

# 九泰天利量化股票型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 10 月 12 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<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.....	14
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.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	56
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
8.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	58
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
11.4 基金投资策略的改变 .....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
11.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
13.1 备查文件目录 .....	64
13.2 存放地点 .....	64
13.3 查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	九泰天利量化股票型证券投资基金	
基金简称	九泰天利量化	
基金主代码	011589	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 10 月 12 日	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	54,927,816.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C
下属分级基金的交易代码:	011589	011590
报告期末下属分级基金的份额总额	8,967,217.27 份	45,960,599.61 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用量化多策略模型，寻找具备长期投资价值的优秀企业，同时有效控制组合风险，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析以及对资本市场趋势的判断，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的长期回报。</p> <p>本基金采用量化多策略进行股票投资。量化多策略体系的理念主要有两个：一方面寻找长期具备投资价值的优质企业，获取超越指数的收益；另一方面使用多个策略并依照当时市场情况进行轮动，在一定程度上可以分散风险。</p> <p>本基金投资策略还包括债券投资策略、股指期货投资策略等。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	九泰基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛
	联系电话	010-57383999
	电子邮箱	chenpei@jtamc.com
客户服务电话	400-628-0606	95511-3
传真	010-57383867	0755-82080387
注册地址	北京市丰台区丽泽路 18 号	广东省深圳市罗湖区深南东路

	院 1 号楼 801-16 室	5047 号
办公地址	北京市朝阳区安立路 30 号 仰山公园 2 号楼 1 栋西侧一 层、二层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	100020	518001
法定代表人	严军	谢永林

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通 合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	九泰基金管理有限公司	北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 2 号楼 1 栋西侧一层、二层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年10月12日(基金合同生效日)-2021年12月31日		2020年		2019年	
	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C
本期已实现收益	-56,140.70	-486,067.38	-	-	-	-
本期利润	26,881.49	-53,112.07	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0025	-0.0004	-	-	-	-
本期加权平均净值利润率	0.25%	-0.04%	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	0.34%	0.23%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	-53,959.30	-326,005.37	-	-	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0060	-0.0071	-	-	-	-
期末基金资产净值	8,997,905.16	46,067,891.72	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0034	1.0023	-	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	0.34%	0.23%	-	-	-	-

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即12月31日。

4、本基金基金合同生效日为2021年10月12日，截至本报告期末本基金成立未满一年，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

九泰天利量化 A

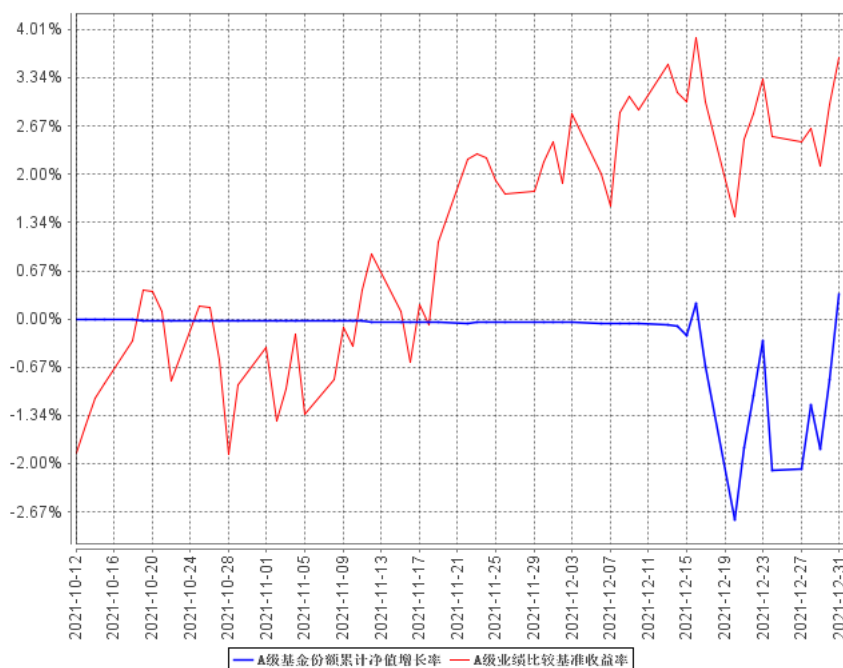
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.34%	0.50%	3.61%	0.73%	-3.27%	-0.23%

九泰天利量化 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.23%	0.50%	3.61%	0.73%	-3.38%	-0.23%

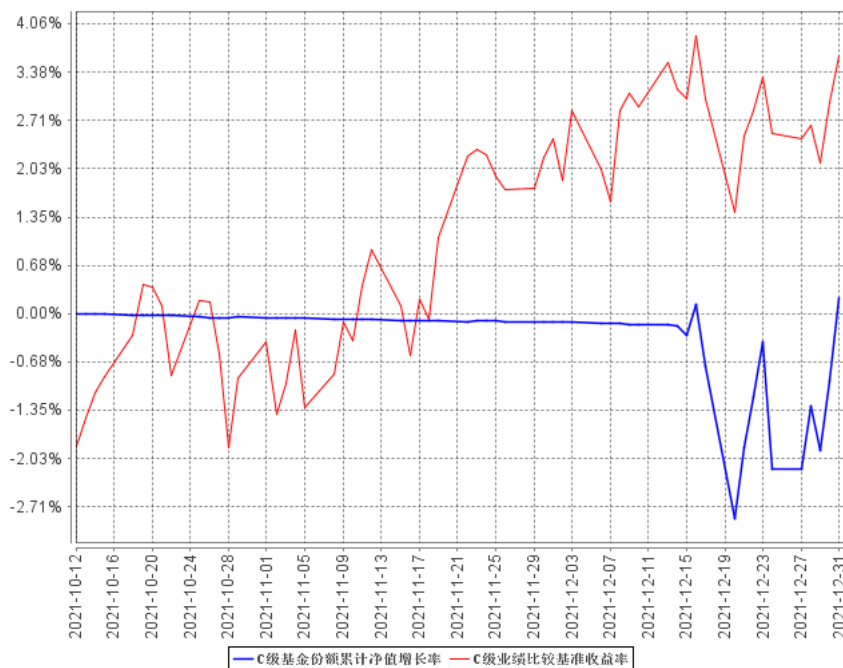
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

