

# 九泰盈泰量化股票型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	67

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12	投资组合报告附注	67
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>69</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	69
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>70</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>71</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	71
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	71
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4	基金投资策略的改变	71
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8	其他重大事件	72
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>75</b>
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	75
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	75
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>76</b>
13.1	备查文件目录	76
13.2	存放地点	76
13.3	查阅方式	76

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	九泰盈泰量化股票型证券投资基金	
基金简称	九泰盈泰量化	
基金主代码	011224	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 18 日	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	85,722,377.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	九泰盈泰量化 A	九泰盈泰量化 C
下属分级基金的交易代码:	011224	011225
报告期末下属分级基金的份额总额	46,913,250.45 份	38,809,126.60 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化模型，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析以及对资本市场趋势的判断，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的长期回报。</p> <p>本基金采用多层次量化模型，在有效控制风险的前提下，选取并持有预期收益较好的行业和股票构成投资组合，充分利用不同模型在不同市场环境下的适应性及其互补优势，在复杂多变的市场环境下，力争实现基金资产的稳健增值。</p> <p>本基金投资策略还包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	九泰基金管理有限公司	浙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	95527
传真	010-57383867	0571-88268688
注册地址	北京市丰台区丽泽路 18 号	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号

	院 1 号楼 801-16 室	
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	杭州市拱墅区延安路 368 号
邮政编码	100020	310006
法定代表人	严军	张荣森(代为履行法定代表人职 责)

注：因原法定代表人辞任，浙商银行股份有限公司于 2022 年 1 月 14 日以书面传签方式召开第六届董事会 2022 年第一次临时会议，审议通过了《关于推举董事代为履行董事长职责的议案》。经全体董事一致表决同意，由执行董事、行长张荣森先生代为履行董事长、董事会战略委员会主任委员、董事会普惠金融发展委员会主任委员及法定代表人职责，直至选举产生新任董事长且其任职资格获银保监会核准之日止。

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日		2020 年	
	九泰盈泰量化 A	九泰盈泰量化 C	九泰盈泰量化 A	九泰盈泰量化 C	九泰盈泰量化 A	九泰盈泰量化 C
本期已实现收益	-6,475,236.97	-5,154,932.59	-4,931,137.80	-3,727,698.36	-	-
本期利润	-7,602,424.10	-5,916,547.97	-5,041,197.48	-3,710,710.80	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1455	-0.1472	-0.0720	-0.0540	-	-
本期加权平均净值利润率	-17.32%	-17.62%	-7.51%	-5.58%	-	-
本期基金份额净值增长率	-15.02%	-15.53%	-7.04%	-7.26%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	-9,853,521.90	-8,405,395.35	-4,365,778.39	-3,361,945.18	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.2100	-0.2166	-0.0734	-0.0755	-	-
期末基金资产净值	37,059,728.55	30,403,731.25	55,299,299.89	41,298,768.45	-	-
期末基金份额净值	0.7900	0.7834	0.9296	0.9274	-	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	-21.00%	-21.66%	-7.04%	-7.26%	-	-

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 12 月 31 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

九泰盈泰量化 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.43%	0.95%	1.69%	1.23%	-3.12%	-0.28%
过去六个月	-13.55%	0.92%	-13.00%	1.05%	-0.55%	-0.13%
过去一年	-15.02%	1.16%	-20.58%	1.22%	5.56%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-21.00%	1.04%	-18.96%	1.12%	-2.04%	-0.08%

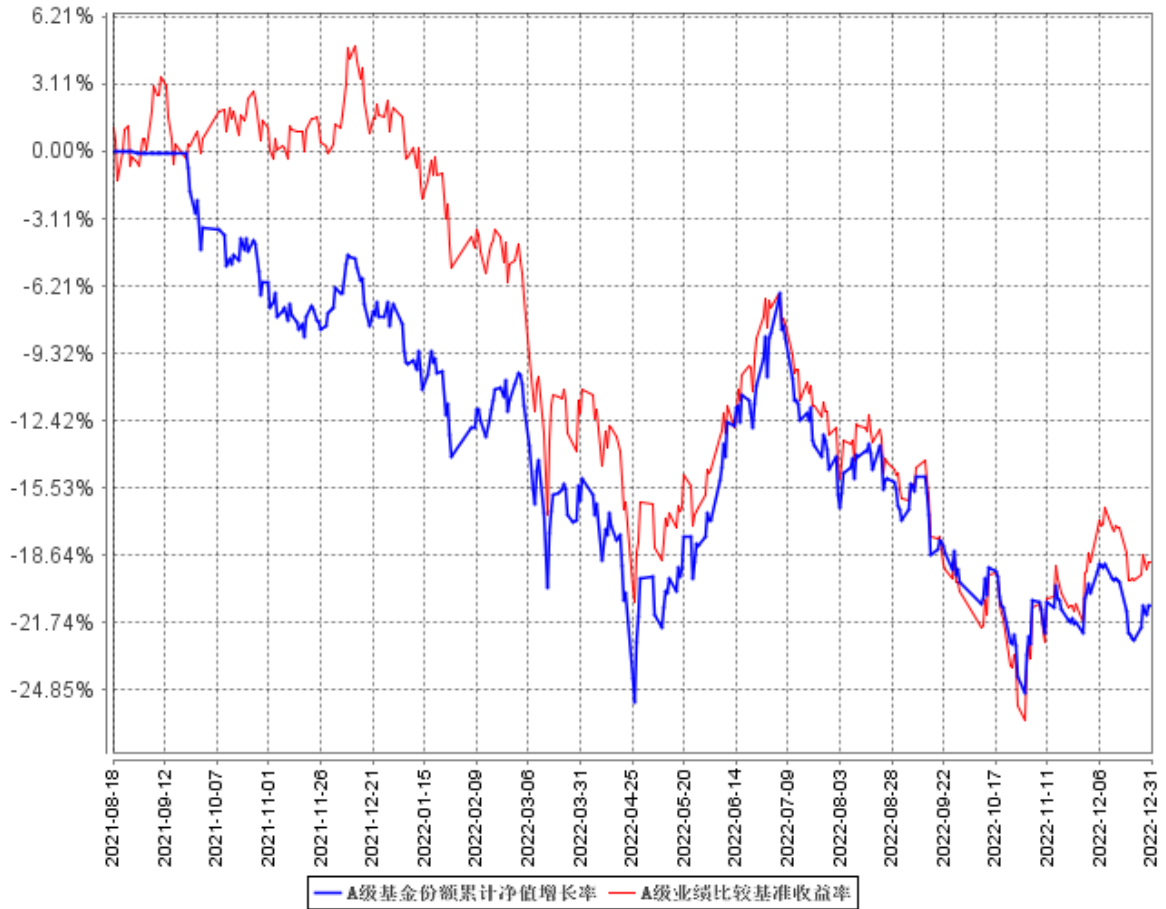
九泰盈泰量化 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.60%	0.95%	1.69%	1.23%	-3.29%	-0.28%
过去六个月	-13.82%	0.92%	-13.00%	1.05%	-0.82%	-0.13%
过去一年	-15.53%	1.16%	-20.58%	1.22%	5.05%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-21.66%	1.04%	-18.96%	1.12%	-2.70%	-0.08%

