九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）
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遵规守信情况的说明 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 14

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15

§5 托管人报告 16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 16

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 17

6.1 资产负债表 17

6.2 利润表 18

6.3 净资产（基金净值）变动表 19

6.4 报表附注.....23
§7 投资组合报告.....49
7.1 期末基金资产组合情况.....49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....49
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.....50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....55
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.....55
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.....55
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.....55
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.....55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....56
7.12 投资组合报告附注.....56
§8 基金份额持有人信息.....58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....59
8.4 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.....59
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....59
§9 开放式基金份额变动.....60
§10 重大事件揭示.....61
10.1 基金份额持有人大会决议.....61
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.....61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....61
10.4 基金投资策略的改变.....61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....61
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.....61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....62
10.8 其他重大事件.....65

§11 影响投资者决策的其他重要信息.....67

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.....67

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....67

§12 备查文件目录.....68

12.1 备查文件目录.....68

12.2 存放地点.....68

12.3 查阅方式.....68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	九泰锐富事件驱动混合（LOF）	
场内简称	九泰锐富 LOF	
基金主代码	168102	
基金运作方式	契约型，上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 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	172,926,372.55 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2016 年 5 月 4 日	
下属分级基金的基金简称：	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	九泰锐富事件驱动混合（LOF）C
下属分级基金场内简称：	九泰锐富 LOF	-
下属分级基金的交易代码：	168102	013600
报告期末下属分级基金的份额总额	172,825,041.82 份	101,330.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	基于对宏观经济、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，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。
投资策略	本基金在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件，将事件性因素作为投资的主线，形成以事件驱动为核心的投资策略。主要投资策略包括大类资产配置策略，股票投资策略，债券投资策略，中小企业私募债投资策略，权证投资策略，股指期货的投资策略等。
业绩比较基准	1、基金合同生效后五年内（含第五年），本基金业绩比较基准为年化收益率 5.5%(单利)。 2、本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金业绩比较基准为： 沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	九泰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	陈沛	郭明
	联系电话	010-57383999	010-66105799
	电子邮箱	chenpei@jtamc.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-628-0606	95588
传真		010-57383867	010-66105798
注册地址		北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园 2 号楼 1 栋西侧一层、二层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100020	100140
法定代表人		严军	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	九泰锐富事件驱动混合（LOF）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	-19,465,559.71	-11,635.21
本期利润	-16,642,043.43	-6,086.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0599	-0.0476
本期加权平均净值利润率	-5.02%	-4.01%
本期基金份额净值增长率	-6.26%	-6.34%
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	21,471,411.42	12,326.67
期末可供分配基金份额利润	0.1242	0.1216
期末基金资产净值	194,296,453.24	113,657.40
期末基金份额净值	1.124	1.122
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	0.47%	-14.78%

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

九泰锐富事件驱动混合（LOF）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	1.35%	0.81%	0.92%	0.51%	0.43%	0.30%
过去三个月	-4.18%	0.78%	-2.35%	0.49%	-1.83%	0.29%
过去六个月	-6.26%	0.79%	0.66%	0.50%	-6.92%	0.29%
过去一年	-16.46%	0.92%	-7.00%	0.59%	-9.46%	0.33%
自基金合同	0.47%	1.31%	-14.65%	0.69%	15.12%	0.62%

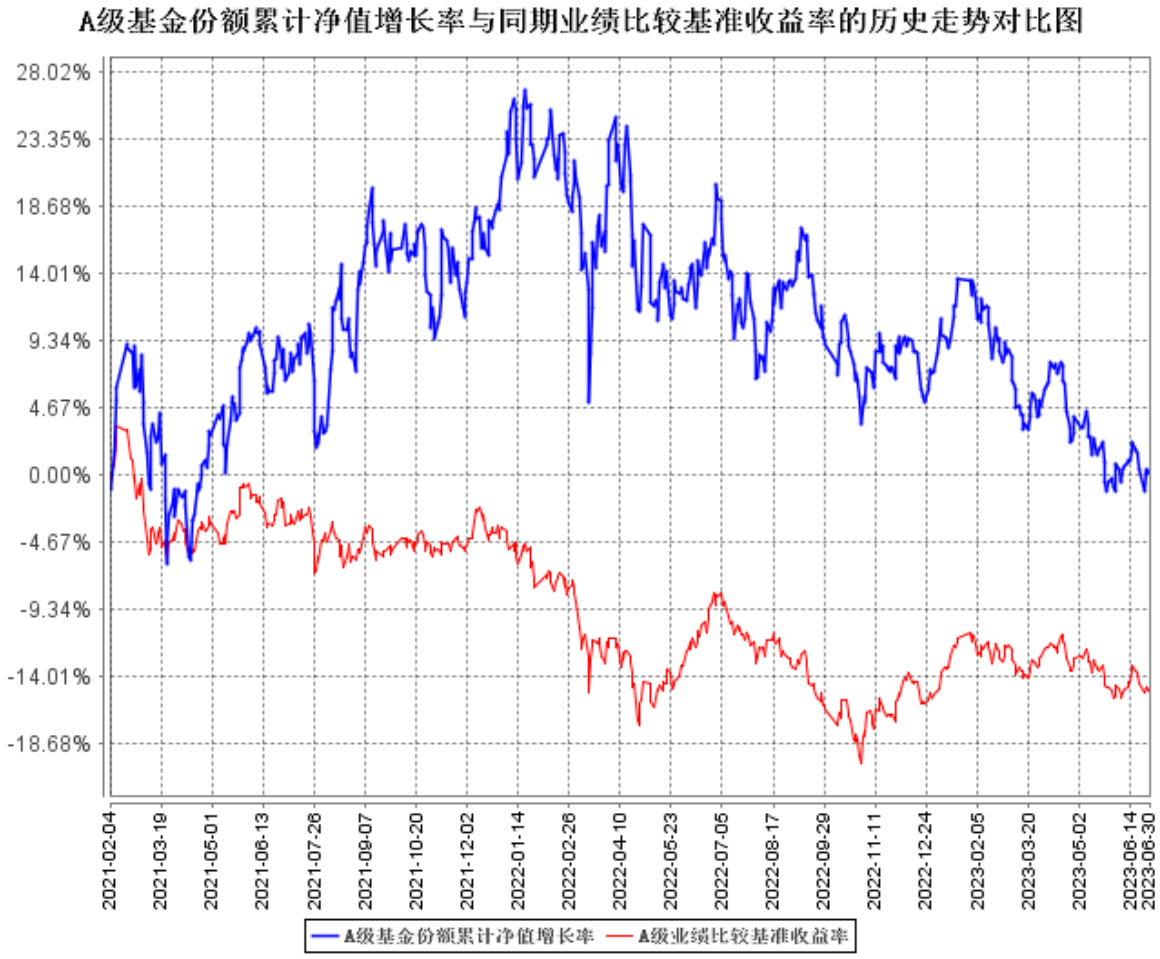
生效起至今						

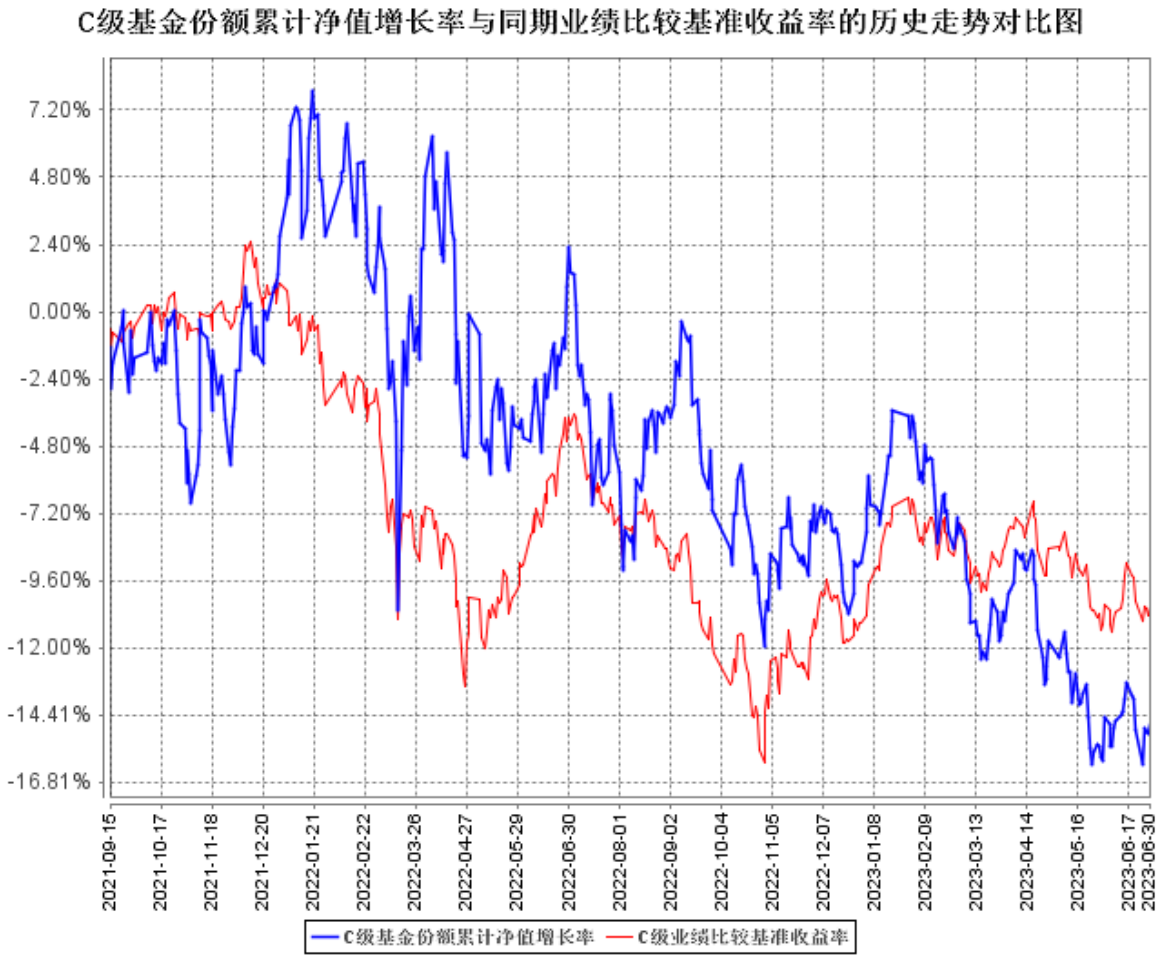
九泰锐富事件驱动混合（LOF）C

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	1.36%	0.81%	0.92%	0.51%	0.44%	0.30%
过去三个月	-4.18%	0.78%	-2.35%	0.49%	-1.83%	0.29%
过去六个月	-6.34%	0.78%	0.66%	0.50%	-7.00%	0.28%
过去一年	-16.70%	0.92%	-7.00%	0.59%	-9.70%	0.33%
自基金合同生效起至今	-14.78%	1.23%	-10.54%	0.66%	-4.24%	0.57%

注：本基金自 2021 年 9 月 15 日起新增 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。自 C 类份额增加日至本报告期末，部分期间 C 类份额为 0，C 类份额为 0 期间按照 A 类份额净值作为参考净值进行计算。

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





注：1. 本基金合同于 2021 年 2 月 4 日生效，截至报告期末，本基金合同生效已满一年。

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。本基金转型而来，转型后无需重新建仓，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. 本基金自 2021 年 9 月 15 日起新增 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。自 C 类份额增加日至本报告期末，部分期间 C 类份额为 0，C 类份额为 0 期间按照 A 类份额净值作为参考净值进行计算。