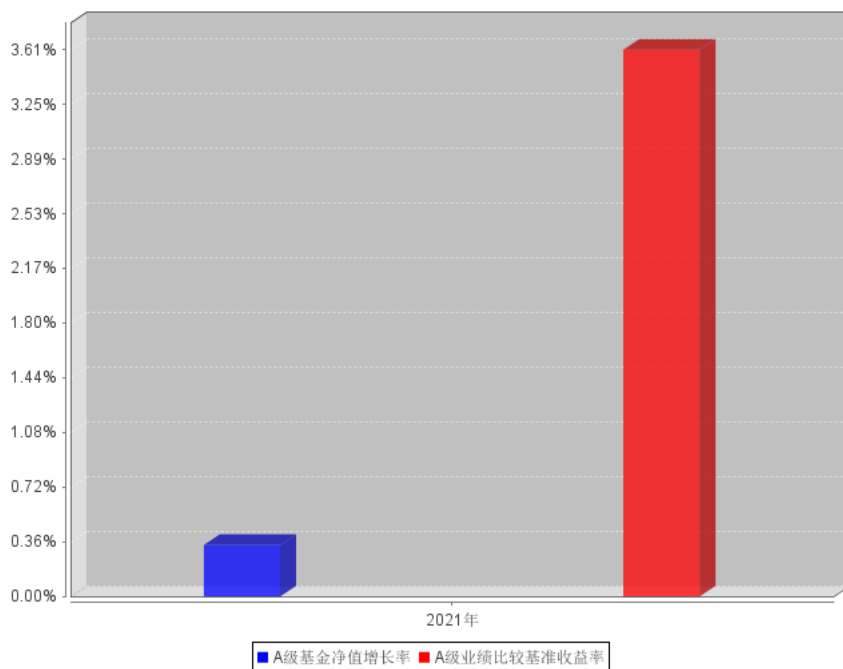


注：1. 本基金合同于 2021 年 10 月 12 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效不满一年。

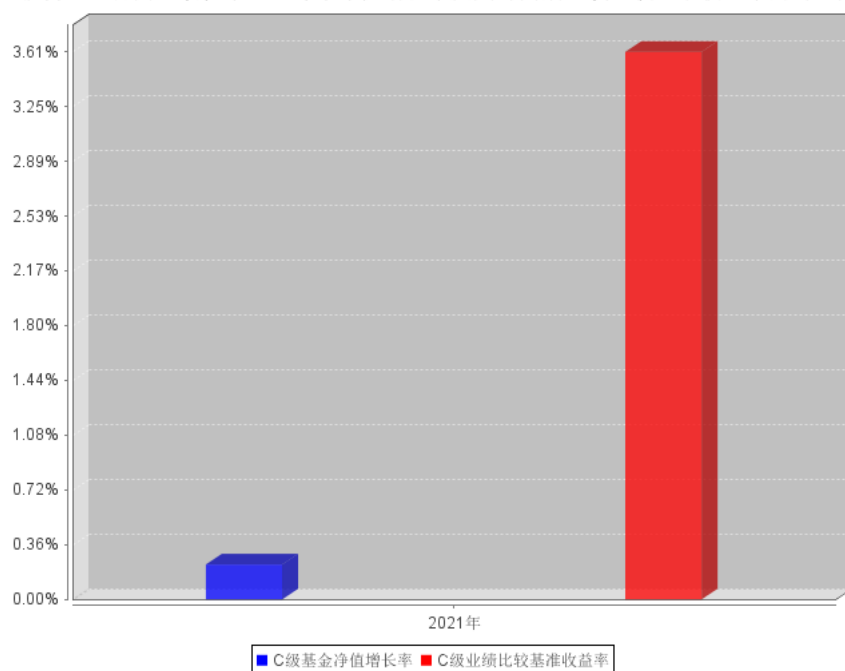
2. 根据基金合同的约定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2021 年 10 月 12 日生效，合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同生效日为 2021 年 10 月 12 日，截至本报告期末（2021 年 12 月 31 日）未进行利润分配。

## § 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。

截至本报告期末（2021 年 12 月 31 日），基金管理人共管理 32 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、九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、九泰泰富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、九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金、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、九泰久元量化股票型证券投资基金、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、九泰久安量化股票型证券投资基金、九泰天兴量化智选股股票型证券投资基金、九泰盈泰量化股票型证券投资基金、九泰天利量化股票型证券投资基金。

## 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		
杨飞	基金经理、九章量化投资部总经理	2021年12月2日	-	5	金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格，5年证券从业经验。曾任思高方达基金服务（加拿大）基金分析部总监、汇丰银行投资银行部副总经理、桐湾投资管理咨询（上海）有限公司量化投研部投资总监、联储证券有限责任公司资产管理部投资总监、大同证券上海资产管理分公司副总经理兼投资总监。2021年10月加入九泰基金管理有限公司，任九章量化投资部总经理，九泰天利量化股票型证券投资基金（2021年12月2日至今）的基金经理。
李响	基金经理	2021年10月12日	-	11	中国科学技术大学硕士，中国籍，具有基金从业资格。11年证券从业经验。先后就职于博时基金、交银施罗德基金及南方基金。2015年6月加入九泰基金管理有限公司，曾任绝对收益部投资经理，九泰久远量化驱动股票型证券投资基金（2020年6月1日至2021年12月15日）的基金经理。现任天元量化投资部基金经理，九泰久

