

九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 年 8 月 28 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 2023 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.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 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	4,879,241.71 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	721,486.91 份	4,157,754.80 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或办公场所

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(2023年1月1日 - 2023年6月30日)	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-228,232.95	454,343.15
本期利润	-71,619.85	502,735.67
加权平均基金份额本期利润	-0.1017	0.0232
本期加权平均净值利润率	-9.20%	2.03%
本期基金份额净值增长率	-9.21%	-9.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	-454,972.51	-2,642,732.02
期末可供分配基金份额利润	-0.6306	-0.6356
期末基金资产净值	730,528.87	4,157,101.18
期末基金份额净值	1.0125	0.9998
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.25%	-0.02%

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	-0.87%	0.86%	1.05%	0.79%	-1.92%	0.07%
过去三个月	-8.25%	0.78%	-4.62%	0.75%	-3.63%	0.03%
过去六个月	-9.21%	0.80%	-0.62%	0.76%	-8.59%	0.04%
过去一年	-14.81%	0.84%	-12.87%	0.89%	-1.94%	-0.05%
过去三年	1.34%	1.13%	-6.44%	1.08%	7.78%	0.05%

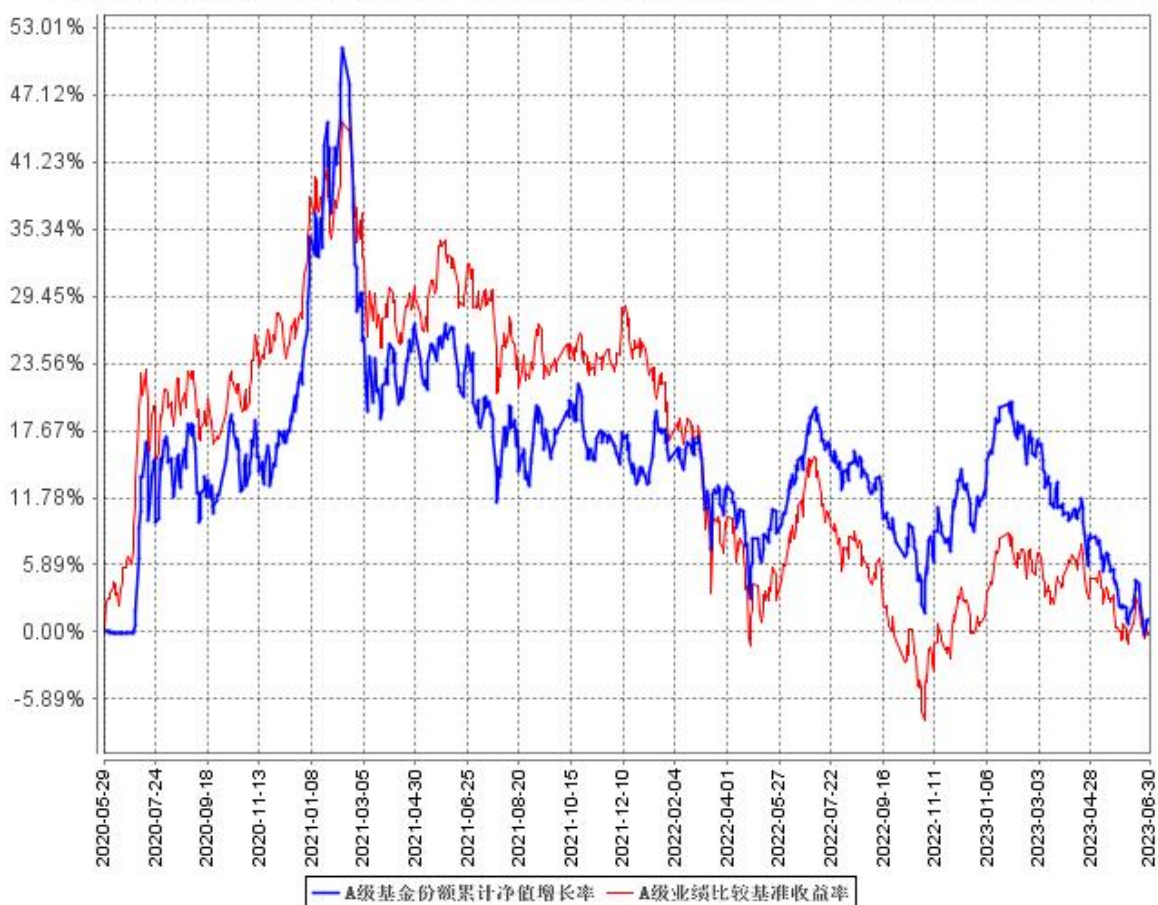
自基金合同生效起至今	1.25%	1.11%	0.26%	1.07%	0.99%	0.04%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

九泰天奕量化价值混合 C

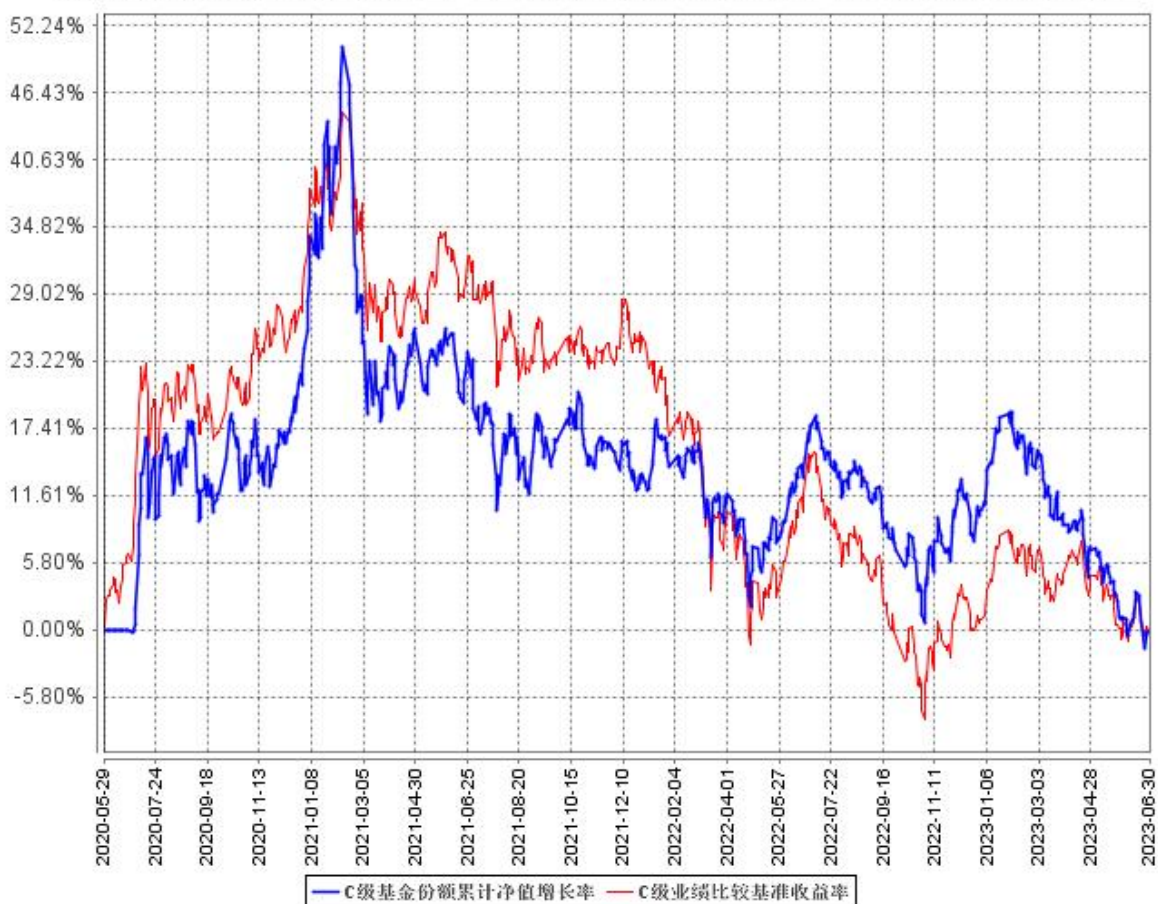
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.88%	0.86%	1.05%	0.79%	-1.93%	0.07%
过去三个月	-8.30%	0.77%	-4.62%	0.75%	-3.68%	0.02%
过去六个月	-9.33%	0.80%	-0.62%	0.76%	-8.71%	0.04%
过去一年	-15.01%	0.84%	-12.87%	0.89%	-2.14%	-0.05%
过去三年	0.14%	1.13%	-6.44%	1.08%	6.58%	0.05%
自基金合同生效起至今	-0.02%	1.11%	0.26%	1.07%	-0.28%	0.04%

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，注册地位于北京市，目前设立有上海分公司及深圳分公司。

公司优先发展公募基金业务，创新拓展私募资产管理业务，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，发展特色产品线，打造差异化的竞争优势。公司秉承长期投资、价值投资的经营理念，建立有效的公司治理和激励约束机制。

公司旗下拥有较为完整的公募基金产品线，覆盖股票型、混合型、货币型等产品类别，以定开式、开放式、上市 LOF 等不同模式运作，有效满足广大投资者不同的投资理财需求。

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		
张鹏程	基金经理、玖方量化投资部总经理	2023 年 4 月 13 日	-	13	清华大学统计专业硕士、北京大学理学学士，13 年证券从业经历。历任博时基金管理有限公司 ETF 及量化投资组基金经理助理、量化分析师，通联数据股份公司首席投资顾问、投资经理。2016 年 4 月加入九泰基金管理有限公司，现任玖方量化投资部总经理、基金经理，具有基金从业资格。
杨飞	基金经理	2022 年 1 月 10 日	2023 年 4 月 13 日	7	金融学硕士，7 年证券从业经历。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，曾任九章量化投资部总经理、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

2023 年上半年各主流宽基指数先涨后跌，在市场流动性有所萎缩的情况下，小盘股表现优于大盘蓝筹。2023 年一季度，伴随疫情管控措施的优化，市场情绪乐观，对经济复苏期望较高，但是随后的高频经济数据恢复速度不及市场预期，市场出现调整。2022 年四季度至 2023 年初赛道股反弹，市场资金集中于热门赛道行业，2023 年一季度市场出现调整，热门赛道行业因交易拥挤出现较大回撤，本基金受此影响出现调整，2023 年上半年本基金表现不及沪深 300 指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末九泰天奕量化价值混合 A 基金份额净值为 1.0125 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.21%；截至本报告期末九泰天奕量化价值混合 C 基金份额净值为 0.9998 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.33%；同期业绩比较基准收益率为-0.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年的经济复苏力度略低于市场预期，显示出经济复苏是漫长曲折的历程，并非一蹴而就，但我们认为 2023 年下半年经济前景无需过度悲观。自疫情管控放松以来，经济领域利好政策频出，这为实体经济提供了强力的托底作用，长期来看也会为经济复苏提供强劲的动能，虽然 2023 年上半年高频数据不及市场预期，我们仍认为经济处于复苏过程的初期阶段，前景乐观。

2023 年上半年经济领域政策频出，伴随经济政策的落地，上市公司的基本面有望得到修复，本基金采用的量化多因子模型将努力捕捉上市公司基本面的改善力争获取收益。行业模型来说，上半年热门赛道行业风险得到了一定释放，下半年市场有可能在经济政策的驱动下重新形成较为清晰稳定的行业主线，本基金使用的行业模型将力争把握相关机会。

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的专业胜任能力。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金出现超过连续 60 个工作日（2023 年 3 月 13 日-2023 年 6 月 30 日）基金资产净值低于 5000 万元的情形，已向中国证监会报告并提出解决方案；未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	684,324.42	580,507.10
结算备付金		-	522,117.69
存出保证金		15,848.28	14,210.32
交易性金融资产	6.4.7.2	4,255,657.40	51,268,235.37
其中：股票投资		4,255,657.40	48,411,648.52
基金投资		-	-
债券投资		-	2,856,586.85
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	-	-
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		-	140,844.22
应收股利		-	-
应收申购款		14,997.50	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,970,827.60	52,525,914.70
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		342.06	121,257.68

