

九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金
(LOF)
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

根据《九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定，九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金在基金合同生效后第五个年度对日即 2021 年 8 月 11 日起，本基金自动转型为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

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。

本报告中财务资料未经审计。

自 2021 年 8 月 11 日起原九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金自动转型为九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）本报告期自 2021 年 8 月 11 日（基金合同生效日）起至 2021 年 9 月 30 日止；原九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 8 月 10 日（基金合同失效前日）止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	九泰锐益混合（LOF）
场内简称	九泰锐益 LOF
基金主代码	168103
交易代码	168103
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2021 年 8 月 11 日
报告期末基金份额总额	437,778,014.86 份
投资目标	通过深入挖掘国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越各阶段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	通过深入挖掘国内经济增长和结构转型所带来的

	投资机会,精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资,力争获取超越各阶段业绩比较基准的收益,追求基金资产的长期稳定增值。主要投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债券投资策略、权证投资策略、股指期货的投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债总指数(总值)财富指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,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,低于股票型基金。
基金管理人	九泰基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

转型前:

基金简称	九泰锐益定增混合
场内简称	九泰锐益
基金主代码	168103
交易代码	168103
基金运作方式	契约型 本基金在基金合同生效后前五年内,场内份额不开放申购、赎回业务,但可上市交易;场外份额每 6 个月定期开放一次基金份额的申购、赎回业务,基金管理人可采取部分确认的方式确保申购、赎回结束后本基金的总份额基本保持不变。基金合同生效后第五个年度对日起,本基金转为上市开放式基金(LOF),并更名为九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金(LOF),接受场内、场外申购与赎回等业务,并继续上市交易。
基金合同生效日	2016 年 8 月 11 日
报告期末基金份额总额	2,243,831,957.34 份
投资目标	基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解,基金合同生效后前五年内,利用定向增发项目,深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的定向增发投资机会,精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资,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。本基金转为上市开放式基金(LOF)后,通过深入挖掘国内经济增长和结构转型所带来的投资机会,精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资,力争获取超越各阶段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	本基金在基金合同生效后前五年内,通过对宏观经

	济、资本市场的深入分析和理解，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的事件性投资机会，在行业分析轮动效应与定向增发项目优势的深入研究的基础上，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发主题相关证券进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线，形成以定向增发为核心的投资策略。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，通过深入挖掘国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越各阶段业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债总指数（总值）财富指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，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，低于股票型基金，属于中高风险收益特征的证券投资基金品种。
基金管理人	九泰基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 8 月 11 日 — 2021 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	279,041,674.76
2. 本期利润	-27,218,635.41
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0405
4. 期末基金资产净值	899,217,732.46
5. 期末基金份额净值	2.054

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

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

3、九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金转型而来，九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同于 2021 年 8 月 11 日生效，

合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年8月10日）
1. 本期已实现收益	1,576,601,177.63
2. 本期利润	10,554,667.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0047
4. 期末基金资产净值	4,705,320,910.32
5. 期末基金份额净值	2.097

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

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

3、原九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金于2021年8月11日转型，原合同失效，相关数据和指标按实际存续期计算。