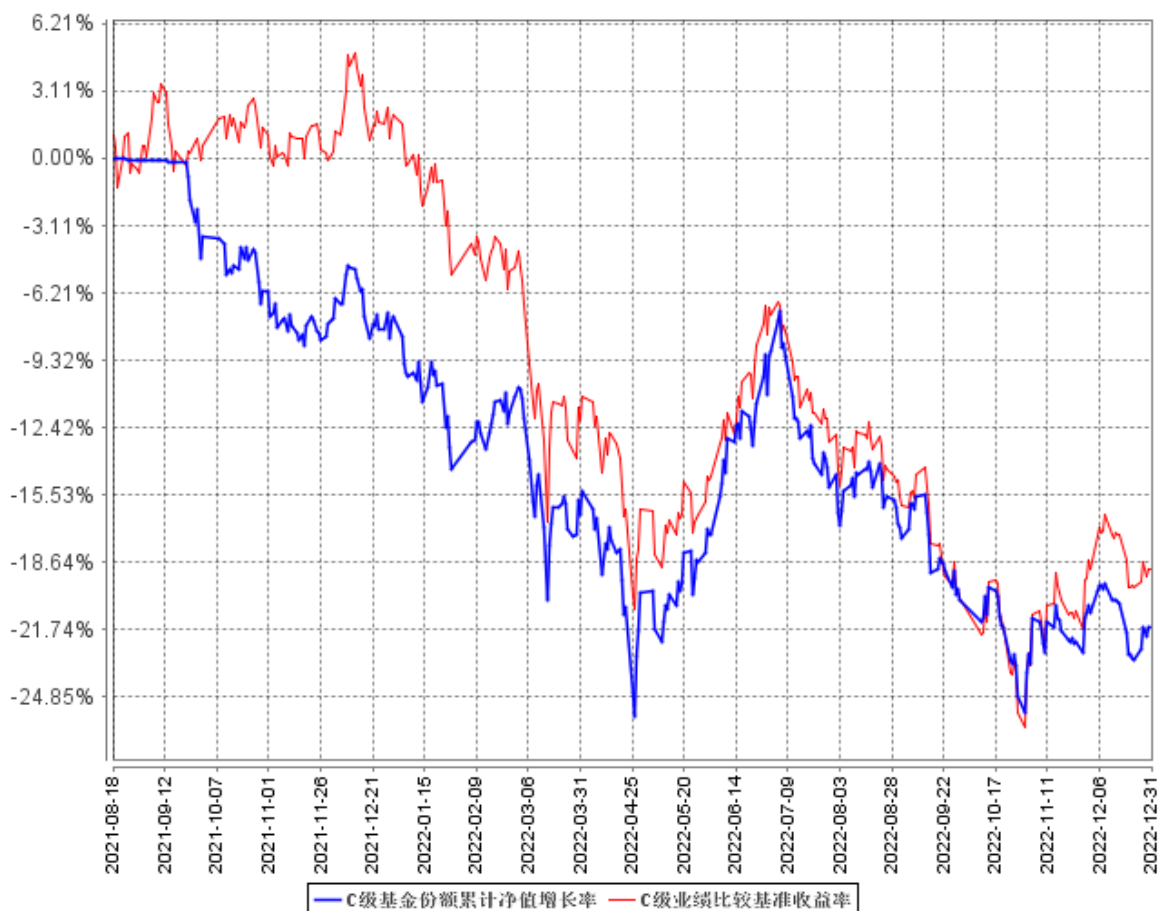


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

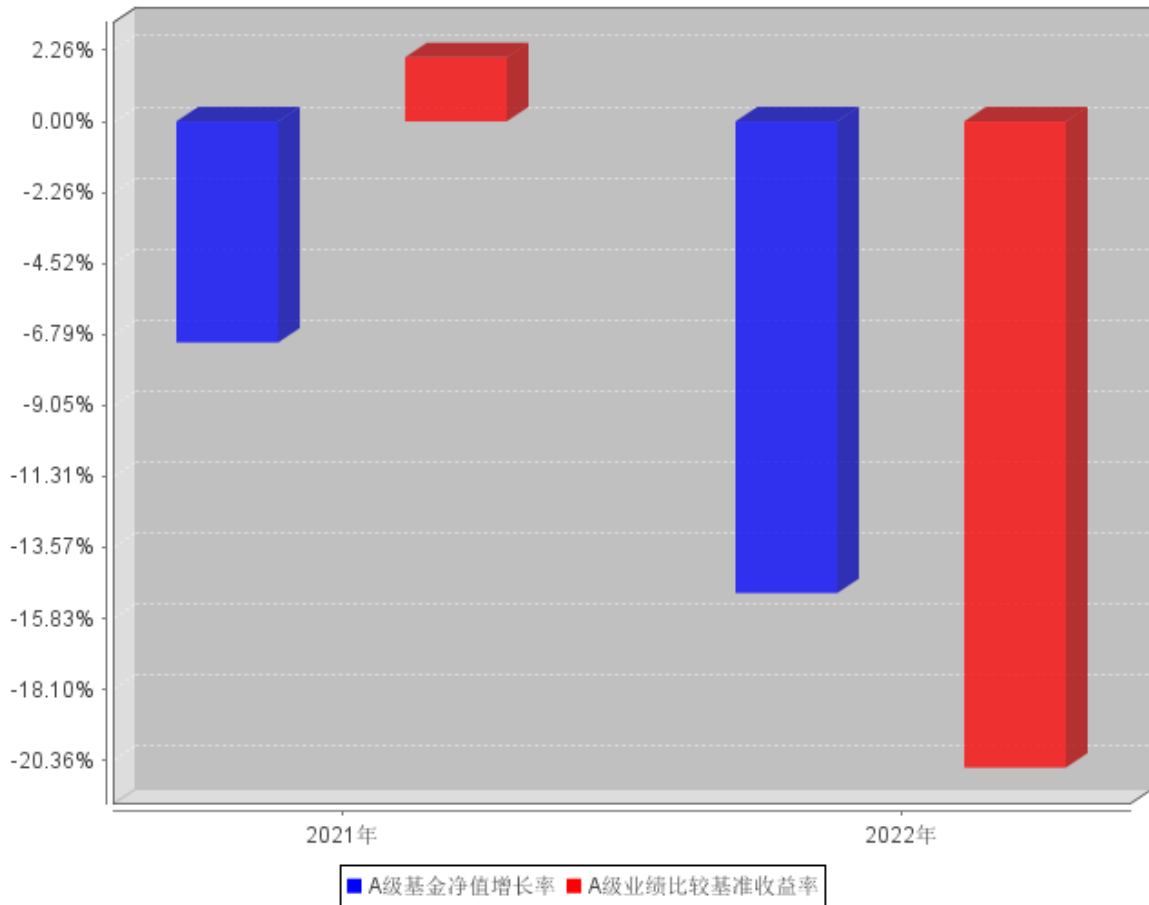


注：1. 本基金合同于 2021 年 8 月 18 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年，距建仓期结束不满一年。

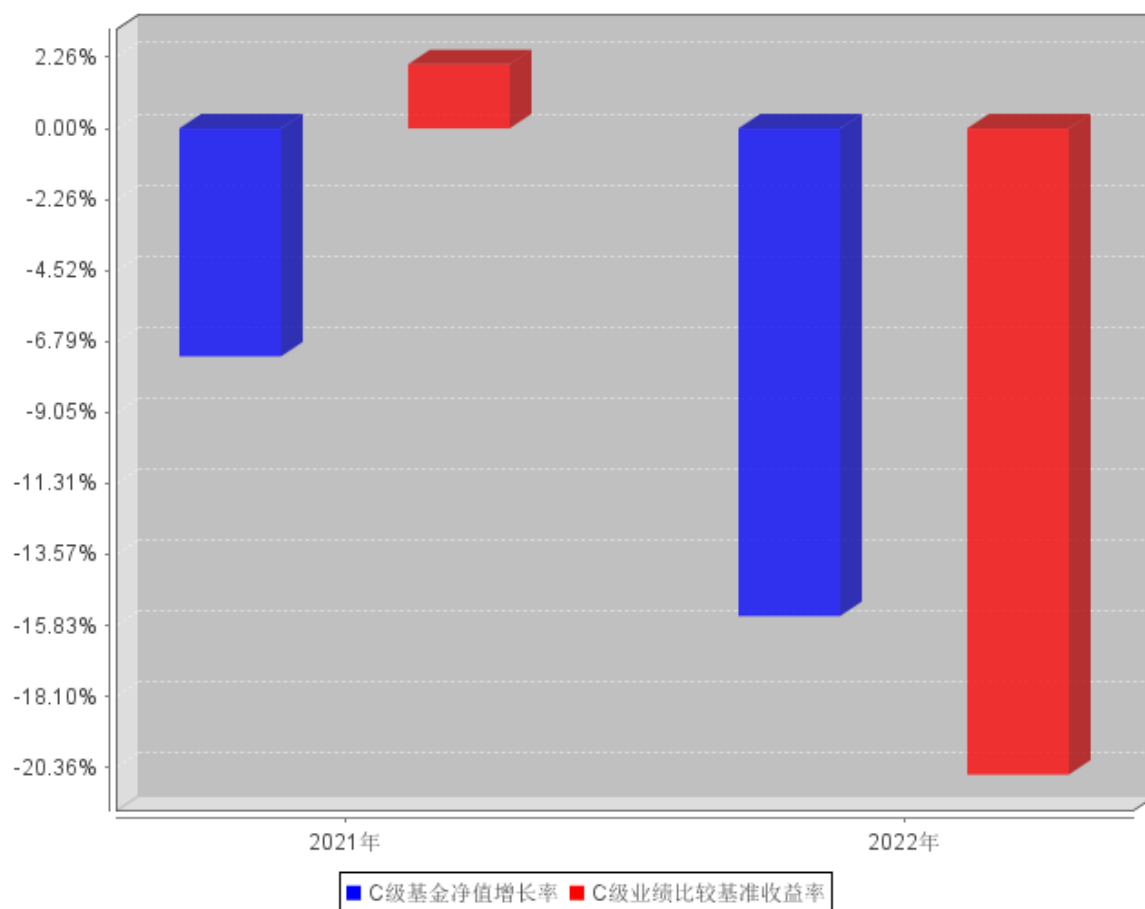
2. 根据基金合同的约定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求。本基金建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

