九泰久睿量化股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告

2021年3月31日

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

报告送出日期: 2021年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2021 年 4 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	九泰久睿量化			
基金主代码	009874			
交易代码	009874			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2020年8月14日			
报告期末基金份额总额	1, 260, 779, 071. 11 份			
本基金采用量化多策略模型,寻找具备长期的优秀企业,同时有效控制组合的风险,力 越业绩比较基准的收益,追求基金资产的长值。				
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。在股票投资方面本基 金采用量化多策略进行股票投资,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、国债期货投资策略等。			
业绩比较基准	中证 500 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。			

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年3月31日)
1. 本期已实现收益	39, 662, 000. 35
2. 本期利润	-1, 556, 621. 20
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0011
4. 期末基金资产净值	1, 144, 151, 999. 08
5. 期末基金份额净值	0.9075

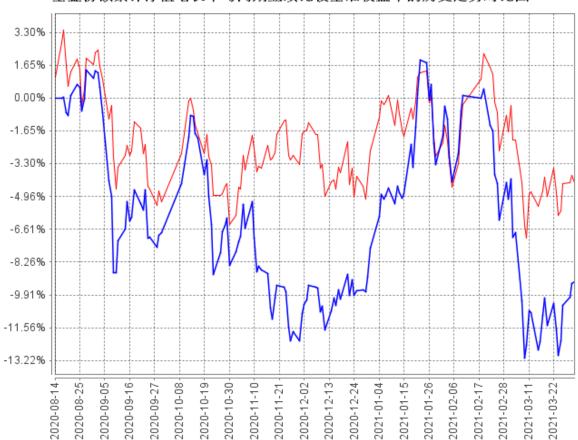
- 注: 1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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

阶段	净值增长率①	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	-1.83%	1.54%	-1.66%	1. 17%	-0.17%	0. 37%
过去六个月	-2.67%	1. 37%	0. 99%	1. 13%	-3.66%	0. 24%
自基金合同 生效起至今	-9. 25%	1. 35%	-4. 27%	1. 14%	-4. 98%	0. 21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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. 本基金合同于 2020 年 8 月 14 日生效,截至本报告期末,本基金合同生效不满一年,距建仓期结束不满一年。

业绩比较基准累计收益率

基金份额累计净值增长率

2. 根据基金合同的规定,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。本基金建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
姓名	い いか いか いっぱい いっぱい いっぱい いっぱい いっぱい いっぱい いっ	任职日期	离任日期	业	<i>ν</i> τ. •ντ
孟亚强	基 金 经 理、天元 量化投资	2020年8月14日	_	12	南开大学保险精算硕士,中国籍,具有基金从业资格。12年证

