

九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金
(LOF)
2026 年中期报告

2026 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2026 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在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 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 净资产变动表	19

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 盈利投资者数量占比.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54

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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）	
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	
基金运作方式	契约型，上市开放式（LOF）	
基金合同生效日	2021 年 8 月 11 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	
报告期末基金份额总额	67,273,928.88 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 11 月 23 日	
下属分级基金的基金简称：	九泰锐益混合（LOF）A	九泰锐益混合（LOF）C
下属分级基金场内简称：	九泰锐益 LOF	—
下属分级基金的交易代码：	168103	016398
报告期末下属分级基金的份额总额	67,257,157.78 份	16,771.10 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郑立昌	滕菲菲
	联系电话	010-87940900	4006800000
	电子邮箱	zhenglichang@jtamc.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-618-5501	95558
传真		010-87940910	010-85230024
注册地址		北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-211 室	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	100012	100020
法定代表人	徐进	方合英

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.jtamc.com
基金中期报告置备地点	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
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

§ 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	九泰锐益混合（LOF）A	九泰锐益混合（LOF）C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日)	报告期(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,229,671.19	961.39
本期利润	-2,972,984.17	-753.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0404	-0.0429
本期加权平均净值利润率	-2.82%	-3.01%
本期基金份额净值增长率	-2.97%	-3.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	27,249,502.76	6,668.10
期末可供分配基金份额利润	0.4052	0.3976
期末基金资产净值	94,506,660.54	23,439.20
期末基金份额净值	1.405	1.398
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-33.00%	-21.37%

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

九泰锐益混合（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
过去三个月	0.57%	1.23%	7.59%	0.76%	-7.02%	0.47%
过去六个月	-2.97%	1.12%	5.47%	0.68%	-8.44%	0.44%
过去一年	22.71%	1.14%	16.12%	0.61%	6.59%	0.53%
过去三年	2.18%	1.56%	24.03%	0.66%	-21.85%	0.90%
自基金合同生效起至今	-33.00%	1.52%	9.42%	0.66%	-42.42%	0.86%