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



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



注：本基金合同于 2021 年 8 月 18 日生效，合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

九泰基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2014】650 号文批准，于 2014 年 7 月 3 日正式成立，注册资本 3 亿元人民币，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	2021 年 8 月 18 日	-	12	清华大学统计专业硕士、北京大学理学学士，12 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，曾任玖方量化投资部副总监，现任玖方量化投资部总经理、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定的相关规定。
- 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 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

2022 年，A 股市场出现一定幅度调整，主流宽基指数中，上证指数、上证 50 指数、沪深 300 指数、中证 500 指数、创业板指整体下跌，回调力度较大。2022 年新冠疫情对国内经济形成一定

的负面影响，国际上欧美央行纷纷退出货币宽松政策，也一定程度上压制了全球权益资产的估值，受这些因素影响，A股市场表现不佳。本基金采用量化模型进行投资操作，2022年相对基准沪深300指数取得了一定的超额收益。本基金采用两类量化模型进行投资操作：行业轮动模型、多因子选股模型。在报告期内，行业轮动模型小幅反弹，主要原因是疫情对各行业产生的影响不同，造成各行业间走势分化，本基金所采用的行业轮动模型较为有效地捕捉到这一点，获取了一定的阿尔法收益；子策略来看，基本面因子出现反弹，价格动量类、分析师类因子略有回撤。多因子选股策略在报告期内表现较好，基本面动量、价值因子表现较强，这是因为疫情下投资者对企业基本面状况更为关注。

#### 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0.7900元，本报告期基金份额净值增长率为-15.02%；截至本报告期末本基金C类份额净值为0.7834元，本报告期基金份额净值增长率为-15.53%；同期业绩比较基准收益率为-20.58%。

#### 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，国际上各国央行加息节奏有所缓和，全球权益资产对货币紧缩的冲击已有较为充分的反应；国内疫情管控措施有所优化，这有助于国内实体经济的稳定；且近期促进实体经济发展的政策频繁落地，这将为我国经济的增长提供动力。我们认为2023年A股市场的投资环境较2022年有所改善，市场的流动性趋于宽松，企业基本面也有望迎来较大反弹，且经过2022年的调整部分股票估值回落，投资价值凸显，我们认为2023年的A股市场可能存在不错的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

理层出具监察稽核报告。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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



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

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对九泰基金管理有限公司编制和披露的九泰盈泰量化股票型证券投资基金 2022 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(23)第 P00023 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	九泰盈泰量化股票型证券投资基金全体持有人：
审计意见	<p>我们审计了九泰盈泰量化股票型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了九泰盈泰量化股票型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于九泰盈泰量化股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>九泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括九泰盈泰量化股票型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报</p>

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

	<p>相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致九泰盈泰量化股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	韩玫   杨婧
会计师事务所的地址	中国·上海
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：九泰盈泰量化股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,993,401.89	4,726,744.93
结算备付金		55,592.50	3,045,484.93
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	61,469,245.36	89,053,022.49
其中：股票投资		61,469,245.36	89,053,022.49
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,284,266.41	7,401.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	3,819.78
资产总计		67,802,506.16	96,836,473.41
<b>负债和净资产</b>			
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		96,727.30	24,790.78

应付管理人报酬		85,819.11	125,533.51
应付托管费		11,442.57	16,737.82
应付销售服务费		15,052.92	21,308.53
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	7.4.7.9	130,004.46	50,034.43
负债合计		339,046.36	238,405.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	85,722,377.05	104,016,820.78
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-18,258,917.25	-7,418,752.44
净资产合计		67,463,459.80	96,598,068.34
负债和净资产总计		67,802,506.16	96,836,473.41

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，九泰盈泰量化 A 份额净值为人民币 0.7900 元，九泰盈泰量化 C 份额净值为人民币 0.7834 元；基金份额总额为 85,722,377.05 份，九泰盈泰量化 A 份额 46,913,250.45 份，九泰盈泰量化 C 份额 38,809,126.60 份。

## 7.2 利润表

会计主体：九泰盈泰量化股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日(基 金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-11,866,497.99	-7,106,629.56
1.利息收入		23,230.29	166,650.37
其中：存款利息收入	7.4.7.13	23,230.29	94,019.31
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		-	72,631.06
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,015,388.82	-7,252,305.26
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-11,327,132.28	-7,375,504.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-

衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,311,743.46	123,198.84
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）	7.4.7.20	-1,888,802.51	-93,072.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	14,463.05	72,097.45
<b>减：二、营业总支出</b>		1,652,474.08	1,645,278.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,165,170.86	740,611.06
2. 托管费	7.4.10.2.2	155,356.10	98,748.14
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	201,947.12	146,625.17
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	130,000.00	659,294.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-13,518,972.07	-8,751,908.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-13,518,972.07	-8,751,908.28
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-13,518,972.07	-8,751,908.28

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 18 日，上年度可比期间为 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：九泰盈泰量化股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	104,016,820.78	-	-7,418,752.44	96,598,068.34



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）	104,016,820.78	-	-7,418,752.44	96,598,068.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,294,443.73	-	-10,840,164.81	-29,134,608.54
（一）、综合收益总额	-	-	-13,518,972.07	-13,518,972.07
（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）	-18,294,443.73	-	2,678,807.26	-15,615,636.47
其中：1.基金申购款	5,189,481.58	-	-1,014,678.54	4,174,803.04
2.基金赎回款	-23,483,925.31	-	3,693,485.80	-19,790,439.51
（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）	85,722,377.05	-	-18,258,917.25	67,463,459.80
项目	上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 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）	-	-	-	-
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）	206,543,567.88	-	-	206,543,567.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-102,526,747.10	-	-7,418,752.44	-109,945,499.54
（一）、综合收益总	-	-	-8,751,908.28	-8,751,908.28

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)	-102,526,747.10	-	1,333,155.84	-101,193,591.26
其中: 1.基金申购款	1,019,820.87	-	-66,487.55	953,333.32
2.基金赎回款	-103,546,567.97	-	1,399,643.39	-102,146,924.58
(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)	104,016,820.78	-	-7,418,752.44	96,598,068.34

注: 本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 18 日, 上年度可比期间为 2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

九泰盈泰量化股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]第 3656 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《九泰盈泰量化股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起, 于 2021 年 6 月 21 日起至 2021 年 8 月 16 日止向社会公开募集。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的, 称为 A 类基金份额; 不收取认购、申购费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费的, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码, 分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金为契约型开放式证券投资基金, 存续期限为不定期。募集期间净认购资金总额为人民币 206,447,977.75 元(其中, A 类基金份额净认购金额为人民币 80,875,288.21 元, 折合 80,875,288.21 份基金份额; C 类基金份额净认购金额为人民币 125,572,689.54 元, 折合

125,572,689.54 份基金份额)，在募集期间产生的利息为人民币 95,590.13 元（其中，A 类基金份额产生的利息为人民币 55,534.42 元，C 类基金份额产生的利息为人民币 40,055.71 元），以上实收基金（本息）合计为人民币 206,543,567.88 元，折合 206,543,567.88 份基金份额。上述募集资金已经北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为[2021]京会兴验字第 69000008 号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于 2021 年 8 月 18 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，基金托管人为浙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《九泰盈泰量化股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准或注册发行的股票），债券（含国债、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、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、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×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

##### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债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，将其公允价值划分为三个层次。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。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采

用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

##### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

##### (4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

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

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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。

本基金在编制 2022 年度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。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。

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、结算备付金和应收利息，金额分别为人民币分别为人民币分别为人民币 4,726,744.93 元、人民币 3,045,484.93 元和人民币 3,819.78 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和结算备付金。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，并反映在银行存款和结算备付金等项目中，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，银行存款和结算备付金的期初金额分别为人民币 4,727,276.17 元和人民币 3,048,773.47 元。

