九泰盈华量化灵活配置混合型证券投资基金（LOF)（九泰盈华量化混合 A 份额）

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 1 月 12 日

送出日期：2021 年 1 月 15 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	九泰盈华量化混合	**基金代码**	168106
下属基金简称	九泰盈华量化混合A	**下属基金代码**	168106
基金管理人	九泰基金管理有限公司	**基金托管人**	渤海银行股份有限公司
基金合同生效日	2018-12-19	**上市交易所及上市日期**	深圳证券交易所 2017-06-16
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**	2018-12-19
		证券从业日期	2010-07-01
其他	1、场内简称：盈华A；2、交易代码：168106；3、基金合同中的特殊终止条款：本基金在存续期内，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，本基金合同终止，无须召开基金份额持有人大会。法律法规另有规定时，从其规定。		

注：《九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月19日生效，2018年5月21日至2018年6月13日期间，九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，根据基金份额持有人大会决议，2018年6月15日变更为九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金。根据《九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金封闭期届满日为2018年12月18日。在封闭期届满后，九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金符合基金合同约定的存续条件，无需召开基金份额持有人大会，于2018年12月19日自动转换为上市开放式基金（LOF），并更名为九泰盈华量化灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

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方法，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（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转

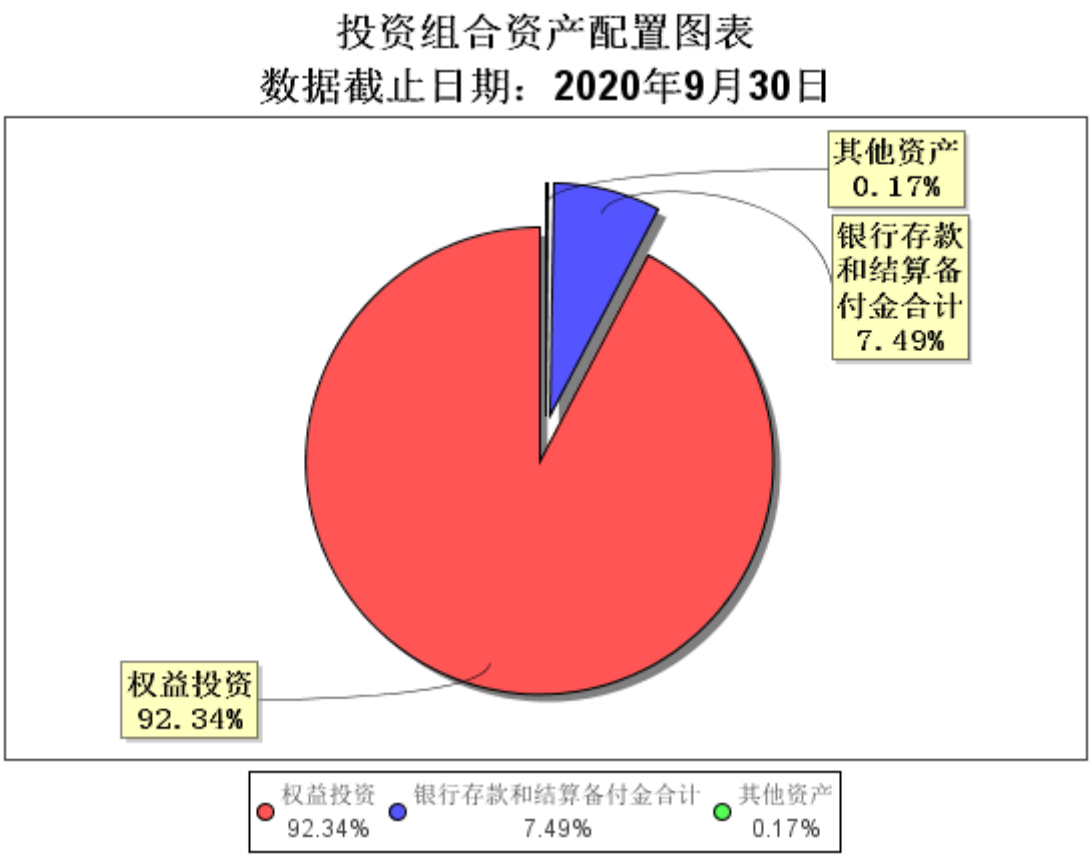
cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	换债券（含分离交易可转债）、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，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）。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，本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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。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	本基金在股票投资过程中主要采用量化投资模型，指导构建投资组合，强调投资纪律，切实贯彻量化投资策略，力争在控制风险的前提下实现基金资产的长期稳健增值。本基金大类资产配置策略主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，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绝对回报。本基金投资策略还包括股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略及股指期货投资策略等。
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。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