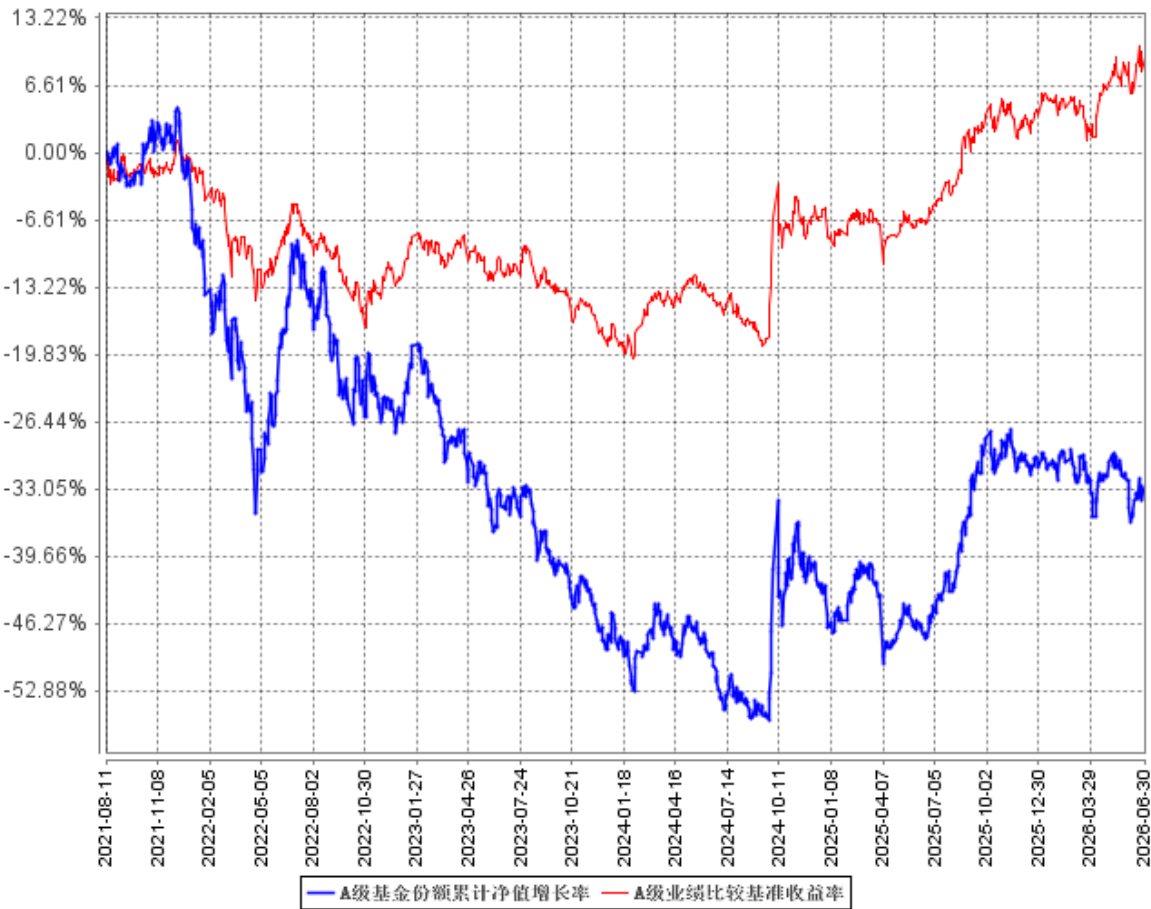
九泰锐益混合（LOF）C

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
过去三个月	0.58%	1.21%	7.59%	0.76%	-7.01%	0.45%
过去六个月	-3.05%	1.11%	5.47%	0.68%	-8.52%	0.43%
过去一年	22.63%	1.14%	16.12%	0.61%	6.51%	0.53%
过去三年	1.75%	1.56%	24.03%	0.66%	-22.28%	0.90%
自基金合同生效起至今	-21.37%	1.51%	21.09%	0.64%	-42.46%	0.87%

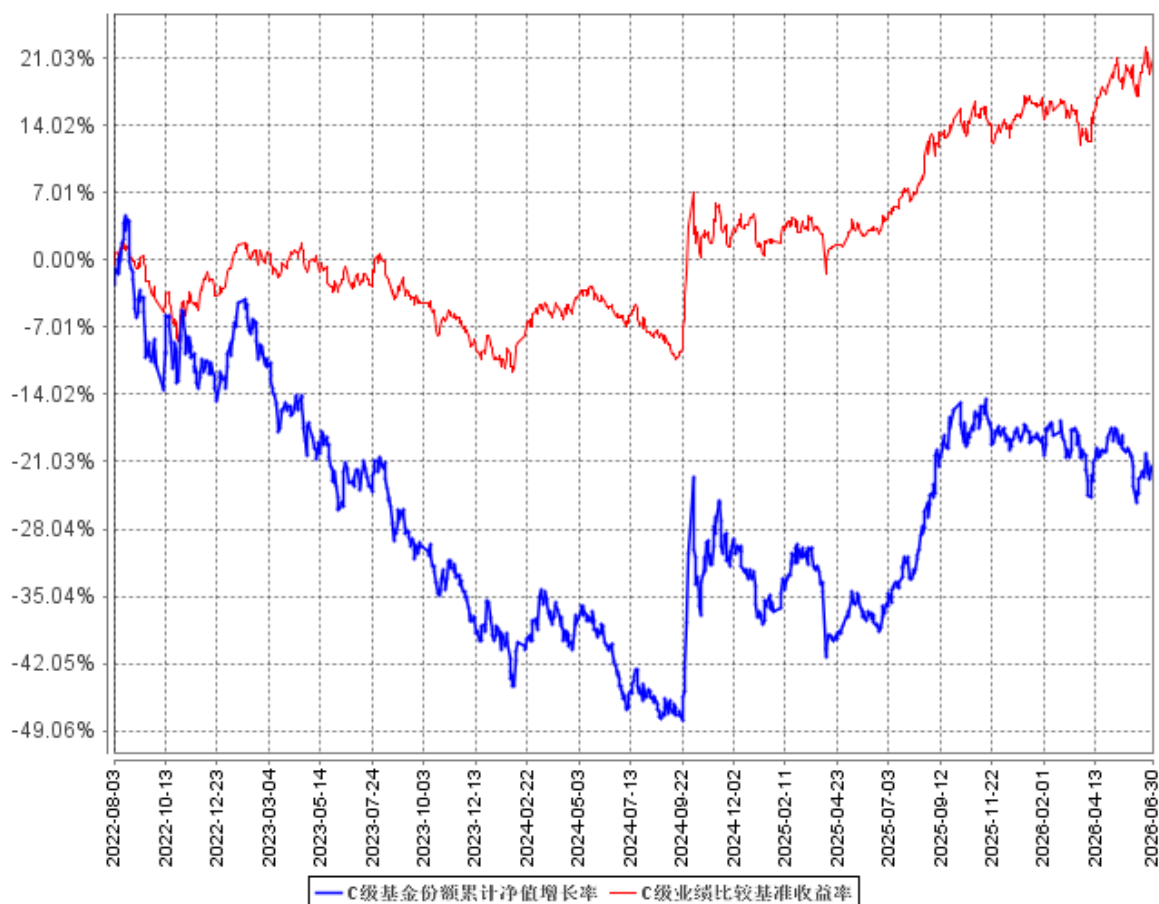
注：本基金自 2022 年 8 月 3 日起新增 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。自 C 类份额增加日至本报告期末，部分期间 C 类份额为 0，C 类份额为 0 期间按照 A 类份额净值作为参考净值进行计算。