本基金自 2022 年 7 月 1 日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》，并按相关衔接规定进行了处理。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	2,612,886.95	347,446.99
等于：本金	2,612,705.55	347,446.99
加：应计利息	181.40	-
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	2,380,514.94	4,379,297.94
等于：本金	2,380,311.20	4,379,297.94
加：应计利息	203.74	-
减：坏账准备	-	-
合计：	4,993,401.89	4,726,744.93

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	63,451,119.99	-	61,469,245.36	-1,981,874.63
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	63,451,119.99	-	61,469,245.36	-1,981,874.63
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	89,146,094.61	-	89,053,022.49	-93,072.12
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	89,146,094.61	-	89,053,022.49	-93,072.12

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.5 债权投资**

无。

**7.4.7.6 其他债权投资**

无。

**7.4.7.7 其他权益工具投资**

无。

**7.4.7.8 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	3,819.78
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	3,819.78

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4.46	34.43
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
应付利息	-	-
预提信息披露费	80,000.00	-
预提审计费	50,000.00	50,000.00
合计	130,004.46	50,034.43

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

九泰盈泰量化 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,487,419.65	59,487,419.65
本期申购	938,053.82	938,053.82
本期赎回（以“-”号填列）	-13,512,223.02	-13,512,223.02
- 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	46,913,250.45	46,913,250.45

金额单位：人民币元

九泰盈泰量化 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,529,401.13	44,529,401.13
本期申购	4,251,427.76	4,251,427.76
本期赎回（以“-”号填列）	-9,971,702.29	-9,971,702.29
- 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	38,809,126.60	38,809,126.60

注：赎回中包含转换出份额及金额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

九泰盈泰量化 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-4,365,778.39	177,658.63	-4,188,119.76
本期利润	-6,475,236.97	-1,127,187.13	-7,602,424.10
本期基金份额交易产生的变动数	1,736,514.28	200,507.68	1,937,021.96

其中：基金申购款	-126,439.43	-14,859.35	-141,298.78
基金赎回款	1,862,953.71	215,367.03	2,078,320.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,104,501.08	-749,020.82	-9,853,521.90

单位：人民币元

九泰盈泰量化 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-3,361,945.18	131,312.50	-3,230,632.68
本期利润	-5,154,932.59	-761,615.38	-5,916,547.97
本期基金份额交易产生的变动数	731,260.17	10,525.13	741,785.30
其中：基金申购款	-760,574.38	-112,805.38	-873,379.76
基金赎回款	1,491,834.55	123,330.51	1,615,165.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,785,617.60	-619,777.75	-8,405,395.35

#### 7.4.7.13 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 12月31日	上年度可比期间 2021年8月18日(基金合同生效日) 至2021年12月31日
活期存款利息收入	9,254.11	26,893.72
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	7,151.42	18,352.11
结算备付金利息收入	6,824.76	48,773.47
其他	-	0.01
合计	23,230.29	94,019.31

注：其他指直销申购款利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 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 12月31日	上年度可比期间 2021年8月18日(基金合同生效日)至2021年12月 31日
卖出股票成交总额	479,573,240.51	275,717,230.92
减：卖出股票成本总额	489,940,419.60	283,092,735.02
减：交易费用	959,953.19	-

买卖股票差价收入	-11,327,132.28	-7,375,504.10
----------	----------------	---------------

#### 7.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月18日(基金合同生效日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,311,743.46	123,198.84
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,311,743.46	123,198.84

#### 7.4.7.20 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12月31日	上年度可比期间 2021年8月18日(基金合同生效日)至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,888,802.51	-93,072.12
——股票投资	-1,888,802.51	-93,072.12
——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	-1,888,802.51	-93,072.12

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年8月18日(基金合同生效日)至2021年12月31日
基金赎回费收入	14,267.72	71,638.94
基金转换费收入	195.33	458.51
合计	14,463.05	72,097.45

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年8月18日(基金合同生效日)至2021年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	-
证券出借违约金	-	-
交易费用	-	608,894.35
其他	-	400.00
合计	130,000.00	659,294.35

注：其他指证券账户开户费。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。



### 7.4.9 关联方关系

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

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 8 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,165,170.86	740,611.06
其中：支付销售机构的客户维护费	577,795.25	317,718.39

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，于次月首日起 3 个工作日内由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工

作日内支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	155,356.10	98,748.14

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰盈泰量化 A	九泰盈泰量化 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	-	-
浙商银行股份有限公司	-	159,562.19	159,562.19
合计	-	159,562.19	159,562.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰盈泰量化 A	九泰盈泰量化 C	合计
九泰基金管理有限公司	-	40,207.17	40,207.17
浙商银行股份有限公司	-	75,640.73	75,640.73
合计	-	115,847.90	115,847.90

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 0.60%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

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

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有	2,612,886.95	9,254.11	347,446.99	26,893.72

限公司				
-----	--	--	--	--

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

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了董事会及风险控制委员会、总经理、风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部以及相关业务部门构成的风险管理架构体系。董事会负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度。董事会下设风险控制委员会，风险控制委员会负责对公司

经营管理与资产组合运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查；总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险管理委员会，负责审议公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等，重点是公司的合规控制和投资的风险控制；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人在商业银行开立的托管账户，投资其他银行存款由基金管理人根据投资制度审慎选择存款银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

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

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

于本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

于本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

于本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

综上所述，本基金在本报告期内流动性良好，无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	4,993,401.89	-	-	-	-	-	4,993,401.89
结算备付金	55,592.50	-	-	-	-	-	55,592.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	61,469,245.36	61,469,245.36
应收申购款	-	-	-	-	-	1,284,266.41	1,284,266.41
资产总计	5,048,994.39	-	-	-	-	62,753,511.77	67,802,506.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	96,727.30	96,727.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	85,819.11	85,819.11
应付托管费	-	-	-	-	-	11,442.57	11,442.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,052.92	15,052.92
其他负债	-	-	-	-	-	130,004.46	130,004.46
负债总计	-	-	-	-	-	339,046.36	339,046.36
利率敏感度缺口	5,048,994.39	-	-	-	-	62,414,465.41	67,463,459.80
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	4,726,744.93	-	-	-	-	-	4,726,744.93
结算备付金	3,045,484.93	-	-	-	-	-	3,045,484.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-	89,053,022.49	89,053,022.49

应收申购款	-	-	-	-	7,401.28	7,401.28
其他资产	-	-	-	-	3,819.78	3,819.78
资产总计	7,772,229.86	-	-	-	89,064,243.55	96,836,473.41
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	24,790.78	24,790.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	125,533.51	125,533.51
应付托管费	-	-	-	-	16,737.82	16,737.82
应付销售服务费	-	-	-	-	21,308.53	21,308.53
其他负债	-	-	-	-	50,034.43	50,034.43
负债总计	-	-	-	-	238,405.07	238,405.07
利率敏感度缺口	7,772,229.86	-	-	-	-88,825,838.48	-96,598,068.34

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	61,469,245.36	91.11	89,053,022.49	92.19
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	61,469,245.36	91.11	89,053,022.49	92.19

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	2,401,676.62	3,909,745.26
	沪深 300 指数下跌 5%	-2,401,676.62	-3,909,745.26

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	61,469,245.36	88,993,261.03
第二层次	-	-
第三层次	-	59,761.46
合计	61,469,245.36	89,053,022.49

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至 2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	59,761.46	59,761.46
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	44,806.56	44,806.56
当期利得或损失总额	-	-14,954.90	-14,954.90
其中：计入损益的利得或损失	-	-14,954.90	-14,954.90
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2021年8月18日 (基金合同生效日)至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	30,122.98	30,122.98
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	29,638.48	29,638.48
其中：计入损益的利得或损失	-	29,638.48	29,638.48
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	59,761.46	59,761.46
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	29,638.48	29,638.48

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	59,761.46	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	1.7261	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	61,469,245.36	90.66
	其中：股票	61,469,245.36	90.66
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	5,048,994.39	7.45
8	其他各项资产	1,284,266.41	1.89
9	合计	67,802,506.16	100.00

注：银行存款中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,462,700.00	5.13
B	采矿业	3,249,386.00	4.82
C	制造业	30,995,079.24	45.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,172,348.00	3.22
E	建筑业	1,576,463.80	2.34
F	批发和零售业	1,389,950.10	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	829,396.00	1.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,607,489.22	3.87
J	金融业	12,850,856.06	19.05
K	房地产业	15,648.00	0.02
L	租赁和商务服务业	46,352.74	0.07
M	科学研究和技术服务业	267,532.20	0.40

