

九泰盈丰量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2020年12月17日

送出日期：2020年12月18日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	九泰盈丰量化混合	基金代码	007849
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
基金合同生效日	-	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	张鹏程	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2010-07-01

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资者可阅读《招募说明书（更新）》“基金的投资”章节了解详细情况

投资目标	本基金主要采用量化投资策略指导构建投资组合，强调投资纪律，力争在控制风险的前提下实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；同业存单占基金资产的比例不高于20%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
主要投资策略	本基金主要采用量化投资策略指导构建投资组合，强调投资纪律，力争在控制风险的前提下实现基金资产的长期稳健增值。本基金的股票投资组合比例将按照沪深300指数PE(TTM)估值水平进行调整。本基金采用三种量化模型进行股票投资，选取并持有

预期收益较好的行业和股票构成投资组合，通过仓位控制规避可能的市场下跌风险，并充分利用不同模型在不同市场环境下的适应性及其互补优势，在复杂多变的市场环境下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

主要投资策略还包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×50%+中债总指数（总值）财富指数收益率×50%

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。

注：本基金法律文件披露的风险收益特征系基于基金投资方向与策略特点的概括性表述，根据《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构可适时调整对本基金的风险等级结果。请投资者及时关注基金管理人和销售机构对风险评级结果的调整情况，审慎做出投资决策。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

无。

（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

无。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额（S）或金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
认购费	M<1,000,000	1.2%	-
	1,000,000≤M<3,000,000	0.8%	-
	3,000,000≤M<5,000,000	0.4%	-
	M≥5,000,000	每笔1,000元	-
申购费（前收费）	M<1,000,000	1.5%	-
	1,000,000≤M<3,000,000	1.0%	-
	3,000,000≤M<5,000,000	0.5%	-
	M≥5,000,000	每笔1,000元	-
赎回费	N<7日	1.50%	-
	7日≤N<30日	0.75%	-
	30日≤N<180日	0.50%	-
	N≥180日	0	-

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.50%
托管费	0.25%

销售服务费**其他费用**

基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；证券/期货等账户开户费用、账户维护费用、银行间账户开立、查询及交易费用等；按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

注：1. 本基金不收取销售服务费。

2. 本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示**(一) 风险揭示**

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金投资过程中面临的主要风险包括市场风险（经济周期风险、利率风险、公司经营风险、通货膨胀风险及财务风险等）、流动性风险、信用风险、管理风险、政策风险、本基金特有风险、其他风险（基金管理人职责终止风险、操作风险、技术风险及其他风险等）及本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险等级评价结果表述可能不一致的风险等。

本基金特有风险：

1、采用量化投资模型的风险

本基金主要采用三大类量化模型，分别用以控制风险确定仓位、行业配置和精选个股，因此投资过程中的多个环节将依赖于量化模型，可能存在数据错误的风险和模型失效的风险，导致其优选出的组合收益率不一定持续为正或持续高于业绩比较基准的收益率，从而存在基金业绩表现不佳的风险。

(1) 数据错误的风险。本基金的量化模型以广泛覆盖各类型信息的数据库为基础，包括宏观经济数据、行业经济数据、证券与期货交易行情数据、上市公司财务数据等，这些数据规模庞大，在搜集、采集、预处理等过程中均可能出现错误，从而影响量化模型的输出结果。

(2) 模型失效的风险。本基金基于量化模型进行投资决策，模型的有效性在一定程度上也会影响本基金的业绩表现。一方面，面对不断变换的市场环境，建立量化模型的假设前提、变量因子有可能改变，理论和工具也存在适用性的问题，从而影响模型整体效果的稳定性；另一方面，量化模型存在对历史数据的依赖，在实际运用过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

2、基金投资金融衍生品的风险

本基金可投资股指期货等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股指期货微小的变动就可能使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来损失。

3、基金投资资产支持证券的风险

本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，本公司将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。

4、本基金可以投资科创板股票，投资风险包括：

（1）市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

（2）流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

（3）科创板企业退市风险

科创板有更为严格的退市标准，且不设暂停上市、恢复上市和重新上市制度，科创板上市企业退市风险更大，可能给本基金带来不利影响。

（4）集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

（5）系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

（6）政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

本基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板，基金资产并非必然投资于科创板。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站【<http://www.jtamc.com>】【客服电话：4006280606】

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料

六、其他情况说明

本基金无其他情况说明。