

九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 10 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 |
| §5 托管人报告 | 17 |
| 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 |
| §6 审计报告 | 18 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 18 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 18 |
| §7 年度财务报表 | 21 |
| 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..... | 24 |
| §8 投资组合报告 | 52 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 52 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 52 |
| 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..... | 53 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 55 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 60 |
| 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..... | 60 |
| 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..... | 60 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 60 |
| 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 | 60 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 60 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 61 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 61 |
| § 9 基金份额持有人信息 | 63 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 63 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 63 |
| 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 | 63 |
| § 10 开放式基金份额变动 | 65 |
| § 11 重大事件揭示 | 66 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 66 |
| 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 | 66 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 66 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 66 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 67 |
| 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 | 67 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 67 |
| 11.8 其他重大事件 | 68 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 72 |
| 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 | 72 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 72 |
| § 13 备查文件目录 | 74 |
| 13.1 备查文件目录 | 74 |
| 13.2 存放地点 | 74 |
| 13.3 查阅方式 | 74 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|--------------|
| 基金名称 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 九泰天奕量化价值混合 | |
| 基金主代码 | 008077 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 5 月 29 日 | |
| 基金管理人 | 九泰基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,292,832.21 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 九泰天奕量化价值混合 A | 九泰天奕量化价值混合 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 008077 | 008137 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 938,870.47 份 | 353,961.74 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 采用多策略量化模型，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 | 本基金是混合型基金，主要目的是以合理的价格，买入具有投资价值的标的，实现资产的长期保值增值，投资主要依托于量化多策略体系平台来实现。主要投资策略包括资产配置策略，股票投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，股指期货投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*90%+银行活期存款利率（税后）*10% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|------------------------------------|---------------------|
| 名称 | | 九泰基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陈沛 | 郭明 |
| | 联系电话 | 010-57383999 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | chenpei@jtamc.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-628-0606 | 95588 |
| 传真 | | 010-57383867 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 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 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 100020 | 100140 |

| | | |
|-------|----|-----|
| 法定代表人 | 严军 | 陈四清 |
|-------|----|-----|

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jtamc.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|------------------------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼 |
| 注册登记机构 | 九泰基金管理有限公司 | 北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 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 | | 2020 年 5 月 29 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日 | | 2019 年 | |
|---------------|---------------|--------------|---|--------------|--------------|--------------|
| | 九泰天奕量化价值混合 A | 九泰天奕量化价值混合 C | 九泰天奕量化价值混合 A | 九泰天奕量化价值混合 C | 九泰天奕量化价值混合 A | 九泰天奕量化价值混合 C |
| 本期已实现收益 | -4,919,452.53 | -998,760.72 | 2,457,628.77 | 1,112,489.17 | - | - |
| 本期利润 | -6,069,758.81 | -275,330.35 | 2,762,019.32 | 1,379,177.68 | - | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1344 | -0.1288 | 0.3634 | 0.0438 | - | - |
| 本期加权平均净值利润率 | -11.32% | -10.57% | 33.78% | 4.33% | - | - |
| 本期基金份额净值增长率 | -8.41% | -8.81% | 24.97% | 24.37% | - | - |
| 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 | -267,521.25 | -102,811.18 | 495,152.14 | 547,501.96 | - | - |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2849 | -0.2905 | 0.2497 | 0.2437 | - | - |
| 期末基金资产净值 | 1,074,668.40 | 401,414.46 | 2,477,878.75 | 2,794,548.16 | - | - |
| 期末基金份额净值 | 1.1446 | 1.1341 | 1.2497 | 1.2437 | - | - |
| 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 | 14.46% | 13.41% | 24.97% | 24.37% | - | - |

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 12 月 31 日。

4、本基金基金合同于 2020 年 5 月 29 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

九泰天奕量化价值混合 A

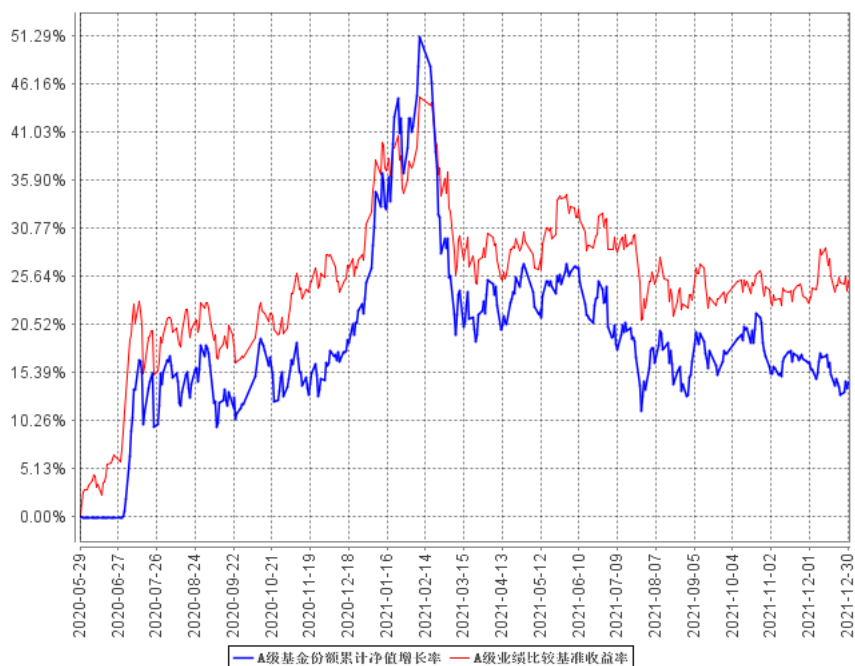
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -2.52% | 0.72% | 1.39% | 0.71% | -3.91% | 0.01% |
| 过去六个月 | -6.98% | 1.00% | -4.83% | 0.92% | -2.15% | 0.08% |
| 过去一年 | -8.41% | 1.27% | -4.51% | 1.05% | -3.90% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.46% | 1.29% | 25.37% | 1.10% | -10.91% | 0.19% |

九泰天奕量化价值混合 C

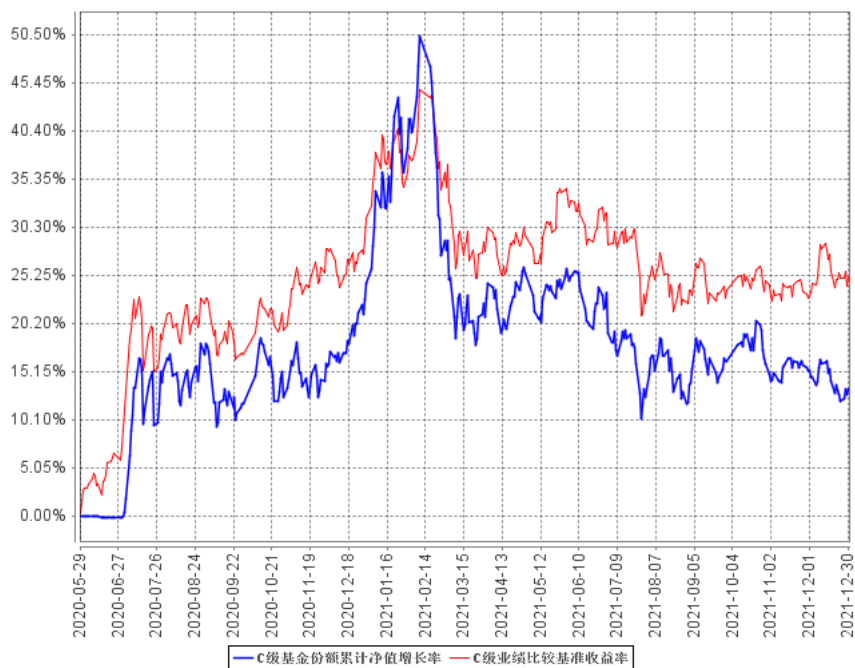
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -2.44% | 0.72% | 1.39% | 0.71% | -3.83% | 0.01% |
| 过去六个月 | -7.02% | 1.00% | -4.83% | 0.92% | -2.19% | 0.08% |
| 过去一年 | -8.81% | 1.27% | -4.51% | 1.05% | -4.30% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.41% | 1.28% | 25.37% | 1.10% | -11.96% | 0.18% |