3.2.2 自基金转型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 2022 年 8 月 3 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。

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、副总经理、首席投资官、兼任权益投资部总监	2021 年 8 月 11 日	—	15	金融学硕士，15 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，现任副总经理、首席投资官、兼任权益投资部总监、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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及基金合同、

招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

（一）基金投资策略

1、本基金在报告期内继续精选多行业高性价比标的进行投资。

2、坚持价值投资，以“低价买入看得明白的好公司”作为主要投资策略。所谓“好公司”指的是具有可持续竞争优势的公司，可持续竞争优势在财务指标上通常体现为在较长时间内有较高的资本回报率。所谓“看得明白”指的是公司未来的盈利能力与成长性具有相对较高的可预测性。所谓“低价”，指的是结合公司可持续竞争优势的分析，对影响企业内在价值的关键要素包括较长周期的 ROE、净利润率、市场占有率、行业成长空间等进行深入研究，同时利用 AI 辅助研究，通过 DCF 模型对股票进行估值，并根据公司不同的质地等级设定不同的买入折价率。

3、适度集中持股策略：原则上前十大股票持仓占比不低于股票资产的 70%。

4、我们希望通过长期持有股票获取收益。当然，在有其他更具性价比的投资机会时，我们也会适当调仓。总体而言，预期基金的换手率会比较低。

5、我们倾向于较高仓位持有股票，当然，在市场整体估值水平过高以及我们持有的股票市价明显高于合理估值且没有找到新的低估标的时，我们将降低股票仓位。

6、公司投研团队秉持统一的投资理念，在研究上重点聚焦对公司可持续竞争优势、增长前景和估值的分析。基金经理与研究员均深度参与研究。公司内部建立了完善的研究讨论与分享机制。

（二）重要的买入与卖出

- 1、基于以上投资策略，本基金在报告期内继续持有原重仓股票，没有重点买入的股票。
- 2、本基金在报告期内，没有重点卖出的股票。
- 3、在本报告期末，本基金前十大股票持仓占基金股票资产的比重为 87%左右。

（三）“好基金+好买点”的基金投资理念

我们认为基金投资要获取较好的投资收益，需要具备“好基金+好买点”两个条件。

1、所谓“好基金”，指的是具有明确、具体、可行的投资策略，并通过重要的交易执行和一定时间长度的投资业绩验证了其相关投资策略的基金。我们努力将本基金打造成这样的基金。