					兴灵活配置混合型证券投资基金(2019年12月25日至今)、九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金(2019年12月25日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年6月1日至今)、九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金(2021年1月7日至今)、九泰量化新兴产业混合型证券投资基金(2021年4月28日至今)、九泰久慧混合型证券投资基金(2021年5月19日至今)、九泰久安量化股票型证券投资基金(2021年7月2日至今)、九泰天兴量化智选股票型证券投资基金(2021年8月12日至今)、九泰天利量化股票型证券投资基金(2021年10月12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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，公平交易制度，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度的规定。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所管理的投资组合，在参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况共出现了 2 次，未发现异常。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

报告期内，股票市场分化较为严重，结构化行情明显。本基金主要采用多策略进行股票投资：一方面是使用量化多策略按照当时市场情况进行轮动择股，另一方面是寻找具备长期投资价值的优质企业，两种理念并行来为本基金增厚收益，分散风险。同时，本基金建仓期也通过控制股票仓位高低来降低系统性风险带来的损失。在债券投资方面，主要投资于国债逆回购，维持资金流动性的同时也增厚产品的收益。

#### 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 1.0034 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.34%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.0023 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.23%；同期

业绩比较基准收益率为 3.61%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 2022 年将会是货币及财政双宽松的一年，权益市场也将会呈现结构性机会大于整体机会的现状。传统的核心资产代表医药和消费在经过 2021 年的调整之后，2022 年中会具有一定的性价比和吸引力。另外一个注意的方向是那些因为客观政策或疫情受到影响企业是否会迎来困境反转，其中要注意行业基本面是否真的迎来了改变。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，本基金管理人从合法、合规、为持有人创造价值出发，依照公司内部控制的整体要求，持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司在投资管理、研究支持、证券交易、基金运营、市场销售、客户服务、反洗钱、员工投资行为管理等多方面制订有相应制度，并进行及时的修订更新，持续完善公司合规制度建设；通过开展合规咨询、合规审查、合规培训、合规考试、合规问责等形式，不断提升员工的合规守法意识；通过对业务部门专兼职合规管理员的培训和管理，强化业务合规管理，将合规管理内置到前台业务中。在风险控制方面，持续推动风险控制前置，对新产品和新业务的风险控制方面加强布局，加强防控风险，保护持有人利益；持续加强投资风险监控工作，通过人员培训、系统建设、流程梳理等手段不断提高风险监控能力，把控投资风险；加强绩效评价工作频率和质量，积极促进投研业务水平提高。在监察稽核方面，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展各项业务的专项稽核，对于发现的问题及时提出整改要求并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制定的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。对下属管理的不同基

金持有的具有相同特征的同一投资品种的估值原则、程序及技术保持一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。

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

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

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

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

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

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

本基金报告期内未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P02220 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	九泰天利量化股票型证券投资基金全体持有人：
审计意见	<p>我们审计了九泰天利量化股票型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了九泰天利量化股票型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于九泰天利量化股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>九泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括九泰天利量化股票型证券投资基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报</p>

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

	<p>相关披露：如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致九泰天利量化股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	郝琪   杨婧
会计师事务所的地址	中国·上海
审计报告日期	2022 年 3 月 30 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：九泰天利量化股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,360,471.36	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	49,650,970.95	-
其中：股票投资		49,650,970.95	-
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,200,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	-839.58	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		55,210,602.73	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		125.07	-
应付管理人报酬		70,374.64	-
应付托管费		4,691.64	-
应付销售服务费		19,614.50	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	50,000.00	-
负债合计		144,805.85	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	54,927,816.88	-
未分配利润	7.4.7.10	137,980.00	-
所有者权益合计		55,065,796.88	-
负债和所有者权益总计		55,210,602.73	-

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，九泰天利量化 A 份额净值为人民币 1.0034 元，九泰天利量化 C 份额净值为人民币 1.0023 元；基金份额总额为 54,927,816.88 份，九泰天利量化 A 份额 8,967,217.27 份，九泰天利量化 C 份额 45,960,599.61 份；

2、本基金合同生效日为 2021 年 10 月 12 日，本会计期间为 2021 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止。截至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同期比较数据。

## 7.2 利润表

会计主体：九泰天利量化股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 10 月 12 日(基金 合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		713,602.28	-
1.利息收入		306,383.85	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	67,026.53	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		239,357.32	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-161,389.75	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-161,389.75	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	515,977.50	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	52,630.68	-
<b>减：二、费用</b>		739,832.86	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	440,615.49	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	29,374.38	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	135,131.19	-
4. 交易费用	7.4.7.19	84,311.80	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	50,400.00	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-26,230.58	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-26,230.58	-

注：本基金合同生效日为 2021 年 10 月 12 日，本会计期间为 2021 年 10 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。截至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同期比较数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰天利量化股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 10 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 10 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	236,811,046.61	-	236,811,046.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-26,230.58	-26,230.58
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	-181,883,229.73	164,210.58	-181,719,019.15

列)			
其中：1. 基金申购款	113,438.73	-134.38	113,304.35
2. 基金赎回款	-181,996,668.46	164,344.96	-181,832,323.50
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）	54,927,816.88	137,980.00	55,065,796.88
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
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 2021 年 10 月 12 日，本会计期间为 2021 年 10 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。截至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同期比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
严军

