

九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	70
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	70
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	70
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
7.12 投资组合报告附注.....	70
§8 基金份额持有人信息.....	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	75
§10 重大事件揭示.....	76
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
10.4 基金投资策略的改变.....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	77
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	80

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录.....	81
12.1 备查文件目录.....	81
12.2 存放地点.....	81
12.3 查阅方式.....	81

§ 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	34,562,439.20 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	789,814.65 份	33,772,624.55 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
	联系电话	010-57383999
	电子邮箱	chenpei@jtamc.com
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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jtamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	九泰基金管理有限公司	北京市朝阳区安立路30号仰山公园2号楼1栋西侧一层、二层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	九泰天奕量化价值混合 A	九泰天奕量化价值混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	-9,703.39	-506,136.50
本期利润	35,659.55	537,861.57
加权平均基金份额本期利润	0.0433	0.0135
本期加权平均净值利润率	3.84%	1.21%
本期基金份额净值增长率	3.84%	3.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	-233,506.55	-10,204,695.04
期末可供分配基金份额利润	-0.2956	-0.3022
期末基金资产净值	938,732.18	39,731,587.52
期末基金份额净值	1.1885	1.1764
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	18.85%	17.64%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

九泰天奕量化价值混合 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
过去一个月	7.57%	0.69%	8.63%	0.96%	-1.06%	-0.27%
过去三个月	6.32%	1.01%	5.64%	1.29%	0.68%	-0.28%
过去六个月	3.84%	1.00%	-8.22%	1.31%	12.06%	-0.31%
过去一年	-3.41%	1.00%	-12.65%	1.12%	9.24%	-0.12%
自基金合同	18.85%	1.22%	15.06%	1.15%	3.79%	0.07%

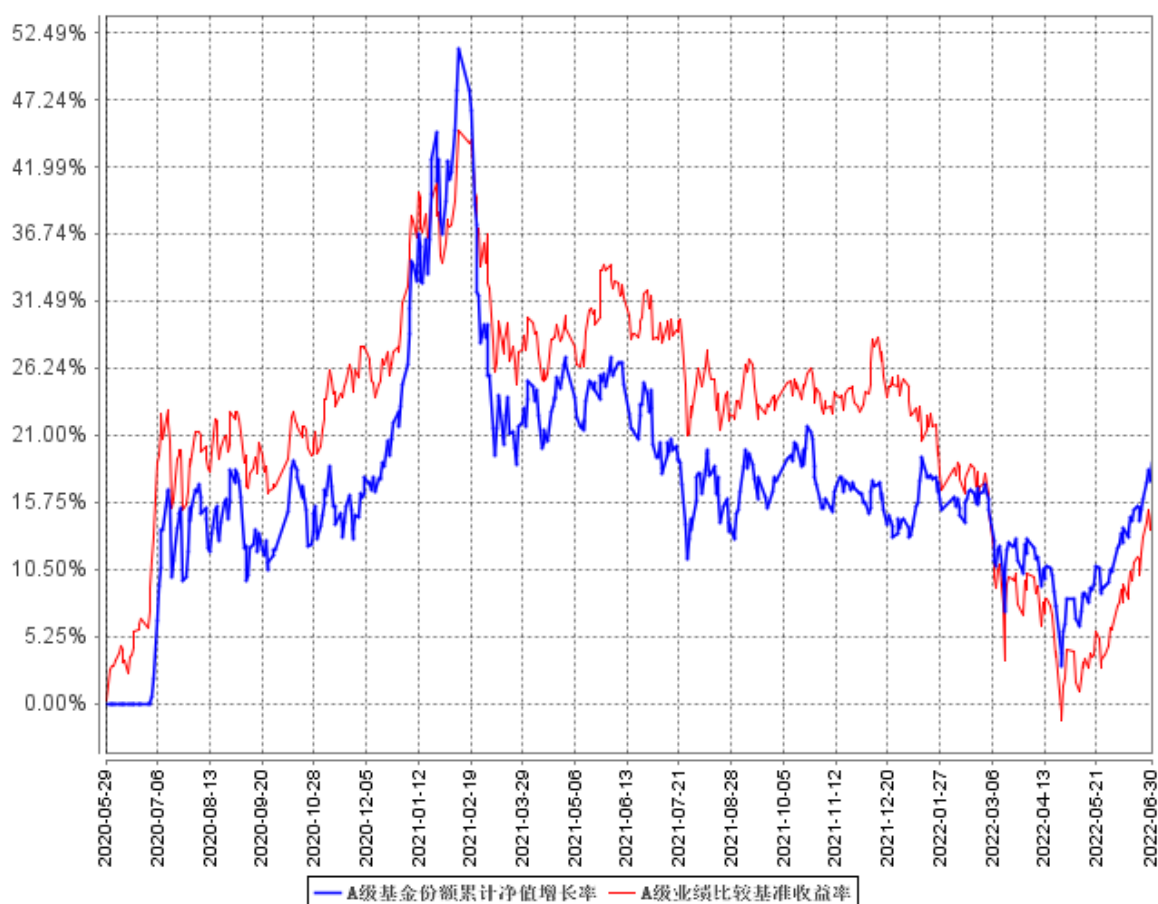
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

九泰天变量化价值混合 C

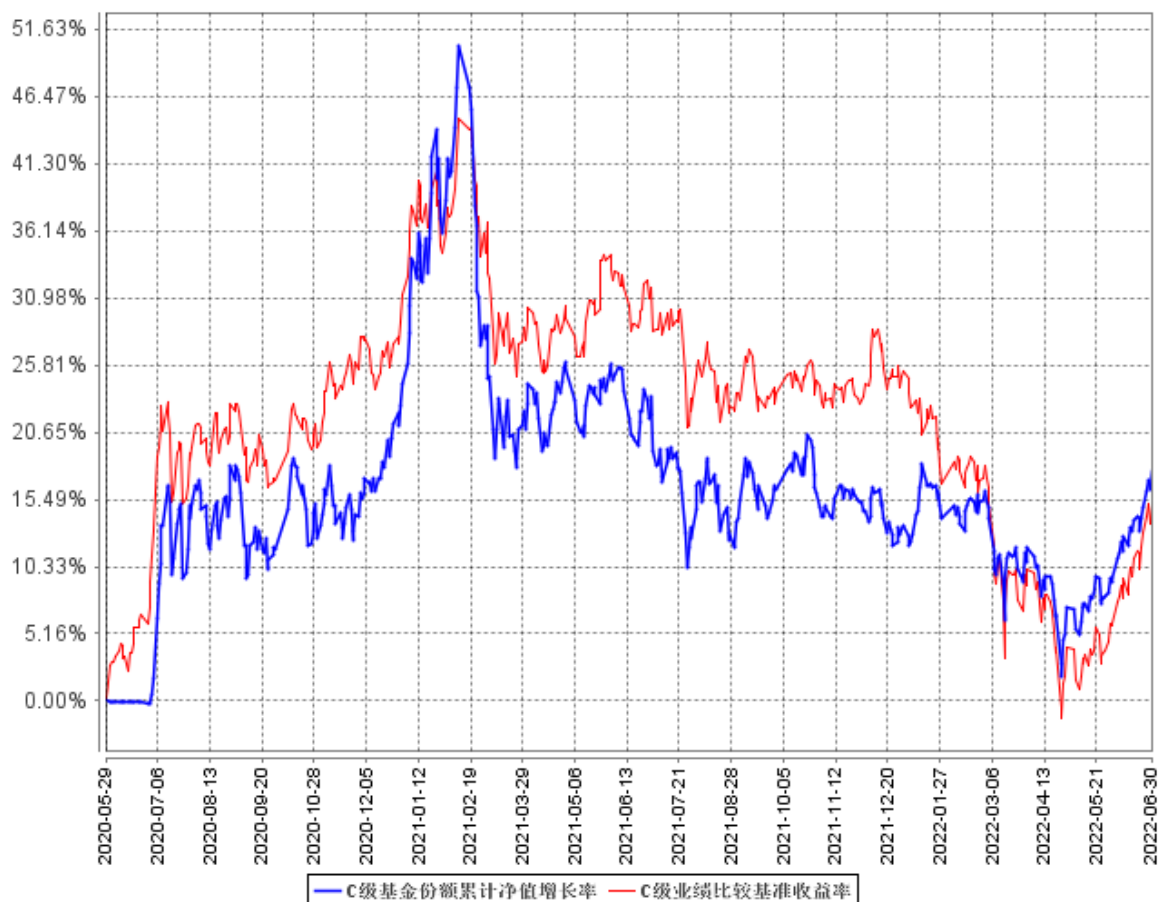
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.55%	0.69%	8.63%	0.96%	-1.08%	-0.27%
过去三个月	6.28%	1.02%	5.64%	1.29%	0.64%	-0.27%
过去六个月	3.73%	1.00%	-8.22%	1.31%	11.95%	-0.31%
过去一年	-3.55%	1.00%	-12.65%	1.12%	9.10%	-0.12%
自基金合同生效起至今	17.64%	1.22%	15.06%	1.15%	2.58%	0.07%

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。

§ 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（2022 年 6 月 30 日），基金管理人共管理 27 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、九泰锐和 18 个月定期开放混合型证券投资基金、九泰锐升 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、九泰久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	2022 年 1 月 10	-	6	金融学硕士，6 年证券从

	理、九章 量化投 资部总 经理	日			业经历。历任思高方达基金服务（加拿大）基金分析部总监、汇丰银行投资银行部副总经理、桐湾投资管理咨询(上海)有限公司量化投研部投资总监、联储证券有限责任公司资产管理部投资总监、大同证券上海资产管理分公司副总经理兼投资总监。2021 年 10 月加入九泰基金管理有限公司，现任九章量化投资部总经理、基金经理，具有基金从业资格。
孟亚强	基金经 理、天元 量化投 资部总 经理	2020 年 5 月 29 日	2022 年 1 月 13 日	13	南开大学保险精算硕士，13 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，现任天元量化投资部总经理、基金经理，具有基金从业资格。

注：

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金未发生基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金采用多策略量化模型，同时寻找具备长期投资价值的优秀企业，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。另一方面，通过调整权益资产仓位、配置债券资产和参与国债逆回购来降低组合波动以及增厚产品收益。报告期内，市场经历了大幅震荡调整，整个一季度，由于宏观经济差、俄乌战争爆发以及上海疫情等因素，各主流指数纷纷下跌超 10%。而在二季度，国内市场展现出了相对独立的行情，叠加外部利空出尽、国内政策利好、市场流动性增加、资产估值偏低以及投资者风险偏好提升的因素影响，市场走出了深 V 趋势，各宽基指数大多反弹 20%-30%。本基金在报告期内结合中短期策略，增加了部分高端制造、新能源及消费等板块配置，并且投资了部分具有长期投资价值的优质企业。

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 1.1885 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.84%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.1764 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.73%；同期业绩比较基准收益率为-8.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历跌宕起伏的 2022 年上半年，虽然 5 月市场走出了超跌反弹的行情，但目前 A 股动态估值

处于历史区间偏低水平，具备中线投资价值。但是下半年市场内外部环境可能面临一定挑战，市场上行空间需更多积极催化剂支持，因此短期不冲动，中期或较乐观。下半年投资的主线可能会由估值与业绩共同推动，因为根据历史规律，市场对于超预期下跌的反弹和修复一般都是从估值开始，当市场及行业估值修复到一定水平之后，市场的推动就需要靠良好的业绩来保障。目前国内的宽流动性政策为市场提供了足量的资金，在前期市场的超跌反弹过程中，估值得到了一定的修复，同时也消耗了一定的市场资金，使市场剩余流动性减少，难以继续推动估值一路向上，后面必须靠业绩来推动整个市场继续前进。所以下半年我们要着重从业绩加估值的主线来投资机会。相对来讲，下半年的中下游产业的业绩修复能力的确定性可能会更强。一是因为内需，有希望受益于疫情消退、复工复产及货币政策落地等因素，从而展开修复；另一方面是因为很多大宗商品见顶，上半年受损于上游原材料暴涨而需求下降的中下游领域，随着大宗商品的回落，中下游行业的业绩有望得到改善和提升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金管理人设立了由估值业务分管高管、研究业务分管高管、督察长、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金出现超过连续 20 个工作日（2022 年 3 月 7 日-2022 年 6 月 1 日）基金资产净值低于 5000 万元的情形，未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对九泰基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：九泰天奕量化价值混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	21,216,476.07	719,684.35
结算备付金		10,197,315.75	2,070.15
存出保证金		14,812.78	49,218.01
交易性金融资产	6.4.7.2	25,231,357.52	971,934.86
其中：股票投资		25,231,357.52	971,934.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,000,000.00	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	93.85
资产总计		59,659,962.12	1,743,001.22
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,718,244.96	-

应付赎回款		15,055,341.70	972.02
应付管理人报酬		26,009.58	865.59
应付托管费		6,502.41	216.38
应付销售服务费		8,521.21	99.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	175,022.56	264,765.26
负债合计		18,989,642.42	266,918.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	34,562,439.20	1,292,832.21
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	6,107,880.50	183,250.65
净资产合计		40,670,319.70	1,476,082.86
负债和净资产总计		59,659,962.12	1,743,001.22

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，九泰天奕量化价值混合 A 类基金份额净值人民币 1.1885 元，九泰天奕量化价值混合 C 类基金份额净值人民币 1.1764 元；基金份额总额 34,562,439.20 份，其中九泰天奕量化价值混合 A 类基金份额 789,814.65 份，九泰天奕量化价值混合 C 类基金份额 33,772,624.55 份。

6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		811,145.84	-3,455,201.11
1.利息收入		82,784.69	9,317.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	33,141.15	6,440.79
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		49,643.54	2,876.72
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-414,157.41	825,220.39
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-705,620.90	675,370.21
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	291,463.49	149,850.18
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,089,361.01	-4,291,090.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	53,157.55	1,351.55
减：二、营业总支出		237,624.72	424,327.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	134,357.63	154,651.97
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,589.42	25,775.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	43,861.29	12,713.26
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	25,816.38	231,186.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		573,521.12	-3,879,528.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		573,521.12	-3,879,528.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		573,521.12	-3,879,528.41

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,292,832.21	-	183,250.65	1,476,082.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,292,832.21	-	183,250.65	1,476,082.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	33,269,606.99	-	5,924,629.85	39,194,236.84
（一）、综合收益总额	-	-	573,521.12	573,521.12
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	33,269,606.99	-	5,351,108.73	38,620,715.72
其中：1.基金申购款	56,813,328.69	-	9,076,925.00	65,890,253.69
2.基金赎回款	-23,543,721.70	-	-3,725,816.27	-27,269,537.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产 （基金净值）	34,562,439.20	-	6,107,880.50	40,670,319.70
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	4,229,772.81	-	1,042,654.10	5,272,426.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	4,229,772.81	-	1,042,654.10	5,272,426.91
三、本期增减变动 额（减少以“-”号 填列）	104,017,954.35	-	23,889,781.19	127,907,735.54
（一）、综合收益 总额	-	-	-3,879,528.41	-3,879,528.41
（二）、本期基金 份额交易产生的基 金净值变动数（净 值减少以“-”号填 列）	104,017,954.35	-	27,769,309.60	131,787,263.95
其中：1.基金申购款	106,905,988.91	-	28,593,497.69	135,499,486.60
2.基金赎回款	-2,888,034.56	-	-824,188.09	-3,712,222.65
（三）、本期向基 金份额持有人分配 利润产生的基金净 值变动（净值减少	-	-	-	-

以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	108,247,727.16	-	24,932,435.29	133,180,162.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 严军 荣静 荣静
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

九泰天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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照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”)以及中国证监会发布的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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日止 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020

年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

在金融资产分类与计量方面，新金融工具准则要求金融资产基于其合同现金流量特征及本基金管理该等资产的业务模式分类为“以摊余成本计量的金融资产”、“以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产”和“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产”三大类别，取消了原金融工具准则中贷款和应收款项、持有至到期投资和可供出售金融资产等分类。

在减值方面，新金融工具准则有关减值的要求适用于以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及应收账款。新金融工具准则要求采用预期信用损失模型确认信用损失准备，以替代原先的已发生信用损失模型。新减值模型采用三阶段模型，依据相关项目自初始确认后信用风险是否发生显著增加，信用损失准备按 12 个月内预期信用损失或者整个存续期的预期信用损失进行计提。本基金对应收账款按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。“应收利息”科目和“应付利息”科目仅反映相关金融工具已到期可收取或应支付但于资产负债表日尚未收到或尚未支付的利息，在“其他资产”或“其他负债”项目中列示。

本基金在编制 2022 中期财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为人民币 719,684.35 元、人民币 2,070.15 元、人民币 49,218.01 元和人民币 93.85 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金和存出保证金。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金和存出保证金等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金和存出保证金的期初金额分别为人民币 719,755.20 元、人民币 2,071.05 元和人民币 49,240.11 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	21,216,476.07
等于：本金	21,216,092.49
加：应计利息	383.58
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	21,216,476.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	23,997,793.36	-	25,231,357.52	1,233,564.16
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债	-	-	-	-
交易所市场	-	-	-	-
银行间市场	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	23,997,793.36	-	25,231,357.52	1,233,564.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	150,227.37
其中：交易所市场	150,227.37
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提审计费用	24,795.19
合计	175,022.56

6.4.7.10 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	938,870.47	938,870.47
本期申购	49,029.11	49,029.11
本期赎回(以“-”号填列)	-198,084.93	-198,084.93
- 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	789,814.65	789,814.65

金额单位：人民币元

九泰天奕量化价值混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	353,961.74	353,961.74
本期申购	56,764,299.58	56,764,299.58
本期赎回(以“-”号填列)	-23,345,636.77	-23,345,636.77
- 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	33,772,624.55	33,772,624.55

注：本期申购中包含转换入份额和金额，赎回中包含转换出份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

九泰天奕量化价值混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-267,521.25	403,319.18	135,797.93
本期利润	-9,703.39	45,362.94	35,659.55
本期基金份额交易产生的变动数	43,718.09	-66,258.04	-22,539.95
其中：基金申购款	-14,699.08	22,228.86	7,529.78
基金赎回款	58,417.17	-88,486.90	-30,069.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-233,506.55	382,424.08	148,917.53

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
本期期初	-102,811.18	150,263.90	47,452.72
本期利润	-506,136.50	1,043,998.07	537,861.57
本期基金份额交易	-9,595,747.36	14,969,396.04	5,373,648.68

产生的变动数			
其中：基金申购款	-16,864,525.47	25,933,920.69	9,069,395.22
基金赎回款	7,268,778.11	-10,964,524.65	-3,695,746.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,204,695.04	16,163,658.01	5,958,962.97

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	10,869.86
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	19,209.98
其他	3,061.31
合计	33,141.15