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

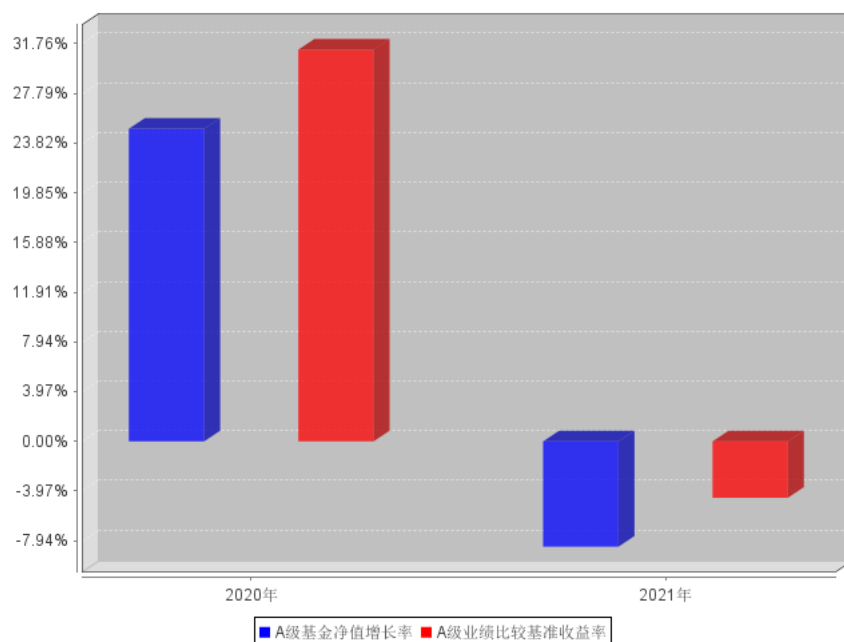


注：1. 本基金合同于 2020 年 5 月 29 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束已满一年。

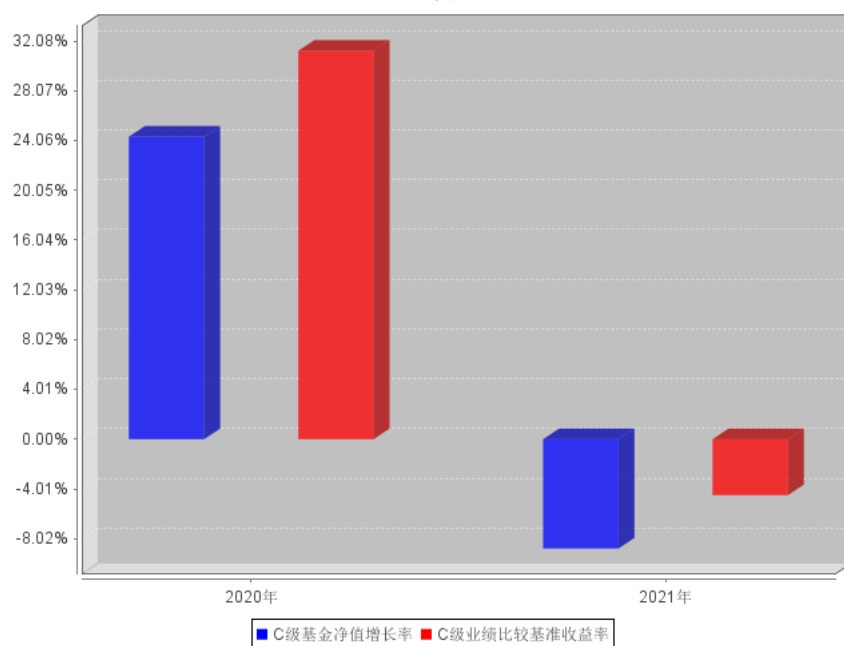
2. 根据基金合同的约定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求。本基金建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 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 2020 年 5 月 29 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

本基金自 2020 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

§ 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 | | |
| 孟亚强 | 基金经理、天元量化投资部总经理 | 2020年5月29日 | - | 12 | 南开大学保险精算硕士，中国籍，具有基金从业资格。12年证券从业经历。历任博时基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理。2015年8月加入九泰基金管理有限公司，曾任九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金（原九泰久稳保本混合型证券投资基金，2016年6月7日至2018年11月26日）、九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金（2017年8月16日至2020年3月23日）、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金（2017年2月10日至2020年9月22日）、九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金（2016年12月26日至2021年1月11日）、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金（2020年4月22日至2021年12月15日）的基金经理，现任天元量化投资部总经理，九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金（2016年6月7日 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰久睿量化股票型证券投资基金(2020年8月14日至今)、九泰久福量化股票型证券投资基金(2021年1月20日至今)、九泰锐升18个月封闭运作混合型证券投资基金(2021年1月20日至今)、九泰久元量化股票型证券投资基金(2021年1月26日至今)的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

2、截止本报告批准送出日，本基金经理由孟亚强变更为孟亚强、杨飞，变更日期为2022年1月10日。孟亚强先生2020年5月29日至2022年1月13日任本基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金未发生基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，本基金采用多策略量化模型，在有效控制组合风险的前提下，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。在报告期内，整体组合为大盘蓝筹配置，持股集中度没有明显变化，在风格上配置相对均衡，低配银行和保险，部分增加医药和食品饮料的配置，同时进一步降低股票仓位，个股集中度适当降低。

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 1.1446 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.41%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.1341 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.81%；同期业绩比较基准收益率为-4.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，经济基本面“前低后高”与政策面“前松后紧”的已经成为市场一致预期。“稳字当头”的背景下，政策层面对于波动率的关注可能会超过历年，从国内数据看，国内稳增长政策或将会延续，宽信用是大概率事件，但时间和力度将会显著影响股票市场，也是决定市场的核心变量。从历史看，进入 2 季度之后，随着地方政府和国企部门加大稳增长的投资力度，预计市场悲观情绪将会扭转，应当逐步增加权益资产配置。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金管理人设立了由督察长、估值业务分管高管、研究业务分管高管、风险管理部、研究部、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。

4.8 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，本基金于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

本基金出现超过连续 60 个工作日（2020 年 9 月 21 日-2021 年 9 月 6 日）基金份额持有人数量不满 200 人的情形，已向中国证监会报告并提出解决方案；本基金出现超过连续 20 个工作日（2021 年 10 月 27 日-2021 年 12 月 31 日）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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——九泰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对九泰基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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 P02207 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 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金全体持有人： |
| 审计意见 | <p>我们审计了九泰天奕量化价值混合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 年度利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于九泰天奕量化价值混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | <p>九泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 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。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</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奕量化价值混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算九泰天奕量化价值混合型证券投资基金、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奕量化价值混合型证券投资基金的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对九泰天奕量化价值混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我</p> |

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

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 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 719,684.35 | 403,365.78 |
| 结算备付金 | | 2,070.15 | 35,770.75 |
| 存出保证金 | | 49,218.01 | 12,447.19 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 971,934.86 | 4,875,701.00 |
| 其中：股票投资 | | 971,934.86 | 4,875,701.00 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 93.85 | 66.32 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 4,000.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,743,001.22 | 5,331,351.04 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 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 | | 972.02 | 7,551.08 |
| 应付管理人报酬 | | 865.59 | 7,284.29 |
| 应付托管费 | | 216.38 | 1,214.06 |
| 应付销售服务费 | | 99.11 | 1,955.12 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 94,765.26 | 20,919.58 |
| 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 | 170,000.00 | 20,000.00 |
| 负债合计 | | 266,918.36 | 58,924.13 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,292,832.21 | 4,229,772.81 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 183,250.65 | 1,042,654.10 |
| 所有者权益合计 | | 1,476,082.86 | 5,272,426.91 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,743,001.22 | 5,331,351.04 |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，九泰天奕量化价值混合 A 类基金份额净值人民币 1.1446 元，九泰天奕量化价值混合 C 类基金份额净值人民币 1.1341 元；基金份额总额 1,292,832.21 份，其中九泰天奕量化价值混合 A 类基金份额 938,870.47 份，九泰天奕量化价值混合 C 类基金份额 353,961.74 份。