2、所谓“好买点”指的是基金投资的时点选择也非常重要。我们认为好买点取决于两个因素，一是基金对标的指数的估值水平（指数当前 PE 估值相对于历史中位数的情况），二是基金投资组合相对其内在价值的估值水平。当前（7 月 6 日）沪深 300 PE(TTM)为 14.3，过去十年中位数为 12.7，指数估值仍处于合理估值区间（正向偏离 13%，指数 PE 历史中位数上下 15%以内为指数的合理估值区间）。同时，基金组合的估值相对其内在价值低估幅度为 16%。我们认为当前本基金仍处于中长期配置的不错时点。（组合低估幅度为内部测算结果，仅供中长期投资参考。）

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 1.405 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.97%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.398 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.05%；同期业绩比较基准收益率为 5.47%。

注：本基金自 2022 年 8 月 3 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

（一）宏观经济展望

基于（1）中国拥有 14 亿多人口和 4 亿多中等收入群体，同时积极构建全国统一大市场，内需潜力巨大；（2）中国目前人均 GDP 不足美国人均 GDP 的六分之一，拥有巨大的增长空间；（3）中国正在从“人口红利”向“人才红利”转变，高素质的劳动者和企业家为中国经济发展注入了新动力，推动产业升级和竞争力提升，我们对中国经济长期增长前景充满信心。

（二）证券市场展望

当前市场代表性指数沪深 300 PE(TTM)为 14.3，过去十年中位数为 12.7，指数估值仍处于合

理估值区间（正向偏离 13%，指数 PE 历史中位数上下 15% 以内为指数的合理估值区间），当前仍是进行中长期权益资产配置的良好时机。

（三）行业走势展望

消费、制造、出海是未来较长时期内值得持续重视的三条主线。（1）消费方面，居民收入提升、消费分层与品牌升级并行，优质企业有望依托品牌、渠道、产品力和供应链能力持续扩大份额，服务消费、新型消费及高性价比消费均孕育长期机会。（2）制造方面，中国在产业配套、工程师红利、成本控制和规模化生产上仍具显著优势，高端制造、设备升级、进口替代及技术创新推动下，具备核心技术、全球竞争力和稳定现金流的制造企业有望长期受益。（3）出海方面，中国企业正由产品输出走向品牌、渠道、供应链和能力输出，全球市场空间远大于国内，具备成本优势、产品创新、品牌建设和本地化运营能力的企业，有望在更广阔市场中实现持续成长。

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合规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，九泰基金管理有限公司在九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，九泰基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日： 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	8,705,882.45	19,229,295.74
结算备付金		-	-
存出保证金		2,713.48	23,129.36
交易性金融资产	6.4.7.2	85,340,944.13	98,987,072.57
其中：股票投资		85,340,944.13	98,987,072.57
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		1,714,692.21	358,755.47
应收股利		-	-
应收申购款		734.50	1,523.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		95,764,966.77	118,599,776.31
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		-	-

应付赎回款		1,052,501.15	863,220.94
应付管理人报酬		93,394.01	121,903.40
应付托管费		15,565.71	20,317.23
应付销售服务费		3.63	8.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	73,402.53	161,161.32
负债合计		1,234,867.03	1,166,611.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	67,273,928.88	81,087,712.61
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	27,256,170.86	36,345,452.50
净资产合计		94,530,099.74	117,433,165.11
负债和净资产总计		95,764,966.77	118,599,776.31

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，九泰锐益混合（LOF）A 基金份额净值 1.405 元，基金份额总额 67,257,157.78 份；九泰锐益混合（LOF）C 基金份额净值 1.398 元，基金份额总额 16,771.10 份。九泰锐益混合（LOF）份额总额合计为 67,273,928.88 份。