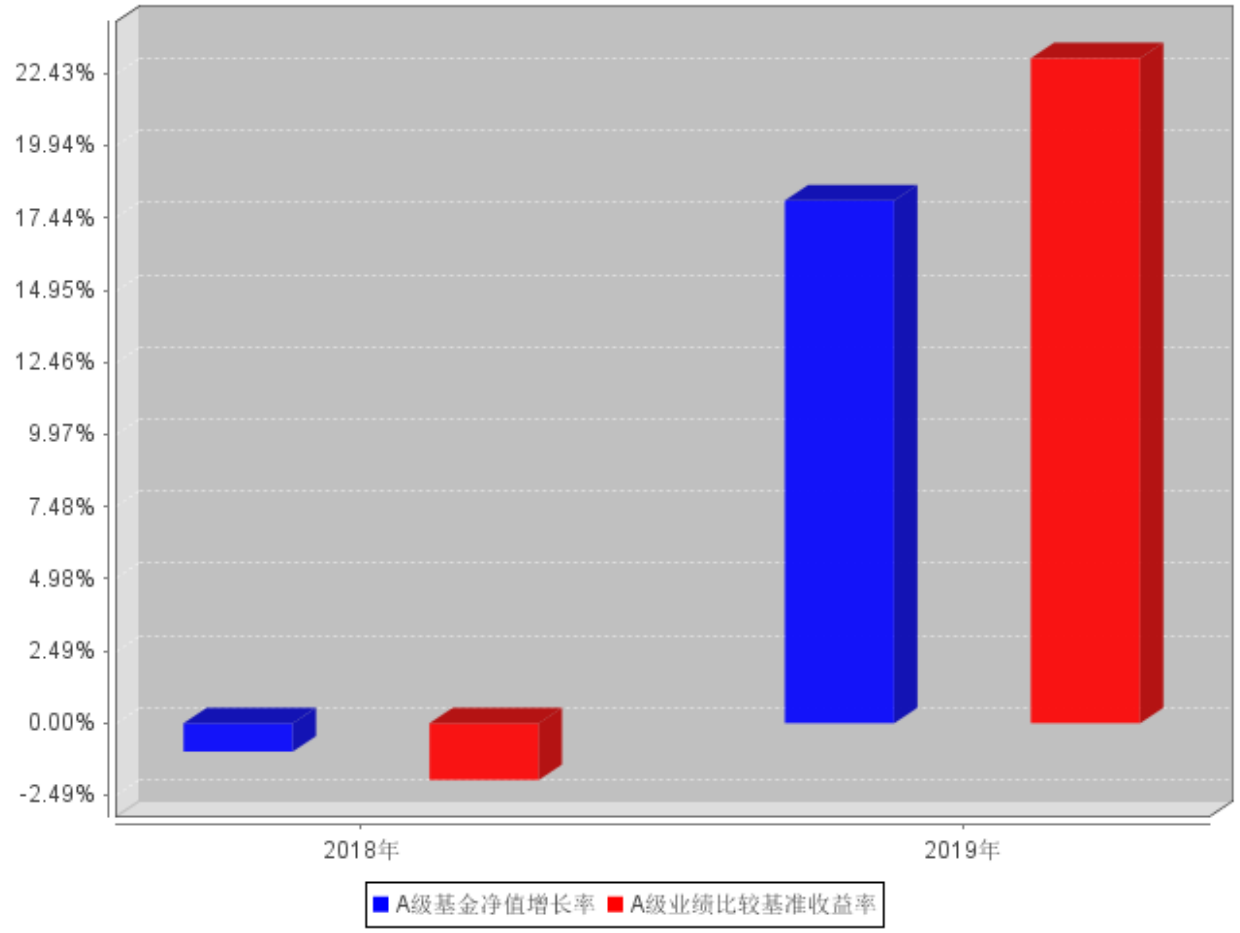


注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

（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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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2019年12月31日。基金的过往业绩不代表未来表现。

2、本基金由九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金转换而来，基金合同于2018年12月19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%	场外份额
	500,000≤M<1,000,000	1.00%	场外份额
	1,000,000≤M<5,000,000	0.50%	场外份额
	M≥5,000,000	按笔固定收取，每笔1000元	场外份额
	-	深圳证券交易所会员单位应按照本基金招募说	场内份额

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

		明书约定的场外申购费率设定投资者的场内申购费率。	
赎回费	N<7日	1.50%	场外份额
	7日≤N<30日	0.75%	场外份额
	30日≤N<365日	0.50%	场外份额
	365日≤N<730日	0.25%	场外份额
	N≥730日	0	场外份额
	N<7日	1.50%	场内份额
	N≥7日	0.50%	场内份额

注：本基金A类份额上市交易，场内交易费用以证券公司实际收取为准。

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
管理费	1.00%
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；基金的上市费和年费；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A类份额不收取销售服务费。

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、财务风险）、流动性风险、信用风险（所投资的债券自身的信用风险及债券交易对手的风险）、管理风险、政策风险、本基金特有风险、其他风险（操作风险、技术风险及其他风险）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，从而导致本基金所面临的模型风险高于传统混合型基金，存在导致基金业绩表现不佳的风险。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

可能出现错误，从而影响量化模型的输出结果。

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、折价风险

本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，场内份额可以在满足上市交易条件后在深交所上市交易。在证券市场持续下跌、基金场内交易不活跃等情形下，有可能出现基金份额场内交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失。

3、投资流通受限股票风险

基金投资流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，故本基金的净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值，投资者在场内交易时，需考虑该估值方式对基金净值的影响。另外，本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

4、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，股价指数微小的变动就可能会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。

5、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。

（二）重要提示

中国证监会对九泰锐华定增灵活配置混合型证券投资基金变更为九泰锐华灵活配置混合型证券投资基金的注册，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】

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn