 受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股 流通 受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力 股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	47.33	251.96	310	14,672.30	78,107.60	-
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股 流通 受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股 流通 受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同 药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-

		日	月 15 日	受限						
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	33.22	87.50	514	17,075.08	44,975.00	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	48.59	90.39	322	15,645.98	29,105.58	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月	新股流通	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

		日	月 11 日	受限						
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股 流通 受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股 流通 受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股 流通 受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股 流通 受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股 流通 受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股 流通 受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股 流通 受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股 流通 受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

		日	月 17 日	受限						
301012	扬电 科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股 流通 受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和 兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股 流通 受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋 医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔 伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉 平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股 流通 受限	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301018	申菱 环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
301020	密封 科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺 激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中 港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才 股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688076	诺泰 生物	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 17 日	新股 流通	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-

		日	月 22 日	受限						
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股 流通 受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688161	威高骨科	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	36.22	82.27	2,649	95,946.78	217,933.23	-
688195	腾景科技	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688269	凯立新材	2021 年 6 月 1 日	2021 年 12 月 9 日	新股 流通 受限	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688315	诺禾致源	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股 流通 受限	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
688367	工大高科	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 28 日	新股 流通 受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股 流通 受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688533	上声电子	2021 年 4 月 9 日	2021 年 10 月 19 日	新股 流通 受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688565	力源科技	2021 年 5 月 6 日	2021 年 11 月 15 日	新股 流通 受限	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
688611	杭州柯林	2021 年 4 月 1 日	2021 年 10	新股 流通	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-

		日	月 12 日	受限						
688616	西力 科技	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 22 日	新股 流通 受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
688619	罗普 特	2021 年 2 月 8 日	2021 年 8 月 23 日	新股 流通 受限	19.31	26.74	5,856	113,079.36	156,589.44	-
688625	呈和 科技	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 7 日	新股 流通 受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688655	迅捷 兴	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股 流通 受限	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
688659	元琛 科技	2021 年 3 月 24 日	2021 年 10 月 8 日	新股 流通 受限	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688687	凯因 科技	2021 年 1 月 29 日	2021 年 8 月 9 日	新股 流通 受限	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-
688689	银河 微电	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 27 日	新股 流通 受限	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、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。

3、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》（中



国证券监督管理委员会令第 30 号) 规范的非公开发行股票, 所认购的非公开发行新增股份上市首日起 12 个月或 36 个月内不得转让, 同时按照中国证监会修订的《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》(证监会公告[2017]9 号) 的补充规定, 自股份解除限售之日起 12 个月内, 通过集中竞价交易减持数量不得超过持有该次非公开发行股份数量的 50%。中国证监会于 2020 年 2 月 14 日修改并实施了《上市公司证券发行管理办法》(中国证券监督管理委员会令第 163 号), 所认购的非公开发行新增股份上市首日起 6 个月或 18 个月内不得转让, 同时依据修改后的《上市公司证券发行管理办法》通过非公开发行股票取得的上市公司股份, 其减持不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》的有关规定。

4、截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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。

#### **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、资产支持证券、股指期货、国债期货等。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**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	19,424,986.70	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	19,424,986.70	-

注：1. 长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券，以上列示不包括国债、政策性金融债、央行票据和同业存单。

2. 以上信用评级系根据第三方评估机构的债券评级报告确定。

**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、债券及买入返售金融资产等。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	4,556,465.10	-	-	-	-	-	4,556,465.10
结算备付金	793,356.19	-	-	-	-	-	793,356.19
存出保证金	91,726.80	-	-	-	-	-	91,726.80
交易性金融资产	30,000,000.00	-105,899,642.00	17,323,744.70	40,514,000.00	128,479,234.17	-	322,216,620.87
买入返售金融	11,000,000.00	-	-	-	-	-	11,000,000.00

资产							
应收证 券清算 款		-	-	-	-	1,241,197.84	1,241,197.84
应收利 息		-	-	-	-	2,327,967.67	2,327,967.67
应收申 购款		-	-	-	-	247,348.67	247,348.67
资产总 计	46,441,548.09		-105,899,642.00	17,323,744.70	40,514,000.00	132,295,748.35	342,474,683.14
负债							
应付赎 回款		-	-	-	-	464,870.30	464,870.30
应付管 理人报 酬		-	-	-	-	223,534.44	223,534.44
应付托 管费		-	-	-	-	55,883.59	55,883.59
应付销 售服务 费		-	-	-	-	46,241.14	46,241.14
应付交 易费用		-	-	-	-	68,889.50	68,889.50
应交税 费		-	-	-	-	134.74	134.74
其他负 债		-	-	-	-	90,225.85	90,225.85
负债总 计		-	-	-	-	949,779.56	949,779.56
利率敏 感度缺 口	46,441,548.09		-105,899,642.00	17,323,744.70	40,514,000.00	131,345,968.79	341,524,903.58
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	2,571,804.35	-	-	-	-	-	2,571,804.35
结算备 付金	3,433,315.87	-	-	-	-	-	3,433,315.87
存出保 证金	206,404.27	-	-	-	-	-	206,404.27

交易性金融资产	12,998,700.00	-	29,928,000.00	30,532,422.50	-	122,175,551.39	195,634,673.89
买入返售金融资产	120,000,000.00	-	-	-	-	-	120,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,209,069.41	2,209,069.41
应收利息	-	-	-	-	-	1,433,250.45	1,433,250.45
应收申购款	-	-	-	-	-	197.04	197.04
资产总计	139,210,224.49	-	29,928,000.00	30,532,422.50	-	125,818,068.29	325,488,715.28
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	700,757.14	700,757.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	220,344.64	220,344.64
应付托管费	-	-	-	-	-	55,086.15	55,086.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	37,928.61	37,928.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	146,702.10	146,702.10
其他负债	-	-	-	-	-	55,613.20	55,613.20
负债总计	-	-	-	-	-	1,216,431.84	1,216,431.84
利率敏感度缺口	139,210,224.49	-	29,928,000.00	30,532,422.50	-	124,601,636.45	324,272,283.44

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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）

市场利率下降 25 个基点	1, 029, 629. 96	130, 420. 87
市场利率上升 25 个基点	-1, 009, 402. 33	-129, 822. 80

#### 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	128, 479, 234. 17	37. 62	122, 175, 551. 39	37. 68
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	193, 737, 386. 70	56. 73	73, 459, 122. 50	22. 65
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	322, 216, 620. 87	94. 35	195, 634, 673. 89	60. 33

##### 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%	6,375,783.79	5,863,649.57
	沪深 300 指数下跌 5%	-6,375,783.79	-5,863,649.57

#### 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的余额为人民币 131,621,223.63 元，属于第二层次的余额为人民币 184,531,914.91 元，属于第三层次的余额为人民币 6,063,482.33 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 121,198,988.10 元，属于第二层次 73,653,054.75，第三层次 782,631.04 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属于第三层次的余额为人



人民币 6,063,482.33 元；本报告期因购入带锁定期的股票转入第三层次的金額为人民币 4,618,935.42 元，转出第三层次的金額为人民币 1,074,285.57 元，计入公允价值变动损益的金額为人民币 1,736,201.44 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	128,479,234.17	37.51
	其中：股票	128,479,234.17	37.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	193,737,386.70	56.57
	其中：债券	193,737,386.70	56.57
	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	11,000,000.00	3.21
	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	5,349,821.29	1.56
8	其他各项资产	3,908,240.98	1.14
9	合计	342,474,683.14	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	5,439.50	0.00
B	采矿业	1,171,200.00	0.34
C	制造业	90,059,528.06	26.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	95,577.58	0.03
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	3,641,447.14	1.07
J	金融业	28,914,284.60	8.47
K	房地产业	2,142,900.00	0.63
L	租赁和商务服务业	1,787,900.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	145,471.20	0.04

N	水利、环境和公共设施管理业	78,934.33	0.02
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	398,160.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	128,479,234.17	37.62