6.2 利润表

会计主体：九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,169,376.57	-2,302,945.63
1.利息收入		39,548.48	16,100.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	39,548.48	16,100.88
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,934,743.20	-26,754,727.50
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,960,899.75	-27,944,367.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	32,887.92
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	973,843.45	1,156,752.22
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	-7,204,370.01	24,396,722.69
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	60,701.76	38,958.30
减：二、营业总支出		804,360.86	903,026.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	629,907.69	714,126.10
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	104,984.65	119,020.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	24.66	296.45
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	69,443.86	69,583.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,973,737.43	-3,205,972.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,973,737.43	-3,205,972.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,973,737.43	-3,205,972.50

6.3 净资产变动表

会计主体：九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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	81,087,712.61	-	36,345,452.50	117,433,165.11

净资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	81,087,712.61	-	36,345,452.50	117,433,165.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,813,783.73	-	-9,089,281.64	-22,903,065.37
（一）、综合收益总额	-	-	-2,973,737.43	-2,973,737.43
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-13,813,783.73	-	-6,115,544.21	-19,929,327.94
其中：1.基金申购款	157,361.11	-	69,054.48	226,415.59
2.基金赎回款	-13,971,144.84	-	-6,184,598.69	-20,155,743.53
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减	-	-	-	-

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	67,273,928.88	-	27,256,170.86	94,530,099.74
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	109,109,344.33	-	19,232,883.05	128,342,227.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	109,109,344.33	-	19,232,883.05	128,342,227.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,796,575.91	-	-4,860,851.62	-14,657,427.53
(一)、综合收益总额	-	-	-3,205,972.50	-3,205,972.50
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-9,796,575.91	-	-1,654,879.12	-11,451,455.03

（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	158,144.62	-	24,438.36	182,582.98
2.基金赎回款	-9,954,720.53	-	-1,679,317.48	-11,634,038.01
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	99,312,768.42	-	14,372,031.43	113,684,799.85

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：

徐进

基金管理人负责人

谢海波

主管会计工作负责人

钟亮

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）是由九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“九泰锐益定增混合”)转型而来。九泰锐益定增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[2016] 第 1271 号文《关于准予九泰锐益定增灵活配置混合型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《九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起,于 2016 年 7 月 11 日至 2016 年 8 月 5 日向社会公开募集。九泰锐益定增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 2,243,454,063.76 元,在募集期间产生的利息为人民币 377,899.27 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 2,243,831,963.03 元,折合 2,243,831,963.03 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 8 月 11 日生效。九泰锐益定增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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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》及《九泰锐益定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关约定,自 2021 年 8 月 11 日起,九泰锐益定增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,场外基金简称变更为“九泰锐益混合(LOF)”。

根据《关于九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金(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信银行股份有限公司协商一致,决定自 2022 年 8 月 3 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》、《九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》及《九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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交易的股票(包括创业板、中小板股票及其他中国证监会核准发行的股票)、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)。本基金的业绩比较基准是:沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+中债总指数(总值)财富指数收益率 $\times$ 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”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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》、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[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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金（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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

(3)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，暂不征收企业所得税；

(4)对基金取得的股票股息红利所得，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。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税；

(6)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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	8,705,882.45
等于：本金	8,704,329.93
加：应计利息	1,552.52
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	8,705,882.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		78,694,638.39	-	85,340,944.13	6,646,305.74
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	78,694,638.39	-	85,340,944.13	6,646,305.74

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17.28
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,960.89
其中：交易所市场	3,960.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费用	9,916.99
合计	73,402.53

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

九泰锐益混合（LOF）A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	81,073,979.69	81,073,979.69
本期申购	136,474.64	136,474.64
本期赎回(以“-”号填列)	-13,953,296.55	-13,953,296.55
－ 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	67,257,157.78	67,257,157.78

金额单位：人民币元

九泰锐益混合（LOF）C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,732.92	13,732.92
本期申购	20,886.47	20,886.47
本期赎回(以“-”号填列)	-17,848.29	-17,848.29
－ 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	16,771.10	16,771.10

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

九泰锐益混合（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	95,474,305.18	-59,134,923.02	36,339,382.16
加：会计政策变更	—	—	—