§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		
刘开运	基金经理、总裁助理、致远权益投资部总经理兼执行投资总监	2021 年 2 月 4 日	-	12	金融学硕士，12 年证券从业经历。历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，现任总裁助理、致远权益投资部总经理兼执行投资总监、基金经理，具有基金从业资格。
袁多武	基金经理、研究发展部执行总监	2022 年 8 月 17 日	-	8	复旦大学经济学硕士，8 年证券从业经历。曾任中国长江三峡集团公司国际投资部业务主管，2015 年 5 月加入九泰基金管理有限公司，历任产业投资部先进制造行业组执行投资总监、科技创新投资部高端装备行业执行总监、投资经理、战略投资部副总监，现任研究发展部执行

					总监、基金经理，具有基金从业资格。

注：

1、证券从业的含义遵从监管部门和行业协会的相关规定。

2、基金经理的“任职日期”为基金合同生效日或公司相关公告中披露的聘任日期，“离任日期”为公司相关公告中披露的解聘日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金未发生基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期，经济复苏动能呈现出前高后低的特征。今年前 3 个月经济疫后复苏动能较强，房地产和消费部门均出现较好的恢复势头；但是，进入 4 月之后经济逐步减弱，国内经济总体呈现为有效需求不足，房地产呈现出较为明显的压力，居民部门呈现出消费能力不足的现象。政策层面，货币政策维持宽松的基调，财政政策总体较为克制，地产政策也较为克制，对数字经济和供应链安全相关的政策持续不断。

A 股市场出现了倒 V 型的走势，先上后下。结构上，分化较为严重，以人工智能为代表的 TMT 板块出现明显的相对强势，主题投资氛围浓厚；以公用事业和高股息资产为代表的防御类板块出现较好的走势；与经济周期关系密切的顺周期板块表现较差。

本报告期，本基金重点配置了估值相对低位、受益于稳增长政策的金融和地产，特别是地产行业中的优质标的，一方面政策持续转暖，另一方面，行业正在经历一场“供给侧改革”，高信用的优质房企有望价值重估；本基金还重点配置了一批上游和中游制造业的龙头公司，这些公司在长期竞争中充分体现了自身的竞争优势，并且这种竞争优势可能将持续给企业创造价值，但是因为资本市场的阶段性偏好主题投资，使得这些优质公司的 PB 估值达到历史很低的分位数，因此我们布局了这些龙头制造业企业；本基金还配置了估值相对较低且具有长期成长潜力的智能汽车、医药等股票。本基金阶段性的参与了人工智能和国防军工的投资机会，目前已经获利了结。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末九泰锐富事件驱动混合（LOF）A 基金份额净值为 1.124 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.26%；截至本报告期末九泰锐富事件驱动混合（LOF）C 基金份额净值为 1.122 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.34%；同期业绩比较基准收益率为 0.66%。

注：本基金自 2021 年 9 月 15 日起新增 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。自 C 类份额增加日至本报告期末，部分期间 C 类份额为 0，C 类份额为 0 期间按照 A 类份额净值作为参考净值进行计算。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

值得注意的是，在二季度末，经济基本面在发生细微且重要的变化，同时，TMT 行情也在产业基本面发生重要变化的背景下出现势能消退的特征。随着市场的调整和风格的演绎，目前市场上出现了一大批便宜且优质的公司，这为未来创造了很好的获取复合收益率的条件。

随着政策的持续发力和经济周期本身的力量，经济可能呈现出弱复苏且持续震荡的特征。有效需求不足的现实问题摆在面前，走出困局不仅依赖经济周期本身的力量，更依赖于国家智慧。保持耐心，寻找又好又便宜的公司进行投资，是未来两年创造好的复合收益率的正道。

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。

4.7 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：九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）

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	33,372,417.70	100,299,229.51
结算备付金		540,367.79	3,474,337.44
存出保证金		101,093.03	90,958.21
交易性金融资产	6.4.7.2	145,716,308.24	397,419,648.18
其中：股票投资		145,716,308.24	395,674,730.45
基金投资		-	-
债券投资		-	1,744,917.73
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-3,106.84	-
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		15,750,095.30	1,352,351.01
应收股利		-	-
应收申购款		3,516.24	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		195,480,691.46	502,636,524.35
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		113,320.77	691,855.39

应付赎回款		181,492.11	8,018.48
应付管理人报酬		240,890.35	680,730.49
应付托管费		40,148.39	113,455.08
应付销售服务费		18.51	53.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	71,526,662.41
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	494,710.69	675,110.82
负债合计		1,070,580.82	73,695,886.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	172,926,372.55	357,634,717.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	21,483,738.09	71,305,920.27
净资产合计		194,410,110.64	428,940,637.98
负债和净资产总计		195,480,691.46	502,636,524.35

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，九泰锐富事件驱动混合（LOF）A 基金份额净值 1.124 元，基金份额总额 172,825,041.82 份；九泰锐富事件驱动混合（LOF）C 基金份额净值 1.122 元，基金份额总额 101,330.73 份。九泰锐富事件驱动混合（LOF）份额总额合计为 172,926,372.55 份。

6.2 利润表

会计主体：九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）

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		-13,652,374.98	-17,294,775.56
1.利息收入		219,740.29	173,380.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	79,356.39	166,524.81
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		140,383.90	6,855.83
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,135,504.21	8,420,682.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-19,123,317.19	6,338,467.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-12,998.04	-
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	2,000,811.02	2,082,215.27
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	2,829,065.18	-26,596,371.12
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	434,323.76	707,532.47
减：二、营业总支出		2,995,754.76	4,333,623.18
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,495,070.98	3,587,544.87
2．托管费	6.4.10.2.2	415,845.17	597,924.02
3．销售服务费	6.4.10.2.3	153.05	63,416.73
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	84,685.56	84,737.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,648,129.74	-21,628,398.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,648,129.74	-21,628,398.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-16,648,129.74	-21,628,398.74