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,425.50	26,565.44
应付托管费		606.37	6,641.35
应付销售服务费		689.81	8,721.49
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	79,133.81	292,568.77
负债合计		83,197.55	455,754.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,879,241.71	47,210,689.84
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	8,388.34	4,859,470.13
净资产合计		4,887,630.05	52,070,159.97
负债和净资产总计		4,970,827.60	52,525,914.70

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，九泰天奕量化价值混合 A 基金份额净值 1.0125 元，基金份额总额 721,486.91 份；九泰天奕量化价值混合 C 基金份额净值 0.9998 元，基金份额总额 4,157,754.80 份。九泰天奕量化价值混合份额总额合计为 4,879,241.71 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		617,012.62	811,145.84
1.利息收入		4,022.73	82,784.69
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,022.73	33,141.15
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
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		406,913.57	-414,157.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	352,062.87	-705,620.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	9,268.53	-
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	45,582.17	291,463.49
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	205,005.62	1,089,361.01
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	1,070.70	53,157.55
减：二、营业总支出		185,896.80	237,624.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	76,612.98	134,357.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,153.27	33,589.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	24,763.55	43,861.29
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	65,367.00	25,816.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		431,115.82	573,521.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		431,115.82	573,521.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		431,115.82	573,521.12

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	47,210,689.84	-	4,859,470.13	52,070,159.97
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）	47,210,689.84	-	4,859,470.13	52,070,159.97
三、本期增减 变动额（减少 以“-”号填列）	-42,331,448.13	-	-4,851,081.79	-47,182,529.92
（一）、综合 收益总额	-	-	431,115.82	431,115.82
（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）	-42,331,448.13	-	-5,282,197.61	-47,613,645.74
其中：1.基金 申购款	4,243,495.66	-	78,861.85	4,322,357.51
2.基金赎回款	-46,574,943.79	-	-5,361,059.46	-51,936,003.25
（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）	4,879,241.71	-	8,388.34	4,887,630.05
项目	上年度可比期间			
	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	-	-	573,521.12	573,521.12

收益总额				
(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

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

基金管理人负责人

荣静

主管会计工作负责人

荣静

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售,由基金管理人九泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关规定和《九泰天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 \times 90%+银行活期存款利率(税后) \times 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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；2018 年 1 月 1 日起，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，暂不计缴企业所得税。

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

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

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	684,324.42
等于：本金	684,270.60
加：应计利息	53.82
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：	684,324.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,282,526.68	-	4,255,657.40	-26,869.28
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	4,282,526.68	-	4,255,657.40	-26,869.28

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**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2023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	14,667.04
其中：交易所市场	14,667.04
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提审计费用	24,795.19
预提信息披露费用	39,671.58
合计	79,133.81

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	721,712.67	721,712.67
本期申购	55,019.46	55,019.46
本期赎回(以“-”号填列)	-55,245.22	-55,245.22
- 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	721,486.91	721,486.91

金额单位：人民币元

九泰天奕量化价值混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,488,977.17	46,488,977.17
本期申购	4,188,476.20	4,188,476.20
本期赎回(以“-”号填列)	-46,519,698.57	-46,519,698.57
- 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	4,157,754.80	4,157,754.80

注：本期申购中包含转换入份额及金额。

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
上年度末	-221,981.56	305,136.70	83,155.14

本期利润	-228,232.95	156,613.10	-71,619.85
本期基金份额交易产生的变动数	-4,758.00	2,264.67	-2,493.33
其中：基金申购款	-23,785.06	29,599.19	5,814.13
基金赎回款	19,027.06	-27,334.52	-8,307.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-454,972.51	464,014.47	9,041.96