注：其他指结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	139,565,659.67
减：卖出股票成本总额	139,840,724.15
减：交易费用	430,556.42
买卖股票差价收入	-705,620.90

6.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无证券支持资产投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	291,463.49
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	291,463.49

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,089,361.01
——股票投资	1,089,361.01
——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	1,089,361.01

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	53,157.02
基金转换费收入	0.53
合计	53,157.55

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,021.19
合计	25,816.38

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截止至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
九泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	134,357.63	154,651.97
其中：支付销售机构的客户维护费	5,732.67	7,535.15

注：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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,589.42	25,775.35

注：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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天奕量化价值混合 A	九泰天奕量化价值混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	40,402.80	40,402.80
合计	-	40,402.80	40,402.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰天奕量化价值混合 A	九泰天奕量化价值混合 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	5,098.72	5,098.72
合计	-	5,098.72	5,098.72

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 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。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 个工作日或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金于本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	21,216,476.07	10,869.86	8,043,880.06	6,245.76

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人在商业银行开立的托管账户，投资其他银行存款由基金管理人根据投

资制度审慎选择存款银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 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 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

综上所述，本基金在本报告期内流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,216,476.07	-	-	-	-	-	-21,216,476.07
结算备付金	10,197,315.75	-	-	-	-	-	-10,197,315.75
存出保证金	14,812.78	-	-	-	-	-	14,812.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-25,231,357.52	25,231,357.52
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	3,000,000.00	3,000,000.00
资产总计	31,428,604.60	-	-	-	-	-28,231,357.52	59,659,962.12
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,718,244.96	3,718,244.96
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,055,341.70	15,055,341.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,009.58	26,009.58
应付托管费	-	-	-	-	-	6,502.41	6,502.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,521.21	8,521.21
其他负债	-	-	-	-	-	175,022.56	175,022.56
负债总计	-	-	-	-	-	18,989,642.42	18,989,642.42
利率敏感度缺口	31,428,604.60	-	-	-	-	9,241,715.10	40,670,319.70
上年度末 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
其他资产	-	-	-	-	-	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
其他负债	-	-	-	-	-	264,765.26	264,765.26
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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	25,231,357.52	62.04	971,934.86	65.85
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	25,231,357.52	62.04	971,934.86	65.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	1,270,704.50	46,423.14
	沪深 300 指数下跌 5%	-1,270,704.50	-46,423.14

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值**6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	25,231,357.52	640,462.94
第二层次	-	-
第三层次	-	331,471.92
合计	25,231,357.52	971,934.86

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	25,231,357.52	42.29
	其中：股票	25,231,357.52	42.29
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	3,000,000.00	5.03
	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	31,413,791.82	52.65
8	其他各项资产	14,812.78	0.02
9	合计	59,659,962.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	643,714.00	1.58
B	采矿业	795,879.00	1.96
C	制造业	15,700,083.94	38.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	659,536.85	1.62
E	建筑业	497,214.00	1.22
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	301,206.00	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	516,780.00	1.27
J	金融业	5,088,227.29	12.51
K	房地产业	536,963.00	1.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	429,793.44	1.06

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	61,960.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	25,231,357.52	62.04

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	700	1,431,500.00	3.52
2	600036	招商银行	21,500	907,300.00	2.23
3	601318	中国平安	18,941	884,355.29	2.17
4	000333	美的集团	11,500	694,485.00	1.71
5	002129	TCL 中环	11,600	683,124.00	1.68
6	601658	邮储银行	97,400	524,986.00	1.29
7	601166	兴业银行	26,000	517,400.00	1.27
8	002460	赣锋锂业	3,200	475,840.00	1.17
9	600919	江苏银行	65,900	469,208.00	1.15
10	002142	宁波银行	12,100	433,301.00	1.07
11	600887	伊利股份	11,000	428,450.00	1.05
12	688981	中芯国际	9,400	424,598.00	1.04
13	603259	药明康德	4,056	421,783.44	1.04
14	002475	立讯精密	11,900	402,101.00	0.99
15	600690	海尔智家	14,400	395,424.00	0.97
16	002714	牧原股份	7,000	386,890.00	0.95
17	300122	智飞生物	3,200	355,232.00	0.87
18	601601	中国太保	14,300	336,479.00	0.83
19	002594	比亚迪	1,000	333,490.00	0.82
20	600438	通威股份	5,100	305,286.00	0.75
21	600392	盛和资源	13,500	305,100.00	0.75
22	002415	海康威视	8,400	304,080.00	0.75

23	600900	长江电力	13,000	300,560.00	0.74
24	000876	新希望	19,600	299,880.00	0.74
25	000651	格力电器	8,800	296,736.00	0.73
26	600426	华鲁恒升	9,400	274,480.00	0.67
27	600089	特变电工	9,900	271,161.00	0.67
28	000001	平安银行	18,100	271,138.00	0.67
29	601328	交通银行	54,200	269,916.00	0.66
30	000100	TCL 科技	55,200	264,408.00	0.65
31	002821	凯莱英	900	260,100.00	0.64
32	600809	山西汾酒	800	259,840.00	0.64
33	002352	顺丰控股	4,600	256,726.00	0.63
34	300498	温氏股份	12,000	255,480.00	0.63
35	601186	中国铁建	31,800	251,220.00	0.62
36	002812	恩捷股份	1,000	250,450.00	0.62
37	601615	明阳智能	7,400	250,120.00	0.62
38	601012	隆基绿能	3,660	243,865.80	0.60
39	001979	招商蛇口	17,300	232,339.00	0.57
40	600111	北方稀土	6,600	232,056.00	0.57
41	300014	亿纬锂能	2,200	214,500.00	0.53
42	300750	宁德时代	400	213,600.00	0.53
43	000799	酒鬼酒	1,100	204,391.00	0.50
44	000895	双汇发展	6,600	193,380.00	0.48
45	002405	四维图新	12,800	192,896.00	0.47
46	300601	康泰生物	4,140	187,045.20	0.46
47	603986	兆易创新	1,300	184,873.00	0.45
48	002001	新和成	8,040	183,392.40	0.45
49	601288	农业银行	59,800	180,596.00	0.44
50	601668	中国建筑	33,400	177,688.00	0.44
51	002240	盛新锂能	2,900	175,044.00	0.43
52	000725	京东方 A	43,100	169,814.00	0.42
53	300142	沃森生物	3,500	169,365.00	0.42
54	002555	三七互娱	7,200	152,856.00	0.38
55	600989	宝丰能源	10,300	150,895.00	0.37
56	601939	建设银行	24,900	150,894.00	0.37
57	603019	中科曙光	5,100	148,002.00	0.36
58	601088	中国神华	4,100	136,530.00	0.34
59	300363	博腾股份	1,700	132,583.00	0.33
60	600547	山东黄金	7,000	129,920.00	0.32
61	002304	洋河股份	700	128,205.00	0.32

62	002493	荣盛石化	8,200	126,198.00	0.31
63	600521	华海药业	5,500	124,850.00	0.31
64	600522	中天科技	5,300	122,430.00	0.30
65	601899	紫金矿业	13,100	122,223.00	0.30
66	600048	保利发展	6,700	116,982.00	0.29
67	600362	江西铜业	6,513	116,126.79	0.29
68	601995	中金公司	2,600	115,674.00	0.28
69	000063	中兴通讯	4,500	114,885.00	0.28
70	000792	盐湖股份	3,700	110,852.00	0.27
71	002648	卫星化学	4,256	110,017.60	0.27
72	300118	东方日升	3,700	108,521.00	0.27
73	300073	当升科技	1,200	108,408.00	0.27
74	000683	远兴能源	10,300	108,253.00	0.27
75	600011	华能国际	15,200	107,008.00	0.26
76	002463	沪电股份	7,200	106,272.00	0.26
77	600383	金地集团	7,800	104,832.00	0.26
78	002241	歌尔股份	3,100	104,160.00	0.26
79	300724	捷佳伟创	1,100	98,285.00	0.24
80	600176	中国巨石	5,600	97,496.00	0.24
81	600795	国电电力	24,900	97,359.00	0.24
82	600141	兴发集团	2,200	96,778.00	0.24
83	688303	大全能源	1,400	95,648.00	0.24
84	300568	星源材质	3,200	92,928.00	0.23
85	300390	天华超净	1,000	87,400.00	0.21
86	600487	亨通光电	6,000	87,240.00	0.21
87	600872	中炬高新	2,500	86,525.00	0.21
88	601857	中国石油	16,300	86,390.00	0.21
89	600905	三峡能源	13,465	84,694.85	0.21
90	002371	北方华创	300	83,136.00	0.20
91	600559	老白干酒	2,800	80,332.00	0.20
92	000002	万科 A	3,900	79,950.00	0.20
93	300418	昆仑万维	4,900	78,400.00	0.19
94	601699	潞安环能	5,100	74,562.00	0.18
95	000937	冀中能源	9,100	67,886.00	0.17
96	600497	驰宏锌锗	12,900	66,951.00	0.16
97	601985	中国核电	9,500	65,170.00	0.16
98	601600	中国铝业	13,700	65,075.00	0.16
99	688005	容百科技	500	64,720.00	0.16
100	600409	三友化工	7,800	63,882.00	0.16