7.2 利润表

会计主体：九泰天奕量化价值混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 5 月 29 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | -4,970,011.63 | 4,922,816.13 |
| 1.利息收入 | | 48,489.74 | 149,494.27 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 28,291.12 | 137,823.04 |
| 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 | | 20,198.62 | 11,671.23 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -4,950,738.12 | 4,124,373.76 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -6,304,728.12 | 4,056,379.26 |
| 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 | 1,353,990.00 | 67,994.50 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -426,875.91 | 571,079.06 |
| 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 | 359,112.66 | 77,869.04 |
| 减：二、费用 | | 1,375,077.53 | 781,619.13 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 576,819.75 | 361,445.58 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 111,508.20 | 60,240.97 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 16,408.30 | 154,211.02 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 448,266.87 | 182,878.98 |
| 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 | 222,074.41 | 22,842.58 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -6,345,089.16 | 4,141,197.00 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -6,345,089.16 | 4,141,197.00 |

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 5 月 29 日，上年度可比期间为 2020 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：九泰天奕量化价值混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 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） | 4,229,772.81 | 1,042,654.10 | 5,272,426.91 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -6,345,089.16 | -6,345,089.16 |
| 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） | -2,936,940.60 | 5,485,685.71 | 2,548,745.11 |
| 其中：1. 基金申购款 | 120,575,568.25 | 31,213,325.12 | 151,788,893.37 |
| 2. 基金赎回款 | -123,512,508.85 | -25,727,639.41 | -149,240,148.26 |
| 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） | 1,292,832.21 | 183,250.65 | 1,476,082.86 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金合同生效日)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） | 214,918,097.43 | - | 214,918,097.43 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 4,141,197.00 | 4,141,197.00 |
| 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） | -210,688,324.62 | -3,098,542.90 | -213,786,867.52 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,273,626.72 | 174,522.46 | 1,448,149.18 |
| 2. 基金赎回款 | -211,961,951.34 | -3,273,065.36 | -215,235,016.70 |
| 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） | 4,229,772.81 | 1,042,654.10 | 5,272,426.91 |

注：本基金基金合同生效日为2020年5月29日，上年度可比期间为2020年5月29日（基金合同生效日）至2020年12月31日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| <u> 严军 </u> | <u> 严军 </u> | <u> 荣静 </u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第1704号文准予募集注册并公开发行,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《九泰天奕量化价值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3月13日起至2020

年 5 月 26 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 214,860,884.38 元（其中，A 类基金份额净认购金额为人民币 21,266,123.64 元，折合 21,266,123.64 份基金份额；C 类基金份额净认购金额为人民币 193,594,760.74 元，折合 193,594,760.74 份基金份额），在募集期间产生的利息为人民币 57,213.05 元（其中，A 类基金份额产生的利息为人民币 20,992.66 元，C 类基金份额产生的利息为人民币 36,220.39 元），以上实收基金（本息）合计为人民币 214,918,097.43 元，折合 214,918,097.43 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 69000012 号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于 2020 年 5 月 29 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰天奕量化价值混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包括中小板、创业板股票及其他中国证监会允许基金投资的股票），债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券），资产支持证券、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：沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

持续经营

根据《九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。本基金出现超过连续 60 个工作日（2019 年 10 月 18 日-2021 年 12 月 31 日）基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监

会报告并提出解决方案，并未计划与其他基金合并或者终止基金合同等，故本财务报表以持续经营为编制基础。

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 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。上年度可比期间为 2020 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 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相应类别的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任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

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,对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 | 719,684.35 | 403,365.78 |
| 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： | 719,684.35 | 403,365.78 |

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 | | 827,731.71 | 971,934.86 | 144,203.15 |
| 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 | | 827,731.71 | 971,934.86 | 144,203.15 |
| 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 | | 4,304,621.94 | 4,875,701.00 | 571,079.06 |
| 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 | | 4,304,621.94 | 4,875,701.00 | 571,079.06 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----------|------------------|------------------|
| | 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
| 应收活期存款利息 | 70.85 | 44.62 |
| 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 | 0.90 | 16.10 |
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 应收出借证券利息 | - | - |
| 其他 | 22.10 | 5.60 |
| 合计 | 93.85 | 66.32 |

注：其他指应收保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 94,765.26 | 20,919.58 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 94,765.26 | 20,919.58 |

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 | - | - |
| 预提信息披露费 | 120,000.00 | - |
| 预提审计费 | 50,000.00 | 20,000.00 |
| 合计 | 170,000.00 | 20,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 九泰天奕量化价值混合 A | |
|--------------|--|
| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
| | |

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 1,982,726.61 | 1,982,726.61 |
| 本期申购 | 118,697,021.73 | 118,697,021.73 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -119,740,877.87 | -119,740,877.87 |
| - 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 | 938,870.47 | 938,870.47 |

金额单位：人民币元

| 九泰天奕量化价值混合 C | | |
|---------------|--|---------------|
| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,247,046.20 | 2,247,046.20 |
| 本期申购 | 1,878,546.52 | 1,878,546.52 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,771,630.98 | -3,771,630.98 |
| - 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 | 353,961.74 | 353,961.74 |

注：本期申购中包含转换入份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 九泰天奕量化价值混合 A | | | |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 575,907.11 | -80,754.97 | 495,152.14 |
| 本期利润 | -4,919,452.53 | -1,150,306.28 | -6,069,758.81 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,076,024.17 | 1,634,380.43 | 5,710,404.60 |
| 其中：基金申购款 | 49,508,016.59 | -18,858,488.45 | 30,649,528.14 |
| 基金赎回款 | -45,431,992.42 | 20,492,868.88 | -24,939,123.54 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -267,521.25 | 403,319.18 | 135,797.93 |

单位：人民币元

| 九泰天奕量化价值混合 C | | | |
|----------------|-------------|-------------|-------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 639,117.58 | -91,615.62 | 547,501.96 |
| 本期利润 | -998,760.72 | 723,430.37 | -275,330.35 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 256,831.96 | -481,550.85 | -224,718.89 |
| 其中：基金申购款 | 837,030.61 | -273,233.63 | 563,796.98 |
| 基金赎回款 | -580,198.65 | -208,317.22 | -788,515.87 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -102,811.18 | 150,263.90 | 47,452.72 |

7.4.7.11 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 12月31日 | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金合同生效日) 至2020年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--|
| 活期存款利息收入 | 24,949.66 | 23,967.82 |
| 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 | 3,026.81 | 113,779.59 |
| 其他 | 314.65 | 75.63 |
| 合计 | 28,291.12 | 137,823.04 |

注：其他包括结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

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1月1日至2021 年12月31日 | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金 合同生效日)至2020年12月 31日 |
|------------|---------------------------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 165,868,235.63 | 60,077,876.97 |
| 减：卖出股票成本总额 | 172,172,963.75 | 56,021,497.71 |
| 买卖股票差价收入 | -6,304,728.12 | 4,056,379.26 |

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金合同生效日)至2020年12月31日 |
|---------------|-----------------------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,353,990.00 | 67,994.50 |
| 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 | 1,353,990.00 | 67,994.50 |

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1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金合同生效日)至2020年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | -426,875.91 | 571,079.06 |
| ——股票投资 | -426,875.91 | 571,079.06 |
| ——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 | -426,875.91 | 571,079.06 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年 12月31日 | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金合同生 效日)至2020年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--|
| 基金赎回费收入 | 359,112.66 | 77,869.04 |
| 合计 | 359,112.66 | 77,869.04 |

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年 12月31日 | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金合同生 效日)至2020年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--|
| 交易所市场交易费用 | 448,266.87 | 182,878.98 |
| 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 | 448,266.87 | 182,878.98 |

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021 年12月31日 | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金合同 生效日)至2020年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--|
| 审计费用 | 50,000.00 | 20,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | - |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费 | 2,074.41 | 2,442.58 |
| 其他 | - | 400.00 |
| 持有人大会费用 | 50,000.00 | - |
| 合计 | 222,074.41 | 22,842.58 |

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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 九州证券股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 同创九鼎投资管理集团股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 昆吾九鼎投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 九泰基金销售（北京）有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 5 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 576,819.75 | 361,445.58 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 9,693.15 | 63,498.59 |

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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，若遇法定节假日