第 4 页 共 12 页

等从业经历。历任博 时基金管理。2015 年8年在经理。2015 年8月限公元九泰基管任 九泰太管任 九泰太管任 九泰太晚最基金(原和泰大晚最基础 合型证券投资基金(原和泰大晚子的,1月26日), 九泰昭联合型证券投资基金(2017年8月 16日至2020年3月 23日3日,九泰工兴产 发基金(2017年2月10日年2020年3月 23日3日,九泰王配基金(2017年2月10日年2020年1月12日,九泰东配基金(2016年1月26日)的基金经理,现象还是有是第一个企为,九张配置。(2016年12月26日至少,九次配量。(2016年12月26日至少,九次配量。(2016年12月26日至少,九次正数是依据李大康证券投资基金(2016年12月26日至今),九泰大康证券投资基金(2016年6月全日全分,九泰大亚等投资基金(2020年5月29日至今),九多大赛量化价值。2020年5月29日至今),九泰大度量化价值。至2020年5月29日至今),九泰大赛量化股票。证券投资基金至今,1月29日至少,九泰大赛量化股票。			
研究员、基金经理。2015年8月加入九本案的情理、投资经理。2015年8月加入九本等的任允素人的。	部总经理		券从业经历。历任博
研究员、基金经理。2015年8月加入九率曾任九泰久稳是证案的位置混合型证券投资基金。管理有限公司配置混合型证券投资基金。(见几泰分股本金)之016年6月7日2018年11月26日入九泰湾置混合型证券投资基金。(2017年8月16日至2020年3月23日)、九泰河武器配置混合型证券投资基金(2017年2月10日至2020年9月22日)、九赤阳置混合全型证券投资基金(2016年1月11日)的重量处理,现任天正是企业,现任天正是企业,是任于现代资本企业,是任于现代资本企业,是不是企业,是不是企业,是不是企业,是不是企业,是不是企业,是不是企业,是不是企业,是不是企业,是不是企业,是不是企业,是不是一个人,是要是一个人,是要是一个人,是要是一个人,是要是一个人,是要是一个人,是是是一个人,是是一个一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是一个人,			时基金管理有限公司
理、投资经理。2015年8月加入九本基金管理有限公司,曾任 九泰《稳灵活配置混合型证券投资基金(原几本条久稳保本混合型证券投资基金(2016年6月7日至2018年11月26日)、九泰鸿祥服务升级对资基金(2017年2月16日至2020年9月23日)、九泰人兴灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日至2020年9月21日,九泰天高配置混合型证券投资基金(2016年1月11日)的基金经理,现任天元量化,现在是一个成绩是一个成绩是一个成绩是一个成绩是一个成绩是一个成绩是一个成绩是一个成绩			研究员、基金经理助
年8月加入九泰基金管理有限公司,曾任九泰久稳灵活整基金(原元泰久稳灵活整基金(原九泰久稳灵活整基金(原九泰久稳保本。2016年6月7日2018年11月26日)、九泰海祥服务升级灵活配置温合型证券投资基金(2017年8月16日至2020年9月23日),九泰天高改资基金(2017年2月10日至2020年9月2日),九泰天高改管基金(2016年12月26日至2021年1月1日)的基金经理,规任天元量化投资部总经理,规任天元量化投资部总经理,规任天元量化投资部总经理,规任天元量化投资部总经理,规任天元量化投资部总经理,规任天元量化投资部总经理,规任天元量化发资部总经理,规任天元量化发资部总经过。(2016年6月7日至今),九泰天高量化等对资量化聚型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久高量化聚型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久高量化聚型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰天容量化价。2020年5月29日至今)、九泰天容量化散票型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰人容量化聚票型			
管理有限公司、曾任 九泰久稳灵活配置混 合型证券投资基金。 (原九泰久稳保基金。 (原九泰久稳保基金。 2016 年 6 月 7 口至 2018年11月26日)、九泰湾洋服务升级券贷基金(2017 年 8 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日)、九泰八兴灵资 配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日至 2020 年 9 月 22 日)、九泰不富置紀合型证券投资基金(2016 年 12 月 26 日 全 2021 年 1 月 11 日)的基金 经理,现总经理,九志配置混合型证券投资部总统是,九志配置混合型证务投资部总统理,九志配置混合型证券投资部总统。 经理,现总经理,九志配置混合型证务投资部。 全(2016 年 6 月 7 日至今)、九泰人原量投资基金(2020 年 3 月 12 日至今)、九泰人原量投资基金(2020 年 4 月 22 日至今)、九泰人原量化股票型证券投资基金(2020 年 5 月 20 日至今)、九秦天变量化股票型证券投资基金(2020 年 5 月 20 日至今)、九秦天变量化股票型证券投资基金(2020 年 5 月 20 日至今)、九泰天变量化股票型证券投资基金(2020 年 5 月 29 日至今)、九泰人春量化股票型			
九泰久稳灵活配置混合型证券投资基金(原几本次稳保本混合型证券投资基金,2016年6月7日至2018年11月26日)、九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月16日至2020年3月12日)、九泰大宫改革金(2017年2月10日至2020年9月22日)、九泰天宫改革型证券投资基金(2016年12月26日至021年1月11日的的基金(2016年6月7日至021年1月11日至0),九泰天宫改革型证券投资部总经理,九标久。底量合型证券投资部分及资部经理,九标久底。全型型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰人高量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九秦天变量低准息全(2020年5月20日至今)、九秦天变量低准息全(2020年5月20日至今)、九秦天变量低价值混合型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九秦天变量低价值混合型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九秦天变量还是全位股票型			
合型证券投资基金、(原九泰久稳保本混合型证券投资基金,2016年6月7日至2018年11月26日5、九泰鸿祥服务升级灵活配置企2017年8月16日至2020年3月16日至2020年3月16日至2020年9月23日5、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日至2020年9月215日至2020年9月22日5月1日日的基金经理,现总经理灵活企业证券投资基金(2016年1月11日的基金经理,现总经律灵活企业证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天后是代数对力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰人高量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九秦天突量依值混合型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九秦天突量依值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰天突量依值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰天突量依值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰天突量依便黑型			
(原九泰久稳保本混合型证券投资基金,2016年6月7日至2018年11月26日)、九泰鸿祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金(2017年8月16日至2020年3月23日)、九泰大兴灵资基金(2017年2月10日至2020年9月12日)、九泰天富置混合型证券投资基金(2016年12月36日至101月11日的基金经理,现任天元 九泰人底量合理证券投资基金(2016年12月11日)的基金经理,现任天元 九泰人底量全型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰人底量化聚动股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰人后量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九秦人后量化价值混合型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九秦天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九秦天奕量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九秦天奕看及能量(2020年5月29日至今)、九秦天奕看处股票型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九秦天奕看处股票型			