（若有）			
前期差错更正	-	-	-
（若有）			
其他（若有）	-	-	-
本期期初	95,474,305.18	-59,134,923.02	36,339,382.16
本期利润	4,229,671.19	-7,202,655.36	-2,972,984.17
本期基金份额交易产生的变动数	-16,430,887.66	10,313,992.43	-6,116,895.23
其中：基金申购款	161,612.21	-101,602.27	60,009.94
基金赎回款	-16,592,499.87	10,415,594.70	-6,176,905.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,273,088.71	-56,023,585.95	27,249,502.76

单位：人民币元

九泰锐益混合（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	7,650.10	-1,579.76	6,070.34
加：会计政策变更	-	-	-
（若有）			
前期差错更正	-	-	-
（若有）			
其他（若有）	-	-	-
本期期初	7,650.10	-1,579.76	6,070.34
本期利润	961.39	-1,714.65	-753.26
本期基金份额交易产生的变动数	1,713.72	-362.70	1,351.02
其中：基金申购款	11,757.91	-2,713.37	9,044.54
基金赎回款	-10,044.19	2,350.67	-7,693.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,325.21	-3,657.11	6,668.10

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	39,526.33

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	-
其他	22.15
合计	39,548.48

注：其他包括结算保证金利息收入。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,422,185.14
减：卖出股票成本总额	6,450,550.43
减：交易费用	10,734.96
买卖股票差价收入	3,960,899.75

6.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	973,843.45
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	973,843.45

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,204,370.01
——股票投资	-7,204,370.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-7,204,370.01

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	60,701.76
合计	60,701.76

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	19.50
合计	69,443.86

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、关联关系

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
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华源证券股份有限公司	基金管理人的股东、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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	629,907.69	714,126.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	98,383.85	109,880.15
应支付基金管理人的净管理费	531,523.84	604,245.95

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 1.20\%/ \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	104,984.65	119,020.96

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.20\%/ \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	九泰锐益混合（LOF）A	九泰锐益混合（LOF）C	合计
九泰基金管理有限公司	-	0.27	0.27
合计	-	0.27	0.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	九 泰 锐 益 混 合 (LOF)A	九泰锐益混合 (LOF)C	合 计
九泰基金管理有限公司	-	0.30	0.30
合计	-	0.30	0.30

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.20\%/ \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起 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 个工作日或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
中信银行股份有限公司	8,705,882.45	39,526.33	424,967.37	16,074.20

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中信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（2026 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
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	103	2,258.79	8,011.34	-
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	32	896.00	888.96	-

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《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》，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。

3、截至本报告期末 2026 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

本基金在日常经营活动中面临的風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。本基金的基金管理人從事風險管理的主要目標是在嚴格控制投資風險的前提下，力爭為投資者獲取超越業績比較基準的投資回報。

本基金的基金管理人建立了董事會及風險控制委員會、總經理、風險管理委員會、督察長、監察稽核部、風險管理部以及相關業務部門構成的風險管理架構體系。董事會負責審定重大風險管理戰略、風險政策和風險控制制度。董事會下設風險控制委員會，風險控制委員會負責對公司經營管理與資產組合運作的風險控制及合法合規性進行審議、監督和檢查；總經理負責公司日常經營管理中的風險控制工作。總經理下設風險管理委員會，負責審議公司風險管理和控制政策、程序的制定、風險限額的設定等，重點是公司的合規控制和投資的風險控制；在業務操作層面的風險控制職責主要由監察稽核部和風險管理部具體負責和督促協調，並與各部門合作完成公司及基金運作風險控制以及進行投資風險分析與績效評估。

本基金的基金管理人對於金融工具的風險管理方法主要是通過定性分析和定量分析的方法去估測各種風險產生的可能損失。從定性分析的角度出發，判斷風險損失的嚴重程度和出現同類風險損失的頻度。而從定量分析的角度出發，根據本基金的投資目標，結合基金資產所運用金融工具特徵通過特定的風險量化指標、模型，日常的量化報告，確定風險損失的限度和相應置信程度，及時可靠地對各種風險進行監督、檢查和評估，並通過相應決策，將風險控制在可承受的範圍內。