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。

2、根据《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》等相关法律法规的规定及本基金合同的约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，九泰基金管理有限公司决定自 2021 年 8 月 11 日起，将基金管理费率由原合同约定的 1.50%调低至 0.60%（具体公告请查阅九泰基金管理有限公司官方网站 www.jtamc.com），故本基金自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 8 月 10 日止按 1.50%的年费率计提基金管理费，自 2021 年 8 月 11 日起按 0.60%的年费率计提基金管理费。

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 111,508.20 | 60,240.97 |

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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。

2、根据《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》等相关法律法规的规定及本基金合同的约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，九泰基金管理有限公司决定自 2021 年 8 月 11 日起，将基金托管费率由原合同约定的 0.25%调低至 0.15%（具体公告请查阅九泰基金管理有限公司官方网站 www.jtamc.com），故本基金自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 8 月 10 日止按 0.25%的年费率计提基金托管费，自 2021 年 8 月 11 日起按 0.15%的年费率计提基金托管费。

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1月1日至2021年12月31日 | | |
|----------------|--|------------------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 九泰天奕量化价值 混合 A | 九泰天奕量化价值 混合 C | 合计 |
| 九泰基金管理有限公司 | - | 7,808.72 | 7,808.72 |
| 合计 | - | 7,808.72 | 7,808.72 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金合同生效日)至2020年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 九泰天奕量化价值 混合 A | 九泰天奕量化价值 混合 C | 合计 |
| 九泰基金管理有限公司 | - | 85,183.53 | 85,183.53 |
| 合计 | - | 85,183.53 | 85,183.53 |

注：1、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。

2、根据《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》等相关法律法规的规定及本基金合同的约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，九泰基金管理有限公司决定自 2021 年 8 月 11 日起，将基金销售服务费率由原合同约定的 0.80% 调低至 0.20%（具体公告请查阅九泰基金管理有限公司官方网站 www.jtamc.com），故本基金自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 8 月 10 日止按 0.80% 的年费率计提基金销售服务费，自 2021 年 8 月 11 日起按 0.20% 的年费率计提基金销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

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固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

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1月1日至2021年12月31日 | | 上年度可比期间 2020年5月29日(基金合同生效日)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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 719,684.35 | 24,949.66 | 403,365.78 | 23,967.82 |

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

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

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------------|-----------------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688767 | 博拓生物 | 2021 年 9 月 1 日 | 2022 年 3 月 8 日 | 新股流通受限 | 34.55 | 66.38 | 1,153 | 39,836.15 | 76,536.14 | - |
| 301069 | 凯盛新材 | 2021 年 9 月 16 日 | 2022 年 3 月 28 日 | 新股流通受限 | 5.17 | 44.21 | 539 | 2,786.63 | 23,829.19 | - |
| 301060 | 兰卫医学 | 2021 年 9 月 6 日 | 2022 年 3 月 14 日 | 新股流通受限 | 4.17 | 30.94 | 587 | 2,447.79 | 18,161.78 | - |
| 300994 | 久祺股份 | 2021 年 8 月 2 日 | 2022 年 2 月 14 日 | 新股流通受限 | 11.90 | 45.45 | 315 | 3,748.50 | 14,316.75 | - |
| 301046 | 能辉科技 | 2021 年 8 月 10 日 | 2022 年 2 月 17 日 | 新股流通受限 | 8.34 | 48.99 | 290 | 2,418.60 | 14,207.10 | - |
| 301035 | 润丰股份 | 2021 年 7 月 21 日 | 2022 年 1 月 28 日 | 新股流通受限 | 22.04 | 56.28 | 191 | 4,209.64 | 10,749.48 | - |
| 301048 | 金鹰重工 | 2021 年 8 月 11 日 | 2022 年 2 月 18 日 | 新股流通受限 | 4.13 | 12.96 | 799 | 3,299.87 | 10,355.04 | - |
| 301089 | 拓新药业 | 2021 年 10 月 20 日 | 2022 年 4 月 27 日 | 新股流通受限 | 19.11 | 67.93 | 146 | 2,790.06 | 9,917.78 | - |
| 300774 | 倍杰特 | 2021 年 7 月 26 日 | 2022 年 2 月 7 日 | 新股流通受限 | 4.57 | 21.08 | 444 | 2,029.08 | 9,359.52 | - |
| 301040 | 中环海陆 | 2021 年 7 月 26 日 | 2022 年 2 月 7 日 | 新股流通受限 | 13.57 | 38.51 | 241 | 3,270.37 | 9,280.91 | - |
| 301062 | 上海艾录 | 2021 年 9 月 7 日 | 2022 年 3 月 14 日 | 新股流通受限 | 3.31 | 17.01 | 523 | 1,731.13 | 8,896.23 | - |
| 300814 | 中富电路 | 2021 年 8 月 4 日 | 2022 年 2 月 14 日 | 新股流通受限 | 8.40 | 23.88 | 328 | 2,755.20 | 7,832.64 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|--------|------------------|-----------------|------------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 301055 | 张 小 泉 | 2021 年 8 月 26 日 | 2022 年 3 月 7 日 | 新股流 通受限 | 6.90 | 21.78 | 355 | 2,449.50 | 7,731.90 | - |
| 301078 | 孩 子 王 | 2021 年 9 月 30 日 | 2022 年 4 月 14 日 | 新股流 通受限 | 5.77 | 12.14 | 612 | 3,531.24 | 7,429.68 | - |
| 301087 | 可 孚 医疗 | 2021 年 10 月 15 日 | 2022 年 4 月 25 日 | 新股流 通受限 | 93.09 | 75.34 | 85 | 7,912.65 | 6,403.90 | - |
| 301090 | 华 润 材料 | 2021 年 10 月 19 日 | 2022 年 4 月 26 日 | 新股流 通受限 | 10.45 | 11.22 | 566 | 5,914.70 | 6,350.52 | - |
| 301056 | 森 赫 股份 | 2021 年 8 月 27 日 | 2022 年 3 月 7 日 | 新股流 通受限 | 3.93 | 11.09 | 572 | 2,247.96 | 6,343.48 | - |
| 301041 | 金 百 泽 | 2021 年 8 月 2 日 | 2022 年 2 月 11 日 | 新股流 通受限 | 7.31 | 28.21 | 215 | 1,571.65 | 6,065.15 | - |
| 301072 | 中 捷 精工 | 2021 年 9 月 22 日 | 2022 年 3 月 29 日 | 新股流 通受限 | 7.46 | 33.41 | 181 | 1,350.26 | 6,047.21 | - |
| 301083 | 百 胜 智能 | 2021 年 10 月 13 日 | 2022 年 4 月 21 日 | 新股流 通受限 | 9.08 | 14.21 | 416 | 3,777.28 | 5,911.36 | - |
| 301049 | 超 越 科技 | 2021 年 8 月 17 日 | 2022 年 2 月 24 日 | 新股流 通受限 | 19.34 | 32.92 | 179 | 3,461.86 | 5,892.68 | - |
| 301081 | 严 牌 股份 | 2021 年 10 月 13 日 | 2022 年 4 月 20 日 | 新股流 通受限 | 12.95 | 17.44 | 319 | 4,131.05 | 5,563.36 | - |
| 300854 | 中 兰 环保 | 2021 年 9 月 8 日 | 2022 年 3 月 16 日 | 新股流 通受限 | 9.96 | 27.29 | 203 | 2,021.88 | 5,539.87 | - |
| 301063 | 海 锅 股份 | 2021 年 9 月 9 日 | 2022 年 3 月 24 日 | 新股流 通受限 | 17.40 | 36.11 | 153 | 2,662.20 | 5,524.83 | - |
| 301038 | 深 水 规院 | 2021 年 7 月 22 日 | 2022 年 2 月 7 日 | 新股流 通受限 | 6.68 | 20.23 | 266 | 1,776.88 | 5,381.18 | - |
| 301059 | 金 三 江 | 2021 年 9 月 3 日 | 2022 年 3 月 14 日 | 新股流 通受限 | 8.09 | 19.30 | 259 | 2,095.31 | 4,998.70 | - |
| 301036 | 双 乐 股份 | 2021 年 7 月 21 日 | 2022 年 2 月 | 新股流 通受限 | 23.38 | 29.93 | 159 | 3,717.42 | 4,758.87 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|-----------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| | | 日 | 7 日 | | | | | | | |
| 301037 | 保立佳 | 2021 年 7 月 21 日 | 2022 年 2 月 7 日 | 新股流通受限 | 14.82 | 24.26 | 193 | 2,860.26 | 4,682.18 | - |
| 301053 | 远信工业 | 2021 年 8 月 25 日 | 2022 年 3 月 1 日 | 新股流通受限 | 11.87 | 28.78 | 155 | 1,839.85 | 4,460.90 | - |
| 301057 | 汇隆新材 | 2021 年 8 月 31 日 | 2022 年 3 月 9 日 | 新股流通受限 | 8.03 | 19.02 | 218 | 1,750.54 | 4,146.36 | - |
| 301068 | 大地海洋 | 2021 年 9 月 16 日 | 2022 年 3 月 28 日 | 新股流通受限 | 13.98 | 28.38 | 144 | 2,013.12 | 4,086.72 | - |
| 301092 | 争光股份 | 2021 年 10 月 21 日 | 2022 年 5 月 5 日 | 新股流通受限 | 36.31 | 35.52 | 103 | 3,739.93 | 3,658.56 | - |
| 301088 | 戎美股份 | 2021 年 10 月 19 日 | 2022 年 4 月 28 日 | 新股流通受限 | 33.16 | 24.67 | 145 | 4,808.20 | 3,577.15 | - |
| 301079 | 邵阳液压 | 2021 年 10 月 11 日 | 2022 年 4 月 19 日 | 新股流通受限 | 11.92 | 24.82 | 140 | 1,668.80 | 3,474.80 | - |