合型证券投资基金,2016年6月7日至2018年11月26日),九泰鸿祥服务升级灵洁配置混合型证券投资基金(2017年8月16日至2020年3月23日),九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日至2020年9月22日),九泰不富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月26日至2021年1月1日)的基金经理,现任天理量化投资部总经理,几季人企量化投资部总经理是现任于1月1日)的基金经理,现在是收货等。全(2016年6月7日至今),九泰人广量化数新动力股票型证券投资 基金(2020年3月12日至今),九泰人应量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今),九泰人信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰人常量化价量混合型证券投资基金(2020年5月20日至今),九泰人常量化价量混合型证券投资基金(2020年5月20日至今),九泰人等量化份量混合型证券投资基金(2020年5月20日至今),九泰人等量化股票型			
2016 年 6 月 7 日至 2018 年 11 月 26 日)、 九泰鸿祥服务升级灵 活配置混合型证券 投资基金(2017 年 8 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日)、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日至 2020 年 9 月 22 日)、九泰天富改革新 动力灵活配量混合型证券投资基金(2016 年 9 日至 2021 年 1 月 11 日)的基金经理,现任天元量化投资量化先等投资基金(2016 年 6 月 7 日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2016 年 6 月 7 日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020 年 3 月 12 日至今)、九泰型证券投资基金(2020 年 4 月 22 日至今)、九泰型证券投资基金(2020 年 5 月 20 日至今)、九泰天卖量化价值混合型证券投资基金(2020 年 5 月 20 日至今)、九泰天卖量化价值混合型证券投资基金(2020 年 5 月 29 日至今)、九泰人客量化股票型			
2018 年 11 月 26 日)、 九泰鸿祥服务升级灵 活配置混合型证券投资基金 (2017 年 8 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日)、九泰久深灵活 配置混合型证券投资基金 (2017 年 2 月 10 日至 2020 年 9 月 22 日)、九泰天置温。合型证券投资基金 (2016 年 12 月 26 日至 2021 年 1 月 11 日)的基金 经理,现任天元量化 投资都总经锋对投资基金 (2016 年 6 月 7 日 至今)、九泰天辰量化 新动力股票型证券投资基金 (2016 年 6 月 7 日 至今)、九泰天辰量化 新动力股票型证券投资基金 (2020 年 3 月 12 日至今)、九泰 人信量化股票型证券 投资基金 (2020 年 4 月 22 日至今)、九泰 久信量化股票型证券 投资基金 (2020 年 5 月 20 日至今)、九泰 久信量化分别混合型证券 投资基金 (2020 年 5 月 20 日至今)、九泰 久信量化份混合型证券 投资基金 (2020 年 5 月 20 日至今)、九泰			
九泰灣祥服务升级灵活配置混合型证券投资基金(2017年8月16日至2020年3月23日)、九泰人兴灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日至2020年9月22日)、九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月26日至2021年1月11日的基金经理,现任天元基金经理,对任天元基金经理,对任天元量化投资部总经理。大孩基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰人适量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰人信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天底量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰天安量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰天安量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰久容量化股票型			2016 年 6 月 7 日至
活配置混合型证券投资基金(2017 年 8 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日)、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日至 2020 年 9 月 22 日)、九泰天富改合型证券投资基金(2016 年 9 月 26 日至 2021 年 1 月 11 日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九泰人盛量化先锋灵力资量。 (2016 年 6 月 7 日 至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020 年 3 月 12 日至今)、九泰人应量化驱动股票型证券投资基金(2020 年 4 月 22 日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020 年 4 月 20 日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020 年 5 月 20 日至今)、九泰天变量化价值混合型证券投资基金(2020 年 5 月 29 日至今)、九泰天变量化价值混合型证券投资基金(2020 年 5 月 29 日至今)、九泰天变量化价值混合型证券投资基金(2020 年 5 月 29 日至今)、九泰人者量化股票型			2018年11月26日)、
资基金(2017年8月16日至2020年3月23日)、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日至2020年9月22日)、九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月26日至2021年1月11日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型长投资基金(2020年3月12日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型工券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天产资量化价值。合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰久睿量化股票型			九泰鸿祥服务升级灵
16 日至 2020 年 3 月 23 日)、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日至 2020 年 9 月 22 日)、九泰天高改革新动力灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 12 月 26 日至 2021 年 1 月 11 日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 6 月 7 日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020 年 3 月 12 日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金(2020 年 4 月 22 日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020 年 5 月 20 日至今)、九泰天变量化价值混合型证券投资基金(2020 年 5 月 20 日至今)、九泰天变量化价值混合型证券投资基金(2020 年 5 月 29 日至今)、九泰久容量化股票型			活配置混合型证券投
23 日)、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日至2020年9月22日)、九泰天高改革新动力灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月26日至2021年1月11日)的基金经理,现任天进全人投资部总经理,九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天荣量化价值混合型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天荣量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰人客量化股票型			资基金(2017年8月
23 日)、九泰久兴灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日至2020年9月22日)、九泰天高改革新动力灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月26日至2021年1月11日)的基金经理,现任天进全人投资部总经理,九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天荣量化价值混合型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天荣量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰人客量化股票型			16 日至 2020 年 3 月
配置混合型证券投资基金(2017年2月10日至2020年9月22日)、九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月26日至2021年1月11日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九泰人盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量代新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天爱量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰人容量化股票型			