6.4.13.2 信用風險

信用風險是指基金在交易過程中因交易對手未履行合約責任，或者基金所投資證券之發行人

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

综上所述，本基金在本报告期内流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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							
货币资金	8,705,882.45	-	-	-	-	-	8,705,882.45
存出保证金	2,713.48	-	-	-	-	-	2,713.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-85,340,944.13	85,340,944.13
应收清算款	-	-	-	-	-	1,714,692.21	1,714,692.21
应收申购款	-	-	-	-	-	734.50	734.50
资产总计	8,708,595.93	-	-	-	-	-87,056,370.84	95,764,966.77
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,052,501.15	1,052,501.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	93,394.01	93,394.01
应付托管费	-	-	-	-	-	15,565.71	15,565.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3.63	3.63
其他负债	-	-	-	-	-	73,402.53	73,402.53
负债总计	-	-	-	-	-	1,234,867.03	1,234,867.03
利率敏感度缺口	8,708,595.93	-	-	-	-	-85,821,503.81	94,530,099.74
上年度末 2025 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							
货币资金	19,229,295.74	-	-	-	-	-	19,229,295.74
存出保证金	23,129.36	-	-	-	-	-	23,129.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-98,987,072.57	98,987,072.57
应收清算款	-	-	-	-	-	358,755.47	358,755.47
应收申购款	-	-	-	-	-	1,523.17	1,523.17
资产总计	19,252,425.10	-	-	-	-	-99,347,351.21	118,599,776.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	863,220.94	863,220.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	121,903.40	121,903.40
应付托管费	-	-	-	-	-	20,317.23	20,317.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8.31	8.31

其他负债	-	-	-	-	-	161,161.32	161,161.32
负债总计	-	-	-	-	-	1,166,611.20	1,166,611.20
利率敏感度缺口	19,252,425.10	-	-	-	-	-98,180,740.01	117,433,165.11

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	85,340,944.13	90.28	98,987,072.57	84.29
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	85,340,944.13	90.28	98,987,072.57	84.29

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（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1、沪深 300 指数上涨 5%	3,699,908.01	4,871,132.19
	2、沪深 300 指数下跌 5%	-3,699,908.01	-4,871,132.19

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	85,332,043.83	98,927,910.38
第二层次	-	-
第三层次	8,900.30	59,162.19
合计	85,340,944.13	98,987,072.57

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	85,340,944.13	89.11
	其中：股票	85,340,944.13	89.11
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	8,705,882.45	9.09
8	其他各项资产	1,718,140.19	1.79
9	合计	95,764,966.77	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	78,038,655.47	82.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	888.96	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,295,211.00	7.72
J	金融业	—	—
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	6,188.70	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	85,340,944.13	90.28

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	300750	宁德时代	22,280	8,756,262.80	9.26
2	002415	海康威视	253,900	8,683,380.00	9.19
3	002371	北方华创	9,485	8,390,051.60	8.88
4	300014	亿纬锂能	115,275	7,496,333.25	7.93
5	600519	贵州茅台	6,200	7,350,038.00	7.78
6	600941	中国移动	84,700	7,295,211.00	7.72
7	300274	阳光电源	44,220	7,031,864.40	7.44
8	600690	海尔智家	320,200	6,535,282.00	6.91
9	002601	龙佰集团	393,600	6,486,528.00	6.86
10	600585	海螺水泥	346,700	5,876,565.00	6.22
11	300866	安克创新	47,482	4,961,869.00	5.25
12	002043	兔宝宝	364,400	4,037,552.00	4.27
13	600438	通威股份	199,400	2,414,734.00	2.55
14	301687	新广益	103	8,011.34	0.01
15	301667	纳百川	101	7,304.32	0.01
16	301449	天溯计量	105	4,063.50	0.00
17	001369	双欣材料	213	2,879.76	0.00
18	001396	誉帆科技	60	2,125.20	0.00
19	001220	世盟股份	32	888.96	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	001220	世盟股份	8,792.00	0.01