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。

注 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。

注 3:根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》,发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式,安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

注 4:截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止,本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有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

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

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

综上所述，本基金在本报告期内流动性良好，无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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 | 719,684.35 | - | - | - | - | - | 719,684.35 |

| | | | | | | | |
|---------------------|------------|-------|------------|------|------|---------------|--------------|
| 结算备付金 | 2,070.15 | - | - | - | - | - | 2,070.15 |
| 存出保证金 | 49,218.01 | - | - | - | - | - | 49,218.01 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 971,934.86 | 971,934.86 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 93.85 | 93.85 |
| 资产总计 | 770,972.51 | - | - | - | - | 972,028.71 | 1,743,001.22 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 972.02 | 972.02 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 865.59 | 865.59 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 216.38 | 216.38 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 99.11 | 99.11 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 94,765.26 | 94,765.26 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 170,000.00 | 170,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 266,918.36 | 266,918.36 |
| 利率敏感度缺口 | 770,972.51 | - | - | - | - | 705,110.35 | 1,476,082.86 |
| 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 | 403,365.78 | - | - | - | - | - | 403,365.78 |
| 结算备付金 | 35,770.75 | - | - | - | - | - | 35,770.75 |
| 存出保证金 | 12,447.19 | - | - | - | - | - | 12,447.19 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -4,875,701.00 | 4,875,701.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 66.32 | 66.32 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 4,000.00 | 4,000.00 |
| 资产总计 | 451,583.72 | - | - | - | - | -4,879,767.32 | 5,331,351.04 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 7,551.08 | 7,551.08 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 7,284.29 | 7,284.29 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,214.06 | 1,214.06 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 1,955.12 | 1,955.12 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 20,919.58 | 20,919.58 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 20,000.00 | 20,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 58,924.13 | 58,924.13 |
| 利率敏感度缺口 | 451,583.72 | - | - | - | - | -4,820,843.19 | 5,272,426.91 |

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于报告期末及上年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 | 971,934.86 | 65.85 | 4,875,701.00 | 92.48 |
| 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 | 971,934.86 | 65.85 | 4,875,701.00 | 92.48 |

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% | | 46,423.14 |
| 沪深 300 指数下跌 5% | | -46,423.14 | -272,279.76 |

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 640,462.94 元，无属于第二层次的余额，属于第三层次的余额为人民币 331,471.92 元。（于 2020 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 4,875,701.00 元，无属于第二层次和第三层次的余额。）

本基金持有的金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 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三层次的余额为人民币 331,471.92 元；本报告期因购入非公开发行股票转入第三层次的金额为人民币 138,625.56 元，无转出第三层次的金额，计入公允价值变动损益的金额为人民币 192,846.36 元。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|--------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 971,934.86 | 55.76 |
| | 其中：股票 | 971,934.86 | 55.76 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 721,754.50 | 41.41 |
| 8 | 其他各项资产 | 49,311.86 | 2.83 |
| 9 | 合计 | 1,743,001.22 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 15,520.00 | 1.05 |
| C | 制造业 | 591,127.61 | 40.05 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 11,006.83 | 0.75 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,007.00 | 0.95 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 149,499.81 | 10.13 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 38,321.00 | 2.60 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 113,498.76 | 7.69 |

| | | | |
|---|---------------|------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 20,792.07 | 1.41 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 18,161.78 | 1.23 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 971,934.86 | 65.85 |