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
严军

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
荣静

会计机构负责人



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

九泰天利量化股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]第 42 号文准予募集注册并公开发售,由基金管理人九泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关规定和《九泰天利量化股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起,于 2021 年 7 月 5 日起至 2021 年 9 月 30 日止向社会公开募集。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限为不定期。募集期间净认购资金总额为人民币 236,725,377.53 元(其中,A 类基金份额净认购金额为人民币 12,221,809.04 元,折合 12,221,809.04 份基金份额;C 类基金份额净认购金额为人民币 224,503,568.49 元,折合 224,503,568.49 份基金份额),在募集期间产生的利息为人民币 85,669.08 元(其中,A 类基金份额产生的利息为人民币 5,151.17 元,C 类基金份额产生的利息为人民币 80,517.91 元),以上实收基金(本息)合计为人民币 236,811,046.61 元,折合 236,811,046.61 份基金份额。上述募集资金已经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为[2021]京会兴验字第 69000009 号验资报告。经向中国证监会备案,基金合同于 2021 年 10 月 12 日正式生效。本基金的基金管理人为九泰基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰天利量化股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市交易的股票(包含主板、中小板、创业板股票及其他中国证监会核准或注册发行的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则以及相关规定(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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2021 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债),并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产的分类

金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系股指期货投资)于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金将持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款和应收款项。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债应当在初始确认时划分为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款和应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及收到的全部股利和利息计入相关损益，贷款和应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为股指期货投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和中小企业私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值；

(2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值；

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件时，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人的估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估

值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认，于期末全额转入“未分配利润”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；
- (3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；
- (4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率，在实际持有期间内逐日计提；
- (5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入

账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

(3) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》,在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金无需说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金无需说明的重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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，受让方不再缴纳印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,691,161.16	-
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	2,669,310.20	-
合计：	4,360,471.36	-

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	49,134,993.45	49,650,970.95	515,977.50
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	49,134,993.45	49,650,970.95	515,977.50	
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
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	-	-	-	

#### 7.4.7.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,200,000.00	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。



#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	173.04	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	665.74	-
应收结算备付金利息	-	-
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	-1,678.36	-
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	-	-
合计	-839.58	-

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	50,000.00	-
合计	50,000.00	-

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

九泰天利量化 A		
项目	本期 2021 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	12,226,960.21	12,226,960.21
本期申购	71,694.45	71,694.45
本期赎回（以“-”号填列）	-3,331,437.39	-3,331,437.39
- 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	8,967,217.27	8,967,217.27

金额单位：人民币元

九泰天利量化 C		
项目	本期 2021年10月12日(基金合同生效日)至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	224,584,086.40	224,584,086.40
本期申购	41,744.28	41,744.28
本期赎回（以“-”号填列）	-178,665,231.07	-178,665,231.07
- 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	45,960,599.61	45,960,599.61

注：本基金于2021年7月5日起至2021年9月30日止向社会公开募集，截至2021年10月12日(基金合同生效日)止，募集期间净认购资金总额为人民币236,725,377.53元（其中，A类基金份额净认购金额为人民币12,221,809.04元，折合12,221,809.04份基金份额；C类基金份额净认购金额为人民币224,503,568.49元，折合224,503,568.49份基金份额），在募集期间产生的利息为人民币85,669.08元（其中，A类基金份额产生的利息为人民币5,151.17元，C类基金份额产生的利息为人民币80,517.91元），以上实收基金(本息)合计为人民币236,811,046.61元，折合236,811,046.61份基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

九泰天利量化 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-56,140.70	83,022.19	26,881.49
本期基金份额交易产生的变动数	2,181.40	1,625.00	3,806.40

其中：基金申购款	-64.15	5.58	-58.57
基金赎回款	2,245.55	1,619.42	3,864.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-53,959.30	84,647.19	30,687.89

单位：人民币元

九泰天利量化 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-486,067.38	432,955.31	-53,112.07
本期基金份额交易产生的变动数	160,062.01	342.17	160,404.18
其中：基金申购款	-50.91	-24.90	-75.81
基金赎回款	160,112.92	367.07	160,479.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-326,005.37	433,297.48	107,292.11

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月12日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	57,391.27	-
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	9,635.26	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	67,026.53	-

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月12日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	35,317,689.62	-
减：卖出股票成本总额	35,479,079.37	-

买卖股票差价收入	-161,389.75	-
----------	-------------	---

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年10月12日(基金 合同生效日)至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	515,977.50	-
——股票投资	515,977.50	-
——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	515,977.50	-

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月12日(基金合 同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日

基金赎回费收入	52,630.68	-
合计	52,630.68	-

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月12日(基金合 同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
交易所市场交易费用	84,311.80	-
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	84,311.80	-

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月12日(基金合 同生效日)至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
审计费用	50,000.00	-
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
其他	400.00	-
合计	50,400.00	-

注：其他指证券账户开户费。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

### 7.4.9 关联方关系

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

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年10月12日(基金合同生效日)至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	440,615.49	-
其中：支付销售机构的客户维护费	13,043.31	-

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，由基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日

结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 10 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,374.38	-

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

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.10.2.3 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 10 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	120,681.79	120,681.79
合计	-	120,681.79	120,681.79
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C	合计
合计	-	-	-

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

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给本基金登记机构，并由登记机构代为支付给 C 类基金份额销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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。

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

本基金本报告期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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 10 月 12 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	1,691,161.16	57,391.27	-	-

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



#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，一般情况下其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金的投资范围主要包括股票、债券、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制投资风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人建立了董事会及风险控制委员会、总经理、风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部以及相关业务部门构成的风险管理架构体系。董事会负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度。董事会下设风险控制委员会，风险控制委员会负责对公司经营管理与资产组合运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查；总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险管理委员会，负责审议公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等，重点是公司的合规控制和投资的风险控制；在业务操作层面的

风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

于本报告期末，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）。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

于本报告期末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

于本报告期末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

于本报告期末，本基金未持有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）。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