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	-14,647,188.34	19,423,503.33	4,776,314.99
本期利润	454,343.15	48,392.52	502,735.67
本期基金份额交易产生的变动数	11,550,113.17	-16,829,817.45	-5,279,704.28
其中：基金申购款	-2,496,407.97	2,569,455.69	73,047.72
基金赎回款	14,046,521.14	-19,399,273.14	-5,352,752.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,642,732.02	2,642,078.40	-653.62

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,457.16
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	1,253.75
其他	311.82
合计	4,022.73

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	112,953,005.05
减：卖出股票成本总额	112,305,512.16

减：交易费用	295,430.02
买卖股票差价收入	352,062.87

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	12,972.53
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,704.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,268.53

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,013,026.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,902,898.00
减：应计利息总额	113,832.22
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-3,704.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	45,582.17
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	45,582.17

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	205,005.62
——股票投资	204,870.62
——债券投资	135.00
——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	205,005.62

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,070.70
合计	1,070.70

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	900.23
合计	65,367.00

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	76,612.98	134,357.63
其中：支付销售机构的客户维护费	2,627.61	5,732.67

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,153.27	33,589.42

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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	23,302.07	23,302.07
合计	-	23,302.07	23,302.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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

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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	684,324.42	2,457.16	21,216,476.07	10,869.86

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（2023 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	2,700	18,441.00	18,819.00	-

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 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 2023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	684,324.42	-	-	-	-	-	684,324.42
存出保证金	15,848.28	-	-	-	-	-	15,848.28
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,255,657.40	4,255,657.40
应收申购款	-	-	-	-	-	14,997.50	14,997.50
资产总计	700,172.70	-	-	-	-	4,270,654.90	4,970,827.60
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	342.06	342.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,425.50	2,425.50
应付托管费	-	-	-	-	-	606.37	606.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	689.81	689.81
其他负债	-	-	-	-	-	79,133.81	79,133.81
负债总计	-	-	-	-	-	83,197.55	83,197.55
利率敏感度缺口	700,172.70	-	-	-	-	4,187,457.35	4,887,630.05
上年度末 2022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	580,507.10	-	-	-	-	-	580,507.10
结算备付金	522,117.69	-	-	-	-	-	522,117.69
存出保证金	14,210.32	-	-	-	-	-	14,210.32
交易性金融资产	2,856,586.85	-	-	-	-	-48,411,648.52	51,268,235.37
应收清算款	-	-	-	-	-	140,844.22	140,844.22
资产总计	3,973,421.96	-	-	-	-	-48,552,492.74	52,525,914.70
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	121,257.68	121,257.68

应付管理人报酬	-	-	-	-	26,565.44	26,565.44
应付托管费	-	-	-	-	6,641.35	6,641.35
应付销售服务费	-	-	-	-	8,721.49	8,721.49
其他负债	-	-	-	-	292,568.77	292,568.77
负债总计	-	-	-	-	455,754.73	455,754.73
利率敏感度缺口	3,973,421.96	-	-	-	-48,096,738.01	52,070,159.97

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率下降25个基点	0.00	274.26
	市场利率上升25个基点	0.00	-274.21

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	4,255,657.40	87.07	48,411,648.52	92.97
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	2,856,586.85	5.49
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	4,255,657.40	87.07	51,268,235.37	98.46

注：由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	193,505.49	2,157,811.59
	沪深 300 指数下跌 5%	-193,505.49	-2,157,811.59

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	4,236,838.40	25,231,357.52
第二层次	18,819.00	-
第三层次	-	-
合计	4,255,657.40	25,231,357.52

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	4,255,657.40	85.61
	其中：股票	4,255,657.40	85.61
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	684,324.42	13.77
8	其他各项资产	30,845.78	0.62
9	合计	4,970,827.60	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	8,604.00	0.18
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,825,721.00	57.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	274,165.00	5.61
E	建筑业	10,013.00	0.20
F	批发和零售业	36,471.00	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	124,422.00	2.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	225,043.00	4.60
J	金融业	705,046.40	14.43
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