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 | 603259 | 药明康德 | 656 | 77,788.48 | 5.27 |
| 2 | 688767 | 博拓生物 | 1,153 | 76,536.14 | 5.19 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 1,200 | 58,452.00 | 3.96 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 700 | 51,667.00 | 3.50 |
| 5 | 000001 | 平安银行 | 2,900 | 47,792.00 | 3.24 |
| 6 | 002202 | 金风科技 | 2,599 | 42,805.53 | 2.90 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 541 | 27,271.81 | 1.85 |
| 8 | 002557 | 洽洽食品 | 392 | 24,053.12 | 1.63 |
| 9 | 301069 | 凯盛新材 | 539 | 23,829.19 | 1.61 |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 100 | 21,941.00 | 1.49 |
| 11 | 002271 | 东方雨虹 | 400 | 21,072.00 | 1.43 |
| 12 | 002372 | 伟星新材 | 825 | 20,064.00 | 1.36 |
| 13 | 002572 | 索菲亚 | 900 | 19,980.00 | 1.35 |
| 14 | 002032 | 苏泊尔 | 300 | 18,672.00 | 1.26 |
| 15 | 301060 | 兰卫医学 | 587 | 18,161.78 | 1.23 |
| 16 | 600298 | 安琪酵母 | 300 | 18,108.00 | 1.23 |
| 17 | 600690 | 海尔智家 | 600 | 17,934.00 | 1.21 |
| 18 | 300285 | 国瓷材料 | 400 | 17,028.00 | 1.15 |
| 19 | 600183 | 生益科技 | 700 | 16,485.00 | 1.12 |
| 20 | 002027 | 分众传媒 | 2,000 | 16,380.00 | 1.11 |
| 21 | 601100 | 恒立液压 | 200 | 16,360.00 | 1.11 |
| 22 | 300012 | 华测检测 | 600 | 16,122.00 | 1.09 |
| 23 | 601169 | 北京银行 | 3,600 | 15,984.00 | 1.08 |
| 24 | 601899 | 紫金矿业 | 1,600 | 15,520.00 | 1.05 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 25 | 002050 | 三花智控 | 600 | 15,180.00 | 1.03 |
| 26 | 002690 | 美亚光电 | 400 | 14,984.00 | 1.02 |
| 27 | 000651 | 格力电器 | 400 | 14,812.00 | 1.00 |
| 28 | 300994 | 久祺股份 | 315 | 14,316.75 | 0.97 |
| 29 | 301046 | 能辉科技 | 290 | 14,207.10 | 0.96 |
| 30 | 600009 | 上海机场 | 300 | 14,007.00 | 0.95 |
| 31 | 301035 | 润丰股份 | 191 | 10,749.48 | 0.73 |
| 32 | 301048 | 金鹰重工 | 799 | 10,355.04 | 0.70 |
| 33 | 301089 | 拓新药业 | 146 | 9,917.78 | 0.67 |
| 34 | 300774 | 倍杰特 | 444 | 9,359.52 | 0.63 |
| 35 | 301040 | 中环海陆 | 241 | 9,280.91 | 0.63 |
| 36 | 301062 | 上海艾录 | 523 | 8,896.23 | 0.60 |
| 37 | 300814 | 中富电路 | 328 | 7,832.64 | 0.53 |
| 38 | 301055 | 张小泉 | 355 | 7,731.90 | 0.52 |
| 39 | 301078 | 孩子王 | 612 | 7,429.68 | 0.50 |
| 40 | 301087 | 可孚医疗 | 85 | 6,403.90 | 0.43 |
| 41 | 301090 | 华润材料 | 566 | 6,350.52 | 0.43 |
| 42 | 301056 | 森赫股份 | 572 | 6,343.48 | 0.43 |
| 43 | 301041 | 金百泽 | 215 | 6,065.15 | 0.41 |
| 44 | 301072 | 中捷精工 | 181 | 6,047.21 | 0.41 |
| 45 | 301083 | 百胜智能 | 416 | 5,911.36 | 0.40 |
| 46 | 301049 | 超越科技 | 179 | 5,892.68 | 0.40 |
| 47 | 301081 | 严牌股份 | 319 | 5,563.36 | 0.38 |
| 48 | 300854 | 中兰环保 | 203 | 5,539.87 | 0.38 |
| 49 | 301063 | 海锅股份 | 153 | 5,524.83 | 0.37 |
| 50 | 301038 | 深水规院 | 266 | 5,381.18 | 0.36 |
| 51 | 301059 | 金三江 | 259 | 4,998.70 | 0.34 |
| 52 | 301036 | 双乐股份 | 159 | 4,758.87 | 0.32 |
| 53 | 301037 | 保立佳 | 193 | 4,682.18 | 0.32 |
| 54 | 301053 | 远信工业 | 155 | 4,460.90 | 0.30 |
| 55 | 301057 | 汇隆新材 | 218 | 4,146.36 | 0.28 |
| 56 | 301068 | 大地海洋 | 144 | 4,086.72 | 0.28 |
| 57 | 301092 | 争光股份 | 103 | 3,658.56 | 0.25 |
| 58 | 301088 | 戎美股份 | 145 | 3,577.15 | 0.24 |
| 59 | 301079 | 邵阳液压 | 140 | 3,474.80 | 0.24 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 15,341,258.55 | 290.97 |
| 2 | 603259 | 药明康德 | 14,767,760.69 | 280.09 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 14,650,400.00 | 277.87 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 11,389,553.00 | 216.02 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 10,511,708.00 | 199.37 |
| 6 | 002202 | 金风科技 | 9,702,870.95 | 184.03 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 4,225,307.53 | 80.14 |
| 8 | 300760 | 迈瑞医疗 | 4,146,679.00 | 78.65 |
| 9 | 601888 | 中国中免 | 4,007,558.00 | 76.01 |
| 10 | 600298 | 安琪酵母 | 3,795,621.00 | 71.99 |
| 11 | 002572 | 索菲亚 | 3,714,365.00 | 70.45 |
| 12 | 601169 | 北京银行 | 3,713,328.00 | 70.43 |
| 13 | 002557 | 洽洽食品 | 3,710,215.32 | 70.37 |
| 14 | 002032 | 苏泊尔 | 3,691,958.00 | 70.02 |
| 15 | 600009 | 上海机场 | 3,680,028.00 | 69.80 |
| 16 | 601100 | 恒立液压 | 3,624,653.00 | 68.75 |
| 17 | 300012 | 华测检测 | 3,598,651.00 | 68.25 |
| 18 | 002271 | 东方雨虹 | 3,585,432.00 | 68.00 |
| 19 | 002690 | 美亚光电 | 3,582,336.17 | 67.94 |
| 20 | 000651 | 格力电器 | 3,568,477.00 | 67.68 |
| 21 | 002027 | 分众传媒 | 3,560,986.00 | 67.54 |
| 22 | 002372 | 伟星新材 | 3,545,014.54 | 67.24 |
| 23 | 600690 | 海尔智家 | 3,521,389.00 | 66.79 |
| 24 | 601899 | 紫金矿业 | 3,511,488.00 | 66.60 |
| 25 | 002050 | 三花智控 | 3,455,129.00 | 65.53 |
| 26 | 601328 | 交通银行 | 3,427,806.00 | 65.01 |
| 27 | 300285 | 国瓷材料 | 3,377,975.14 | 64.07 |
| 28 | 600183 | 生益科技 | 3,242,128.00 | 61.49 |
| 29 | 600900 | 长江电力 | 301,457.00 | 5.72 |
| 30 | 300122 | 智飞生物 | 293,987.00 | 5.58 |
| 31 | 000661 | 长春高新 | 264,890.00 | 5.02 |

| | | | | |
|----|--------|--------|------------|------|
| 32 | 300124 | 汇川技术 | 261,930.00 | 4.97 |
| 33 | 601919 | 中远海控 | 253,445.00 | 4.81 |
| 34 | 601166 | 兴业银行 | 237,526.00 | 4.51 |
| 35 | 600763 | 通策医疗 | 232,715.00 | 4.41 |
| 36 | 600132 | 重庆啤酒 | 226,251.00 | 4.29 |
| 37 | 603392 | 万泰生物 | 220,062.00 | 4.17 |
| 38 | 601799 | 星宇股份 | 219,576.00 | 4.16 |
| 39 | 300059 | 东方财富 | 218,132.08 | 4.14 |
| 40 | 603288 | 海天味业 | 212,652.00 | 4.03 |
| 41 | 603806 | 福斯特 | 194,910.00 | 3.70 |
| 42 | 300759 | 康龙化成 | 190,637.00 | 3.62 |
| 43 | 300782 | 卓胜微 | 189,390.00 | 3.59 |
| 44 | 600426 | 华鲁恒升 | 177,338.00 | 3.36 |
| 45 | 000100 | TCL 科技 | 160,340.00 | 3.04 |
| 46 | 600438 | 通威股份 | 160,047.00 | 3.04 |
| 47 | 000725 | 京东方 A | 159,516.00 | 3.03 |
| 48 | 600309 | 万华化学 | 157,560.00 | 2.99 |
| 49 | 300677 | 英科医疗 | 155,964.00 | 2.96 |
| 50 | 601377 | 兴业证券 | 146,589.70 | 2.78 |
| 51 | 300033 | 同花顺 | 141,503.00 | 2.68 |
| 52 | 601939 | 建设银行 | 138,552.00 | 2.63 |
| 53 | 601825 | 沪农商行 | 137,772.00 | 2.61 |
| 54 | 300413 | 芒果超媒 | 134,355.00 | 2.55 |
| 55 | 300628 | 亿联网络 | 132,944.00 | 2.52 |
| 56 | 600176 | 中国巨石 | 132,304.00 | 2.51 |
| 57 | 002460 | 赣锋锂业 | 131,804.00 | 2.50 |
| 58 | 000069 | 华侨城 A | 131,537.00 | 2.49 |
| 59 | 300896 | 爱美客 | 131,189.00 | 2.49 |
| 60 | 601138 | 工业富联 | 129,227.00 | 2.45 |
| 61 | 300015 | 爱尔眼科 | 128,397.00 | 2.44 |
| 62 | 300274 | 阳光电源 | 125,719.00 | 2.38 |
| 63 | 688111 | 金山办公 | 124,260.00 | 2.36 |
| 64 | 601288 | 农业银行 | 124,164.00 | 2.35 |
| 65 | 000858 | 五粮液 | 122,995.00 | 2.33 |
| 66 | 300595 | 欧普康视 | 122,078.00 | 2.32 |
| 67 | 600000 | 浦发银行 | 120,082.00 | 2.28 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 68 | 600845 | 宝信软件 | 119,686.00 | 2.27 |
| 69 | 603486 | 科沃斯 | 117,552.00 | 2.23 |
| 70 | 002841 | 视源股份 | 117,112.00 | 2.22 |
| 71 | 002064 | 华峰化学 | 115,929.00 | 2.20 |
| 72 | 600999 | 招商证券 | 112,800.00 | 2.14 |
| 73 | 002709 | 天赐材料 | 111,948.00 | 2.12 |
| 74 | 002241 | 歌尔股份 | 111,541.00 | 2.12 |
| 75 | 601211 | 国泰君安 | 108,836.00 | 2.06 |
| 76 | 300454 | 深信服 | 108,274.00 | 2.05 |