于本报告期末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

综上所述，本基金在本报告期内流动性良好，无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,691,161.16	-	-	-	-	-	1,691,161.16
存出保证金	2,669,310.20	-	-	-	-	-	2,669,310.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-49,650,970.95	-49,650,970.95
买入返售金融资产	1,200,000.00	-	-	-	-	-	1,200,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	-839.58	-839.58
资产总计	5,560,471.36	-	-	-	-	-49,650,131.37	55,210,602.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	125.07	125.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,374.64	70,374.64
应付托管费	-	-	-	-	-	4,691.64	4,691.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	19,614.50	19,614.50
其他负债	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	144,805.85	144,805.85
利率敏感度缺口	5,560,471.36	-	-	-	-	-49,505,325.52	55,065,796.88
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							
资产总计	-	-	-	-	-	-	-
负债							
负债总计	-	-	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	-	-

注：1. 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。

2. 本基金基金合同于 2021 年 10 月 12 日生效，本基金于 2021 年 10 月 12 日成立，无上年末数据。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于报告期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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	49,650,970.95	90.17	-	-
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	49,650,970.95	90.17	-	-

##### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	沪深 300 指数上涨 5%	1,763,112.49	-
	沪深 300 指数下跌 5%	-1,763,112.49	

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项和其他金融负债，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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 49,650,970.95 元，无属于第二层次、第三层次的余额。

本基金持有的金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

##### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	49,650,970.95	89.93
	其中：股票	49,650,970.95	89.93
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	1,200,000.00	2.17
	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	4,360,471.36	7.90
8	其他各项资产	-839.58	0.00
9	合计	55,210,602.73	100.00

注：银行存款中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	525,177.00	0.95
B	采矿业	3,283,540.00	5.96
C	制造业	31,622,636.70	57.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,217,775.00	5.84
E	建筑业	460,866.00	0.84
F	批发和零售业	886,445.00	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	89,244.00	0.16
H	住宿和餐饮业	3,432.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,607,357.15	8.37
J	金融业	1,931,184.00	3.51
K	房地产业	127,039.00	0.23
L	租赁和商务服务业	10,161.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,227,110.10	2.23

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	65,186.00	0.12
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,000,829.00	1.82
S	综合	592,989.00	1.08
	合计	49,650,970.95	90.17

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002008	大族激光	29,400	1,587,600.00	2.88
2	600030	中信证券	47,400	1,251,834.00	2.27
3	002371	北方华创	3,400	1,179,868.00	2.14
4	603185	上机数控	6,700	1,118,766.00	2.03
5	688388	嘉元科技	8,713	1,093,917.15	1.99
6	601985	中国核电	125,700	1,043,310.00	1.89
7	300207	欣旺达	20,700	872,712.00	1.58
8	002191	劲嘉股份	54,500	824,585.00	1.50
9	002049	紫光国微	3,500	787,500.00	1.43
10	000893	亚钾国际	29,500	786,175.00	1.43
11	688202	美迪西	1,590	772,088.10	1.40
12	600176	中国巨石	42,000	764,400.00	1.39
13	000629	攀钢钒钛	194,800	757,772.00	1.38
14	601225	陕西煤业	61,400	749,080.00	1.36
15	600905	三峡能源	98,300	738,233.00	1.34
16	300182	捷成股份	114,100	722,253.00	1.31
17	600690	海尔智家	21,200	633,668.00	1.15
18	003022	联泓新科	17,300	630,412.00	1.14
19	603888	新华网	26,100	620,136.00	1.13
20	300568	星源材质	16,600	609,718.00	1.11
21	601666	平煤股份	69,600	582,552.00	1.06
22	688200	华峰测控	1,061	543,125.90	0.99
23	600123	兰花科创	57,300	536,901.00	0.98
24	603936	博敏电子	31,100	534,920.00	0.97



25	603986	兆易创新	3,000	527,550.00	0.96
26	300398	飞凯材料	21,000	507,360.00	0.92
27	600105	永鼎股份	90,900	488,133.00	0.89
28	002821	凯莱英	1,100	478,500.00	0.87
29	600027	华电国际	88,500	473,475.00	0.86
30	000875	吉电股份	50,800	461,772.00	0.84
31	600338	西藏珠峰	12,200	459,452.00	0.83
32	002756	永兴材料	3,100	458,862.00	0.83
33	600760	中航沈飞	6,700	455,868.00	0.83
34	002345	潮宏基	82,300	453,473.00	0.82
35	002068	黑猫股份	43,100	452,550.00	0.82
36	600887	伊利股份	10,900	451,914.00	0.82
37	002436	兴森科技	31,900	446,600.00	0.81
38	000762	西藏矿业	7,700	409,101.00	0.74
39	300037	新宙邦	3,500	395,500.00	0.72
40	300073	当升科技	4,500	390,915.00	0.71
41	600869	远东股份	56,000	385,280.00	0.70
42	002129	中环股份	9,000	375,750.00	0.68
43	002505	鹏都农牧	98,000	374,360.00	0.68
44	600256	广汇能源	52,500	343,350.00	0.62
45	688589	力合微	4,601	333,434.47	0.61
46	600546	山煤国际	40,400	331,684.00	0.60
47	002057	中钢天源	36,000	331,200.00	0.60
48	603505	金石资源	9,000	326,070.00	0.59
49	688005	容百科技	2,781	321,427.98	0.58
50	600438	通威股份	7,100	319,216.00	0.58
51	300674	宇信科技	13,300	317,870.00	0.58
52	603305	旭升股份	6,200	309,256.00	0.56
53	300036	超图软件	10,200	306,510.00	0.56
54	002204	大连重工	70,400	306,240.00	0.56
55	600108	亚盛集团	84,000	296,520.00	0.54
56	300378	鼎捷软件	12,200	292,800.00	0.53
57	601688	华泰证券	16,000	284,160.00	0.52
58	002326	永太科技	5,500	281,655.00	0.51
59	601108	财通证券	25,200	280,224.00	0.51
60	300633	开立医疗	8,600	274,598.00	0.50
61	000676	智度股份	34,500	268,065.00	0.49
62	002635	安洁科技	15,600	265,668.00	0.48
63	000733	振华科技	2,100	260,988.00	0.47