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）

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）	357,634,717.71	-	71,305,920.27	428,940,637.98
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）	357,634,717.71	-	71,305,920.27	428,940,637.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-184,708,345.16	-	-49,822,182.18	-234,530,527.34
（一）、综合收益总额	-	-	-16,648,129.74	-16,648,129.74
（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）	-184,708,345.16	-	-33,174,052.44	-217,882,397.60
其中：1.基金申购款	16,267,253.84	-	3,196,761.52	19,464,015.36
2.基金赎回款	-200,975,599.00	-	-36,370,813.96	-237,346,412.96
（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）	172,926,372.55	-	21,483,738.09	194,410,110.64
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）	263,906,351.82	-	183,896,433.89	447,802,785.71
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）	263,906,351.82	-	183,896,433.89	447,802,785.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-20,512,191.14	-	-15,665,085.96	-36,177,277.10
（一）、综合	-	-	-21,628,398.74	-21,628,398.74

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）	-20,512,191.14	-	5,963,312.78	-14,548,878.36
其中：1.基金申购款	212,417,654.79	-	152,830,968.59	365,248,623.38
2.基金赎回款	-232,929,845.93	-	-146,867,655.81	-379,797,501.74
（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）	243,394,160.68	-	168,231,347.93	411,625,508.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

严军	荣静	荣静
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”)是由九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(以下简称“九泰锐富事件驱动混合”)转型而来。九泰锐富事件驱动混合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[2015]第 1134 号文《关于准予九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册，由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》等有关规定和《九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起，于 2016 年 1 月 13 日至 2016 年 1 月 29 日向社会公开募集。九泰锐富事件驱动混合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 625,902,475.80 元，在募集期间产生的利息为人民币 110,676.54 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 626,013,152.34 元，折合 626,013,152.34 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。经向中国证监会备案后，基金合同于 2016 年 2 月 4 日生效。九泰锐富事件驱动混合的基金管理人为九泰基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金基金合同》及《九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金招募说明书》的相关约定，九泰锐富事件驱动混合封闭期届满日为 2021 年 2 月 3 日。自 2021 年 2 月 4 日起，九泰锐富事件驱动混合将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“九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)”，场外基金简称变更为“九泰锐富事件驱动混合(LOF)”。

根据《九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)增加 C 类基金份额并修改基金合同及其他法律文件的公告》，本基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定自 2021 年 9 月 15 日起对本基金增设 C 类基金份额，同时对本基金的基金合同及其他法律文件作相应修改。本基金的原有基金份额全部转为 A 类基金份额。

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，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 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)

基金合同》及《九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)的投资范围为国内依法发行上市交易的股票(包括创业板、中小板股票及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，权证，股指期货，货币市场工具，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)。九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

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	33,372,417.70

等于：本金	33,369,549.84
加：应计利息	2,867.86
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：	33,372,417.70

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		154,278,493.57	-	145,716,308.24	-8,562,185.33
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	154,278,493.57	-	145,716,308.24	-8,562,185.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-3,106.84	-
银行间市场	-	-
合计	-3,106.84	-

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买断式逆回购交易中取得的债券。

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	21.00
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	410,387.13
其中：交易所市场	410,387.13
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	494,710.69

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

九泰锐富事件驱动混合（LOF）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	357,418,585.71	357,418,585.71
本期申购	16,198,849.96	16,198,849.96
本期赎回(以"-"号填列)	-200,792,393.85	-200,792,393.85
- 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	172,825,041.82	172,825,041.82

金额单位：人民币元

九泰锐富事件驱动混合（LOF）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	216,132.00	216,132.00
本期申购	68,403.88	68,403.88
本期赎回(以"-"号填列)	-183,205.15	-183,205.15
- 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	101,330.73	101,330.73

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

九泰锐富事件驱动混合（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	135,895,212.99	-64,632,073.94	71,263,139.05
本期利润	-19,465,559.71	2,823,516.28	-16,642,043.43
本期基金份额交易产生的变动数	-67,199,568.53	34,049,884.33	-33,149,684.20
其中：基金申购款	6,137,375.21	-2,951,716.60	3,185,658.61
基金赎回款	-73,336,943.74	37,001,600.93	-36,335,342.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,230,084.75	-27,758,673.33	21,471,411.42

单位：人民币元

九泰锐富事件驱动混合（LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	58,184.92	-15,403.70	42,781.22
本期利润	-11,635.21	5,548.90	-6,086.31
本期基金份额交易产生的变动数	-29,047.52	4,679.28	-24,368.24
其中：基金申购款	16,769.68	-5,666.77	11,102.91
基金赎回款	-45,817.20	10,346.05	-35,471.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,502.19	-5,175.52	12,326.67

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	64,971.69
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	13,434.58
其他	950.12
合计	79,356.39

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	596,934,663.26
减：卖出股票成本总额	614,590,261.38
减：交易费用	1,467,719.07
买卖股票差价收入	-19,123,317.19

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	2,162.96
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-15,161.00
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	-12,998.04

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	1,744,819.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,730,240.00

减：应计利息总额	29,740.69
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-15,161.00

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	2,000,811.02
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	2,000,811.02

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	2,829,065.18
——股票投资	2,816,165.18
——债券投资	12,900.00
——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	2,829,065.18

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	434,323.76
合计	434,323.76

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	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	383.00
合计	84,685.56

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

截至本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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

6.4.10 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。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	2,495,070.98	3,587,544.87

其中：支付销售机构的客户维护费	500,746.97	519,079.19

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%/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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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 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
当期发生的基金应支付的托管费	415,845.17	597,924.02

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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

	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	九泰锐富事件驱动混合（LOF）C	合计
九泰基金管理有限公司	-	2.93	2.93
合计	-	2.93	2.93
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		
	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	九泰锐富事件驱动混合（LOF）C	合计
九泰基金管理有限公司	-	39,887.03	39,887.03
合计	-	39,887.03	39,887.03

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 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 0.2%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.2%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，并由基金管理人代为支付给 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。