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 14,580,128.00 | 276.54 |
| 2 | 603259 | 药明康德 | 14,410,361.80 | 273.32 |
| 3 | 002202 | 金风科技 | 13,124,183.74 | 248.92 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 11,855,450.36 | 224.86 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 9,977,439.00 | 189.24 |
| 6 | 000001 | 平安银行 | 9,587,029.00 | 181.83 |
| 7 | 601100 | 恒立液压 | 3,986,280.95 | 75.61 |
| 8 | 002557 | 洽洽食品 | 3,950,387.00 | 74.93 |
| 9 | 600009 | 上海机场 | 3,926,393.50 | 74.47 |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 3,851,434.53 | 73.05 |
| 11 | 002050 | 三花智控 | 3,823,867.00 | 72.53 |
| 12 | 300760 | 迈瑞医疗 | 3,726,190.00 | 70.67 |
| 13 | 601888 | 中国中免 | 3,551,692.00 | 67.36 |
| 14 | 601899 | 紫金矿业 | 3,515,407.00 | 66.68 |
| 15 | 601169 | 北京银行 | 3,434,757.84 | 65.15 |
| 16 | 600298 | 安琪酵母 | 3,381,039.00 | 64.13 |
| 17 | 600690 | 海尔智家 | 3,331,542.68 | 63.19 |
| 18 | 600183 | 生益科技 | 3,203,156.30 | 60.75 |
| 19 | 002690 | 美亚光电 | 3,174,245.00 | 60.20 |
| 20 | 601328 | 交通银行 | 3,122,707.00 | 59.23 |
| 21 | 300012 | 华测检测 | 3,075,077.00 | 58.32 |
| 22 | 002271 | 东方雨虹 | 2,929,700.00 | 55.57 |
| 23 | 300285 | 国瓷材料 | 2,915,027.82 | 55.29 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 24 | 002027 | 分众传媒 | 2,902,320.00 | 55.05 |
| 25 | 002032 | 苏泊尔 | 2,707,386.40 | 51.35 |
| 26 | 002372 | 伟星新材 | 2,664,920.36 | 50.54 |
| 27 | 002572 | 索菲亚 | 2,637,551.00 | 50.03 |
| 28 | 000651 | 格力电器 | 2,572,777.00 | 48.80 |
| 29 | 603486 | 科沃斯 | 338,333.00 | 6.42 |
| 30 | 688385 | 复旦微电 | 330,325.86 | 6.27 |
| 31 | 600438 | 通威股份 | 305,560.00 | 5.80 |
| 32 | 600900 | 长江电力 | 295,573.00 | 5.61 |
| 33 | 600809 | 山西汾酒 | 291,961.00 | 5.54 |
| 34 | 300122 | 智飞生物 | 291,226.00 | 5.52 |
| 35 | 601166 | 兴业银行 | 282,782.00 | 5.36 |
| 36 | 600143 | 金发科技 | 275,416.00 | 5.22 |
| 37 | 601919 | 中远海控 | 269,432.00 | 5.11 |
| 38 | 300124 | 汇川技术 | 261,388.00 | 4.96 |
| 39 | 600132 | 重庆啤酒 | 259,090.00 | 4.91 |
| 40 | 603392 | 万泰生物 | 248,270.00 | 4.71 |
| 41 | 601211 | 国泰君安 | 246,049.00 | 4.67 |
| 42 | 002714 | 牧原股份 | 241,170.20 | 4.57 |
| 43 | 000661 | 长春高新 | 240,501.00 | 4.56 |
| 44 | 601012 | 隆基股份 | 238,365.00 | 4.52 |
| 45 | 600763 | 通策医疗 | 237,471.00 | 4.50 |
| 46 | 300059 | 东方财富 | 236,718.20 | 4.49 |
| 47 | 002241 | 歌尔股份 | 233,026.00 | 4.42 |
| 48 | 300676 | 华大基因 | 232,383.00 | 4.41 |
| 49 | 300033 | 同花顺 | 230,805.00 | 4.38 |
| 50 | 300413 | 芒果超媒 | 230,082.00 | 4.36 |
| 51 | 002736 | 国信证券 | 226,480.00 | 4.30 |
| 52 | 300782 | 卓胜微 | 224,118.60 | 4.25 |
| 53 | 000568 | 泸州老窖 | 215,202.00 | 4.08 |
| 54 | 300015 | 爱尔眼科 | 212,300.50 | 4.03 |
| 55 | 603806 | 福斯特 | 212,258.00 | 4.03 |
| 56 | 601799 | 星宇股份 | 211,439.00 | 4.01 |
| 57 | 603882 | 金域医学 | 198,363.00 | 3.76 |
| 58 | 300759 | 康龙化成 | 193,876.00 | 3.68 |
| 59 | 002493 | 荣盛石化 | 191,962.00 | 3.64 |
| 60 | 600426 | 华鲁恒升 | 183,723.00 | 3.48 |
| 61 | 688778 | 厦钨新能 | 180,860.67 | 3.43 |

| | | | | |
|----|--------|--------|------------|------|
| 62 | 603288 | 海天味业 | 176,098.40 | 3.34 |
| 63 | 002475 | 立讯精密 | 176,040.00 | 3.34 |
| 64 | 601225 | 陕西煤业 | 174,591.00 | 3.31 |
| 65 | 603501 | 韦尔股份 | 172,623.00 | 3.27 |
| 66 | 688779 | 长远锂科 | 166,922.13 | 3.17 |
| 67 | 301069 | 凯盛新材 | 161,565.26 | 3.06 |
| 68 | 688798 | 艾为电子 | 154,734.72 | 2.93 |
| 69 | 002607 | 中公教育 | 153,369.00 | 2.91 |
| 70 | 600309 | 万华化学 | 153,165.00 | 2.91 |
| 71 | 688707 | 振华新材 | 152,405.46 | 2.89 |
| 72 | 688733 | 壹石通 | 149,415.50 | 2.83 |
| 73 | 601825 | 沪农商行 | 149,072.40 | 2.83 |
| 74 | 601377 | 兴业证券 | 147,994.00 | 2.81 |
| 75 | 002352 | 顺丰控股 | 146,975.00 | 2.79 |
| 76 | 601818 | 光大银行 | 143,499.00 | 2.72 |
| 77 | 688187 | 时代电气 | 142,385.17 | 2.70 |
| 78 | 000725 | 京东方 A | 142,311.00 | 2.70 |
| 79 | 002414 | 高德红外 | 141,385.40 | 2.68 |
| 80 | 300628 | 亿联网络 | 141,132.00 | 2.68 |
| 81 | 002705 | 新宝股份 | 140,409.00 | 2.66 |
| 82 | 000895 | 双汇发展 | 136,126.00 | 2.58 |
| 83 | 601939 | 建设银行 | 134,982.00 | 2.56 |
| 84 | 301046 | 能辉科技 | 133,965.06 | 2.54 |
| 85 | 300896 | 爱美客 | 131,120.00 | 2.49 |
| 86 | 300595 | 欧普康视 | 130,975.00 | 2.48 |
| 87 | 688509 | 正元地信 | 129,408.58 | 2.45 |
| 88 | 000100 | TCL 科技 | 129,140.00 | 2.45 |
| 89 | 301078 | 孩子王 | 123,155.08 | 2.34 |
| 90 | 301048 | 金鹰重工 | 122,217.00 | 2.32 |
| 91 | 601288 | 农业银行 | 120,909.00 | 2.29 |
| 92 | 601066 | 中信建投 | 119,950.00 | 2.28 |
| 93 | 688511 | 天微电子 | 119,858.71 | 2.27 |
| 94 | 002030 | 达安基因 | 119,625.00 | 2.27 |
| 95 | 002064 | 华峰化学 | 119,450.00 | 2.27 |
| 96 | 688718 | 唯赛勃 | 119,321.54 | 2.26 |
| 97 | 688787 | 海天瑞声 | 118,857.65 | 2.25 |
| 98 | 000858 | 五粮液 | 118,417.00 | 2.25 |
| 99 | 600000 | 浦发银行 | 116,738.00 | 2.21 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|------------|------|
| 100 | 000069 | 华侨城 A | 115,484.00 | 2.19 |
| 101 | 601138 | 工业富联 | 113,967.00 | 2.16 |
| 102 | 600999 | 招商证券 | 112,370.00 | 2.13 |
| 103 | 688622 | 禾信仪器 | 112,142.53 | 2.13 |
| 104 | 300454 | 深信服 | 111,491.00 | 2.11 |
| 105 | 600845 | 宝信软件 | 111,369.00 | 2.11 |
| 106 | 688711 | 宏微科技 | 110,935.72 | 2.10 |
| 107 | 600176 | 中国巨石 | 110,707.00 | 2.10 |
| 108 | 688103 | 国力股份 | 110,693.49 | 2.10 |
| 109 | 002812 | 恩捷股份 | 108,490.00 | 2.06 |
| 110 | 301055 | 张小泉 | 107,171.40 | 2.03 |
| 111 | 600111 | 北方稀土 | 106,224.00 | 2.01 |
| 112 | 300274 | 阳光电源 | 105,456.00 | 2.00 |