64	600581	八一钢铁	41,900	260,199.00	0.47
65	000968	蓝焰控股	27,700	258,995.00	0.47
66	600141	兴发集团	6,700	253,796.00	0.46
67	002812	恩捷股份	1,000	250,400.00	0.45
68	000009	中国宝安	17,300	249,639.00	0.45
69	603693	江苏新能	8,700	247,602.00	0.45
70	300756	金马游乐	8,700	247,341.00	0.45
71	300322	硕贝德	17,700	245,676.00	0.45
72	601515	东风股份	28,600	232,518.00	0.42
73	002135	东南网架	19,500	225,420.00	0.41
74	002241	歌尔股份	4,100	221,810.00	0.40
75	601669	中国电建	27,200	219,776.00	0.40
76	600206	有研新材	13,400	219,492.00	0.40
77	002234	民和股份	12,600	216,216.00	0.39
78	002597	金禾实业	4,200	215,670.00	0.39
79	002941	新疆交建	17,500	211,575.00	0.38
80	300770	新媒股份	3,500	210,000.00	0.38
81	601339	百隆东方	34,600	203,794.00	0.37
82	300725	药石科技	1,400	199,038.00	0.36
83	002815	崇达技术	11,700	197,145.00	0.36
84	300098	高新兴	35,746	187,666.50	0.34
85	002517	恺英网络	32,100	186,822.00	0.34
86	300861	美畅股份	2,400	186,648.00	0.34
87	600116	三峡水利	16,000	186,560.00	0.34
88	603619	中曼石油	12,200	182,878.00	0.33
89	300010	豆神教育	41,700	174,723.00	0.32
90	000519	中兵红箭	6,500	173,355.00	0.31
91	300022	吉峰科技	33,900	173,229.00	0.31
92	688536	思瑞浦	223	171,264.00	0.31
93	600085	同仁堂	3,800	170,924.00	0.31
94	002240	盛新锂能	2,800	162,260.00	0.29
95	002539	云图控股	12,200	161,894.00	0.29
96	300404	博济医药	11,500	159,045.00	0.29
97	300835	龙磁科技	2,200	158,730.00	0.29
98	688017	绿的谐波	906	158,151.36	0.29
99	002196	方正电机	13,500	157,680.00	0.29
100	300759	康龙化成	1,100	155,397.00	0.28
101	002860	星帅尔	6,300	153,720.00	0.28
102	300311	任子行	18,600	151,962.00	0.28

103	002581	未名医药	6,800	145,180.00	0.26
104	300347	泰格医药	1,100	140,580.00	0.26
105	002624	完美世界	6,800	138,108.00	0.25
106	002168	惠程科技	31,600	135,564.00	0.25
107	603727	博迈科	6,500	133,380.00	0.24
108	000680	山推股份	30,500	130,540.00	0.24
109	600771	广誉远	3,000	129,180.00	0.23
110	300139	晓程科技	10,100	126,149.00	0.23
111	000977	浪潮信息	3,500	125,405.00	0.23
112	002425	凯撒文化	13,000	125,320.00	0.23
113	300807	天迈科技	4,500	124,200.00	0.23
114	300465	高伟达	9,700	118,049.00	0.21
115	605133	嵘泰股份	4,100	117,711.00	0.21
116	688700	东威科技	1,700	115,770.00	0.21
117	002459	晶澳科技	1,200	111,240.00	0.20
118	600210	紫江企业	12,000	110,160.00	0.20
119	300998	宁波方正	3,300	109,989.00	0.20
120	002043	兔宝宝	9,100	109,928.00	0.20
121	600641	万业企业	3,300	109,791.00	0.20
122	688277	天智航	4,149	108,911.25	0.20
123	300735	光弘科技	7,200	108,504.00	0.20
124	000793	华闻集团	36,900	108,486.00	0.20
125	301052	果麦文化	3,000	106,950.00	0.19
126	002284	亚太股份	10,100	105,141.00	0.19
127	300157	恒泰艾普	21,300	104,583.00	0.19
128	300148	天舟文化	19,400	104,178.00	0.19
129	002850	科达利	600	96,204.00	0.17
130	002961	瑞达期货	3,900	96,096.00	0.17
131	603629	利通电子	4,300	95,890.00	0.17
132	688007	光峰科技	2,767	95,046.45	0.17
133	688158	优刻得	3,568	94,623.36	0.17
134	002167	东方锆业	11,900	94,010.00	0.17
135	300083	创世纪	6,500	92,820.00	0.17
136	603260	合盛硅业	700	92,379.00	0.17
137	300316	晶盛机电	1,300	90,350.00	0.16
138	688033	天宜上佳	2,704	89,367.20	0.16
139	300703	创源股份	7,700	87,703.00	0.16
140	600114	东睦股份	7,200	84,600.00	0.15
141	300457	赢合科技	2,700	82,944.00	0.15