基金(2017年2月10日至2020年9月22日)、九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月26日至2021年1月11日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九泰人盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰人后量化股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰人信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天爱量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰人客量化股票型			, = ,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,
日至 2020 年 9 月 22 日)、九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金 (2016 年 12 月 26 日至 2021 年 1 月 11 日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金 (2016 年 6 月 7 日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金 (2020 年 3 月 12 日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金 (2020 年 4 月 22 日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金 (2020 年 5 月 20 日至今)、九泰天荣重化价值混合型证券投资基金 (2020 年 5 月 29 日至今)、九泰人容量化股票型			
日)、九泰天富改革新 动力灵活配置混合型 证券投资基金(2016 年12月26日至2021 年1月11日)的基金 经理,现任天元量化 投资部总经理,九泰 久盛量化先锋灵活配 置混合型证券投资基金(2016年6月7日 至今)、九泰天辰量化 新动力股票型证券投资基金(2020年3月 12日至今)、九泰人远量化驱动股票型证券 投资基金(2020年4月22日至今)、九泰 人信量化股票型证券 投资基金(2020年5月20日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰			
动力灵活配置混合型证券投资基金(2016年12月26日至2021年1月11日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九秦人盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰人远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰人信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰不容量化股票型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰不容量化股票型			
证券投资基金(2016年12月26日至2021年1月11日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰人远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰人信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰天李量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰			
年12月26日至2021年1月11日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九泰人盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰人应量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰人信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰久睿量化股票型			
年1月11日)的基金经理,现任天元量化投资部总经理,九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰人远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰久睿量化股票型			
经理,现任天元量化 投资部总经理,九泰 久盛量化先锋灵活配 置混合型证券投资基 金(2016年6月7日 至今)、九泰天辰量化 新动力股票型证券投资基金(2020年3月 12日至今)、九泰人远 量化驱动股票型证券 投资基金(2020年4 月22日至今)、九泰 久信量化股票型证券 投资基金(2020年5 月20日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020年5月29日至今)、 九泰久睿量化股票型			
投资部总经理,九泰 久盛量化先锋灵活配 置混合型证券投资基 金(2016年6月7日 至今)、九泰天辰量化 新动力股票型证券投 资基金(2020年3月 12日至今)、九泰人远 量化驱动股票型证券 投资基金(2020年4月22日至今)、九泰 久信量化股票型证券 投资基金(2020年5月20日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020年5月29日至今)、 九泰久睿量化股票型			
久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰人容量化股票型			
置混合型证券投资基金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰人容量化股票型			投资部总经理,九泰
金(2016年6月7日至今)、九泰天辰量化新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰久睿量化股票型			久盛量化先锋灵活配
至今)、九泰天辰量化 新动力股票型证券投资基金(2020年3月 12日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券 投资基金(2020年4月22日至今)、九泰 久信量化股票型证券 投资基金(2020年5月20日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰			置混合型证券投资基
新动力股票型证券投资基金(2020年3月12日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰久睿量化股票型			金(2016年6月7日
资基金(2020年3月 12日至今)、九泰久远量化驱动股票型证券投资基金(2020年4月22日至今)、九泰久信量化股票型证券投资基金(2020年5月20日至今)、九泰天奕量化价值混合型证券投资基金(2020年5月29日至今)、九泰久睿量化股票型			至今)、九泰天辰量化
12 日至今)、九泰久远 量化驱动股票型证券 投资基金(2020 年 4 月 22 日至今)、九泰 久信量化股票型证券 投资基金(2020 年 5 月 20 日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020 年 5 月 29 日至今)、 九泰久睿量化股票型			新动力股票型证券投
量化驱动股票型证券 投资基金(2020年4月22日至今)、九泰 久信量化股票型证券 投资基金(2020年5月20日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020年5月29日至今)、 九泰久睿量化股票型			资基金(2020年3月
投资基金(2020年4 月22日至今)、九泰 久信量化股票型证券 投资基金(2020年5 月20日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020年5月29日至今)、 九泰久睿量化股票型			12 日至今)、九泰久远
投资基金(2020年4 月22日至今)、九泰 久信量化股票型证券 投资基金(2020年5 月20日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020年5月29日至今)、 九泰久睿量化股票型			量化驱动股票型证券
月 22 日至今)、九泰 久信量化股票型证券 投资基金 (2020 年 5 月 20 日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金 (2020 年 5 月 29 日至今)、 九泰久睿量化股票型			
久信量化股票型证券 投资基金(2020年5 月20日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020年5月29日至今)、 九泰久睿量化股票型			
投资基金(2020年5月20日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020年5月29日至今)、 九泰久睿量化股票型			
月 20 日至今)、九泰 天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020 年 5 月 29 日至今)、 九泰久睿量化股票型			
天奕量化价值混合型 证券投资基金(2020 年 5 月 29 日至今)、 九泰久睿量化股票型			
证券投资基金 (2020 年 5 月 29 日至今)、 九泰久睿量化股票型			
年 5 月 29 日至今)、 九泰久睿量化股票型			
九泰久睿量化股票型			
			证券投资基金(2020