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 | 168,696,073.52 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 165,868,235.63 |

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

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人民币 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。

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 | 49,218.01 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 93.85 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 49,311.86 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1 | 688767 | 博拓生物 | 76,536.14 | 5.19 | 新股流通受限 |
| 2 | 301069 | 凯盛新材 | 23,829.19 | 1.61 | 新股流通受限 |

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 |
| 九泰天奕量化价值混合 A | 117 | 8,024.53 | - | 0.00% | 938,870.47 | 100.00% |
| 九泰天奕量化价值混合 C | 86 | 4,115.83 | - | 0.00% | 353,961.74 | 100.00% |
| 合计 | 203 | 6,368.63 | - | 0.00% | 1,292,832.21 | 100.00% |

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

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 | 九泰天奕量化价值混合 A | 2,783.55 | 0.2965% |
| | 九泰天奕量化价值混合 C | 164.44 | 0.0465% |
| | 合计 | 2,947.99 | 0.2280% |

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 九泰天奕量化价值混合 A | 0~10 |
| | 九泰天奕量化价值混合 C | 0 |

| | | |
|-----------------|--------------|------|
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 九泰天奕量化价值混合 A | 0 |
| | 九泰天奕量化价值混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 九泰天奕量化价值 混合 A | 九泰天奕量化价值 混合 C |
|------------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2020 年 5 月 29 日）基金 份额总额 | 21,287,116.30 | 193,630,981.13 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,982,726.61 | 2,247,046.20 |
| 本报告期基金总申购份额 | 118,697,021.73 | 1,878,546.52 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 119,740,877.87 | 3,771,630.98 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 938,870.47 | 353,961.74 |

注：总申购份额含转换入份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

为保护基金份额持有人的利益，根据《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》等法律法规的规定和《九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，基金管理人九泰基金管理有限公司自 2021 年 2 月 27 日至 2021 年 3 月 16 日以通讯方式召开了九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会，审议《关于持续运作九泰天奕量化价值混合型证券投资基金的议案》。本次基金份额持有人大会已于 2021 年 3 月 17 日完成计票工作，同意票所代表的基金份额达到参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的二分之一以上，满足法定生效条件，符合《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》和《九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本次会议议案获得通过。本次基金份额持有人大会决议自 2021 年 3 月 18 日起生效，基金管理人已将表决通过的事项报中国证券监督管理委员会备案。

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：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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。该会计师事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 五矿证券 | 2 | 248,145,151.49 | 74.72% | 181,466.51 | 73.29% | - |
| 东方财富证券 | 2 | 60,374,047.33 | 18.18% | 44,151.91 | 17.83% | - |
| 招商证券 | 2 | 23,595,286.48 | 7.10% | 21,974.32 | 8.88% | - |

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单经公募基金业务投资决策委员会审批，同意后与被选择的证券经营机构签订相关协议。基金管理人与被选

择的券商经纪人在签订协议时，要明确签定协议双方的公司名称、协议有效期、佣金率、双方的权利义务等。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：新增五矿证券上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个，东方财富证券上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------|------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 五矿证券 | - | - | 95,000,000.00 | 65.52% | - | - |
| 东方财富证券 | - | - | 50,000,000.00 | 34.48% | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-----------|-----------------|
| 1 | 九泰天奕量化价值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 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金（九泰天奕量化价值混合 A 份额）基金产品资料概要（更新） | 规定网站 | 2021 年 1 月 15 日 |
| 3 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金（九泰天奕量化价值混合 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旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 5 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告 | 规定网站 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 6 | 九泰基金管理有限公司关于以通讯方式召开九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 2 月 5 日 |

| | | | |
|----|--|-----------|-----------------|
| | 基金份额持有人大会的公告 | | |
| 7 | 九泰基金管理有限公司关于以通讯方式召开九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 2 月 8 日 |
| 8 | 九泰基金管理有限公司关于以通讯方式召开九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 2 月 9 日 |
| 9 | 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 |
| 10 | 九泰基金管理有限公司关于九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告及公证书 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 3 月 18 日 |
| 11 | 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 |
| 12 | 九泰天奕量化价值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 |
| 13 | 九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与其申购费率优惠活动的公告 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 4 月 17 日 |
| 14 | 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 |
| 15 | 九泰天奕量化价值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 |
| 16 | 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 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 4 月 30 日 |
| 17 | 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 7 月 2 日 |
| 18 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 7 月 20 日 |

| | | | |
|----|---|-----------|------------------|
| 19 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告 | 规定网站 | 2021 年 7 月 21 日 |
| 20 | 九泰基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2021 年 7 月 21 日 |
| 21 | 九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与销售机构申购费率优惠活动的公告 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 7 月 30 日 |
| 22 | 关于九泰天奕量化价值混合型证券投资基金降低费率及调整申购金额限制并修改基金合同等法律文件的公告 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 8 月 11 日 |
| 23 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金招募说明书更新 | 规定网站 | 2021 年 8 月 11 日 |
| 24 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金（九泰天奕量化价值混合 A 份额）基金产品资料概要（更新） | 规定网站 | 2021 年 8 月 11 日 |
| 25 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金（九泰天奕量化价值混合 C 份额）基金产品资料概要（更新） | 规定网站 | 2021 年 8 月 11 日 |
| 26 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金合同 | 规定网站 | 2021 年 8 月 11 日 |
| 27 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金托管协议 | 规定网站 | 2021 年 8 月 11 日 |
| 28 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2021 年中期报告 | 规定网站 | 2021 年 8 月 31 日 |
| 29 | 九泰基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告 | 规定报刊 | 2021 年 8 月 31 日 |
| 30 | 九泰基金管理有限公司关于调整直销柜台《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》 | 规定报刊和规定网站 | 2021 年 9 月 3 日 |
| 31 | 九泰基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 32 | 九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告 | 规定网站 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 33 | 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 |

| | | | |
|----|------------------------------|-----------|------------------|
| 34 | 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 |
| 35 | 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 |
| 36 | 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 |
| 37 | 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 |
| 机构 | 1 | 20210226 至 20210607 | 0.00 | 1,525,320.32 | 1,525,320.32 | 0.00 | 0.00% |
| | 2 | 20211029 至 20211202 | 0.00 | 1,525,320.32 | 1,525,320.32 | 0.00 | 0.00% |
| 个人 | 1 | 20210101 至 20210225 | 900,675.00 | 0.00 | 900,675.00 | 0.00 | 0.00% |
| 产品 | 1 | 20211025 至 20211031 | 0.00 | 20,526,606.66 | 20,526,606.66 | 0.00 | 0.00% |
| | 2 | 20210608 至 20211024 | 0.00 | 36,316,006.34 | 36,316,006.34 | 0.00 | 0.00% |
| | 3 | 20211025 至 20211025 | 0.00 | 21,316,121.90 | 21,316,121.90 | 0.00 | 0.00% |
| | 4 | 20211025 至 20211025 | 0.00 | 19,737,091.43 | 19,737,091.43 | 0.00 | 0.00% |
| | 5 | 20211025 至 20211026 | 0.00 | 20,526,606.66 | 20,526,606.66 | 0.00 | 0.00% |

产品特有风险

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

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足广大投资者的投资需求，降低基金份额持有人的成本，根据《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》等相关法律法规的规定及《九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人九泰基金管理有限公司自 2021 年 8 月 11 日起，将九泰天奕量化价值混合型证券投资基金的管理费年费率由 1.50%降低至 0.60%，托管费年费率由 0.25%降低至 0.15%，销售服务费年费率由 0.80%降低至 0.20%，同时调整申购金额限制，并修订《九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金合同》、《九泰天奕量化价值混合型证券投资基金托管协议》、《九泰天奕量化价值混合型证券投资基金招募说明书》与《九泰天奕量化价值混合型证券投资基金基金产品资料概要》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

九泰基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日