

九泰盈泰量化股票型证券投资基金（九泰盈泰量化 A 份额）

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024 年 6 月 24 日

送出日期：2024 年 6 月 27 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	九泰盈泰量化	基金代码	011224
下属基金简称	九泰盈泰量化A	下属基金代码	011224
基金管理人	九泰基金管理有限公司	基金托管人	浙商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021-08-18	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	股票型	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	李响	开始担任本基金基金经理的日期	2023-09-28
		证券从业日期	2010-04-12

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	本基金主要通过量化模型，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争基金资产的长期稳定增值。
投资范围	本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准或注册发行的股票），债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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。 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为80%—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，本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、存出保证金和应收申购款等。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。
主要投资策略	本基金通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析以及对资本市场趋势的判断，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的长期回报。 本基金采用多层次量化模型，在有效控制风险的前提下，选取并持有预期收益较好的

行业和股票构成投资组合，充分利用不同模型在不同市场环境下的适应性及其互补优势，在复杂多变的市场环境下，力争实现基金资产的稳健增值。

本基金投资策略还包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。

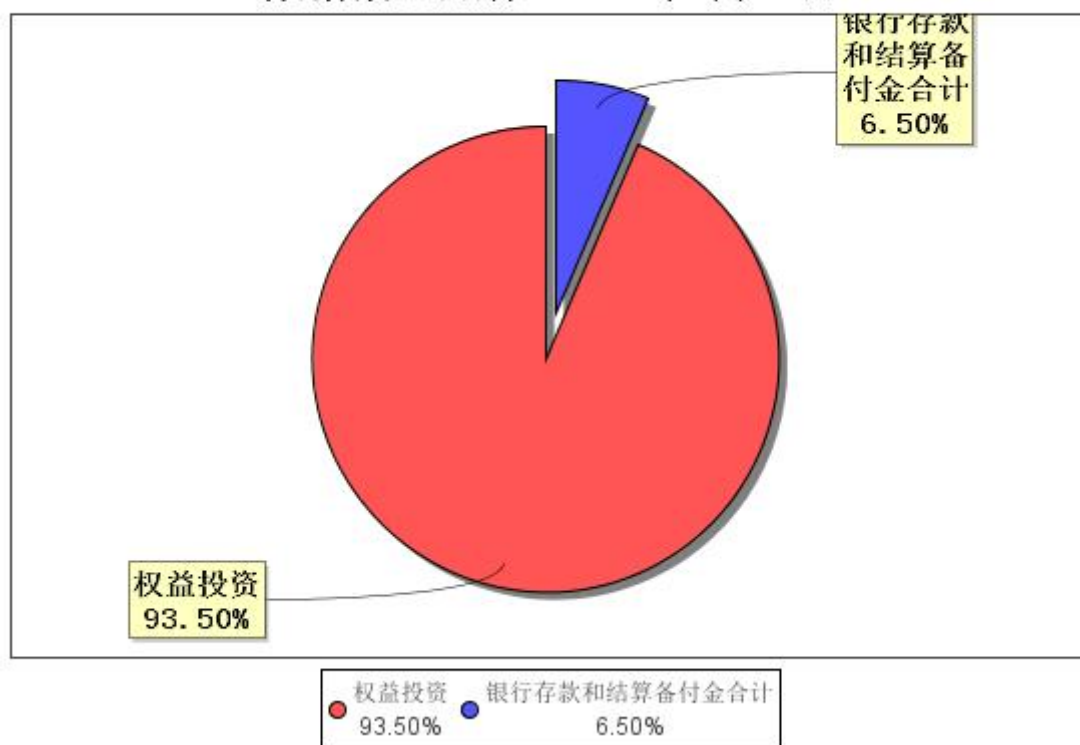
业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征 本基金属于股票型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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