### 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	601318	中国平安	120,000	7,713,600.00	2.26
2	002648	卫星石化	168,000	6,583,920.00	1.93
3	601877	正泰电器	180,000	6,008,400.00	1.76
4	601166	兴业银行	270,000	5,548,500.00	1.62
5	002142	宁波银行	140,000	5,455,800.00	1.60
6	600036	招商银行	95,000	5,148,050.00	1.51
7	300146	汤臣倍健	155,000	5,099,500.00	1.49
8	603678	火炬电子	70,000	4,725,000.00	1.38
9	601012	隆基股份	46,200	4,104,408.00	1.20
10	000423	东阿阿胶	107,000	3,842,370.00	1.13
11	300014	亿纬锂能	35,000	3,637,550.00	1.07
12	000333	美的集团	50,000	3,568,500.00	1.04
13	002752	昇兴股份	578,035	3,150,290.75	0.92
14	002493	荣盛石化	165,000	2,849,550.00	0.83
15	601601	中国太保	96,180	2,786,334.60	0.82
16	600309	万华化学	25,000	2,720,500.00	0.80
17	603267	鸿远电子	20,000	2,558,400.00	0.75
18	002415	海康威视	38,000	2,451,000.00	0.72
19	600438	通威股份	55,000	2,379,850.00	0.70
20	000001	平安银行	100,000	2,262,000.00	0.66
21	002353	杰瑞股份	50,000	2,235,000.00	0.65
22	000002	万科 A	90,000	2,142,900.00	0.63
23	601137	博威合金	160,000	1,835,200.00	0.54

24	002027	分众传媒	190,000	1,787,900.00	0.52
25	600887	伊利股份	48,000	1,767,840.00	0.52
26	300724	捷佳伟创	15,000	1,740,150.00	0.51
27	300627	华测导航	50,000	1,705,500.00	0.50
28	300726	宏达电子	21,000	1,480,290.00	0.43
29	002987	京北方	41,400	1,322,730.00	0.39
30	600660	福耀玻璃	22,000	1,228,700.00	0.36
31	600426	华鲁恒升	39,437	1,220,575.15	0.36
32	002925	盈趣科技	30,600	1,190,646.00	0.35
33	601088	中国神华	60,000	1,171,200.00	0.34
34	002271	东方雨虹	20,000	1,106,400.00	0.32
35	300682	朗新科技	65,000	1,093,300.00	0.32
36	600399	抚顺特钢	60,000	1,088,400.00	0.32
37	603558	健盛集团	120,000	1,042,800.00	0.31
38	300502	新易盛	32,206	1,006,437.50	0.29
39	600522	中天科技	100,000	1,000,000.00	0.29
40	002884	凌霄泵业	42,000	978,180.00	0.29
41	601058	赛轮轮胎	90,000	899,100.00	0.26
42	600031	三一重工	30,000	872,100.00	0.26
43	002078	太阳纸业	60,000	801,000.00	0.23
44	688639	华恒生物	16,000	767,840.00	0.22
45	002025	航天电器	15,000	752,550.00	0.22
46	300369	绿盟科技	45,000	717,750.00	0.21
47	000911	南宁糖业	70,000	712,600.00	0.21
48	600737	中粮糖业	70,000	700,700.00	0.21
49	300587	天铁股份	30,000	673,500.00	0.20
50	300630	普利制药	12,000	628,800.00	0.18
51	601677	明泰铝业	30,000	586,500.00	0.17
52	601567	三星医疗	25,000	532,500.00	0.16
53	000513	丽珠集团	10,000	500,200.00	0.15
54	002597	金禾实业	14,000	485,800.00	0.14
54	603456	九洲药业	10,000	485,800.00	0.14
55	603187	海容冷链	11,200	480,256.00	0.14
56	603989	艾华集团	14,000	456,260.00	0.13
57	002064	华峰化学	30,000	426,000.00	0.12
58	600519	贵州茅台	200	411,340.00	0.12
59	603225	新风鸣	20,000	406,000.00	0.12
60	603096	新经典	12,000	398,160.00	0.12
61	002327	富安娜	49,570	383,671.80	0.11

62	002223	鱼跃医疗	10,000	381,300.00	0.11
63	000338	潍柴动力	20,000	357,400.00	0.10
64	300232	洲明科技	37,975	325,445.75	0.10
65	300379	东方通	10,000	284,900.00	0.08
66	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.07
67	300702	天宇股份	6,739	232,428.11	0.07
68	688161	威高骨科	2,649	217,933.23	0.06
69	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.06
70	300767	震安科技	2,000	166,100.00	0.05
71	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.05
72	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.04
73	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.04
74	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.03
75	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.03
76	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
77	300957	贝泰妮	310	78,107.60	0.02
78	300919	中伟股份	412	67,156.00	0.02
79	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.02
80	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
81	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.02
82	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
83	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.02
84	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.02
85	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
86	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.01
87	300979	华利集团	514	44,975.00	0.01
88	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
89	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
90	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
91	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.01
92	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
93	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.01
94	300981	中红医疗	322	29,105.58	0.01
95	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
96	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
97	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
98	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
99	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
100	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01