		年 8 月 14 日至今)、
		九泰久福量化股票型
		证券投资基金(2021
		年 1 月 20 日至今)、
		九泰锐升 18 个月封闭
		运作混合型证券投资
		基金 (2021年1月20
		日至今)、九泰久元量
		化股票型证券投资基
		金(2021年1月26日
		至今)的基金经理。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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组合,在不同时间窗下(1日内、3日内、5日内)的季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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内市场波动较大,以春节为节点,节后市场风格从大盘成长转变到小盘价值。本基金采用多策略量化模型,在有效控制组合风险的前提下,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。报告期内,在选股上坚持量化多策略模型来操作,组合整体风险暴露仍偏向于中小盘,盈利质量因子继续表现稳定,模型不断降低成长因子权重,适度增加了价值因子的暴露。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9075 元;本报告期基金份额净值增长率为-1.83%,业绩比较基准收益率为-1.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)	
1	权益投资	1, 064, 614, 268. 91	92. 65	
	其中: 股票	1, 064, 614, 268. 91	92. 65	
2	基金投资	I	_	
3	固定收益投资	1	_	
	其中:债券	_	-	
	资产支持证券	1	-	
4	贵金属投资	1	_	
5	金融衍生品投资	I	_	
6	买入返售金融资产	1	-	
	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	81, 567, 805. 77	7. 10	
8	其他资产	2, 841, 824. 04	0. 25	