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	250,240.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	1,702,834.00	2.52
S	综合	52,970.00	0.08
	合计	61,469,245.36	91.11

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,400	2,417,800.00	3.58
2	601288	农业银行	651,400	1,895,574.00	2.81
3	601988	中国银行	586,500	1,853,340.00	2.75
4	600438	通威股份	46,000	1,774,680.00	2.63
5	300144	宋城演艺	112,000	1,635,200.00	2.42
6	300498	温氏股份	68,800	1,350,544.00	2.00
7	601628	中国人寿	35,400	1,314,048.00	1.95
8	002714	牧原股份	23,700	1,155,375.00	1.71
9	600919	江苏银行	152,800	1,113,912.00	1.65
10	601318	中国平安	23,500	1,104,500.00	1.64
11	600089	特变电工	51,200	1,028,096.00	1.52
12	600039	四川路桥	87,500	973,000.00	1.44
13	002304	洋河股份	5,700	914,850.00	1.36
14	600598	北大荒	66,000	908,160.00	1.35
15	002311	海大集团	14,400	888,912.00	1.32
16	601838	成都银行	57,100	873,630.00	1.29
17	601225	陕西煤业	40,300	748,774.00	1.11
18	000651	格力电器	23,154	748,337.28	1.11
19	601857	中国石油	144,500	718,165.00	1.06
20	600050	中国联通	150,000	672,000.00	1.00
21	000063	中兴通讯	25,600	662,016.00	0.98
22	601998	中信银行	132,500	659,850.00	0.98
23	601319	中国人保	124,500	649,890.00	0.96
24	601601	中国太保	26,400	647,328.00	0.96

25	603369	今世缘	12,400	631,160.00	0.94
26	300628	亿联网络	10,300	624,077.00	0.93
27	600795	国电电力	144,800	618,296.00	0.92
28	605499	东鹏饮料	3,400	604,860.00	0.90
29	600546	山煤国际	40,900	592,641.00	0.88
30	600521	华海药业	27,000	590,220.00	0.87
31	600015	华夏银行	112,700	584,913.00	0.87
32	600188	兖矿能源	17,400	584,292.00	0.87
33	300014	亿纬锂能	6,200	544,980.00	0.81
34	603658	安图生物	8,800	544,280.00	0.81
35	002594	比亚迪	2,100	539,637.00	0.80
36	300763	锦浪科技	2,800	504,140.00	0.75
37	600809	山西汾酒	1,700	484,483.00	0.72
38	601398	工商银行	109,000	473,060.00	0.70
39	600027	华电国际	80,000	470,400.00	0.70
40	600028	中国石化	102,600	447,336.00	0.66
41	300769	德方纳米	1,900	436,221.00	0.65
42	002466	天齐锂业	5,500	434,445.00	0.64
43	300003	乐普医疗	18,000	413,460.00	0.61
44	601009	南京银行	39,400	410,548.00	0.61
45	600085	同仁堂	9,100	406,588.00	0.60
46	601169	北京银行	92,100	396,951.00	0.59
47	600600	青岛啤酒	3,600	387,000.00	0.57
48	600845	宝信软件	8,150	365,120.00	0.54
49	600079	人福医药	14,000	334,460.00	0.50
50	600160	巨化股份	20,500	317,955.00	0.47
51	000568	泸州老窖	1,400	313,992.00	0.47
52	000963	华东医药	6,600	308,880.00	0.46
53	000333	美的集团	5,700	295,260.00	0.44
54	002372	伟星新材	13,800	294,492.00	0.44
55	300496	中科创达	2,900	290,870.00	0.43
56	601186	中国铁建	36,700	283,691.00	0.42
57	000999	华润三九	6,000	280,860.00	0.42
58	002050	三花智控	12,800	271,616.00	0.40
59	603659	璞泰来	5,200	269,828.00	0.40
60	603688	石英股份	2,000	262,640.00	0.39
61	600660	福耀玻璃	7,400	259,518.00	0.38
62	000792	盐湖股份	11,100	251,859.00	0.37
63	603882	金域医学	3,200	250,240.00	0.37

64	600985	淮北矿业	19,500	249,600.00	0.37
65	002252	上海莱士	39,300	249,162.00	0.37
66	600487	亨通光电	16,500	248,490.00	0.37
67	300316	晶盛机电	3,900	247,884.00	0.37
68	300751	迈为股份	600	247,104.00	0.37
69	603259	药明康德	3,000	243,000.00	0.36
70	002152	广电运通	23,700	235,578.00	0.35
71	600161	天坛生物	9,600	227,808.00	0.34
72	300390	天华超净	3,900	217,932.00	0.32
73	600926	杭州银行	16,600	217,128.00	0.32
74	600875	东方电气	10,100	212,302.00	0.31
75	300142	沃森生物	5,200	208,988.00	0.31
76	002460	赣锋锂业	3,000	208,530.00	0.31
77	605117	德业股份	600	198,720.00	0.29
78	002030	达安基因	12,600	196,056.00	0.29
79	000883	湖北能源	46,600	195,720.00	0.29
80	600900	长江电力	9,300	195,300.00	0.29
81	002557	洽洽食品	3,778	188,900.00	0.28
82	000596	古井贡酒	700	186,830.00	0.28
83	600025	华能水电	28,200	186,120.00	0.28
84	002240	盛新锂能	4,900	183,701.00	0.27
85	600298	安琪酵母	4,000	180,880.00	0.27
86	600233	圆通速递	9,000	180,810.00	0.27
87	601698	中国卫通	15,600	178,152.00	0.26
88	002756	永兴材料	1,900	175,123.00	0.26
89	000938	紫光股份	8,907	173,775.57	0.26
90	002459	晶澳科技	2,867	172,278.03	0.26
91	603198	迎驾贡酒	2,700	169,506.00	0.25
92	601808	中海油服	10,000	165,800.00	0.25
93	601766	中国中车	32,300	165,053.00	0.24
94	601006	大秦铁路	24,500	163,660.00	0.24
95	600536	中国软件	2,800	163,324.00	0.24
96	002821	凯莱英	1,100	162,800.00	0.24
97	002353	杰瑞股份	5,800	161,878.00	0.24
98	003816	中国广核	59,000	158,710.00	0.24
99	600739	辽宁成大	12,600	158,634.00	0.24
100	603456	九洲药业	3,700	156,991.00	0.23
101	600570	恒生电子	3,842	155,447.32	0.23
102	600380	健康元	13,200	149,028.00	0.22

103	002920	德赛西威	1,400	147,476.00	0.22
104	000831	中国稀土	4,400	144,672.00	0.21
105	000858	五粮液	800	144,552.00	0.21
106	600741	华域汽车	8,000	138,640.00	0.21
107	600018	上港集团	25,900	138,306.00	0.21
108	002371	北方华创	600	135,180.00	0.20
109	601689	拓普集团	2,300	134,734.00	0.20
110	601238	广汽集团	11,900	131,257.00	0.19
111	601012	隆基绿能	3,100	131,006.00	0.19
112	600522	中天科技	8,100	130,815.00	0.19
113	600588	用友网络	5,400	130,518.00	0.19
114	002032	苏泊尔	2,600	128,596.00	0.19
115	600941	中国移动	1,900	128,573.00	0.19
116	601138	工业富联	14,000	128,520.00	0.19
117	601390	中国中铁	22,600	125,656.00	0.19
118	600803	新奥股份	7,800	125,580.00	0.19
119	300124	汇川技术	1,800	125,100.00	0.19
120	002791	坚朗五金	1,200	124,740.00	0.18
121	600886	国投电力	11,500	124,545.00	0.18
122	600096	云天化	5,800	122,032.00	0.18
123	600737	中粮糖业	17,500	121,450.00	0.18
124	002230	科大讯飞	3,650	119,829.50	0.18
125	600153	建发股份	8,694	118,673.10	0.18
126	002444	巨星科技	6,100	115,778.00	0.17
127	300699	光威复材	1,600	115,600.00	0.17
128	600436	片仔癀	400	115,384.00	0.17
129	002384	东山精密	4,600	113,758.00	0.17
130	300896	爱美客	200	113,270.00	0.17
131	300073	当升科技	2,000	112,800.00	0.17
132	002179	中航光电	1,940	112,054.40	0.17
133	600563	法拉电子	700	111,916.00	0.17
134	601615	明阳智能	4,400	111,144.00	0.16
135	002938	鹏鼎控股	4,000	109,760.00	0.16
136	002352	顺丰控股	1,800	103,968.00	0.15
137	601877	正泰电器	3,600	99,720.00	0.15
138	603019	中科曙光	4,500	99,630.00	0.15
139	603290	斯达半导	300	98,790.00	0.15
140	600176	中国巨石	7,200	98,712.00	0.15
141	603185	上机数控	900	95,265.00	0.14