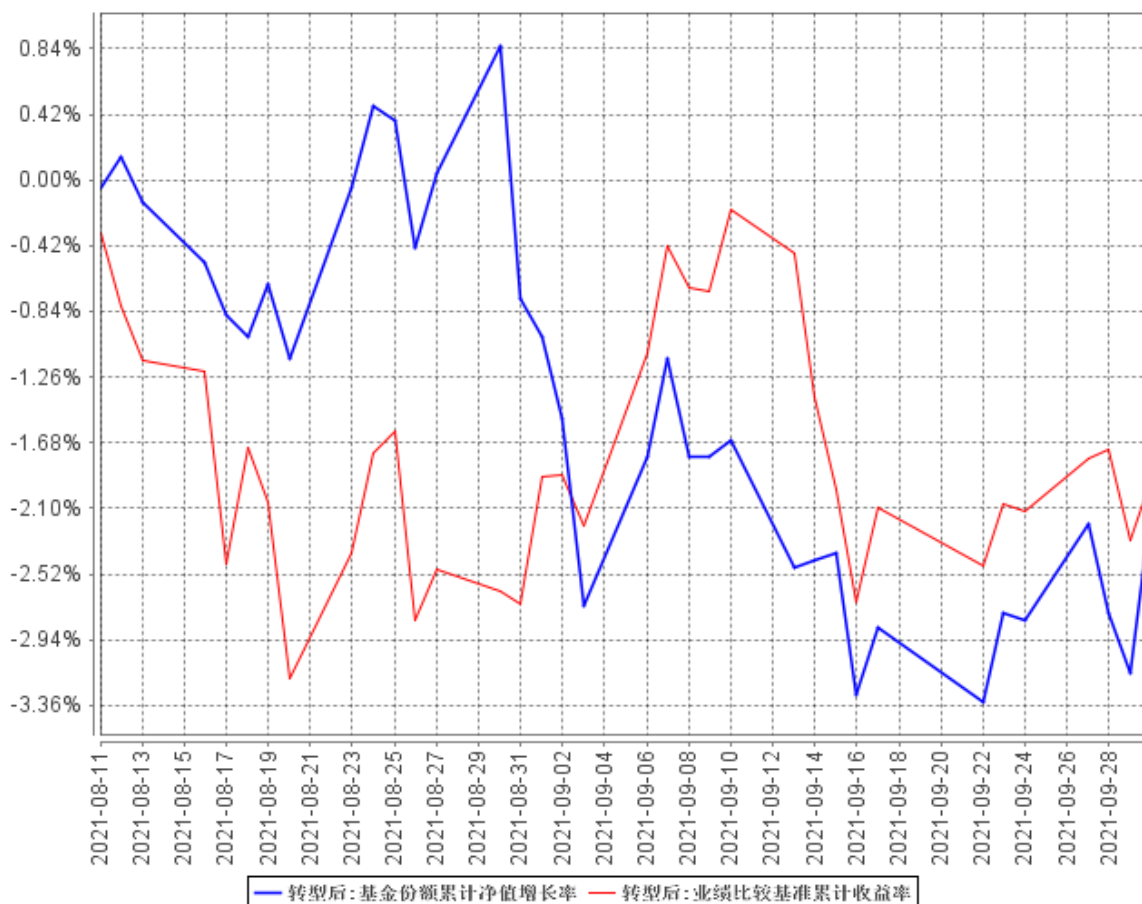
3.2 基金净值表现（转型后）

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

阶段	净值增长率①	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
2021.08.11-2021.09.30	-2.05%	0.65%	-1.90%	0.61%	-0.15%	0.04%

3.2.2 自基金转型以来基金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

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. 本基金于 2021 年 8 月 11 日转型，基金合同于 2021 年 8 月 11 日生效，截至报告期末，本基金合同生效不满一年。

2. 根据基金合同的约定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求。本基金转型而来，转型后无需重新建仓，原建仓期自 2016 年 8 月 11 日至 2017 年 2 月 11 日，距建仓期结束已满一年。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 基金净值表现（转型前）

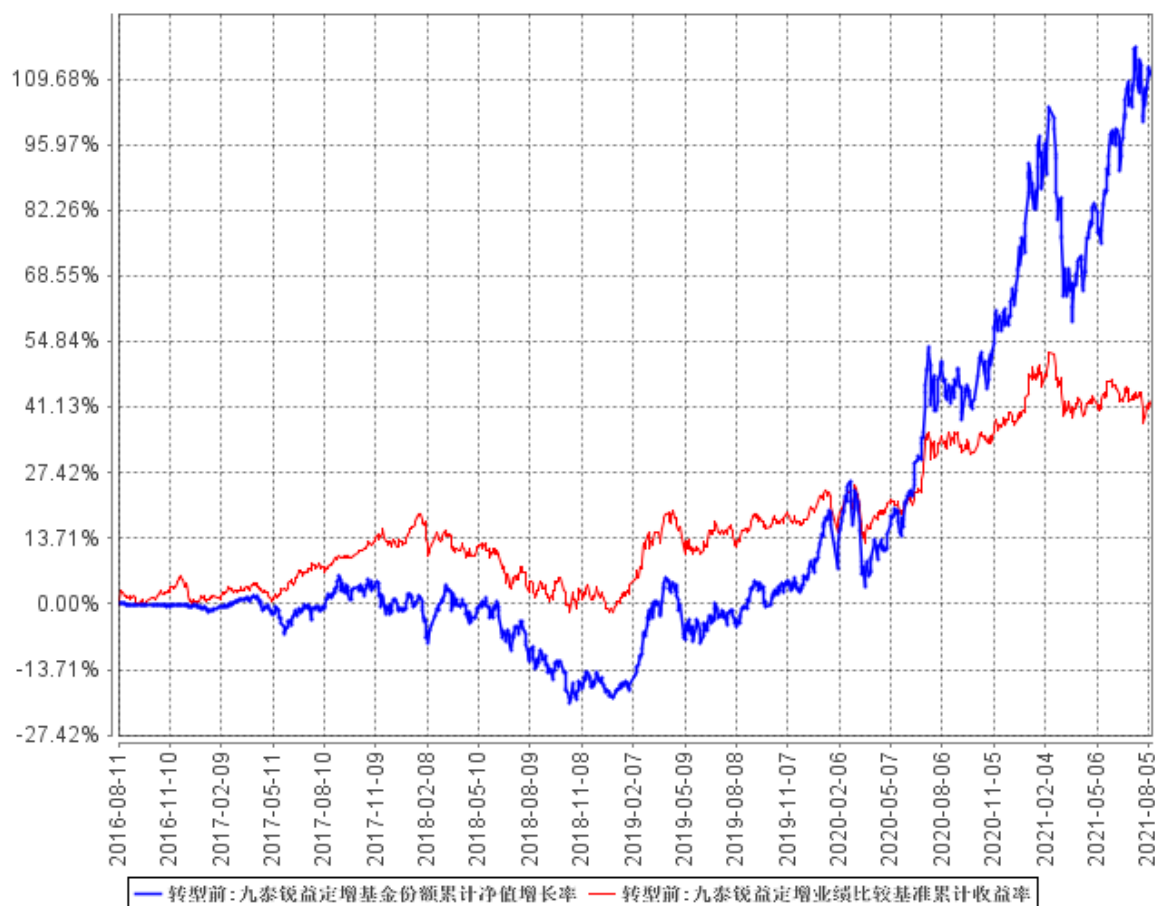
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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
2021.07.01—2021.08.10	0.24%	1.55%	-1.42%	0.85%	1.66%	0.70%
2021.04.01—2021.08.10	25.64%	1.40%	1.25%	0.68%	24.39%	0.72%
2020.10.01—2021.08.10	46.95%	1.60%	8.49%	0.75%	38.46%	0.85%