9	合计	1, 149, 023, 898. 72	100.00
---	----	----------------------	--------

注:银行存款中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例
1 【和书	11 业关剂	公儿게阻(儿)	(%)
A	农、林、牧、渔业	15, 474, 641. 00	1.35
В	采矿业	15, 512, 446. 08	1.36
С	制造业	689, 343, 811. 45	60. 25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	52, 358, 805. 56	4. 58
Е	建筑业	6, 483, 380. 00	0. 57
F	批发和零售业	38, 121, 734. 32	3. 33
G	交通运输、仓储和邮政业	50, 791, 223. 66	4.44
Н	住宿和餐饮业	_	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	66, 036, 844. 17	5. 77
J	金融业	44, 054, 636. 00	3.85
K	房地产业	10, 200. 30	0.00
L	租赁和商务服务业	14, 420, 192. 00	1. 26
M	科学研究和技术服务业	_	_
N	水利、环境和公共设施管理业	19, 340, 673. 92	1. 69
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	15, 163, 842. 98	1.33
Q	卫生和社会工作	22, 427, 628. 30	1. 96
R	文化、体育和娱乐业	15, 074, 209. 17	1.32
S	综合	-	-
	合计	1, 064, 614, 268. 91	93. 05

5.2.2 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股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值 (元)	占基金资产净值 比例(%)
1	603486	科沃斯	176, 100	24, 037, 650. 00	2. 10
2	600143	金发科技	1, 049, 713	22, 789, 269. 23	1. 99
3	603882	金域医学	176, 526	22, 427, 628. 30	1. 96
4	603806	福斯特	254, 400	21, 855, 504. 00	1. 91

5	600132	重庆啤酒	196, 346	21, 851, 346. 34	1. 91
6	601799	星宇股份	111,600	21, 092, 400. 00	1.84
7	603345	安井食品	99, 700	20, 793, 432. 00	1. 82
8	002030	达安基因	671, 491	20, 433, 471. 13	1. 79
9	002124	天邦股份	1, 060, 900	18, 364, 179. 00	1. 61
10	600966	博汇纸业	1, 046, 300	17, 609, 229. 00	1.54

5.4 报告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。

- **5.5 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债券投资明细** 本基金本报告期末未持有债券。
 - 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

- **5.7 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。
- **5.8 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权证投资明细** 本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IC2104	IC2104	15	18, 678, 000. 00	131, 520. 00	本基金利用股指期 货进行多头套保,是 为了应对由于基金 的大额赎回而带来 的对基金净值的影 响。
公允价值变动	131, 520. 00				
股指期货投资	285, 393. 78				
股指期货投资	-97, 320. 00				

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内,本基金按照基金合同约定进行股指期货投资,少量参与股指期货交易,主要是用来调节组合头寸。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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,在本报告编制目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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	2, 801, 700. 00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7, 808. 78
5	应收申购款	32, 315. 26
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2, 841, 824. 04

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位: 份

报告期期初基金份额总额	1, 675, 598, 553. 93
报告期期间基金总申购份额	18, 978, 864. 68
减:报告期期间基金总赎回份额	433, 798, 347. 50
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"	_
填列)	
报告期期末基金份额总额	1, 260, 779, 071. 11

注: 总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金募集的文件;
- 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。

9.2 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。

9.3 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 2021 年 4 月 22 日