101	000739	普洛药业	2,900	59,856.00	0.15
102	601225	陕西煤业	2,600	55,068.00	0.14
103	300398	飞凯材料	2,400	54,864.00	0.13
104	600406	国电南瑞	1,940	52,380.00	0.13
105	600172	黄河旋风	6,000	52,320.00	0.13
106	601390	中国中铁	8,500	52,190.00	0.13
107	000933	神火股份	3,900	51,012.00	0.13
108	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.12
109	000568	泸州老窖	200	49,308.00	0.12
110	601238	广汽集团	3,200	48,768.00	0.12
111	603799	华友钴业	500	47,810.00	0.12
112	600779	水井坊	500	46,270.00	0.11
113	300661	圣邦股份	250	45,505.00	0.11
114	601919	中远海控	3,200	44,480.00	0.11
115	002245	蔚蓝锂芯	1,900	44,099.00	0.11
116	300763	锦浪科技	200	42,600.00	0.10
117	688396	华润微	700	41,349.00	0.10
118	603369	今世缘	800	40,800.00	0.10
119	300663	科蓝软件	2,600	40,248.00	0.10
120	603198	迎驾贡酒	600	39,084.00	0.10
121	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.09
122	300343	联创股份	2,500	37,975.00	0.09
123	000893	亚钾国际	1,100	37,851.00	0.09
124	600732	爱旭股份	1,100	36,322.00	0.09
125	300413	芒果超媒	1,000	33,360.00	0.08
126	688599	天合光能	500	32,625.00	0.08
127	300782	卓胜微	240	32,400.00	0.08
128	601877	正泰电器	900	32,202.00	0.08
129	000831	五矿稀土	1,000	31,250.00	0.08
130	002756	永兴材料	200	30,442.00	0.07
131	300182	捷成股份	5,200	28,600.00	0.07
132	600771	广誉远	800	28,120.00	0.07
133	601688	华泰证券	1,900	26,980.00	0.07
134	603659	璞泰来	300	25,320.00	0.06
135	002466	天齐锂业	200	24,960.00	0.06
136	002074	国轩高科	500	22,800.00	0.06
137	002759	天际股份	800	21,744.00	0.05
138	300482	万孚生物	500	20,355.00	0.05
139	300316	晶盛机电	300	20,277.00	0.05

140	601168	西部矿业	1,700	20,111.00	0.05
141	688185	康希诺	100	19,908.00	0.05
142	300346	南大光电	520	18,709.60	0.05
143	600711	盛屯矿业	2,300	17,848.00	0.04
144	601868	中国能建	6,800	16,116.00	0.04
145	688298	东方生物	137	15,638.55	0.04
146	600549	厦门钨业	700	15,134.00	0.04
147	601898	中煤能源	1,300	13,494.00	0.03
148	300204	舒泰神	1,000	13,420.00	0.03
149	000960	锡业股份	700	11,739.00	0.03
150	600499	科达制造	500	10,320.00	0.03
151	002374	中锐股份	2,300	9,453.00	0.02
152	688388	嘉元科技	100	8,487.00	0.02
153	002050	三花智控	300	8,244.00	0.02
154	300081	恒信东方	900	8,010.00	0.02
155	000887	中鼎股份	400	7,296.00	0.02
156	002709	天赐材料	100	6,206.00	0.02
157	600028	中国石化	1,200	4,896.00	0.01
158	600863	内蒙华电	1,300	4,745.00	0.01
159	600346	恒力石化	200	4,448.00	0.01
160	688772	珠海冠宇	100	3,070.00	0.01
161	000656	金科股份	1,000	2,860.00	0.01
162	000860	顺鑫农业	100	2,682.00	0.01
163	002124	天邦食品	200	1,344.00	0.00
164	601222	林洋能源	100	835.00	0.00
165	600219	南山铝业	100	369.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	4,675,020.00	316.72
2	300750	宁德时代	3,910,105.00	264.90
3	603259	药明康德	2,665,299.95	180.57
4	002460	赣锋锂业	2,623,675.00	177.75
5	600036	招商银行	2,509,476.00	170.01

6	002466	天齐锂业	2,199,126.00	148.98
7	601318	中国平安	2,110,115.00	142.95
8	300014	亿纬锂能	2,052,866.00	139.08
9	601012	隆基绿能	2,037,713.60	138.05
10	000858	五粮液	1,944,327.00	131.72
11	000333	美的集团	1,813,844.00	122.88
12	601166	兴业银行	1,658,217.00	112.34
13	600887	伊利股份	1,609,537.00	109.04
14	002371	北方华创	1,605,588.00	108.77
15	002475	立讯精密	1,574,547.00	106.67
16	002352	顺丰控股	1,532,848.79	103.85
17	600030	中信证券	1,513,369.00	102.53
18	002129	TCL 中环	1,429,980.00	96.88
19	603986	兆易创新	1,382,207.00	93.64
20	002821	凯莱英	1,371,719.00	92.93
21	600690	海尔智家	1,356,257.00	91.88
22	002142	宁波银行	1,293,653.00	87.64
23	600809	山西汾酒	1,287,688.00	87.24
24	300073	当升科技	1,273,952.00	86.31
25	002594	比亚迪	1,272,059.00	86.18
26	601888	中国中免	1,257,453.00	85.19
27	603799	华友钴业	1,222,190.00	82.80
28	002241	歌尔股份	1,206,668.00	81.75
29	600276	恒瑞医药	1,199,715.00	81.28
30	000002	万科 A	1,180,068.00	79.95
31	300122	智飞生物	1,165,657.00	78.97
32	600111	北方稀土	1,151,848.00	78.03
33	600900	长江电力	1,147,006.00	77.71
34	300207	欣旺达	1,139,550.00	77.20
35	000063	中兴通讯	1,127,156.00	76.36
36	600919	江苏银行	1,095,913.00	74.24
37	300274	阳光电源	1,091,702.00	73.96
38	002812	恩捷股份	1,090,462.00	73.88
39	300347	泰格医药	1,089,084.00	73.78
40	002240	盛新锂能	1,082,787.00	73.36
41	300059	东方财富	1,077,653.00	73.01

42	002709	天赐材料	1,050,293.00	71.15
43	601688	华泰证券	1,010,619.00	68.47
44	000661	长春高新	1,003,540.00	67.99
45	601658	邮储银行	976,874.00	66.18
46	600745	闻泰科技	976,089.00	66.13
47	688599	天合光能	948,297.84	64.24
48	600460	士兰微	943,907.00	63.95
49	002415	海康威视	921,010.00	62.40
50	002714	牧原股份	882,196.00	59.77
51	601919	中远海控	870,878.00	59.00
52	601088	中国神华	862,180.00	58.41
53	601601	中国太保	847,796.00	57.44
54	601899	紫金矿业	847,138.00	57.39
55	000876	新希望	846,833.00	57.37
56	300601	康泰生物	825,130.00	55.90
57	300661	圣邦股份	818,372.00	55.44
58	688981	中芯国际	798,549.34	54.10
59	300498	温氏股份	787,422.00	53.35
60	600438	通威股份	785,107.00	53.19
61	601225	陕西煤业	761,589.00	51.60
62	000568	泸州老窖	749,280.00	50.76
63	000100	TCL 科技	743,592.00	50.38
64	002230	科大讯飞	740,038.00	50.14
65	000977	浪潮信息	733,582.00	49.70
66	002008	大族激光	732,549.00	49.63
67	002001	新和成	728,430.00	49.35
68	300496	中科创达	727,974.00	49.32
69	600703	三安光电	727,507.00	49.29
70	600570	恒生电子	717,917.48	48.64
71	000001	平安银行	710,315.72	48.12
72	300015	爱尔眼科	683,224.87	46.29
73	603501	韦尔股份	679,007.00	46.00
74	000792	盐湖股份	674,391.00	45.69
75	300316	晶盛机电	669,494.00	45.36
76	600588	用友网络	665,534.00	45.09
77	600779	水井坊	656,090.00	44.45

78	300759	康龙化成	652,875.00	44.23
79	000725	京东方 A	650,983.00	44.10
80	300223	北京君正	646,035.00	43.77
81	600584	长电科技	641,367.00	43.45
82	603260	合盛硅业	629,101.00	42.62
83	601800	中国交建	626,007.00	42.41
84	002013	中航机电	622,977.00	42.20
85	300433	蓝思科技	620,958.00	42.07
86	002459	晶澳科技	614,293.00	41.62
87	300769	德方纳米	603,073.00	40.86
88	688012	中微公司	602,818.25	40.84
89	002405	四维图新	602,642.00	40.83
90	000799	酒鬼酒	589,125.00	39.91
91	002049	紫光国微	584,539.00	39.60
92	000596	古井贡酒	580,487.00	39.33
93	300363	博腾股份	570,299.00	38.64
94	000625	长安汽车	563,630.00	38.18
95	600884	杉杉股份	561,147.00	38.02
96	601838	成都银行	556,248.00	37.68
97	600547	山东黄金	554,728.00	37.58
98	601615	明阳智能	546,003.00	36.99
99	600009	上海机场	536,891.00	36.37
100	300782	卓胜微	533,708.00	36.16
101	300408	三环集团	522,426.00	35.39
102	001979	招商蛇口	519,166.00	35.17
103	600958	东方证券	511,212.00	34.63
104	601186	中国铁建	510,059.00	34.55
105	601669	中国电建	506,656.00	34.32
106	600436	片仔癀	506,447.00	34.31
107	002050	三花智控	499,572.00	33.84
108	300450	先导智能	496,987.00	33.67
109	601633	长城汽车	491,072.00	33.27
110	603589	口子窖	488,883.00	33.12
111	603019	中科曙光	487,940.00	33.06
112	300763	锦浪科技	485,160.00	32.87
113	601668	中国建筑	482,869.00	32.71