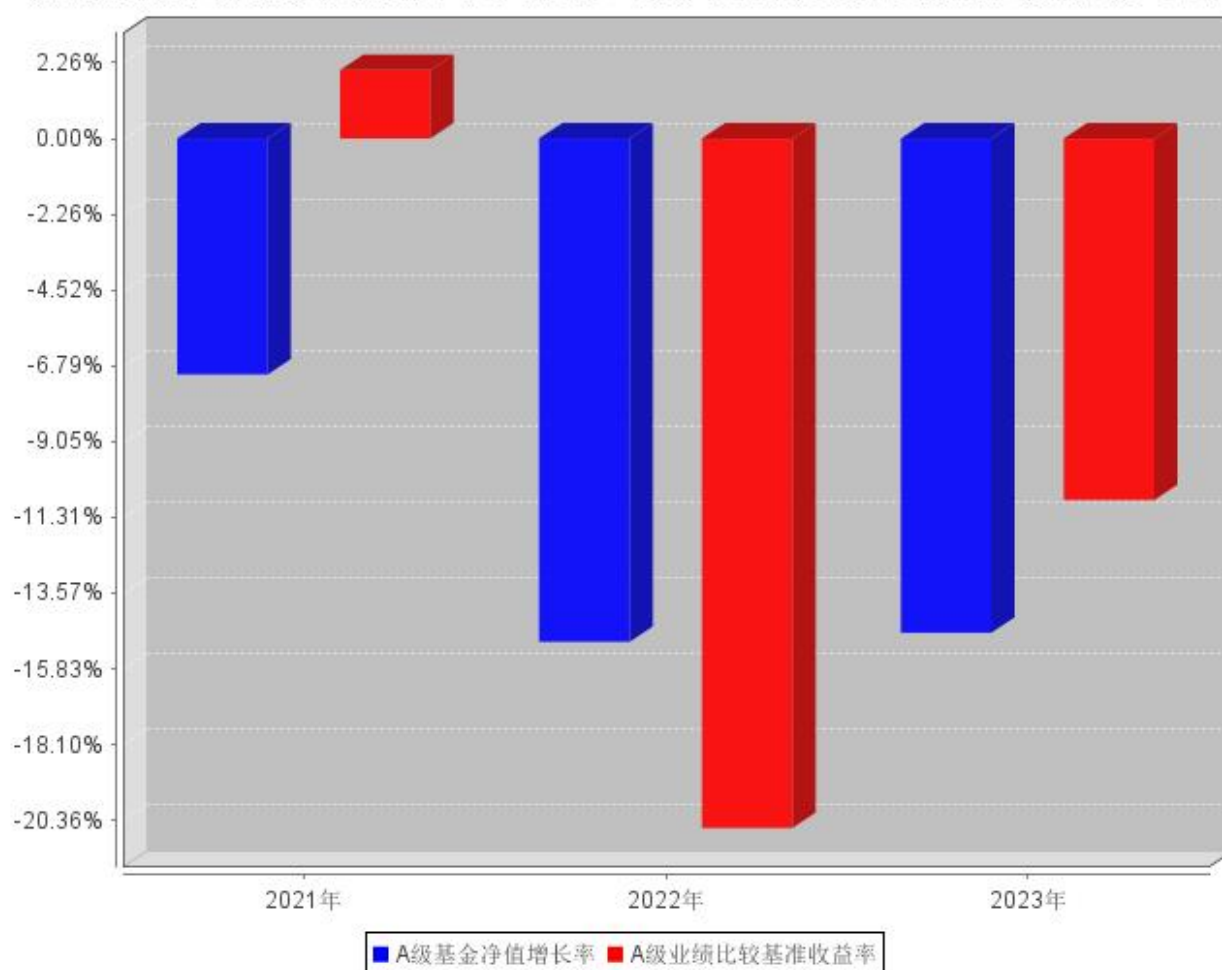
投资组合资产配置图表
数据截止日期：2024年3月31日



注：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。

（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

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



注：1、业绩表现截止日期2023年12月31日。基金的过往业绩不代表未来表现。

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

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
申购费（前收费）	M < 500,000	1.50%	-
	500,000 ≤ M < 1,000,000	1.00%	-
	1,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.50%	-
	M ≥ 5,000,000	按笔固定收取，1000元/笔	-
赎回费	N < 7日	1.50%	-
	7日 ≤ N < 30日	0.75%	-
	30日 ≤ N < 365日	0.50%	-
	N ≥ 365日	0	-

认购费：本基金已成立运作，不涉及认购费用。

（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/年费率或金额	收取方
管理费	年费率1.2%	基金管理人和销售机构
托管费	年费率0.2%	基金托管人
销售服务费	-	销售机构
审计费用	年费用金额50,000.00元	会计师事务所
信息披露费	年费用金额80,000.00元	规定披露报刊

注：

- 1、上表中年费用金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。
- 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。
- 3、除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
1.62%

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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

本基金主要采用两大类量化模型，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、基金投资股指期货的风险

本基金可以投资股指期货，可能面临基差风险、合约品种差异造成的风险、标的物风险和保证金风险等风险。标的股票指数价格与股指期货价格之间的价差被称为基差。在股指期货交易中因基差波动的不确定性而导致的风险被称为基差风险。合约品种差异造成的风险，是指类似的合约品种，在相同因素的影响下，价格变动不同。表现为两种情况：1）价格变动的方向相反；2）价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格，在相同因素作用下变动幅度上的差异，也构成了合约品种差异的风险。标的物风险是由于投资组合与股指期货的标的指数的结构不完全一致，导致投资组合特定风险无法完全锁定所带来的风险。股指期货采用保证金交易制度，具有明显的杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能使投资者权益遭受较大损失。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，可能给投资带来重大损失。

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停限制，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北京仲裁委员会，按照北京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，除非仲裁裁决另有规定。

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。