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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	九泰锐富事件驱动混合（LOF）C
基金合同生效日（ 2021 年 2 月 4 日 ）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	九泰锐富事件驱动混合（LOF）C
基金合同生效日（ 2021 年 2 月 4 日 ）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,601,161.13	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,601,161.13	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.5300%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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	33,372,417.70	64,971.69	91,043,520.85	138,966.35

注：本基金的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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月以内	新股流通受限	57.66	57.66	1,358	78,302.28	78,302.28	-

			（含）							
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月以内（含）	新股流通受限	26.68	26.68	2,641	70,461.88	70,461.88	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月以内（含）	新股流通受限	55.00	55.00	1,078	59,290.00	59,290.00	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月以内（含）	新股流通受限	25.82	25.82	1,943	50,168.26	50,168.26	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	2,061	40,931.46	37,221.66	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	603	14,333.31	25,862.67	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	386	9,109.60	24,962.62	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	196	15,052.80	21,158.20	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股流通受限	26.80	22.32	746	19,992.80	16,650.72	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	116	17,676.08	15,772.52	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	490	15,846.60	15,611.40	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	386	13,953.90	14,718.18	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	43.99	51.57	281	12,361.19	14,491.17	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	849	9,423.90	14,466.96	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	447	22,350.00	13,727.37	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	58.32	45.36	302	17,612.64	13,698.72	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,114	13,479.40	13,445.98	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	357	14,276.43	13,105.47	-
001287	中电	2023 年 3	6 个月	新股流通	11.88	21.02	600	7,128.00	12,612.00	-

	港	月 30 日		受限						
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	506	10,712.02	11,891.00	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	75.00	90.76	131	9,825.00	11,889.56	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	340	9,064.40	10,710.00	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	86	14,242.48	10,501.46	-
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	502	12,675.50	9,884.38	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	582	11,634.18	9,835.80	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	330	12,500.40	9,731.70	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	183	5,909.07	9,354.96	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,233	8,113.14	9,346.14	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	20.92	19.16	476	9,957.92	9,120.16	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	75	10,185.00	9,030.75	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	38.13	31.03	244	9,303.72	7,571.32	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	46.16	35.72	209	9,647.44	7,465.48	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	140	6,113.80	7,427.00	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	308	6,732.88	7,345.80	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	241	8,191.59	7,107.09	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通受限	35.66	33.26	213	7,595.58	7,084.38	-

301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	146	10,723.70	6,809.44	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	259	6,386.94	5,830.09	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	57.88	49.17	117	6,771.96	5,752.89	-
688429	C 时创	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	224	4,300.80	5,718.72	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	95	6,887.50	5,549.90	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	219	6,626.94	5,547.27	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	136	7,244.72	5,467.20	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	165	7,004.25	5,440.05	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	131	5,116.86	5,156.16	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	428	4,434.08	5,067.52	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	378	4,407.48	4,634.28	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	52	6,545.76	4,513.08	-
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，通过摇号抽签方式抽取公募产品、社保基金、养老金、企业年金基

金、保险资金和合格境外机构投资者资金中 10%的账户，中签账户的基金管理人承诺中签账户获配股份锁定，持有期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则(2021 年修订)》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型发起式证券投资基金，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、权证、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公司发行的证券不得超过该证券的

10%，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

综上所述，本基金在本报告期内流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。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	33,372,417.70	-	-	-	-	-	33,372,417.70
结算备付金	540,367.79	-	-	-	-	-	540,367.79
存出保证金	101,093.03	-	-	-	-	-	101,093.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	145,716,308.24	145,716,308.24
买入返售金融资产	-3,106.84	-	-	-	-	-	-3,106.84

应收清算款	-	-	-	-	-	15,750,095.30	15,750,095.30
应收申购款	-	-	-	-	-	3,516.24	3,516.24
资产总计	34,010,771.68	-	-	-	-	161,469,919.78	195,480,691.46
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	113,320.77	113,320.77
应付赎回款	-	-	-	-	-	181,492.11	181,492.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	240,890.35	240,890.35
应付托管费	-	-	-	-	-	40,148.39	40,148.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	18.51	18.51
其他负债	-	-	-	-	-	494,710.69	494,710.69
负债总计	-	-	-	-	-	1,070,580.82	1,070,580.82
利率敏感度缺口	34,010,771.68	-	-	-	-	160,399,338.96	194,410,110.64
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	100,299,229.51	-	-	-	-	-	100,299,229.51
结算备付金	3,474,337.44	-	-	-	-	-	3,474,337.44
存出保证金	90,958.21	-	-	-	-	-	90,958.21
交易性金融资产	-	-	1,744,917.73	-	-	395,674,730.45	397,419,648.18
应收清算款	-	-	-	-	-	1,352,351.01	1,352,351.01
资产总计	103,864,525.16	-	1,744,917.73	-	-	397,027,081.46	502,636,524.35
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	691,855.39	691,855.39
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,018.48	8,018.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	680,730.49	680,730.49
应付托管费	-	-	-	-	-	113,455.08	113,455.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	53.70	53.70
应付利润	-	-	-	-	-	71,526,662.41	71,526,662.41
其他负债	-	-	-	-	-	675,110.82	675,110.82
负债总计	-	-	-	-	-	73,695,886.37	73,695,886.37
利率敏感度缺口	103,864,525.16	-	1,744,917.73	-	-	323,331,195.09	428,940,637.98

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	-	2,531.61
	市场利率上升 25 个基点	-	-2,524.29

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	145,716,308.24	74.95	395,674,730.45	92.24
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	1,744,917.73	0.41

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	145,716,308.24	74.95	397,419,648.18	92.65

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%	6,791,128.19	15,570,530.91
	沪深 300 指数下跌 5%	-6,791,128.19	-15,570,530.91

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	144,876,432.44	392,268,700.49
第二层次	258,222.42	3,872,974.21
第三层次	581,653.38	1,277,973.48
合计	145,716,308.24	397,419,648.18

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

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。

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	145,716,308.24	74.54
	其中：股票	145,716,308.24	74.54
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	-3,106.84	-
	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	33,912,785.49	17.35
8	其他各项资产	15,854,704.57	8.11
9	合计	195,480,691.46	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	2,936,000.00	1.51
B	采矿业	8,947,200.00	4.60
C	制造业	72,003,059.37	37.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,784,034.28	5.55
F	批发和零售业	27,788.23	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	6,172,000.00	3.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,015,213.81	1.55
J	金融业	17,036,892.80	8.76
K	房地产业	17,998,235.37	9.26
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	1,883,884.38	0.97
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	4,912,000.00	2.53
S	综合	-	-
	合计	145,716,308.24	74.95

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本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	600048	保利发展	900,015	11,727,195.45	6.03
2	601939	建设银行	1,000,000	6,260,000.00	3.22
3	603885	吉祥航空	400,000	6,172,000.00	3.17
4	600938	中国海油	280,000	5,073,600.00	2.61
5	601318	中国平安	100,002	4,640,092.80	2.39
6	002011	盾安环境	300,000	4,149,000.00	2.13
7	002508	老板电器	160,000	4,046,400.00	2.08
8	000002	万科 A	280,014	3,925,796.28	2.02
9	600887	伊利股份	130,000	3,681,600.00	1.89
10	300291	百纳千成	500,000	3,520,000.00	1.81
11	601390	中国中铁	460,000	3,486,800.00	1.79
12	002840	华统股份	200,000	3,128,000.00	1.61
13	300498	温氏股份	160,000	2,936,000.00	1.51
14	601668	中国建筑	500,000	2,870,000.00	1.48
15	002385	大北农	430,000	2,838,000.00	1.46
16	603456	九洲药业	100,000	2,738,000.00	1.41
17	601117	中国化学	320,000	2,649,600.00	1.36
18	600036	招商银行	80,000	2,620,800.00	1.35
19	600019	宝钢股份	450,000	2,529,000.00	1.30
20	002353	杰瑞股份	96,131	2,415,772.03	1.24
21	001979	招商蛇口	179,988	2,345,243.64	1.21
22	603833	欧派家居	24,000	2,299,200.00	1.18

23	000100	TCL 科技	550,000	2,167,000.00	1.11
24	688066	航天宏图	35,000	2,131,500.00	1.10
25	600176	中国巨石	150,000	2,124,000.00	1.09
26	300101	振芯科技	100,000	1,939,000.00	1.00
27	002078	太阳纸业	179,996	1,924,157.24	0.99
28	002935	天奥电子	95,000	1,879,100.00	0.97
29	603588	高能环境	200,000	1,874,000.00	0.96
30	000338	潍柴动力	150,000	1,869,000.00	0.96
31	300628	亿联网络	53,000	1,858,710.00	0.96
32	601838	成都银行	150,000	1,831,500.00	0.94
33	601186	中国铁建	180,000	1,773,000.00	0.91
34	603337	杰克股份	90,000	1,713,600.00	0.88
35	000001	平安银行	150,000	1,684,500.00	0.87
36	600309	万华化学	19,000	1,668,960.00	0.86
37	600031	三一重工	100,000	1,663,000.00	0.86
38	300193	佳士科技	200,000	1,528,000.00	0.79
39	000951	中国重汽	90,000	1,516,500.00	0.78
40	600989	宝丰能源	120,000	1,513,200.00	0.78
41	002100	天康生物	180,000	1,485,000.00	0.76
42	002155	湖南黄金	120,000	1,464,000.00	0.75
43	600486	扬农化工	16,000	1,398,720.00	0.72
44	601098	中南传媒	120,000	1,392,000.00	0.72
45	301018	申菱环境	35,000	1,259,650.00	0.65
46	300443	金雷股份	35,000	1,240,750.00	0.64
47	600489	中金黄金	120,000	1,239,600.00	0.64
48	000975	银泰黄金	100,000	1,170,000.00	0.60
49	300679	电连技术	35,000	1,156,750.00	0.60
50	000733	振华科技	12,000	1,150,200.00	0.59
51	603187	海容冷链	56,000	1,119,440.00	0.58
52	000933	神火股份	80,000	1,040,000.00	0.53
53	300408	三环集团	35,000	1,027,250.00	0.53
54	002327	富安娜	120,000	1,010,400.00	0.52
55	002884	凌霄泵业	65,000	991,250.00	0.51
56	688428	诺诚健华	80,000	924,000.00	0.48
57	000807	云铝股份	70,000	891,100.00	0.46
58	688235	百济神州	8,000	872,880.00	0.45
59	688192	迪哲医药	25,000	867,500.00	0.45
60	688302	海创药业	16,000	849,920.00	0.44
61	301095	广立微	10,000	826,500.00	0.43

62	603848	好太太	50,000	800,000.00	0.41
63	002291	遥望科技	60,000	786,000.00	0.40
64	688331	荣昌生物	13,000	724,750.00	0.37
65	001269	欧晶科技	6,500	477,945.00	0.25
66	301486	致尚科技	1,358	78,302.28	0.04
67	301395	仁信新材	2,641	70,461.88	0.04
68	688603	天承科技	1,078	59,290.00	0.03
69	301202	朗威股份	1,943	50,168.26	0.03
70	688249	晶合集成	2,061	37,221.66	0.02
71	301358	湖南裕能	603	25,862.67	0.01
72	688361	中科飞测	386	24,962.62	0.01
73	301325	曼恩斯特	196	21,158.20	0.01
74	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.01
75	301303	真兰仪表	746	16,650.72	0.01
76	688562	航天软件	726	16,197.06	0.01
77	688531	日联科技	116	15,772.52	0.01
78	301307	美利信	490	15,611.40	0.01
79	688146	中船特气	386	14,718.18	0.01
80	301399	英特科技	281	14,491.17	0.01
81	688472	阿特斯	849	14,466.96	0.01
82	301246	宏源药业	447	13,727.37	0.01
83	301387	光大同创	302	13,698.72	0.01
84	688352	颀中科技	1,114	13,445.98	0.01
85	688484	南芯科技	357	13,105.47	0.01
86	001287	中电港	600	12,612.00	0.01
87	688552	航天南湖	506	11,891.00	0.01
88	688458	美芯晟	131	11,889.56	0.01
89	688433	华曙高科	340	10,710.00	0.01
90	688507	索辰科技	86	10,501.46	0.01
91	301305	朗坤环境	502	9,884.38	0.01
92	301439	泓淋电力	582	9,835.80	0.01
93	688443	智翔金泰	330	9,731.70	0.01
94	301315	威士顿	183	9,354.96	0.00
95	601061	中信金属	1,233	9,346.14	0.00
96	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
97	688512	慧智微	476	9,120.16	0.00
98	688576	西山科技	75	9,030.75	0.00
99	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
100	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00