114	600048	保利发展	482,150.00	32.66
115	600893	航发动力	481,153.90	32.60
116	000651	格力电器	475,238.00	32.20
117	002756	永兴材料	470,628.00	31.88
118	600426	华鲁恒升	464,917.00	31.50
119	601009	南京银行	464,067.00	31.44
120	300413	芒果超媒	452,100.00	30.63
121	600141	兴发集团	450,535.00	30.52
122	601328	交通银行	447,710.00	30.33
123	300390	天华超净	445,752.00	30.20
124	002920	德赛西威	443,276.00	30.03
125	600256	广汇能源	438,779.00	29.73
126	603659	璞泰来	435,368.00	29.49
127	000066	中国长城	428,501.00	29.03
128	000895	双汇发展	425,496.00	28.83
129	601238	广汽集团	422,277.00	28.61
130	600089	特变电工	422,157.00	28.60
131	000301	东方盛虹	421,458.00	28.55
132	002410	广联达	420,638.00	28.50
133	600521	华海药业	419,028.00	28.39
134	601985	中国核电	415,129.00	28.12
135	300896	爱美客	410,650.00	27.82
136	002555	三七互娱	402,245.00	27.25
137	002074	国轩高科	388,883.00	26.35
138	600392	盛和资源	386,798.00	26.20
139	002304	洋河股份	384,285.00	26.03
140	600499	科达制造	382,247.00	25.90
141	601995	中金公司	371,083.00	25.14
142	600406	国电南瑞	370,740.00	25.12
143	600765	中航重机	368,681.00	24.98
144	603993	洛阳钼业	363,570.00	24.63
145	601288	农业银行	360,467.00	24.42
146	600176	中国巨石	359,610.00	24.36
147	688303	大全能源	358,811.76	24.31
148	300033	同花顺	356,748.00	24.17
149	600926	杭州银行	350,225.00	23.73

150	600183	生益科技	347,675.00	23.55
151	002493	荣盛石化	347,430.50	23.54
152	000776	广发证券	343,002.00	23.24
153	603369	今世缘	342,237.00	23.19
154	002180	纳思达	340,961.00	23.10
155	600600	青岛啤酒	336,459.00	22.79
156	600741	华域汽车	336,243.00	22.78
157	601211	国泰君安	334,105.00	22.63
158	300760	迈瑞医疗	328,562.00	22.26
159	600872	中炬高新	325,847.00	22.08
160	600702	舍得酒业	324,997.54	22.02
161	601939	建设银行	318,328.00	21.57
162	600233	圆通速递	315,012.00	21.34
163	002602	世纪华通	312,250.00	21.15
164	600010	包钢股份	306,230.00	20.75
165	300142	沃森生物	304,175.00	20.61
166	600150	中国船舶	301,772.00	20.44
167	600598	北大荒	297,424.00	20.15
168	600018	上港集团	295,754.00	20.04
169	600585	海螺水泥	294,964.00	19.98
170	000938	紫光股份	290,209.00	19.66
171	688005	容百科技	288,664.70	19.56
172	600085	同仁堂	284,715.00	19.29
173	600760	中航沈飞	283,801.00	19.23
174	605358	立昂微	283,476.00	19.20
175	600905	三峡能源	279,129.00	18.91
176	002120	韵达股份	277,231.00	18.78
177	600522	中天科技	273,946.00	18.56
178	688187	时代电气	271,276.28	18.38
179	601100	恒立液压	270,469.00	18.32
180	000768	中航西飞	270,230.00	18.31
181	601898	中煤能源	270,092.00	18.30
182	600489	中金黄金	267,432.00	18.12
183	600989	宝丰能源	266,134.00	18.03
184	601699	潞安环能	255,665.00	17.32
185	601377	兴业证券	249,573.00	16.91

186	601021	春秋航空	239,734.00	16.24
187	600332	白云山	238,905.00	16.19
188	601816	京沪高铁	238,824.00	16.18
189	600309	万华化学	238,203.00	16.14
190	002326	永太科技	238,041.00	16.13
191	002648	卫星化学	231,872.00	15.71
192	688396	华润微	226,234.80	15.33
193	603185	上机数控	224,044.00	15.18
194	002271	东方雨虹	219,561.00	14.87
195	300919	中伟股份	218,354.00	14.79
196	600298	安琪酵母	214,121.00	14.51
197	600362	江西铜业	213,923.20	14.49
198	002497	雅化集团	212,073.00	14.37
199	600188	兖矿能源	211,343.00	14.32
200	002407	多氟多	210,586.00	14.27
201	601857	中国石油	210,030.00	14.23
202	600011	华能国际	208,214.00	14.11
203	002938	鹏鼎控股	202,679.00	13.73
204	603290	斯达半导	202,355.00	13.71
205	300373	扬杰科技	198,980.00	13.48
206	300118	东方日升	198,881.00	13.47
207	603538	美诺华	198,858.00	13.47
208	603198	迎驾贡酒	194,082.00	13.15
209	300346	南大光电	193,025.00	13.08
210	300677	英科医疗	191,323.00	12.96
211	600196	复星医药	190,070.00	12.88
212	601336	新华保险	188,979.00	12.80
213	688298	东方生物	185,064.00	12.54
214	601066	中信建投	179,380.00	12.15
215	600348	华阳股份	179,147.00	12.14
216	002032	苏泊尔	178,659.00	12.10
217	601988	中国银行	178,287.00	12.08
218	002236	大华股份	178,114.00	12.07
219	600763	通策医疗	177,849.00	12.05
220	000739	普洛药业	173,924.00	11.78
221	000683	远兴能源	169,597.00	11.49

222	600038	中直股份	168,888.00	11.44
223	300077	国民技术	162,773.00	11.03
224	601766	中国中车	162,770.00	11.03
225	688008	澜起科技	161,936.58	10.97
226	688363	华熙生物	160,981.87	10.91
227	300979	华利集团	159,891.00	10.83
228	300568	星源材质	157,716.00	10.68
229	000983	山西焦煤	156,179.00	10.58
230	600039	四川路桥	152,224.00	10.31
231	600383	金地集团	149,866.00	10.15
232	300438	鹏辉能源	149,585.00	10.13
233	601818	光大银行	148,827.00	10.08
234	300751	迈为股份	148,450.00	10.06
235	600028	中国石化	147,954.00	10.02
236	600016	民生银行	145,305.00	9.84
237	601456	国联证券	144,299.00	9.78
238	603229	奥翔药业	143,874.40	9.75
239	601229	上海银行	143,809.00	9.74
240	601390	中国中铁	143,132.00	9.70
241	601799	星宇股份	142,056.00	9.62
242	603806	福斯特	140,363.00	9.51
243	600050	中国联通	140,266.00	9.50
244	300672	国科微	139,238.00	9.43
245	603893	瑞芯微	134,503.00	9.11
246	000937	冀中能源	133,186.00	9.02
247	000733	振华科技	133,121.00	9.02
248	002463	沪电股份	132,492.00	8.98
249	300999	金龙鱼	132,397.00	8.97
250	002268	卫士通	132,168.00	8.95
251	600732	爱旭股份	130,735.00	8.86
252	600795	国电电力	129,583.00	8.78
253	002603	以岭药业	129,375.00	8.76
254	300957	贝泰妮	127,012.00	8.60
255	600096	云天化	126,088.00	8.54
256	601872	招商轮船	124,718.00	8.45
257	601689	拓普集团	124,072.00	8.41

258	688065	凯赛生物	123,860.96	8.39
259	002384	东山精密	123,497.00	8.37
260	300398	飞凯材料	122,828.00	8.32
261	000933	神火股份	121,407.00	8.22
262	601877	正泰电器	117,858.00	7.98
263	300037	新宙邦	112,197.00	7.60
264	688126	沪硅产业	110,628.84	7.49
265	605499	东鹏饮料	110,444.00	7.48
266	000166	申万宏源	110,284.00	7.47
267	601878	浙商证券	110,222.00	7.47
268	601156	东航物流	109,697.00	7.43
269	002916	深南电路	108,662.00	7.36
270	300418	昆仑万维	107,292.00	7.27
271	600497	驰宏锌锗	106,844.00	7.24
272	600132	重庆啤酒	105,004.00	7.11
273	601006	大秦铁路	104,810.00	7.10
274	601233	桐昆股份	102,834.00	6.97
275	002064	华峰化学	102,636.00	6.95
276	601169	北京银行	102,179.00	6.92
277	300724	捷佳伟创	100,871.00	6.83
278	002736	国信证券	100,828.00	6.83
279	601600	中国铝业	100,137.00	6.78
280	601868	中国能建	100,137.00	6.78
281	000970	中科三环	97,600.00	6.61
282	301089	拓新药业	95,677.00	6.48
283	688111	金山办公	94,565.00	6.41
284	600409	三友化工	94,135.00	6.38
285	600563	法拉电子	94,024.00	6.37
286	688180	君实生物	92,809.04	6.29
287	000762	西藏矿业	91,744.00	6.22
288	003816	中国广核	89,139.00	6.04
289	600487	亨通光电	85,440.00	5.79
290	600699	均胜电子	85,396.00	5.79
291	600015	华夏银行	84,673.00	5.74
292	600115	中国东航	84,512.00	5.73
293	000807	云铝股份	83,940.00	5.69

294	601117	中国化学	81,502.00	5.52
295	688390	固德威	81,112.00	5.50
296	000338	潍柴动力	79,568.00	5.39
297	600559	老白干酒	78,973.00	5.35
298	002027	分众传媒	76,270.00	5.17
299	603392	万泰生物	74,995.00	5.08
300	600988	赤峰黄金	74,917.00	5.08
301	600771	广誉远	71,610.00	4.85
302	600346	恒力石化	71,304.00	4.83
303	601138	工业富联	69,438.00	4.70
304	600845	宝信软件	67,717.00	4.59
305	603288	海天味业	67,000.00	4.54
306	002601	龙佰集团	66,320.00	4.49
307	002080	中材科技	66,200.00	4.48
308	000960	锡业股份	66,063.00	4.48
309	300204	舒泰神	63,811.00	4.32
310	300087	荃银高科	62,227.00	4.22
311	000893	亚钾国际	61,749.00	4.18
312	300035	中科电气	61,220.00	4.15
313	300663	科蓝软件	60,630.00	4.11
314	600029	南方航空	60,465.00	4.10
315	001965	招商公路	59,945.00	4.06
316	600999	招商证券	59,226.00	4.01
317	300311	任子行	59,223.00	4.01
318	000069	华侨城 A	58,297.00	3.95
319	601788	光大证券	57,746.00	3.91
320	000425	徐工机械	56,461.00	3.83
321	600062	华润双鹤	56,325.00	3.82
322	603456	九洲药业	54,943.00	3.72
323	002245	蔚蓝锂芯	54,771.00	3.71
324	600172	黄河旋风	54,749.00	3.71
325	300454	深信服	54,324.00	3.68
326	601168	西部矿业	50,907.00	3.45
327	300081	恒信东方	50,817.00	3.44
328	688772	珠海冠宇	50,602.00	3.43
329	601618	中国中冶	49,892.00	3.38

330	002185	华天科技	49,650.00	3.36
331	000932	华菱钢铁	49,145.00	3.33
332	601607	上海医药	48,189.00	3.26
333	688185	康希诺	44,848.00	3.04
334	300482	万孚生物	44,843.00	3.04
335	000831	五矿稀土	44,015.00	2.98
336	601360	三六零	43,896.00	2.97
337	000877	天山股份	43,511.00	2.95
338	600516	方大炭素	42,205.00	2.86
339	601865	福莱特	41,683.00	2.82
340	600019	宝钢股份	41,106.00	2.78
341	000736	中交地产	40,735.00	2.76
342	002182	云海金属	40,543.00	2.75
343	603605	珀莱雅	40,041.00	2.71
344	601966	玲珑轮胎	39,261.00	2.66
345	600875	东方电气	38,978.00	2.64
346	300182	捷成股份	38,885.00	2.63
347	601155	新城控股	38,679.00	2.62
348	600918	中泰证券	38,600.00	2.62
349	688561	奇安信	38,065.00	2.58
350	600160	巨化股份	37,819.00	2.56
351	300343	联创股份	37,675.00	2.55
352	600754	锦江酒店	37,648.00	2.55
353	603568	伟明环保	37,487.00	2.54
354	300124	汇川技术	37,147.00	2.52
355	600886	国投电力	36,826.00	2.49
356	601825	沪农商行	36,240.00	2.46
357	688388	嘉元科技	35,611.67	2.41
358	601111	中国国航	35,384.00	2.40
359	601998	中信银行	34,677.00	2.35
360	002311	海大集团	34,205.00	2.32
361	300146	汤臣倍健	33,714.00	2.28
362	600316	洪都航空	33,495.00	2.27
363	603486	科沃斯	33,443.00	2.27
364	000519	中兵红箭	32,145.00	2.18
365	603026	石大胜华	31,923.00	2.16

366	002600	领益智造	30,463.00	2.06
367	002939	长城证券	29,915.00	2.03
368	688036	传音控股	29,605.65	2.01

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	3,547,562.00	240.34
2	600519	贵州茅台	3,320,895.00	224.98
3	603259	药明康德	2,411,409.16	163.37
4	002466	天齐锂业	2,363,202.00	160.10
5	002460	赣锋锂业	2,292,085.00	155.28
6	601012	隆基绿能	1,944,690.00	131.75
7	000858	五粮液	1,918,610.08	129.98
8	300014	亿纬锂能	1,879,588.00	127.34
9	600036	招商银行	1,599,466.00	108.36
10	002371	北方华创	1,561,227.00	105.77
11	600030	中信证券	1,375,713.00	93.20
12	002352	顺丰控股	1,340,398.60	90.81
13	601888	中国中免	1,293,508.00	87.63
14	603799	华友钴业	1,256,336.00	85.11
15	000333	美的集团	1,228,912.00	83.25
16	603986	兆易创新	1,210,978.56	82.04
17	300274	阳光电源	1,194,166.00	80.90
18	600276	恒瑞医药	1,180,142.00	79.95
19	002821	凯莱英	1,172,694.00	79.45
20	601318	中国平安	1,171,110.00	79.34
21	600887	伊利股份	1,168,387.00	79.15
22	600809	山西汾酒	1,155,507.27	78.28
23	000002	万科 A	1,116,496.00	75.64
24	300207	欣旺达	1,107,235.00	75.01
25	601166	兴业银行	1,106,341.00	74.95
26	300073	当升科技	1,093,846.00	74.10
27	002475	立讯精密	1,076,716.00	72.94
28	300059	东方财富	1,070,934.00	72.55
29	300347	泰格医药	1,038,887.00	70.38

30	000661	长春高新	1,021,905.00	69.23
31	002709	天赐材料	1,013,947.00	68.69
32	002594	比亚迪	1,009,102.00	68.36
33	000063	中兴通讯	1,005,406.00	68.11
34	002241	歌尔股份	979,459.00	66.36
35	002129	TCL 中环	973,862.00	65.98
36	600745	闻泰科技	969,071.00	65.65
37	600460	士兰微	965,886.00	65.44
38	688599	天合光能	958,592.23	64.94
39	600690	海尔智家	948,995.00	64.29
40	002240	盛新锂能	942,130.00	63.83
41	300122	智飞生物	892,028.00	60.43
42	600111	北方稀土	887,952.00	60.16
43	002812	恩捷股份	867,197.00	58.75
44	601688	华泰证券	831,128.00	56.31
45	600900	长江电力	818,218.00	55.43
46	002142	宁波银行	816,561.00	55.32
47	601919	中远海控	807,071.00	54.68
48	002230	科大讯飞	803,497.00	54.43
49	601088	中国神华	782,910.00	53.04
50	601225	陕西煤业	774,635.00	52.48
51	300496	中科创达	751,566.46	50.92
52	600703	三安光电	740,507.00	50.17
53	300661	圣邦股份	723,303.00	49.00
54	300015	爱尔眼科	720,093.87	48.78
55	000568	泸州老窖	718,460.00	48.67
56	300759	康龙化成	705,533.00	47.80
57	300601	康泰生物	705,407.00	47.79
58	000977	浪潮信息	693,762.00	47.00
59	600919	江苏银行	682,546.00	46.24
60	601800	中国交建	673,347.00	45.62
61	600438	通威股份	666,670.00	45.16
62	002459	晶澳科技	664,190.00	45.00
63	600570	恒生电子	660,957.64	44.78
64	601899	紫金矿业	660,345.00	44.74
65	002008	大族激光	648,328.00	43.92
66	300316	晶盛机电	644,963.00	43.69
67	002415	海康威视	644,563.00	43.67

68	603260	合盛硅业	640,789.00	43.41
69	300769	德方纳米	636,125.00	43.10
70	688012	中微公司	615,796.93	41.72
71	600584	长电科技	610,421.00	41.35
72	002013	中航机电	608,670.00	41.24
73	601838	成都银行	604,240.00	40.94
74	603501	韦尔股份	604,038.00	40.92
75	600588	用友网络	585,951.00	39.70
76	600779	水井坊	584,241.00	39.58
77	300223	北京君正	583,797.00	39.55
78	002049	紫光国微	580,287.00	39.31
79	000625	长安汽车	577,515.00	39.12
80	600884	杉杉股份	574,821.00	38.94
81	300498	温氏股份	573,364.00	38.84
82	600009	上海机场	568,016.00	38.48
83	000792	盐湖股份	547,146.00	37.07
84	601669	中国电建	541,703.00	36.70
85	000876	新希望	540,001.00	36.58
86	000596	古井贡酒	534,768.00	36.23
87	002714	牧原股份	532,376.00	36.07
88	300433	蓝思科技	529,804.00	35.89
89	601601	中国太保	529,722.00	35.89
90	000100	TCL 科技	511,602.00	34.66
91	002001	新和成	510,864.60	34.61
92	601009	南京银行	508,807.00	34.47
93	300782	卓胜微	508,558.00	34.45
94	300450	先导智能	505,877.00	34.27
95	600436	片仔癀	489,500.00	33.16
96	000001	平安银行	489,133.29	33.14
97	000725	京东方 A	488,659.00	33.11
98	603589	口子窖	486,808.00	32.98
99	002050	三花智控	485,737.00	32.91
100	600893	航发动力	485,547.00	32.89
101	002756	永兴材料	478,827.00	32.44
102	600256	广汇能源	461,837.00	31.29
103	300408	三环集团	448,737.00	30.40
104	600958	东方证券	442,074.00	29.95
105	002920	德赛西威	437,989.00	29.67

106	002405	四维图新	430,456.00	29.16
107	300363	博腾股份	428,540.00	29.03
108	300763	锦浪科技	427,041.00	28.93
109	601658	邮储银行	416,969.00	28.25
110	600048	保利发展	416,514.00	28.22
111	000799	酒鬼酒	416,435.00	28.21
112	000301	东方盛虹	413,363.00	28.00
113	688981	中芯国际	410,325.58	27.80
114	601615	明阳智能	405,060.00	27.44
115	300896	爱美客	400,861.00	27.16
116	000066	中国长城	399,594.00	27.07
117	300413	芒果超媒	390,463.00	26.45
118	603659	璞泰来	387,291.00	26.24
119	002410	广联达	385,177.00	26.09
120	603019	中科曙光	381,969.00	25.88
121	603993	洛阳钼业	378,976.00	25.67
122	600547	山东黄金	377,028.00	25.54
123	601633	长城汽车	370,770.00	25.12
124	300390	天华超净	367,103.00	24.87
125	600499	科达制造	366,150.00	24.81
126	600926	杭州银行	364,428.00	24.69
127	600765	中航重机	358,283.00	24.27
128	600141	兴发集团	356,374.00	24.14
129	300033	同花顺	352,499.00	23.88
130	601238	广汽集团	350,856.80	23.77
131	601985	中国核电	345,254.83	23.39
132	600702	舍得酒业	340,783.00	23.09
133	002074	国轩高科	340,631.00	23.08
134	600521	华海药业	338,880.00	22.96
135	600233	圆通速递	334,676.00	22.67
136	000776	广发证券	333,938.00	22.62
137	600183	生益科技	331,763.00	22.48
138	600600	青岛啤酒	320,471.00	21.71
139	001979	招商蛇口	318,966.00	21.61
140	300760	迈瑞医疗	310,666.00	21.05
141	600406	国电南瑞	309,468.00	20.97
142	601668	中国建筑	304,139.00	20.60
143	600741	华域汽车	303,638.00	20.57

144	600018	上港集团	298,510.00	20.22
145	601211	国泰君安	296,969.00	20.12
146	002180	纳思达	295,948.00	20.05
147	605358	立昂微	295,050.16	19.99
148	600598	北大荒	294,057.00	19.92
149	002602	世纪华通	288,818.00	19.57
150	688303	大全能源	287,957.90	19.51
151	603369	今世缘	285,578.00	19.35
152	600585	海螺水泥	283,223.00	19.19
153	002304	洋河股份	282,274.00	19.12
154	000768	中航西飞	281,329.00	19.06
155	000938	紫光股份	280,021.00	18.97
156	600760	中航沈飞	279,727.00	18.95
157	601898	中煤能源	278,465.00	18.87
158	688187	时代电气	276,217.77	18.71
159	601995	中金公司	275,088.00	18.64
160	600085	同仁堂	272,204.00	18.44
161	601100	恒立液压	271,932.00	18.42
162	600176	中国巨石	271,042.00	18.36
163	600872	中炬高新	270,031.00	18.29
164	600150	中国船舶	267,024.00	18.09
165	600010	宝钢股份	257,018.00	17.41
166	603185	上机数控	247,875.00	16.79
167	002326	永太科技	241,978.00	16.39
168	600309	万华化学	241,676.00	16.37
169	002555	三七互娱	240,252.00	16.28
170	000895	双汇发展	238,617.00	16.17
171	600089	特变电工	238,554.00	16.16
172	601186	中国铁建	238,302.00	16.14
173	002493	荣盛石化	237,380.00	16.08
174	002407	多氟多	235,728.00	15.97
175	600332	白云山	231,457.00	15.68
176	002120	韵达股份	229,681.00	15.56
177	601021	春秋航空	229,250.00	15.53
178	002271	东方雨虹	228,622.00	15.49
179	600489	中金黄金	228,539.00	15.48
180	601816	京沪高铁	228,405.00	15.47
181	601377	兴业证券	224,004.00	15.18

182	600188	兖矿能源	222,801.00	15.09
183	002497	雅化集团	221,731.00	15.02
184	300919	中伟股份	220,291.00	14.92
185	601066	中信建投	218,863.00	14.83
186	688005	容百科技	214,060.71	14.50
187	000651	格力电器	207,703.00	14.07
188	603538	美诺华	199,718.16	13.53
189	600348	华阳股份	199,631.00	13.52
190	300373	扬杰科技	196,684.00	13.32
191	600522	中天科技	196,638.00	13.32
192	300346	南大光电	196,615.00	13.32
193	300677	英科医疗	194,978.60	13.21
194	600298	安琪酵母	192,505.00	13.04
195	688396	华润微	189,642.60	12.85
196	002032	苏泊尔	185,276.00	12.55
197	600763	通策医疗	183,197.00	12.41
198	601336	新华保险	180,489.00	12.23
199	601988	中国银行	180,244.00	12.21
200	601288	农业银行	179,762.00	12.18
201	600196	复星医药	179,279.00	12.15
202	002236	大华股份	178,913.00	12.12
203	601328	交通银行	178,628.00	12.10
204	600038	中直股份	177,469.00	12.02
205	002938	鹏鼎控股	176,120.00	11.93
206	600426	华鲁恒升	175,195.00	11.87
207	300438	鹏辉能源	172,009.00	11.65
208	600905	三峡能源	171,326.00	11.61
209	688298	东方生物	167,968.25	11.38
210	300077	国民技术	167,827.00	11.37
211	601939	建设银行	167,069.00	11.32
212	688363	华熙生物	166,105.08	11.25
213	603290	斯达半导	163,350.00	11.07
214	601766	中国中车	161,310.00	10.93
215	601699	潞安环能	159,334.00	10.79
216	603198	迎驾贡酒	158,183.00	10.72
217	601456	国联证券	157,970.00	10.70
218	300751	迈为股份	153,846.00	10.42
219	688008	澜起科技	153,678.10	10.41

220	300979	华利集团	153,376.00	10.39
221	603806	福斯特	152,350.00	10.32
222	000983	山西焦煤	150,728.00	10.21
223	300672	国科微	150,682.00	10.21
224	603229	奥翔药业	149,030.00	10.10
225	002268	卫士通	145,156.00	9.83
226	600039	四川路桥	142,602.00	9.66
227	601818	光大银行	141,699.00	9.60
228	603893	瑞芯微	138,576.00	9.39
229	600050	中国联通	137,916.00	9.34
230	002603	以岭药业	137,904.00	9.34
231	600028	中国石化	136,436.00	9.24
232	601229	上海银行	136,172.18	9.23
233	300999	金龙鱼	135,356.00	9.17
234	600016	民生银行	134,927.00	9.14
235	300142	沃森生物	133,969.00	9.08
236	300957	贝泰妮	131,915.00	8.94
237	600096	云天化	129,450.00	8.77
238	000733	振华科技	129,366.00	8.76
239	601872	招商轮船	127,469.00	8.64
240	002648	卫星化学	126,215.00	8.55
241	601689	拓普集团	125,463.00	8.50
242	688390	固德威	124,904.00	8.46
243	000970	中科三环	124,610.00	8.44
244	601857	中国石油	123,907.00	8.39
245	601799	星宇股份	123,662.00	8.38
246	688065	凯赛生物	122,440.97	8.29
247	600392	盛和资源	121,727.00	8.25
248	002384	东山精密	121,156.00	8.21
249	301089	拓新药业	120,561.44	8.17
250	300037	新宙邦	119,004.60	8.06
251	601169	北京银行	117,224.00	7.94
252	000739	普洛药业	113,068.00	7.66
253	601878	浙商证券	112,036.00	7.59
254	605499	东鹏饮料	109,730.00	7.43
255	600989	宝丰能源	109,276.00	7.40
256	000166	申万宏源	106,502.00	7.22
257	601156	东航物流	105,336.00	7.14

258	002916	深南电路	104,847.00	7.10
259	000762	西藏矿业	103,844.00	7.04
260	601006	大秦铁路	103,342.00	7.00
261	600132	重庆啤酒	102,840.00	6.97
262	688126	沪硅产业	102,710.97	6.96
263	688767	博拓生物	102,587.00	6.95
264	600732	爱旭股份	102,409.00	6.94
265	002064	华峰化学	99,330.00	6.73
266	600699	均胜电子	97,468.00	6.60
267	601117	中国化学	96,656.00	6.55
268	002736	国信证券	95,488.00	6.47
269	601233	桐昆股份	95,379.00	6.46
270	600011	华能国际	94,923.00	6.43
271	300118	东方日升	94,918.00	6.43
272	600362	江西铜业	92,287.00	6.25
273	688111	金山办公	92,040.24	6.24
274	600563	法拉电子	91,914.00	6.23
275	688180	君实生物	91,261.32	6.18
276	000338	潍柴动力	89,104.00	6.04
277	601390	中国中铁	87,079.00	5.90
278	002027	分众传媒	87,034.00	5.90
279	003816	中国广核	86,300.00	5.85
280	600115	中国东航	82,484.00	5.59
281	000807	云铝股份	81,511.00	5.52
282	600015	华夏银行	80,732.00	5.47
283	603392	万泰生物	79,752.00	5.40
284	601868	中国能建	78,111.00	5.29
285	300568	星源材质	77,125.00	5.22
286	601877	正泰电器	76,648.00	5.19
287	002601	龙佰集团	73,518.00	4.98
288	000683	远兴能源	71,978.00	4.88
289	600988	赤峰黄金	69,578.00	4.71
290	603288	海天味业	68,531.00	4.64
291	300398	飞凯材料	67,475.00	4.57
292	601138	工业富联	67,445.00	4.57
293	300087	荃银高科	66,586.00	4.51
294	600845	宝信软件	66,572.00	4.51
295	000933	神火股份	64,957.00	4.40