142	002171	楚江新材	6,200	82,212.00	0.15
143	300432	富临精工	2,700	79,380.00	0.14
144	300418	昆仑万维	3,400	78,710.00	0.14
145	300786	国林科技	1,800	77,184.00	0.14
146	688012	中微公司	599	75,833.40	0.14
147	300048	合康新能	10,500	74,970.00	0.14
148	600570	恒生电子	1,200	74,580.00	0.14
149	002538	司尔特	7,000	72,030.00	0.13
150	301010	晶雪节能	3,000	71,940.00	0.13
151	605090	九丰能源	1,900	66,823.00	0.12
152	002986	宇新股份	1,800	64,764.00	0.12
153	300556	丝路视觉	2,200	64,658.00	0.12
154	300996	普联软件	2,000	63,180.00	0.11
155	603595	东尼电子	1,700	62,781.00	0.11
156	600640	新国脉	4,100	62,525.00	0.11
157	300691	联合光电	2,600	61,152.00	0.11
158	002369	卓翼科技	8,200	61,008.00	0.11
159	300969	恒帅股份	600	60,048.00	0.11
160	300709	精研科技	1,000	59,950.00	0.11
161	300166	东方国信	5,400	58,320.00	0.11
162	300204	舒泰神	3,300	57,915.00	0.11
163	300773	拉卡拉	1,900	55,138.00	0.10
164	600088	中视传媒	4,700	53,580.00	0.10
165	603881	数据港	1,400	51,688.00	0.09
166	300993	玉马遮阳	1,800	51,678.00	0.09
167	300687	赛意信息	1,700	49,606.00	0.09
168	300984	金沃股份	800	49,320.00	0.09
169	300769	德方纳米	100	49,116.00	0.09
170	002243	力合科创	4,300	48,547.00	0.09
171	002352	顺丰控股	700	48,244.00	0.09
172	300263	隆华科技	4,700	47,940.00	0.09
173	002011	盾安环境	3,200	43,840.00	0.08
174	000657	中钨高新	2,600	41,808.00	0.08
175	603131	上海沪工	1,500	40,875.00	0.07
176	300721	怡达股份	800	40,080.00	0.07
177	300319	麦捷科技	2,600	39,780.00	0.07
178	300076	GQY 视讯	6,700	39,597.00	0.07
179	002182	云海金属	1,700	38,998.00	0.07
180	300292	吴通控股	9,700	38,703.00	0.07

181	002003	伟星股份	3,000	38,460.00	0.07
182	603399	吉翔股份	5,800	38,338.00	0.07
183	002292	奥飞娱乐	6,000	37,980.00	0.07
184	688567	孚能科技	1,105	37,183.25	0.07
185	300219	鸿利智汇	2,300	36,363.00	0.07
186	002073	软控股份	4,100	32,308.00	0.06
187	301061	匠心家居	400	31,520.00	0.06
188	603090	宏盛股份	1,400	31,136.00	0.06
189	002518	科士达	1,200	30,120.00	0.05
190	300379	东方通	1,000	29,530.00	0.05
191	300338	开元教育	4,300	28,982.00	0.05
192	600110	诺德股份	1,800	28,710.00	0.05
193	600018	上港集团	5,200	28,496.00	0.05
194	688689	银河微电	617	25,796.77	0.05
195	688360	德马科技	698	22,754.80	0.04
196	600330	天通股份	1,400	22,722.00	0.04
197	002132	恒星科技	3,700	22,607.00	0.04
198	300094	国联水产	4,600	20,838.00	0.04
199	002946	新乳业	1,300	20,722.00	0.04
200	603217	元利科技	400	20,272.00	0.04
201	300813	泰林生物	200	20,000.00	0.04
202	300745	欣锐科技	300	19,260.00	0.03
203	300192	科德教育	2,300	19,113.00	0.03
204	601658	邮储银行	3,700	18,870.00	0.03
205	002375	亚厦股份	2,500	18,725.00	0.03
206	605189	富春染织	700	17,626.00	0.03
207	000615	奥园美谷	1,600	17,248.00	0.03
208	000526	学大教育	900	17,091.00	0.03
209	688085	三友医疗	537	16,577.19	0.03
210	002759	天际股份	500	14,650.00	0.03
211	603168	莎普爱思	1,500	14,220.00	0.03
212	601869	长飞光纤	400	13,096.00	0.02
213	002458	益生股份	1,100	12,441.00	0.02
214	600499	科达制造	500	12,410.00	0.02
215	601865	福莱特	200	11,588.00	0.02
216	300249	依米康	1,600	11,536.00	0.02
217	300296	利亚德	1,100	11,275.00	0.02
218	688365	光云科技	787	10,907.82	0.02
219	601877	正泰电器	200	10,778.00	0.02

220	002045	国光电器	700	10,500.00	0.02
221	002354	天神娱乐	1,800	10,494.00	0.02
222	300753	爱朋医疗	500	10,145.00	0.02
223	603929	亚翔集成	800	9,728.00	0.02
224	605305	中际联合	100	9,629.00	0.02
225	000681	视觉中国	400	9,560.00	0.02
226	300994	久祺股份	200	9,524.00	0.02
227	601011	宝泰隆	1,800	9,522.00	0.02
228	300268	佳沃食品	500	9,270.00	0.02
229	002642	荣联科技	1,500	8,595.00	0.02
230	603663	三祥新材	300	8,325.00	0.02
231	300239	东宝生物	1,100	7,755.00	0.01
232	002277	友阿股份	2,200	7,172.00	0.01
233	300240	飞力达	800	6,552.00	0.01
234	002686	亿利达	1,000	6,520.00	0.01
235	300662	科锐国际	100	6,221.00	0.01
236	002800	天顺股份	400	5,952.00	0.01
237	002903	宇环数控	300	5,379.00	0.01
238	002885	京泉华	200	5,216.00	0.01
239	000801	四川九洲	500	4,795.00	0.01
240	300057	万顺新材	500	4,705.00	0.01
241	600321	正源股份	2,300	4,669.00	0.01
242	002878	元隆雅图	200	3,940.00	0.01
243	301073	君亭酒店	100	3,432.00	0.01
244	603917	合力科技	100	2,380.00	0.00
245	002474	榕基软件	300	2,091.00	0.00
246	301007	德迈仕	100	1,992.00	0.00
247	300479	神思电子	100	1,617.00	0.00
248	002830	名雕股份	100	1,062.00	0.00
249	002615	哈尔斯	100	558.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	2,010,703.00	3.65
2	300059	东方财富	1,571,174.00	2.85