101	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
102	301291	明阳电气	244	7,571.32	0.00
103	301383	天键股份	209	7,465.48	0.00
104	688543	国科军工	140	7,427.00	0.00
105	688523	航天环宇	308	7,345.80	0.00
106	688479	友车科技	241	7,107.09	0.00
107	301225	恒勃股份	213	7,084.38	0.00
108	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
109	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
110	301345	涛涛车业	146	6,809.44	0.00
111	301376	致欧科技	259	5,830.09	0.00
112	301210	金杨股份	117	5,752.89	0.00
113	688429	C 时创	224	5,718.72	0.00
114	301232	飞沃科技	95	5,549.90	0.00
115	688570	天玛智控	219	5,547.27	0.00
116	301397	溯联股份	136	5,467.20	0.00
117	300804	广康生化	165	5,440.05	0.00
118	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
119	301323	新莱福	131	5,156.16	0.00
120	601065	江盐集团	428	5,067.52	0.00
121	601133	柏诚股份	378	4,634.28	0.00
122	688623	双元科技	52	4,513.08	0.00
123	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
124	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601111	中国国航	15,766,895.00	3.68
2	600029	南方航空	11,152,000.00	2.60
3	000776	广发证券	11,074,321.00	2.58
4	002142	宁波银行	10,923,403.00	2.55
5	600887	伊利股份	9,628,339.00	2.24
6	300841	康华生物	6,812,081.50	1.59
7	600109	国金证券	6,466,710.00	1.51

8	603885	吉祥航空	6,204,469.00	1.45
9	000100	TCL 科技	5,568,500.00	1.30
10	301018	申菱环境	5,344,591.00	1.25
11	600938	中国海油	5,163,801.00	1.20
12	688008	澜起科技	4,835,878.07	1.13
13	601390	中国中铁	4,685,939.00	1.09
14	000783	长江证券	4,437,564.00	1.03
15	600926	杭州银行	4,225,500.00	0.99
16	600489	中金黄金	3,962,532.00	0.92
17	001979	招商蛇口	3,956,979.80	0.92
18	002508	老板电器	3,861,877.00	0.90
19	002665	首航高科	3,853,418.00	0.90
20	002245	蔚蓝锂芯	3,774,113.00	0.88

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	002049	紫光国微	37,498,495.20	8.74
2	000733	振华科技	25,095,180.00	5.85
3	600048	保利发展	22,169,956.00	5.17
4	601111	中国国航	21,130,406.00	4.93
5	000002	万科 A	18,413,407.00	4.29
6	600029	南方航空	17,531,312.00	4.09
7	001979	招商蛇口	17,032,966.52	3.97
8	000776	广发证券	16,383,060.00	3.82
9	600536	中国软件	16,344,907.70	3.81
10	300059	东方财富	15,899,843.62	3.71
11	601318	中国平安	15,156,166.00	3.53
12	002353	杰瑞股份	14,536,491.89	3.39
13	601668	中国建筑	11,350,000.00	2.65
14	601021	春秋航空	11,120,995.80	2.59
15	002142	宁波银行	9,979,476.00	2.33
16	300496	中科创达	9,672,443.20	2.25
17	600036	招商银行	9,302,910.00	2.17
18	603259	药明康德	9,024,666.56	2.10

19	601838	成都银行	7,568,261.00	1.76
20	601058	赛轮轮胎	7,542,538.00	1.76

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	361,815,673.99
卖出股票收入（成交）总额	596,934,663.26

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设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：

2023 年 2 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会对中国建设银行股份有限公司作出行政处罚（银保监罚决字〔2023〕10 号），主要内容为：1、公司治理和内部控制制度与监管规定不符；2、监管发现问题屡查屡犯或未充分整改；3、向检查组提供企业出具的虚假证明材料；4、未按规定及时报送案件信息；5、违规发放房地产贷款；6、贷款审查严重不尽职，违规办理虚假按揭贷款；7、违规发放固定资产贷款；8、违规为地方政府融资平台提供融资，后期以流动资金贷款承接前期融资；9、信用卡资金违规流入证券公司；10、违反产业政策为“两高一剩”企业提供融资；11、小微企业统计数据与事实不符，企业划型不准确，将大中型企业纳入小微企业统计；12、小微快贷业务违反审慎经营规则；13、违规收取民营企业、小微企业费用；14、违规借贷搭售理财产品；15、精准扶贫小额贷款资金违规归集使用；16、向关系人发放信用贷款；17、违规发放贷款掩盖风险；18、违规变相突破单一法人客户授信额度限制；19、搭桥贷款业务不合规；20、流动资金贷款管理违反审慎经营规则；21、固定资产贷款管理违反审慎经营规则；22、并购贷款管理违反审慎经营规则；23、个人贷款管理严重违反审慎经营规则；24、理财业务风险隔离不符合监管规定；25、理财业务投资运作不合规；26、违规通过理财业务实现不良资产虚假出表；27、违规虚增资本；28、面向一般个人客户销售的理财产品资金流向不符合规定，违规投资权益类资产；29、理财产品信息登记不及时，部分产品未登记底层资产；30、理财业务统计数据与事实不符；31、理财资金投资非标准化债权资产的余额超过监管比例要求；32、同业投资业务管理违反审慎经营规则；33、债券投资业务未准确计量风险，个别债券风险加权资产计提比例低于监管要求；34、串用银行承兑汇票保证金掩盖信用风险；35、贴现资金违规回流出票人；36、违规向委托贷款借款人收取手续费；37、对信用卡业务异常交易行为监控不力导致频繁套现；38、银行集团并表统一授信管理流于形式。中国银行保险监督管理委员会对该行没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元。其中，总行 7341.5626 万元，分支机构 12550 万元。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，其他九名证券发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报