142	002475	立讯精密	3,000	95,250.00	0.14
143	000786	北新建材	3,600	93,168.00	0.14
144	000738	航发控制	3,600	92,304.00	0.14
145	600256	广汇能源	10,200	92,004.00	0.14
146	603077	和邦生物	30,000	91,200.00	0.14
147	300363	博腾股份	2,200	89,870.00	0.13
148	600801	华新水泥	6,000	88,920.00	0.13
149	600141	兴发集团	3,000	87,000.00	0.13
150	601901	方正证券	13,000	82,940.00	0.12
151	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.12
152	000878	云南铜业	7,000	82,250.00	0.12
153	300661	圣邦股份	450	77,670.00	0.12
154	600271	航天信息	7,300	75,993.00	0.11
155	600699	均胜电子	5,400	75,870.00	0.11
156	601607	上海医药	4,200	74,886.00	0.11
157	000876	新希望	5,600	72,296.00	0.11
158	603986	兆易创新	700	71,729.00	0.11
159	601872	招商轮船	12,800	71,552.00	0.11
160	000768	中航西飞	2,800	71,260.00	0.11
161	601117	中国化学	8,800	69,872.00	0.10
162	000988	华工科技	4,200	68,922.00	0.10
163	600390	五矿资本	13,400	68,072.00	0.10
164	000625	长安汽车	5,440	66,966.40	0.10
165	002624	完美世界	5,200	66,144.00	0.10
166	002410	广联达	1,100	65,945.00	0.10
167	300919	中伟股份	1,000	65,610.00	0.10
168	001301	尚太科技	1,106	65,298.24	0.10
169	600026	中远海能	5,400	65,070.00	0.10
170	000983	山西焦煤	5,500	64,075.00	0.09
171	601919	中远海控	6,200	63,798.00	0.09
172	002180	纳思达	1,200	62,268.00	0.09
173	600905	三峡能源	10,900	61,585.00	0.09
174	002555	三七互娱	3,400	61,540.00	0.09
175	601800	中国交建	7,600	61,180.00	0.09
176	600104	上汽集团	4,200	60,522.00	0.09
177	300957	贝泰妮	400	59,696.00	0.09
178	002945	华林证券	4,500	59,310.00	0.09
179	002507	涪陵榨菜	2,300	59,271.00	0.09
180	603486	科沃斯	800	58,352.00	0.09

181	601728	中国电信	13,900	58,241.00	0.09
182	601668	中国建筑	10,560	57,340.80	0.08
183	600392	盛和资源	4,000	56,000.00	0.08
184	000519	中兵红箭	2,800	54,992.00	0.08
185	600406	国电南瑞	2,200	53,680.00	0.08
186	600150	中国船舶	2,400	53,472.00	0.08
187	002812	恩捷股份	400	52,516.00	0.08
188	603233	大参林	1,320	52,272.00	0.08
189	600132	重庆啤酒	400	50,952.00	0.08
190	601799	星宇股份	400	50,948.00	0.08
191	603392	万泰生物	400	50,680.00	0.08
192	603605	珀莱雅	300	50,244.00	0.07
193	002049	紫光国微	380	50,091.60	0.07
194	600705	中航产融	15,000	49,200.00	0.07
195	600549	厦门钨业	2,500	48,875.00	0.07
196	600372	中航电子	3,000	47,910.00	0.07
197	000425	徐工机械	9,400	47,658.00	0.07
198	601088	中国神华	1,700	46,954.00	0.07
199	601989	中国重工	13,400	46,766.00	0.07
200	000733	振华科技	400	45,692.00	0.07
201	002497	雅化集团	1,900	44,175.00	0.07
202	601118	海南橡胶	10,000	43,800.00	0.06
203	300001	特锐德	2,800	42,588.00	0.06
204	300251	光线传媒	4,900	42,434.00	0.06
205	600486	扬农化工	400	41,560.00	0.06
206	002120	韵达股份	2,800	40,264.00	0.06
207	603993	洛阳钼业	8,700	39,585.00	0.06
208	600862	中航高科	1,700	37,893.00	0.06
209	600309	万华化学	400	37,060.00	0.05
210	600415	小商品城	7,000	36,680.00	0.05
211	002916	深南电路	500	36,075.00	0.05
212	002602	世纪华通	9,400	35,814.00	0.05
213	300122	智飞生物	400	35,132.00	0.05
214	002709	天赐材料	800	35,088.00	0.05
215	600348	华阳股份	2,400	34,200.00	0.05
216	000009	中国宝安	2,800	33,852.00	0.05
217	002600	领益智造	7,400	33,596.00	0.05
218	603260	合盛硅业	400	33,176.00	0.05
219	300037	新宙邦	740	32,167.80	0.05

220	603596	伯特利	400	31,920.00	0.05
220	603939	益丰药房	500	31,920.00	0.05
221	600765	中航重机	1,000	31,090.00	0.05
222	002736	国信证券	3,500	31,080.00	0.05
223	600887	伊利股份	1,000	31,000.00	0.05
224	002465	海格通信	3,600	29,232.00	0.04
225	002142	宁波银行	900	29,205.00	0.04
226	600655	豫园股份	3,800	28,918.00	0.04
227	300888	稳健医疗	400	28,600.00	0.04
228	300223	北京君正	400	28,176.00	0.04
229	600061	国投资本	4,400	28,116.00	0.04
230	601825	沪农商行	4,651	27,347.88	0.04
231	601995	中金公司	700	26,691.00	0.04
232	300999	金龙鱼	600	26,136.00	0.04
233	601100	恒立液压	400	25,260.00	0.04
234	002739	万达电影	1,800	25,200.00	0.04
235	601899	紫金矿业	2,500	25,000.00	0.04
236	603127	昭衍新药	420	24,532.20	0.04
237	603799	华友钴业	430	23,920.90	0.04
238	002841	视源股份	400	23,616.00	0.04
239	603589	口子窖	400	23,068.00	0.03
240	300418	昆仑万维	1,600	23,056.00	0.03
241	000728	国元证券	3,600	22,788.00	0.03
242	002129	TCL 中环	600	22,596.00	0.03
243	300357	我武生物	400	22,040.00	0.03
244	601985	中国核电	3,600	21,600.00	0.03
245	002673	西部证券	3,500	21,315.00	0.03
246	600745	闻泰科技	400	21,032.00	0.03
247	601699	潞安环能	1,200	20,220.00	0.03
248	002271	东方雨虹	600	20,142.00	0.03
249	603160	汇顶科技	400	20,080.00	0.03
250	600109	国金证券	2,300	20,010.00	0.03
251	600673	东阳光	2,200	19,118.00	0.03
252	603517	绝味食品	300	18,327.00	0.03
253	600704	物产中大	3,800	18,278.00	0.03
254	601179	中国西电	3,900	17,979.00	0.03
255	002603	以岭药业	600	17,976.00	0.03
256	601788	光大证券	1,200	17,844.00	0.03
257	605358	立昂微	400	17,040.00	0.03