3	300750	宁德时代	1,568,336.00	2.85
4	002008	大族激光	1,528,836.00	2.78
5	600760	中航沈飞	1,402,655.00	2.55
6	002191	劲嘉股份	1,375,236.00	2.50
7	002371	北方华创	1,223,272.00	2.22
8	688388	嘉元科技	1,121,289.71	2.04
9	603185	上机数控	1,116,355.00	2.03
10	002756	永兴材料	1,012,177.00	1.84
11	601985	中国核电	973,143.00	1.77
12	300207	欣旺达	967,729.00	1.76
13	000875	吉电股份	944,500.00	1.72
14	000591	太阳能	892,393.00	1.62
15	603986	兆易创新	885,877.00	1.61
16	601225	陕西煤业	864,806.00	1.57
17	002821	凯莱英	841,182.00	1.53
18	000629	攀钢钒钛	826,351.00	1.50
19	600887	伊利股份	821,981.00	1.49
20	000893	亚钾国际	779,423.00	1.42

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	1,527,197.00	2.77
2	300750	宁德时代	1,462,706.00	2.66
3	600760	中航沈飞	892,945.00	1.62
4	000591	太阳能	839,203.00	1.52
5	600030	中信证券	755,907.00	1.37
6	002602	世纪华通	731,161.00	1.33
7	600703	三安光电	700,620.00	1.27
8	000723	美锦能源	696,792.00	1.27
9	000811	冰轮环境	690,037.00	1.25
10	002413	雷科防务	640,635.00	1.16
11	002756	永兴材料	628,138.00	1.14
12	601689	拓普集团	626,710.00	1.14
13	600771	广誉远	577,754.00	1.05

14	002191	劲嘉股份	577, 535. 00	1. 05
15	002466	天齐锂业	571, 762. 00	1. 04
16	002812	恩捷股份	515, 870. 00	0. 94
17	601377	兴业证券	494, 542. 00	0. 90
18	600499	科达制造	487, 622. 00	0. 89
19	002665	首航高科	456, 271. 00	0. 83
20	000875	吉电股份	444, 157. 00	0. 81

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	84, 614, 072. 82
卖出股票收入（成交）总额	35, 317, 689. 62

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。



**8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

本基金投资的前十名股票中，未发生超出基金合同规定的备选股票库的情况。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-839.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	-839.58

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
九泰天利量化 A	133	67,422.69	-	0.00%	8,967,217.27	100.00%
九泰天利量化 C	121	379,839.67	40,014,400.00	87.06%	5,946,199.61	12.94%
合计	254	216,251.25	40,014,400.00	72.85%	14,913,416.88	27.15%

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。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	九泰天利量化 A	49.46	0.0006%
	九泰天利量化 C	40.08	0.0001%
	合计	89.54	0.0002%

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。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰天利量化 A	九泰天利量化 C
基金合同生效日（2021 年 10 月 12 日）基金份额总额	12,226,960.21	224,584,086.40
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	71,694.45	41,744.28
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,331,437.39	178,665,231.07
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	8,967,217.27	45,960,599.61

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、本报告期内，基金管理人发生以下重要人员变更事项：

1、卢伟忠先生不再担任公司总经理及董事职务，严军先生担任公司总经理及董事职务；吴祖尧先生不再担任公司副总经理职务。

2、袁小文女士不再担任公司独立董事职务，华金秋先生担任公司独立董事职务。

以上变更事项已向监管部门备案。

二、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元。目前该会计师事务所首次为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、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，进一步加强了内部控制及对子公司的管控。

2、本报告期内，基金管理人收到监管机构暂停相关业务的行政监管措施，对有关高管人员采取了警示函、认定为不适当人选等行政监管措施；相关事项监管机构立案调查。对此公司高度重视，及时制定了整改方案，以进一步完善公司治理。

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	119,931,762.44	100.00%	47,972.73	100.00%	-

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	2,692,000,000.00	100.00%	-	-

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

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	九泰天利量化股票型证券投资基金份额发售公告	规定报刊和规定网站	2021年7月2日
2	九泰天利量化股票型证券投资基金基金合同	规定网站	2021年7月2日
3	九泰天利量化股票型证券投资基金托管协议	规定网站	2021年7月2日
4	九泰天利量化股票型证券投资基金招募说明书	规定网站	2021年7月2日
5	九泰天利量化股票型证券投资基金（九泰天利量化 A 份额）基金产品资料概要	规定网站	2021年7月2日
6	九泰天利量化股票型证券投资基金（九泰天利量化 C 份额）基金产品资料概要	规定网站	2021年7月2日
7	九泰天利量化股票型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	规定报刊	2021年7月2日
8	九泰基金管理有限公司关于	规定报刊和规定网	2021年9月3日

	调整直销柜台《投资者传真交易协议书》的公告及附件《投资者非现场委托业务协议书》	站	
9	九泰天利量化股票型证券投资基金基金合同生效公告	规定报刊和规定网站	2021 年 10 月 13 日
10	九泰天利量化股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2021 年 10 月 18 日
11	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊和规定网站	2021 年 11 月 13 日
12	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊和规定网站	2021 年 11 月 25 日
13	九泰基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	规定报刊和规定网站	2021 年 12 月 2 日
14	关于九泰天利量化股票型证券投资基金基金经理变更的公告	规定报刊和规定网站	2021 年 12 月 4 日
15	九泰天利量化股票型证券投资基金招募说明书更新	规定网站	2021 年 12 月 6 日
16	九泰天利量化股票型证券投资基金（九泰天利量化 A 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2021 年 12 月 6 日
17	九泰天利量化股票型证券投资基金（九泰天利量化 C 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2021 年 12 月 6 日
18	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊和规定网站	2021 年 12 月 11 日
19	九泰基金管理有限公司关于提请投资者及时更新相关信息的公告	规定报刊和规定网站	2021 年 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
产品	1	20211116 至 20211231	40,005,400.00	0.00	20,002,700.00	20,002,700.00	36.42%
	2	20211116 至 20211231	20,011,700.00	0.00	0.00	20,011,700.00	36.43%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

### 13.3 查阅方式

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

九泰基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日