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	002371	北方华创	8,099,294.00	6.90
2	600941	中国移动	1,058,357.00	0.90
3	002415	海康威视	912,230.00	0.78
4	600519	贵州茅台	290,295.00	0.25
5	301638	南网数字	15,118.32	0.01
6	001220	世盟股份	14,762.00	0.01
7	301563	云汉芯城	14,364.14	0.01
8	301491	汉桑科技	5,996.54	0.01
9	301668	昊创瑞通	5,896.99	0.01
10	301575	艾芬达	4,146.24	0.00
11	001285	瑞立科密	1,724.91	0.00

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	8,792.00
卖出股票收入（成交）总额	10,422,185.14

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约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约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	2,713.48
2	应收清算款	1,714,692.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	734.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,718,140.19

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 益混合 (LOF)A	2,733	24,609.28	1,721,214.32	2.56%	65,535,943.46	97.44%
九泰锐 益混合 (LOF)C	41	409.05	—	—	16,771.10	100.00%
合计	2,774	24,251.60	1,721,214.32	2.56%	65,552,714.56	97.44%

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 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比	96.24%

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	九泰锐益 混合 (LOF)A	121,526.20	0.1807%
	九泰锐益 混合 (LOF)C	—	—
	合计	121,526.20	0.1806%

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	九泰锐益混合(LOF)A	10~50

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	九泰锐益混合(LOF)C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	九泰锐益混合(LOF)A	10~50
	九泰锐益混合(LOF)C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	九泰锐益混合 (LOF)A	九泰锐益混合 (LOF)C
基金合同生效日（2021 年 8 月 11 日）基金份额总额	2,243,831,957.34	-
本报告期期初基金份额总额	81,073,979.69	13,732.92
本报告期基金总申购份额	136,474.64	20,886.47
减：本报告期基金总赎回份额	13,953,296.55	17,848.29
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	67,257,157.78	16,771.10

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
二、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：
1、2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。
2、2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内无涉及管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内无涉及管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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		股票交易	应支付该券商的佣金	
------	--	------	-----------	--

	交易单元 数量	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	备注
华西证券	2	10,422,185.14	100.00%	4,855.63	100.00%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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

- （1）券商经纪人经营行为规范、风险管理健全，在业内有较好的声誉；
- （2）具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- （3）券商经纪人具有较强的研究支持能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告。

2、本公司租用券商交易单元的程序

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

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

10.7.2 基金租用或者通过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
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注：本报告期内本基金未发生租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	九泰基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提	规定报刊	2026 年 1 月 22 日

	示性公告		
2	九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2025 年第四季度报告	规定网站	2026 年 1 月 22 日
3	九泰基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	规定网站	2026 年 3 月 31 日
4	九泰基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 3 月 31 日
5	九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	规定网站	2026 年 3 月 31 日
6	九泰基金管理有限公司因系统维护暂停相关服务的公告	规定网站	2026 年 4 月 1 日
7	九泰基金管理有限公司关于恢复网上交易平台相关功能的公告	规定报刊和规定网站	2026 年 4 月 2 日
8	关于九泰基金管理有限公司旗下公募基金在直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	规定报刊和规定网站	2026 年 4 月 2 日
9	九泰基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 4 月 22 日
10	九泰锐益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2026 年第一季度报告	规定网站	2026 年 4 月 22 日
11	2025 年度九泰基金管理有限公司以股东身份参与股东大会投票信息披露	规定网站	2026 年 4 月 30 日
12	九泰基金管理有限公司因系统维护暂停相关服务的公告	规定网站	2026 年 5 月 13 日
13	九泰基金管理有限公司关于警惕不法分子冒用本公司名义进行非法活动的重要提示	规定报刊和规定网站	2026 年 5 月 21 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	2026 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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有的基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。

2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。

§ 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

2026 年 8 月 31 日