2018.10.01-2021.08.10	138.57%	1.43%	35.45%	0.81%	103.12%	0.62%
2016.10.01-2021.08.10	109.91%	1.22%	42.26%	0.71%	67.65%	0.51%
2016.08.11-2021.08.10	109.70%	1.21%	42.80%	0.71%	66.90%	0.50%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

九泰锐益定增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 2016 年 8 月 11 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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘开运	基金经理、致远权益投资部总经理兼执行投资总监	2021年8月11日	-	10	金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格，10年证券从业经验。曾任毕马威华振会计师事务所审计师，昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理、合伙人助理。2014年7月加入九泰基金管理有限公司，曾任九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金（2015年7月16日至2016年7月16日）、九泰盈华量化灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金、原九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金，2016年12月19日至2018年11月6日）的基金经理，现任致远权益投资部总经理兼执行投资总监，九泰锐智事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金，2015年8月14日至今）、九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）（原九泰锐富事件驱动混合型发起式证券

					<p>投资基金，2016 年 2 月 4 日至今)、九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金，2016 年 8 月 11 日至今)、九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，2016 年 8 月 30 日至今)、九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原九泰锐诚定增灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金，2017 年 3 月 24 日至今)、九泰科盈价值灵活配置混合型证券投资基金(2020 年 3 月 19 日至今)、九泰锐和 18 个月定期开放混合型证券投资基金(2020 年 12 月 3 日至今)、九泰锐升 18 个月封闭运作混合型证券投资基金(2021 年 1 月 20 日至今)、九泰动态策略灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 8 月 25 日至今)的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

4.1.1 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（转型后）

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘开运	基金经理、致远权益投资部总经理兼执行投资总监	2016年8月11日	2021年8月10日	10	金融学硕士，中国籍，具有基金从业资格，10年证券从业经验。曾任毕马威华振会计师事务所审计师，昆吾九鼎投资管理有限公司投资经理、合伙人助理。2014年7月加入九泰基金管理有限公司，曾任九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金（2015年7月16日至2016年7月16日）、九泰盈华量化灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金、原九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金，2016年12月19日至2018年11月6日）的基金经理，现任致远权益投资部总经理兼执行投资总监，九泰锐智事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金，2015年8月14日至今）、九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）（原九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金，2016年2月4日至今）、九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原

					九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金，2016 年 8 月 11 日至今)、九泰锐丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原九泰锐丰定增两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，2016 年 8 月 30 日至今)、九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原九泰锐诚定增灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐诚灵活配置混合型证券投资基金，2017 年 3 月 24 日至今)、九泰科盈价值灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 3 月 19 日至今)、九泰锐和 18 个月定期开放混合型证券投资基金（2020 年 12 月 3 日至今)、九泰锐升 18 个月封闭运作混合型证券投资基金（2021 年 1 月 20 日至今)、九泰动态策略灵活配置混合型证券投资基金（2021 年 8 月 25 日至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.1.1 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（转型前）

本报告期末，本基金未发生基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投

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

4.3 公平交易专项说明

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组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的季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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自成立以来，始终秉持“长期投资、价值投资”的理念展开投资运作。本基金在 8 月份顺利完成了基金转型，根据基金合同约定，转型之前将定向增发投资作为基金的核心策略，转型后，基金核心策略为通过相对均衡的行业配置，长期持有高品质且具有成长属性的公司争取获得企业成长带来的价值提升。

报告期内，本基金对部分通过定向增发持有的股份进行了减持，同时，根据基金转型后的运作策略，进一步优化了基金的持仓结构，构建了更加均衡的行业组合，基金着眼于行业长期投资价值，重点增加了对消费品、高端制造、科技等行业的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金自 2021 年 8 月 11 日转型，截至转型前最后一日，本基金份额净值为 2.097 元，份额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准收益率为-1.42%；转型后，截至本报告期末，本基金份额净值为 2.054 元，份额净值增长率为-2.05%，同期业绩比较基准收益率为-1.90%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	729,878,759.18	80.03
	其中：股票	729,878,759.18	80.03
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	165,687,604.03	18.17
8	其他资产	16,385,372.06	1.80
9	合计	911,951,735.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	5,766.30	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	625,290,169.45	69.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	26,453.25	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,398,509.67	2.05
J	金融业	41,357,413.45	4.60
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	15,600,000.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	29,146,878.64	3.24
N	水利、环境和公共设施管理业	29,459.81	0.00
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	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	729,878,759.18	81.17

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	800,389	66,016,084.72	7.34
2	603501	韦尔股份	262,925	63,788,234.25	7.09
3	300014	亿纬锂能	446,275	44,194,613.25	4.91
4	600519	贵州茅台	19,400	35,502,000.00	3.95
5	300274	阳光电源	215,900	32,035,242.00	3.56
6	300450	先导智能	447,790	31,264,697.80	3.48
7	600438	通威股份	596,900	30,406,086.00	3.38
8	300122	智飞生物	183,500	29,174,665.00	3.24
9	300760	迈瑞医疗	68,900	26,555,438.00	2.95
10	000858	五粮液	114,800	25,185,972.00	2.80

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。报告期内，本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,313,833.36
2	应收证券清算款	15,012,588.75
3	应收股利	-
4	应收利息	54,955.95
5	应收申购款	3,994.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	16,385,372.06

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	863,365,430.74	18.26
	其中：股票	863,365,430.74	18.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	3,640,000,000.00	77.00
	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	152,550,520.37	3.23
8	其他资产	71,123,036.17	1.50
9	合计	4,727,038,987.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	6,587.60	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	716,928,859.55	15.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	457.04	0.00
E	建筑业	19,654.00	0.00
F	批发和零售业	26,761.71	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,632,634.91	1.69
J	金融业	16,981,459.38	0.36
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	49,716,479.26	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	45,258.58	0.00
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	7,278.71	0.00
S	综合	-	-
	合计	863,365,430.74	18.35

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603501	韦尔股份	433,426	117,471,448.78	2.50
2	002812	恩捷股份	355,802	92,569,006.34	1.97
3	002405	四维图新	6,160,000	79,587,200.00	1.69
4	002709	天赐材料	546,144	64,444,992.00	1.37
5	603799	华友钴业	509,013	62,252,289.90	1.32
6	601012	隆基股份	557,619	48,668,986.32	1.03
7	002752	昇兴股份	9,055,876	46,818,878.92	1.00
8	300347	泰格医药	275,250	45,085,950.00	0.96
9	300450	先导智能	447,790	34,712,680.80	0.74
10	300274	阳光电源	215,900	33,347,914.00	0.71

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。报告期内，本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	360,932.97
2	应收证券清算款	69,075,921.49
3	应收股利	-
4	应收利息	621,340.27
5	应收申购款	1,064,841.44
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	71,123,036.17

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603501	韦尔股份	117,471,448.78	2.50	非公开发行, 流通受限
2	002405	四维图新	79,587,200.00	1.69	非公开发行, 流通受限
3	002752	昇兴股份	46,818,878.92	1.00	非公开发行, 流通受限

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2021年8月11日）基金份 额总额	2,243,831,957.34
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	504,185.47
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	1,806,558,127.95
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动 份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	437,778,014.86

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,243,831,962.13
报告期期间基金总申购份额	596,396.42
减：报告期期间基金总赎回份额	596,401.21
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,243,831,957.34

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20210917 至 20210930	93,037,428.18	0.00	0.00	93,037,428.18	21.25%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当持有基金份额比例较高的投资者集中赎回时，极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，进而引发基金的流动性风险。</p> <p>2、当持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、当投资者持有基金份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响。</p> <p>4、若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2021 年 8 月 11 日起，九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金按照基金合同约定自动转型为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，

接受场内、场外申购与赎回等业务，并继续上市交易。基金合同的部分内容根据转型需要、新生效的法规政策等做了修改，但不涉及投资策略的变化；相关修改主要是根据基金合同约定“本基金自基金合同生效后第五个年度对日起，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为契约型上市开放式基金（LOF）”作出，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，且基金管理人和基金托管人已协商一致，无需召开基金份额持有人大会。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金募集的文件；
- 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。

9.2 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。

9.3 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
2021 年 10 月 27 日