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	46,172.00	0.94
S	综合	-	-
	合计	4,255,657.40	87.07

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	200	338,200.00	6.92
2	000338	潍柴动力	12,100	150,766.00	3.08
3	000617	中油资本	19,900	143,877.00	2.94
4	601766	中国中车	21,200	137,800.00	2.82
5	603369	今世缘	2,500	132,000.00	2.70
6	000596	古井贡酒	500	123,690.00	2.53
7	601998	中信银行	19,200	114,816.00	2.35
8	601877	正泰电器	3,800	105,070.00	2.15
9	600011	华能国际	10,800	100,008.00	2.05
10	600886	国投电力	7,500	94,875.00	1.94
11	000768	中航西飞	3,500	93,625.00	1.92
12	000895	双汇发展	3,800	93,062.00	1.90
13	605499	东鹏饮料	500	86,450.00	1.77
14	600089	特变电工	3,700	82,473.00	1.69
15	600418	江淮汽车	6,500	81,835.00	1.67
16	000333	美的集团	1,300	76,596.00	1.57
17	601966	玲珑轮胎	3,400	75,548.00	1.55
18	600482	中国动力	3,200	75,008.00	1.53
19	600919	江苏银行	10,200	74,970.00	1.53
20	002422	科伦药业	2,500	74,200.00	1.52
21	600050	中国联通	14,500	69,600.00	1.42
22	002508	老板电器	2,700	68,283.00	1.40

23	600699	均胜电子	3,700	65,268.00	1.34
24	600015	华夏银行	11,700	63,297.00	1.30
25	601995	中金公司	1,700	60,384.00	1.24
26	000651	格力电器	1,600	58,416.00	1.20
27	300316	晶盛机电	800	56,720.00	1.16
28	000988	华工科技	1,400	53,214.00	1.09
29	601816	京沪高铁	9,700	51,022.00	1.04
30	000425	徐工机械	7,500	50,775.00	1.04
31	603589	口子窖	1,000	49,350.00	1.01
32	002152	广电运通	4,200	49,224.00	1.01
33	600061	国投资本	6,600	46,992.00	0.96
34	601989	中国重工	9,600	46,272.00	0.95
35	300433	蓝思科技	3,900	45,864.00	0.94
36	601006	大秦铁路	6,100	45,323.00	0.93
37	300724	捷佳伟创	400	44,940.00	0.92
38	600380	健康元	3,500	44,485.00	0.91
39	600570	恒生电子	1,000	44,290.00	0.91
40	601169	北京银行	9,000	41,670.00	0.85
41	002415	海康威视	1,200	39,732.00	0.81
42	002600	领益智造	5,500	38,005.00	0.78
43	600879	航天电子	4,400	37,356.00	0.76
44	002050	三花智控	1,200	36,312.00	0.74
45	000728	国元证券	5,400	35,208.00	0.72
46	600085	同仁堂	600	34,536.00	0.71
47	601658	邮储银行	6,500	31,785.00	0.65
48	002371	北方华创	100	31,765.00	0.65
49	002507	涪陵榨菜	1,600	29,296.00	0.60
50	600875	东方电气	1,500	27,975.00	0.57
51	002074	国轩高科	1,000	27,620.00	0.57
52	601928	凤凰传媒	2,300	26,220.00	0.54
53	000027	深圳能源	3,800	25,042.00	0.51
54	002294	信立泰	800	24,952.00	0.51
55	600161	天坛生物	900	24,435.00	0.50
56	300454	深信服	200	22,650.00	0.46
57	601628	中国人寿	600	20,976.00	0.43
58	002230	科大讯飞	300	20,388.00	0.42
59	601607	上海医药	900	20,169.00	0.41
60	300979	华利集团	400	19,496.00	0.40
61	600021	上海电力	1,800	19,386.00	0.40