258	600893	航发动力	400	16,912.00	0.03
259	300450	先导智能	400	16,100.00	0.02
260	601216	君正集团	4,000	15,960.00	0.02
261	601865	福莱特	400	13,324.00	0.02
262	600426	华鲁恒升	400	13,260.00	0.02
263	600460	士兰微	400	13,116.00	0.02
264	600315	上海家化	400	12,740.00	0.02
265	300601	康泰生物	400	12,612.00	0.02
266	300529	健帆生物	400	12,388.00	0.02
267	601966	玲珑轮胎	600	12,288.00	0.02
268	600332	白云山	410	12,213.90	0.02
269	002268	卫士通	400	12,212.00	0.02
270	600362	江西铜业	700	12,201.00	0.02
271	601633	长城汽车	400	11,848.00	0.02
272	000027	深圳能源	1,800	11,448.00	0.02
273	601108	财通证券	1,600	11,392.00	0.02
274	600529	山东药玻	400	11,360.00	0.02
275	002508	老板电器	400	11,104.00	0.02
276	300285	国瓷材料	400	11,028.00	0.02
277	603235	天新药业	376	10,949.12	0.02
278	600118	中国卫星	500	10,775.00	0.02
279	002648	卫星化学	680	10,540.00	0.02
280	002439	启明星辰	400	10,432.00	0.02
281	601236	红塔证券	1,400	10,360.00	0.02
282	002008	大族激光	400	10,260.00	0.02
283	600584	长电科技	400	9,220.00	0.01
284	300059	东方财富	440	8,536.00	0.01
285	600030	中信证券	410	8,163.10	0.01
286	002430	杭氧股份	200	7,872.00	0.01
287	000895	双汇发展	300	7,779.00	0.01
288	600111	北方稀土	300	7,515.00	0.01
289	601166	兴业银行	400	7,036.00	0.01
290	002010	传化智联	1,311	7,000.74	0.01
291	002153	石基信息	460	6,895.40	0.01
292	000630	铜陵有色	2,200	6,864.00	0.01
292	000708	中信特钢	400	6,864.00	0.01
293	002797	第一创业	1,200	6,756.00	0.01
294	601231	环旭电子	400	6,492.00	0.01
295	000977	浪潮信息	300	6,456.00	0.01

296	000776	广发证券	400	6,196.00	0.01
297	600482	中国动力	400	6,116.00	0.01
298	600208	新湖中宝	2,400	6,096.00	0.01
299	601555	东吴证券	890	5,811.70	0.01
300	601618	中国中冶	1,800	5,724.00	0.01
301	002601	龙佰集团	300	5,676.00	0.01
302	000002	万科 A	300	5,460.00	0.01
302	600884	杉杉股份	300	5,460.00	0.01
303	600879	航天电子	800	5,440.00	0.01
304	000800	一汽解放	700	5,411.00	0.01
305	600418	江淮汽车	400	5,252.00	0.01
306	601688	华泰证券	400	5,096.00	0.01
307	600316	洪都航空	200	5,038.00	0.01
308	002156	通富微电	300	4,944.00	0.01
309	600827	百联股份	400	4,848.00	0.01
310	000998	隆平高科	300	4,821.00	0.01
311	000807	云铝股份	400	4,448.00	0.01
312	000975	银泰黄金	400	4,416.00	0.01
313	002414	高德红外	400	4,400.00	0.01
314	000021	深科技	400	4,276.00	0.01
315	000960	锡业股份	300	4,230.00	0.01
316	600383	金地集团	400	4,092.00	0.01
317	000066	中国长城	400	4,080.00	0.01
318	002212	天融信	400	3,996.00	0.01
319	000301	东方盛虹	300	3,912.00	0.01
320	000050	深天马 A	400	3,464.00	0.01
321	601898	中煤能源	400	3,448.00	0.01
322	002236	大华股份	300	3,393.00	0.01
323	002185	华天科技	400	3,316.00	0.00
324	002939	长城证券	400	3,312.00	0.00
325	000783	长江证券	600	3,198.00	0.00
326	601696	中银证券	300	3,171.00	0.00
327	601198	东兴证券	400	3,088.00	0.00
328	300253	卫宁健康	300	3,084.00	0.00
329	601168	西部矿业	300	3,060.00	0.00
330	600011	华能国际	400	3,044.00	0.00
331	601881	中国银河	300	2,787.00	0.00
332	601600	中国铝业	600	2,682.00	0.00
333	002027	分众传媒	400	2,672.00	0.00

334	601360	三六零	400	2,616.00	0.00
335	600489	中金黄金	300	2,457.00	0.00
336	002064	华峰化学	300	2,040.00	0.00
337	601816	京沪高铁	400	1,968.00	0.00
338	600918	中泰证券	300	1,923.00	0.00
339	000157	中联重科	300	1,632.00	0.00
340	600369	西南证券	400	1,500.00	0.00
341	601658	邮储银行	300	1,386.00	0.00
342	600219	南山铝业	400	1,308.00	0.00
343	600808	马钢股份	400	1,124.00	0.00
344	000898	鞍钢股份	300	801.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	7,753,268.00	8.03
2	601838	成都银行	6,645,378.69	6.88
3	601988	中国银行	6,409,396.00	6.64
4	600438	通威股份	6,291,127.00	6.51
5	601998	中信银行	5,888,500.00	6.10
6	000568	泸州老窖	5,748,967.00	5.95
7	601288	农业银行	5,343,098.00	5.53
8	600036	招商银行	5,058,514.00	5.24
9	600089	特变电工	4,993,778.59	5.17
10	002466	天齐锂业	4,568,891.00	4.73
11	600050	中国联通	4,474,292.00	4.63
12	600809	山西汾酒	4,299,284.00	4.45
13	600919	江苏银行	4,250,220.00	4.40
14	002142	宁波银行	4,065,764.90	4.21
15	600188	兖矿能源	4,047,246.00	4.19
16	601166	兴业银行	3,989,066.00	4.13
17	600085	同仁堂	3,812,553.00	3.95
18	603659	璞泰来	3,811,909.00	3.95
19	002459	晶澳科技	3,768,556.83	3.90

20	601919	中远海控	3,669,835.00	3.80
21	601169	北京银行	3,578,458.00	3.70
22	601398	工商银行	3,575,222.00	3.70
23	600039	四川路桥	3,565,235.00	3.69
24	002460	赣锋锂业	3,502,690.00	3.63
25	600015	华夏银行	3,435,906.00	3.56
26	601009	南京银行	3,429,077.00	3.55
27	600436	片仔癀	3,412,014.00	3.53
28	002304	洋河股份	3,399,573.00	3.52
29	300316	晶盛机电	3,318,458.64	3.44
30	600111	北方稀土	3,279,979.00	3.40
31	600546	山煤国际	3,235,194.00	3.35
32	002032	苏泊尔	3,231,167.43	3.34
33	600690	海尔智家	3,124,575.00	3.23
34	002812	恩捷股份	3,121,635.00	3.23
35	601225	陕西煤业	2,993,778.00	3.10
36	002129	TCL 中环	2,981,658.00	3.09
37	600926	杭州银行	2,973,541.00	3.08
38	601857	中国石油	2,946,822.00	3.05
39	600392	盛和资源	2,897,180.00	3.00
40	601615	明阳智能	2,807,496.00	2.91
41	600875	东方电气	2,733,656.00	2.83
42	300059	东方财富	2,680,399.80	2.77
43	002709	天赐材料	2,537,109.29	2.63
44	600018	上港集团	2,522,884.00	2.61
45	600598	北大荒	2,455,936.00	2.54
46	600233	圆通速递	2,447,877.00	2.53
47	601881	中国银河	2,434,140.00	2.52
48	603198	迎驾贡酒	2,431,834.00	2.52
49	600028	中国石化	2,422,603.00	2.51
50	300628	亿联网络	2,388,596.58	2.47
51	603882	金域医学	2,329,970.20	2.41
52	000776	广发证券	2,277,744.00	2.36
53	300144	宋城演艺	2,233,258.00	2.31
54	600256	广汇能源	2,224,858.00	2.30
55	600673	东阳光	2,194,338.00	2.27

56	300037	新宙邦	2,193,563.86	2.27
57	002252	上海莱士	2,158,985.00	2.24
58	603392	万泰生物	2,141,447.55	2.22
59	300769	德方纳米	2,127,155.32	2.20
60	600737	中粮糖业	2,123,508.00	2.20
61	601088	中国神华	2,111,900.00	2.19
62	601628	中国人寿	2,105,403.00	2.18
63	002240	盛新锂能	2,066,475.00	2.14
64	000001	平安银行	2,050,312.00	2.12
65	000938	紫光股份	2,049,208.00	2.12
66	002594	比亚迪	2,035,620.30	2.11
67	601899	紫金矿业	2,026,157.00	2.10
68	603077	和邦生物	1,996,872.00	2.07
69	000792	盐湖股份	1,996,605.00	2.07
70	601318	中国平安	1,991,331.00	2.06
71	000983	山西焦煤	1,980,672.00	2.05
72	601077	渝农商行	1,980,033.00	2.05
73	002736	国信证券	1,971,923.00	2.04
74	600900	长江电力	1,970,901.00	2.04
75	600030	中信证券	1,956,692.05	2.03
76	603369	今世缘	1,949,104.00	2.02