296	600346	恒力石化	64,158.00	4.35
297	600383	金地集团	64,025.00	4.34
298	600029	南方航空	61,965.00	4.20
299	300035	中科电气	61,937.00	4.20
300	300311	任子行	61,280.00	4.15
301	600999	招商证券	59,870.00	4.06
302	601788	光大证券	59,427.00	4.03
303	000425	徐工机械	55,764.00	3.78
304	002080	中材科技	55,495.00	3.76
305	000069	华侨城 A	54,499.00	3.69
306	600062	华润双鹤	54,148.00	3.67
307	000937	冀中能源	53,835.00	3.65
308	000960	锡业股份	53,588.00	3.63
309	001965	招商公路	52,613.00	3.56
310	002185	华天科技	52,246.00	3.54
311	603456	九洲药业	50,815.00	3.44
312	300204	舒泰神	50,553.00	3.42
313	601618	中国中冶	49,994.00	3.39
314	601865	福莱特	49,741.00	3.37
315	600771	广誉远	46,185.00	3.13
316	000932	华菱钢铁	45,393.00	3.08
317	601360	三六零	45,257.00	3.07
318	688772	珠海冠宇	45,163.94	3.06
319	300081	恒信东方	44,957.00	3.05
320	300454	深信服	44,737.00	3.03
321	600516	方大炭素	44,690.00	3.03
322	000736	中交地产	43,192.00	2.93
323	000877	天山股份	42,424.00	2.87
324	002182	云海金属	41,817.00	2.83
325	601607	上海医药	41,815.00	2.83
326	600019	宝钢股份	41,082.00	2.78
327	600754	锦江酒店	40,084.00	2.72
328	600160	巨化股份	39,854.00	2.70
329	300124	汇川技术	39,649.00	2.69
330	603605	珀莱雅	39,417.00	2.67
331	002202	金风科技	38,992.18	2.64
332	601155	新城控股	38,678.00	2.62
333	688561	奇安信	38,585.00	2.61

334	600918	中泰证券	37,124.00	2.52
335	601111	中国国航	37,063.00	2.51
336	600886	国投电力	37,002.00	2.51
337	603568	伟明环保	36,950.00	2.50
338	600875	东方电气	36,813.00	2.49
339	601966	玲珑轮胎	35,918.00	2.43
340	600316	洪都航空	34,887.00	2.36
341	601825	沪农商行	34,655.00	2.35
342	600795	国电电力	34,398.00	2.33
343	002311	海大集团	34,397.00	2.33
344	601998	中信银行	34,355.00	2.33
345	600497	驰宏锌锗	33,843.00	2.29
346	300146	汤臣倍健	33,483.00	2.27
347	000519	中兵红箭	33,191.00	2.25
348	688185	康希诺	33,178.00	2.25
349	300418	昆仑万维	32,899.00	2.23
350	603026	石大胜华	32,891.00	2.23
351	603486	科沃斯	32,862.00	2.23
352	002104	恒宝股份	31,990.00	2.17
353	601168	西部矿业	31,918.00	2.16
354	002939	长城证券	31,475.00	2.13
355	601600	中国铝业	31,310.00	2.12
356	688388	嘉元科技	29,698.00	2.01

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	163,010,785.80
卖出股票收入（成交）总额	139,565,659.67

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、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 7 月 13 日，中国人民银行宁波市中心支行对宁波银行股份有限公司作出行政处罚（甬银处罚字〔2021〕2 号），主要内容：1、违规为存款人多头开立银行结算账户；2、超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料；3、占压财政存款；4、未按照规定履行客户身份识别义务；5、未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告；6、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户。中国人民银行宁波市中心支行对该银行给予警告，并罚款人民币 286.2 万元。

二、2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对中国邮政储蓄银行股份有限公司作出行政处罚（银保监罚决字〔2022〕16 号），主要内容为：监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：1、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；2、漏报贷款核销业务 EAST 数据；3、漏报抵押物价值 EAST 数据；4、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；5、未报送贷款承诺业务 EAST 数据；6、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；7、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；8、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；9、EAST 系统分户账与总账比对不一致；10、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；11、EAST 系统《表外授信业务》表错报；12、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；13、2018 年行政处罚问题依然存在。中国银行保险监督管理委员会对该行处以罚款人民币 370 万元。

三、2022 年 3 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行股份有限公司作出行政处罚（银保监罚决字〔2022〕22 号），主要内容为：兴业银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：1、漏报贸易融资业务 EAST 数据；2、漏报贷款核销业务 EAST 数据；3、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；4、漏报权益类投资业务 EAST 数据；5、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；6、未报送跟单信用证业务 EAST 数据；7、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；8、未报送委托贷款业务 EAST 数据；9、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；10、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；11、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；12、漏报分户账 EAST 数据；13、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；14、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报。中国银行保险监督管理委员会对该行处以罚款人民币 350 万元。

四、2022 年 3 月 21 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行政处罚（银保监罚决字〔2022〕21 号），主要内容为：招商银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：1、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；2、漏报贷款核销业务 EAST 数据；3、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；4、未报送权益类投资业务 EAST 数据；5、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；6、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；7、漏报委托贷款业务 EAST 数据；8、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；9、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；10、EAST 系统分户账与总账比对不一致；11、漏报分户账 EAST 数据；12、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；13、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报。中国银行保险监督管理委员会对该行处以罚款人民币 300 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，其他六名证券发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，未发生超出基金合同规定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,812.78
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,812.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
九泰天奕量化价值混合 A	112	7,051.92	-	-	789,814.65	100.00%
九泰天奕量化价值混合 C	89	379,467.69	31,104,215.14	92.10%	2,668,409.41	7.90%
合计	201	171,952.43	31,104,215.14	89.99%	3,458,224.06	10.01%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	九泰天奕量化价值混合 A	1,898.41	0.2404%
	九泰天奕量化价值混合 C	12,132.00	0.0004%
	合计	2,019.73	0.0058%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金	九泰天奕量化价值混	0~10

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	合 A	
	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

§ 9 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	938,870.47	353,961.74
本报告期基金总申购份额	49,029.11	56,764,299.58
减：本报告期基金总赎回份额	198,084.93	23,345,636.77
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	789,814.65	33,772,624.55

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、本报告期内，基金管理人发生以下重要人员变更事项：

经九泰基金管理有限公司第三届董事会 2022 年第一次会议决议通过，聘任谢海波先生为公司副总经理，公司已按相关规定向监管机构备案。

二、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无涉及管理人、托管人及高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	2	220,281,400.48	72.82%	205,151.71	77.34%	-
五矿证券	2	82,214,648.72	27.18%	60,122.65	22.66%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

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

(1) 券商经纪人经营行为规范、风险管理健全，在业内有较好的声誉；

(2) 具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 券商经纪人具有较强的研究支持能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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：新增长城证券上海交易单元 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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	-	-	184,500,000.00	34.08%	-	-
五矿证券	-	-	356,800,000.00	65.92%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	九泰基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	规定报刊和规定网站	2022 年 1 月 4 日
2	九泰基金管理有限公司关于独立董事变更的公告	规定报刊和规定网站	2022 年 1 月 6 日

3	九泰基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告	规定报刊和规定网站	2022 年 1 月 6 日
4	九泰天奕量化价值混合型证券投资基金恢复大额申购(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	2022 年 1 月 7 日
5	关于九泰天奕量化价值混合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	2022 年 1 月 12 日
6	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	2022 年 1 月 13 日
7	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	2022 年 1 月 13 日
8	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	2022 年 1 月 13 日
9	九泰基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	规定报刊和规定网站	2022 年 1 月 13 日
10	关于九泰天奕量化价值混合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	2022 年 1 月 15 日
11	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	2022 年 1 月 18 日
12	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	2022 年 1 月 18 日
13	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	2022 年 1 月 18 日
14	九泰基金管理有限公司关于终止杭州科地瑞富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	2022 年 1 月 19 日
15	关于九泰基金管理有限公司旗下部分基金调整最低申购金额、最低赎回份额及最低保有份额等业务规则的公告	规定报刊和规定网站	2022 年 1 月 20 日
16	九泰天奕量化价值混合型证	规定网站	2022 年 1 月 24 日

	券投资基金 2021 年第 4 季度报告		
17	九泰基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2022 年 1 月 24 日
18	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	规定报刊和规定网站	2022 年 1 月 26 日
19	九泰基金管理有限公司关于北京分公司注销的公告	规定报刊和规定网站	2022 年 3 月 5 日
20	九泰基金管理有限公司关于调整电子直销交易平台相关功能的公告	规定报刊和规定网站	2022 年 3 月 30 日
21	九泰基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	规定报刊	2022 年 3 月 31 日
22	九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2021 年年度报告	规定网站	2022 年 3 月 31 日
23	九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	规定网站	2022 年 4 月 22 日
24	九泰基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2022 年 4 月 22 日
25	九泰基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯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	2022 年 4 月 22 日
26	九泰基金管理有限公司关于终止上海尚善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	2022 年 5 月 26 日
27	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	2022 年 6 月 20 日
28	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	2022 年 6 月 20 日
29	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	2022 年 6 月 20 日
30	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	2022 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220118 至 20220118	0.00	5,140,507.20	0.00	5,140,507.20	14.87%
	2	20220119 至 20220630	0.00	17,386,643.02	0.00	17,386,643.02	50.31%
	3	20220119 至 20220628	0.00	12,865,597.39	12,865,597.39	0.00	0.00%
个人	1	20220118 至 20220118	0.00	8,509,654.47	8,509,654.47	0.00	0.00%

产品特有风险

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

九泰基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日