62	601728	中国电信	3,400	19,142.00	0.39
63	601298	青岛港	2,700	18,819.00	0.39
64	600941	中国移动	200	18,660.00	0.38
65	002465	海格通信	1,800	18,612.00	0.38
66	600674	川投能源	1,200	18,060.00	0.37
67	002939	长城证券	2,200	17,886.00	0.37
68	600118	中国卫星	600	16,926.00	0.35
69	003816	中国广核	5,400	16,794.00	0.34
70	600704	物产中大	3,300	16,302.00	0.33
71	300418	昆仑万维	400	16,112.00	0.33
72	002673	西部证券	2,500	15,875.00	0.32
73	601318	中国平安	341	15,822.40	0.32
74	603019	中科曙光	300	15,270.00	0.31
75	603893	瑞芯微	200	14,570.00	0.30
76	600038	中直股份	300	11,946.00	0.24
77	601319	中国人保	1,900	11,096.00	0.23
78	601601	中国太保	400	10,392.00	0.21
79	002739	万达电影	800	10,032.00	0.21
80	300144	宋城演艺	800	9,920.00	0.20
81	000157	中联重科	1,400	9,450.00	0.19
82	603885	吉祥航空	600	9,258.00	0.19
83	002268	电科网安	300	8,361.00	0.17
84	000021	深科技	300	5,997.00	0.12
85	603000	人民网	200	5,840.00	0.12
86	000998	隆平高科	300	4,605.00	0.09
87	600598	北大荒	300	3,999.00	0.08
88	601390	中国中铁	500	3,790.00	0.08
89	601618	中国中冶	900	3,573.00	0.07
90	000876	新希望	200	2,336.00	0.05
91	601800	中国交建	200	2,182.00	0.04
92	601868	中国能建	200	468.00	0.01

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	000858	五粮液	2,173,777.00	4.17

2	600519	贵州茅台	1,458,073.00	2.80
3	300014	亿纬锂能	1,105,930.00	2.12
4	600809	山西汾酒	1,098,836.00	2.11
5	002352	顺丰控股	997,460.00	1.92
6	002603	以岭药业	981,930.00	1.89
7	300750	宁德时代	970,803.00	1.86
8	603290	斯达半导	917,114.00	1.76
9	300274	阳光电源	900,877.00	1.73
10	000001	平安银行	885,590.00	1.70
11	000063	中兴通讯	838,524.00	1.61
12	600536	中国软件	835,025.00	1.60
13	002304	洋河股份	817,679.00	1.57
14	000333	美的集团	782,481.00	1.50
15	600276	恒瑞医药	780,567.00	1.50
16	600919	江苏银行	749,464.00	1.44
17	000651	格力电器	734,969.00	1.41
18	002371	北方华创	733,805.00	1.41
19	002594	比亚迪	709,000.00	1.36
20	300759	康龙化成	699,935.00	1.34

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,445,005.00	6.62
2	000858	五粮液	3,047,563.00	5.85
3	600519	贵州茅台	2,843,881.00	5.46
4	300750	宁德时代	2,579,075.00	4.95
5	000651	格力电器	2,282,208.00	4.38
6	002594	比亚迪	2,001,719.00	3.84
7	600919	江苏银行	1,722,713.00	3.31
8	300274	阳光电源	1,645,358.00	3.16
9	601012	隆基绿能	1,640,431.40	3.15
10	002371	北方华创	1,510,740.00	2.90
11	600438	通威股份	1,485,360.00	2.85
12	600036	招商银行	1,456,258.00	2.80

13	000063	中兴通讯	1,434,619.00	2.76
14	300498	温氏股份	1,424,127.00	2.74
15	002129	TCL 中环	1,367,020.00	2.63
16	002603	以岭药业	1,287,084.20	2.47
17	002352	顺丰控股	1,277,270.00	2.45
18	600547	山东黄金	1,273,709.00	2.45
19	002714	牧原股份	1,268,331.00	2.44
20	002812	恩捷股份	1,257,007.00	2.41
21	000001	平安银行	1,187,558.00	2.28
22	601668	中国建筑	1,187,157.00	2.28
23	600809	山西汾酒	1,154,800.00	2.22
24	300014	亿纬锂能	1,139,951.00	2.19
25	603259	药明康德	1,078,400.28	2.07
26	603613	国联股份	1,073,904.00	2.06