101	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
102	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
103	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
104	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
105	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
106	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
107	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
108	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
109	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
110	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
111	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
112	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
113	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
114	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
115	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
116	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
117	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
118	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
119	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
120	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
121	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
122	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
123	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
124	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
125	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
126	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
127	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
128	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
129	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
130	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
131	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
132	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
133	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
134	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
135	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
136	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
137	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
138	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
139	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00

140	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
141	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
142	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
143	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
144	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
145	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
146	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
147	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
148	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
149	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
150	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
151	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
152	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 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	600519	贵州茅台	6,962,101.00	2.15
2	601318	中国平安	6,398,176.00	1.97
3	002142	宁波银行	5,990,921.00	1.85
4	601877	正泰电器	5,895,946.00	1.82
5	601166	兴业银行	4,630,526.00	1.43
6	601601	中国太保	4,182,931.00	1.29
7	603712	七一二	3,714,798.08	1.15
8	600036	招商银行	3,467,298.00	1.07
9	002493	荣盛石化	3,412,707.00	1.05
10	002752	昇兴股份	3,000,001.65	0.93
11	000858	五粮液	2,790,160.00	0.86
12	002648	卫星石化	2,712,621.00	0.84
13	603678	火炬电子	2,502,979.00	0.77
14	002415	海康威视	2,390,798.00	0.74
15	002985	北摩高科	2,326,549.00	0.72
16	002353	杰瑞股份	2,197,808.00	0.68
17	003816	中国广核	2,168,000.00	0.67

18	600809	山西汾酒	2,080,000.00	0.64
19	300724	捷佳伟创	2,063,073.00	0.64
20	002027	分众传媒	2,026,641.00	0.62

#### 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	600048	保利地产	8,655,811.00	2.67
2	000002	万科 A	7,953,105.00	2.45
3	600519	贵州茅台	6,630,978.00	2.04
4	000858	五粮液	6,562,602.00	2.02
5	601318	中国平安	4,965,345.00	1.53
6	603712	七一二	4,419,683.00	1.36
7	601939	建设银行	3,588,079.29	1.11
8	000001	平安银行	3,126,492.00	0.96
9	601838	成都银行	3,120,000.00	0.96
10	603267	鸿远电子	3,091,605.00	0.95
11	603678	火炬电子	2,922,761.00	0.90
12	600383	金地集团	2,909,941.00	0.90
13	601601	中国太保	2,830,727.00	0.87
14	002142	宁波银行	2,670,443.00	0.82
15	300146	汤臣倍健	2,529,170.00	0.78
16	300014	亿纬锂能	2,487,944.00	0.77
17	000568	泸州老窖	2,466,986.00	0.76
18	002985	北摩高科	2,276,674.00	0.70
19	003816	中国广核	2,256,000.00	0.70
20	600438	通威股份	2,139,498.30	0.66

#### 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	141,005,262.99
卖出股票收入（成交）总额	151,029,912.43

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**

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	174,312,400.00	51.04
	其中：政策性金融债	174,312,400.00	51.04
4	企业债券	9,859,000.00	2.89
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	9,565,986.70	2.80
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	193,737,386.70	56.73

**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**

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	018006	国开 1702	330,000	33,389,400.00	9.78
2	210205	21 国开 05	300,000	30,375,000.00	8.89
3	170206	17 国开 06	300,000	30,354,000.00	8.89
4	210201	21 国开 01	300,000	30,018,000.00	8.79
5	200406	20 农发 06	300,000	30,000,000.00	8.78

**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股指期货。报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 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中，海通证券股份有限公司和招商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：