告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，未发生超出基金合同规定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	101,093.03
2	应收清算款	15,750,095.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,516.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,854,704.57

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
九泰锐富事件驱动混合(LOF)A	4,126	41,886.83	96,398,827.49	55.78%	76,426,214.33	44.22%
九泰锐富事件驱动混合(LOF)C	74	1,369.33	-	-	101,330.73	100.00%
合计	4,200	41,172.95	96,398,827.49	55.75%	76,527,545.06	44.25%

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 期末上市基金前十名持有人

九泰锐富事件驱动混合（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	孙悦	874,800.00	4.28%
2	高德荣	811,700.00	3.97%
3	吴嫣	503,853.00	2.47%
4	李朝林	500,000.00	2.45%
5	叶公健	473,500.00	2.32%
6	张靖东	450,000.00	2.20%
7	冯小强	429,900.00	2.10%
8	吴文德	414,500.00	2.03%
9	丁元欣	400,000.00	1.96%
10	谢平	400,000.00	1.96%

注：1、本基金仅 A 类份额上市交易，以上数据为 A 类份额数据；

2、本表格所示持有人，均为 A 类份额场内持有人。

8.3 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	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	246,837.62	0.1428%
	九泰锐富事件驱动混合（LOF）C	13.33	0.0132%
	合计	246,850.95	0.1427%

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。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	10~50
	九泰锐富事件驱动混合（LOF）C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	0
	九泰锐富事件驱动混合（LOF）C	0
	合计	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	0.00	0.00	0.00	0.00	不低于 3 年
基金管理人高级管理人员	214,887.31	0.12	150,049.50	0.09	不低于 3 年
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	不低于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	214,887.31	0.12	150,049.50	0.09	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰锐富事件驱动混合（LOF）A	九泰锐富事件驱动混合（LOF）C
基金合同生效日（2021 年 2 月 4 日）基金份额总额	626,013,153.84	-
本报告期期初基金份额总额	357,418,585.71	216,132.00
本报告期基金总申购份额	16,198,849.96	68,403.88
减:本报告期基金总赎回份额	200,792,393.85	183,205.15
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	172,825,041.82	101,330.73

§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

为本基金提供审计的会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变更。

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	
申万宏源证券	2	299,505,078.96	31.46%	219,029.62	27.57%	-
首创证券	2	161,733,741.94	16.99%	118,269.93	14.89%	-
长江证券	1	155,300,455.32	16.31%	144,635.78	18.21%	-
开源证券	2	96,860,724.76	10.17%	90,206.05	11.36%	-
平安证券	2	84,531,080.07	8.88%	78,725.63	9.91%	-
国海证券	2	51,948,366.93	5.46%	48,379.47	6.09%	-
太平洋证券	2	36,521,928.18	3.84%	34,013.03	4.28%	-
海通证券	1	35,453,996.91	3.72%	33,017.77	4.16%	-
兴业证券	1	17,456,696.75	1.83%	16,257.58	2.05%	-
中信证券	1	12,730,562.00	1.34%	11,855.52	1.49%	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

中信建投证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

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

（1）券商经纪人经营行为规范、风险管理健全，在业内有较好的声誉；

（2）具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（3）券商经纪人具有较强的研究支持能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告。

2、本公司租用券商交易单元的程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单经公募基金业务投资决策委员会审批，同意后与被选择的证券经营机构签订相关协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订协议时，要明确签定协议双方的公司名称、协议有效期、佣金率、双方的权利义务等。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

（1）本基金报告期内新增租用交易单元情况：新增租用平安证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；山西证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个。

（2）本基金报告期内停止租用交易单元情况：停止租用东兴证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个；财信证券股份有限公司深圳交易单元 1 个；九州证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个。

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
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	345,000,000.00	34.12%	-	-
长江证券	1,715,079.00	100.00%	165,000,000.00	16.32%	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	125,000,000.00	12.36%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	273,000,000.00	27.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	103,000,000.00	10.19%	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	九泰基金 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	九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）恢复申购、定期定额投资业务的公告	规定报刊和规定网站	2023 年 1 月 5 日
3	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
4	九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)2022 年第 4 季度报告	规定网站	2023 年 1 月 20 日
5	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
6	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
7	九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)2022 年年度报告	规定网站	2023 年 3 月 31 日
8	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
9	九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金(LOF)2023	规定网站	2023 年 4 月 21 日

	年第 1 季度报告		
10	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
11	九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）招募说明书更新	规定网站	2023 年 6 月 29 日
12	九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）（九泰锐富事件驱动混合（LOF）A 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2023 年 6 月 29 日
13	九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金（LOF）（九泰锐富事件驱动混合（LOF）C 份额）基金产品资料概要（更新）	规定网站	2023 年 6 月 29 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
产品	1	20230101至20230504	132,889,701.00	0.00	132,889,701.00	0.00	0.00%
	2	20230103至20230630	68,184,607.98	11,373,579.32	0.00	79,558,187.30	46.01%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当持有基金份额比例较高的投资者集中赎回时，极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，进而引发基金的流动性风险。 2、当持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。 3、当投资者持有基金份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响。 4、若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：上表中序号 2 产品投资者的申购份额 11,373,579.32 份为红利再投资份额。

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