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	67,944,650.42
卖出股票收入（成交）总额	112,953,005.05

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，未发生超出基金合同规定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,848.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,997.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,845.78

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	111	6,499.88	-	0.00%	721,486.91	100.00%
九泰天奕量化价值混合 C	104	39,978.41	3,960,396.04	95.25%	197,358.76	4.75%
合计	215	22,694.15	3,960,396.04	81.17%	918,845.67	18.83%

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	1,116.61	0.1548%
	九泰天奕量化价值混合 C	95.80	0.0023%
	合计	1,212.41	0.0248%

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	721,712.67	46,488,977.17
本报告期基金总申购份额	55,019.46	4,188,476.20
减：本报告期基金总赎回份额	55,245.22	46,519,698.57
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	721,486.91	4,157,754.80

注：总申购份额含转换入份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 一、本报告期基金管理人无重大人事变动。
- 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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 2 月 13 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会
受到的具体措施类型	责令改正，并处罚款；时任董事长及有关高级管理人员被处以警告、暂停基金从业资格、并处罚款。
受到稽查或处罚等措施的原因	通过九泰久利参与五家上市公司保底定增，利用基金财产为基金份额持有人以外的人牟取利益。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司诚恳接受监管处罚并高度重视，在监管部门的指导下，做好风险化解工作，与股东进行全面业务及风险隔离，对各项问题进行了全面整改。公司主动与监管部门沟通，积极落实各项整改措施，充分保障基金持有人利益。公司将持续提高规范公司运作水平，严格遵守相关法律规定，切实维护广大投资者利益。
其他	相关责任人员均已离任

措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及有关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 4 月 7 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	责令整改；相关高级管理人员被出具警示函。
受到稽查或处罚等措施的原因	固有资金持有高流动性资产比例未达标；基金持有流动性资产比例未达标；交易内控管理相关制度未有效执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	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整改，已将整改落实情况报送监管机构。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无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	
兴业证券	1	96,320,958.81	53.31%	89,704.79	53.31%	-
国盛证券	2	67,456,602.48	37.34%	62,824.11	37.34%	-
海通证券	1	16,887,887.19	9.35%	15,727.76	9.35%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	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，要明确签订协议双方的公司名称、协议有效期、佣金率、双方的权利义务等。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	3,099,194.00	49.97%	-	-	-	-
海通证券	3,103,043.00	50.03%	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-

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 2022 年 12 月 31 日基金资产净值公告	公司官网	2023 年 1 月 1 日
2	九泰基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2023 年 1 月 20 日
3	九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	规定网站	2023 年 1 月 20 日
4	九泰基金管理有限公司公告	规定报刊和规定网站	2023 年 2 月 15 日
5	九泰基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	规定报刊	2023 年 3 月 31 日
6	九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2022 年年度报告	规定网站	2023 年 3 月 31 日
7	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	2023 年 4 月 14 日
8	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	2023 年 4 月 14 日
9	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	2023 年 4 月 14 日
10	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	2023 年 4 月 14 日
11	九泰基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2023 年 4 月 21 日
12	九泰天奕量化价值混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	规定网站	2023 年 4 月 21 日
13	九泰基金管理有限公司关于警惕不法分子冒用本公司名义进行非法活动的重要提示	规定报刊和规定网站	2023 年 6 月 14 日
14	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	2023 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	20230101 至 20230322	17,386,643.02	0.00	17,386,643.02	0.00	0.00%
个人	1	20230324 至 20230329	2,141,878.00	0.00	2,141,878.00	0.00	0.00%
产品	1	20230313 至 20230323 , 20230530 至 20230630	9,010,632.55	990,099.01	9,010,632.55	990,099.01	20.29%
	2	20230530 至 20230630	0.00	1,980,198.02	0.00	1,980,198.02	40.58%
	3	20230101 至 20230323 , 20230530 至 20230630	13,430,029.55	990,099.01	13,430,029.55	990,099.01	20.29%

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

2023 年 8 月 31 日