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601009	南京银行	6,191,781.00	6.41
2	601838	成都银行	6,182,008.00	6.40
3	600809	山西汾酒	6,026,463.00	6.24
4	600919	江苏银行	5,754,488.00	5.96
5	601988	中国银行	5,640,654.00	5.84
6	000568	泸州老窖	5,561,881.82	5.76
7	601998	中信银行	5,250,382.00	5.44
8	600519	贵州茅台	5,141,446.00	5.32
9	600036	招商银行	4,995,418.00	5.17
10	601169	北京银行	4,989,279.00	5.16



11	601225	陕西煤业	4,888,801.00	5.06
12	600050	中国联通	4,698,073.00	4.86
13	600089	特变电工	4,674,401.00	4.84
14	002304	洋河股份	4,476,382.00	4.63
15	002466	天齐锂业	4,431,750.00	4.59
16	601699	潞安环能	4,218,646.13	4.37
17	300059	东方财富	4,131,085.00	4.28
18	603659	璞泰来	4,108,058.00	4.25
19	600926	杭州银行	4,068,447.93	4.21
20	600438	通威股份	4,036,576.00	4.18
21	600436	片仔癀	3,976,693.85	4.12
22	600030	中信证券	3,912,347.00	4.05
23	600015	华夏银行	3,828,882.00	3.96
24	002142	宁波银行	3,825,074.40	3.96
25	600039	四川路桥	3,804,807.00	3.94
26	300316	晶盛机电	3,800,818.00	3.93
27	601166	兴业银行	3,792,558.00	3.93
28	600188	兖矿能源	3,788,950.46	3.92
29	002129	TCL 中环	3,759,677.00	3.89
30	002459	晶澳科技	3,717,752.00	3.85
31	000776	广发证券	3,708,641.00	3.84
32	600487	亨通光电	3,633,006.30	3.76
33	000596	古井贡酒	3,610,574.00	3.74
34	601288	农业银行	3,560,421.00	3.69
35	601919	中远海控	3,428,165.00	3.55
36	603198	迎驾贡酒	3,381,404.00	3.50
37	600085	同仁堂	3,290,375.00	3.41
38	002460	赣锋锂业	3,144,697.40	3.26
39	601398	工商银行	3,140,908.00	3.25
40	002709	天赐材料	3,138,039.00	3.25
41	600111	北方稀土	3,094,243.21	3.20
42	002049	紫光国微	3,074,954.00	3.18
43	002736	国信证券	3,048,413.00	3.16
44	601615	明阳智能	3,028,526.00	3.14
45	600690	海尔智家	2,957,358.00	3.06
46	002812	恩捷股份	2,948,029.00	3.05
47	600392	盛和资源	2,901,925.20	3.00
48	601211	国泰君安	2,798,794.00	2.90

49	603392	万泰生物	2,792,610.00	2.89
50	601857	中国石油	2,786,017.00	2.88
51	603369	今世缘	2,785,950.00	2.88
52	002032	苏泊尔	2,752,049.00	2.85
53	600028	中国石化	2,694,487.00	2.79
54	600900	长江电力	2,676,289.00	2.77
55	601881	中国银河	2,623,635.00	2.72
56	603456	九洲药业	2,617,064.83	2.71
57	600875	东方电气	2,558,036.00	2.65
58	603259	药明康德	2,449,649.00	2.54
59	600018	上港集团	2,413,348.00	2.50
60	601088	中国神华	2,365,274.00	2.45
61	600233	圆通速递	2,347,541.00	2.43
62	601899	紫金矿业	2,314,291.00	2.40
63	600061	国投资本	2,314,185.00	2.40
64	600673	东阳光	2,288,942.00	2.37
65	002230	科大讯飞	2,258,041.00	2.34
66	600256	广汇能源	2,257,578.00	2.34
67	600546	山煤国际	2,148,055.00	2.22
68	601898	中煤能源	2,103,485.00	2.18
69	603882	金域医学	2,103,282.60	2.18
70	300750	宁德时代	2,098,803.00	2.17
71	601818	光大银行	2,072,843.00	2.15
72	002371	北方华创	2,071,716.00	2.14
73	300363	博腾股份	2,018,713.03	2.09
74	600765	中航重机	1,996,475.00	2.07
75	000938	紫光股份	1,984,150.68	2.05
76	000001	平安银行	1,971,870.00	2.04
77	300037	新宙邦	1,956,357.60	2.03

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	464,245,444.98
卖出股票收入（成交）总额	479,573,240.51

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

## 8.10 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。

## 8.11 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。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、江苏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、2022 年 5 月 26 日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司作出行政处罚（银保监罚决字〔2022〕29 号），主要内容为：中国银行理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹的违法违规行为。中国银行保险监督管理委员会对该行处以罚款人民币 200 万元。

二、2022 年 9 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司作出行政处罚（银保监罚决字〔2022〕52 号），主要内容为农业银行理财业务存在以下违法违规行为：

1、作为托管机构，存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况；2、理财托管业务违反资产独立性原则要求，操作管理不到位。中国银行保险监督管理委员会对该行处以罚款人民币 150 万元。

三、2022 年 12 月 5 日，中国证券监督管理委员会江苏监管局对江苏银行股份有限公司采取责令改正措施的决定（〔2022〕114 号），主要内容为：1、零售业务部和网络金融部均负责基金销售业务，但未对基金销售产品实行集中统一准入管理；2、部分基金销售业务人员未取得基金从业资格；3、存在向普通投资者主动推介风险等级高于其风险承受能力的产品或服务的情况。中国证券监督管理委员会江苏监管局对该行采取责令改正的的行政监督管理措施。

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，其他七名证券发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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

本基金投资的前十名股票中，未发生超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,284,266.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,284,266.41

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
九泰盈泰量化 A	1,173	39,994.25	-	-	46,913,250.45	100.00%
九泰盈泰量化 C	616	63,001.83	-	-	38,809,126.60	100.00%
合计	1,789	47,916.37	-	-	85,722,377.05	100.00%

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	九泰盈泰量化 A	10.00	0.0000%
	九泰盈泰量化 C	190.07	0.0005%
	合计	200.07	0.0002%

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰盈泰量化 A	九泰盈泰量化 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 18 日）基金份额总额	80,930,822.63	125,612,745.25
本报告期期初基金份额总额	59,487,419.65	44,529,401.13
本报告期基金总申购份额	938,053.82	4,251,427.76
减：本报告期基金总赎回份额	13,512,223.02	9,971,702.29
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	46,913,250.45	38,809,126.60

注：赎回中包含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、本报告期内，基金管理人发生以下重要人员变更事项：

1、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；

2、经九泰基金管理有限公司第三届董事会 2022 年第二十三次会议决议通过，聘任王泳先生为公司副总经理。

以上事项公司已向监管部门备案。

二、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元。截止本报告期末，该会计师事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理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及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
天风证券	2	943,324,254.10	100.00%	471,686.77	100.00%	-

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	-	-	-	-	-	-

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

### 11.8 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
5	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
6	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
7	九泰盈泰量化股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	规定网站	2022年1月24日
8	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



9	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
10	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
11	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
12	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
13	九泰盈泰量化股票型证券投资基金 2021 年年度报告	规定网站	2022 年 3 月 31 日
14	九泰盈泰量化股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	规定网站	2022 年 4 月 22 日
15	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
16	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
17	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
18	九泰盈泰量化股票型证券投资基金招募说明书更新	规定网站	2022 年 6 月 20 日
19	九泰盈泰量化股票型证券投资基金（九泰盈泰量化 A 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2022 年 6 月 20 日
20	九泰盈泰量化股票型证券投资基金（九泰盈泰量化 C 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2022 年 6 月 20 日
21	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
22	九泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊和规定网站	2022 年 7 月 19 日
23	九泰基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2022 年 7 月 21 日
24	九泰盈泰量化股票型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	规定网站	2022 年 7 月 21 日
25	九泰基金管理有限公司旗下	规定报刊	2022 年 8 月 31 日

	基金 2022 年中期报告提示性公告		
26	九泰盈泰量化股票型证券投资基金 2022 年中期报告	规定网站	2022 年 8 月 31 日
27	九泰基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2022 年 10 月 26 日
28	九泰盈泰量化股票型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	规定网站	2022 年 10 月 26 日
29	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与销售机构申购费率优惠活动的公告	规定报刊和规定网站	2022 年 12 月 19 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 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

九泰基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日