一、2021 年 3 月 30 日，中国证券监督管理委员会上海监管局对海通证券股份有限公司作出了行政处罚（沪证监决（2021）40 号），主要内容为：1、公司在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第 151 号）第三条第二款和《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号，经证监会令第 166 号修正，以下简称《合规办法》）第六条第八项的规定；2、公司未将相关业务行为纳入全面合规风控体系，合规风控机制存在缺失，违反了《合规办法》第三条和《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第 125 号，经证监会令第 166 号修正）第六条第一款的规定；3、公司投资银行业务内部控制存在漏洞，债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离，利益冲突审查机制存在缺失，不符合《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》（银发[2017]302 号）第二条第二项和《证券公司投资银行类业务内部控制指引》（证监会公告[2018]6 号）第四十五条的规定，违反了《合规办法》第六条第六项的规定。中国证券监督管理委员会上海监管局对该公司采取如下监督管理措施：1、责令该公司自本决定作出之日起 1 年内，每 3 个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，向上海监管局报送合规检查报告；2、责令该公司自本决定作出之日起 12 个月内，暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务。

二、2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对招商银行股份有限公司作出了行政处罚（银保监罚决字（2021）16 号），主要内容为：1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；3、理财产品之间风险隔离不到位；4、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；5、同业投资接受第三方金融机构信用担保；6、理财资金池化运作；7、利用理财产品准备金调节收益；8、高净值客户认定不审慎；9、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；10、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；11、投资集合资金信托计划人数超限；12、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品 13、信贷资产非真实转让；14、全权委托业务不规范；15、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；

16、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；17、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；18、票据转贴现假卖断屡查屡犯；19、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；20、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；21、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；22、理财资金认购商业银行增发的股票；23、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；24、为定制公募基金提供投资顾问；25、为本行承销债券兑付提供资金支持；26、协助发行人以非市场化的价格发行债券；27、瞒报案件信息。中国银行保险监督管理委员会对该银行罚款 7170 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，其他八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	91,726.80
2	应收证券清算款	1,241,197.84
3	应收股利	-
4	应收利息	2,327,967.67
5	应收申购款	247,348.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,908,240.98

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113021	中信转债	3,167,100.00	0.93
2	132015	18 中油 EB	3,089,995.00	0.90
3	132004	15 国盛 EB	2,101,242.00	0.62

4	110059	浦发转债	1,207,649.70	0.35
---	--------	------	--------------	------

#### 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
九泰聚鑫混合 A	300	168,955.01	29,238,791.42	57.69%	21,447,711.21	42.31%
九泰聚鑫混合 C	244	1,022,772.77	234,498,941.20	93.97%	15,057,614.78	6.03%
合计	544	551,917.39	263,737,732.62	87.84%	36,505,325.99	12.16%

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	九泰聚鑫混合 A	17,944.15	0.0354%
	九泰聚鑫混合 C	268,009.76	0.1074%
	合计	285,953.91	0.0952%

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	九泰聚鑫混合 A	0
	九泰聚鑫混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	九泰聚鑫混合 A	0
	九泰聚鑫混合 C	10~50
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰聚鑫混合 A	九泰聚鑫混合 C
基金合同生效日（2020 年 7 月 8 日）基金份额总额	96,606,701.08	133,784,216.36
本报告期期初基金份额总额	90,387,338.85	209,769,208.31
本报告期基金总申购份额	1,160,432.17	78,903,032.49
减：本报告期基金总赎回份额	40,861,268.39	39,115,684.82
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	50,686,502.63	249,556,555.98

注：总申购份额含转换入份额。

## § 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：

本报告期内，本基金托管人 2021 年 5 月 11 日发布公告，胡捷先生自 2021 年 4 月 30 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

### 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	
渤海证券	2	280,692,048.94	100.00%	261,409.92	100.00%	-

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：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
渤海证券	26,529,798.82	100.00%	3,015,500,000.00	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	九泰聚鑫混合型证券投资基金招募说明书更新	规定网站	2021年1月15日
2	九泰聚鑫混合型证券投资基金（九泰聚鑫混合A份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2021年1月15日
3	九泰聚鑫混合型证券投资基金（九泰聚鑫混合C份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2021年1月15日
4	九泰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	证监会规定报刊和规定网站	2021年1月20日
5	九泰基金管理有限公司旗下基金2020年第4季度报告提	规定报刊	2021年1月22日



	示性公告		
6	九泰聚鑫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
7	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
8	九泰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	证监会规定报刊和规定网站	2021 年 3 月 23 日
9	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
10	九泰聚鑫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
11	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
12	九泰聚鑫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
13	九泰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	证监会规定报刊和规定网站	2021 年 4 月 24 日
14	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
机构	1	20210101 至 20210630	147,812,376.82	0.00	0.00	147,812,376.82	49.23%

#### 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

2021 年 8 月 31 日