

华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

更新日期：2020年8月28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	华泰柏瑞量化对冲混合	基金代码	002804
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2016年5月26日		
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	每六个月开放一次
基金经理	田汉卿	开始担任本基金基金经理的日期	2016年5月26日
		证券从业日期	1994年6月1日
	曾鸿	开始担任本基金基金经理的日期	2017年8月30日
		证券从业日期	2013年7月15日

基金合同生效满3年后本基金继续存续的，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，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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式或与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

其他

基金合同生效满3年之日（指自然日），若基金资产净值低于2亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

基金合同生效满3年后本基金继续存续的，如基金资产净值连续60个工作日低于5000万元，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权决定终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值。
------	---

投资范围

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的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),股指期货,权证,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)、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,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,如期权等,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

主要投资策略

在力求有效控制投资风险的前提下,通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合,同时利用股指期货等多种策略对冲投资组合的市场风险,以求获得不依赖市场整体走向的比较稳定的长期资产增值。

1、股票投资策略

- (1) 多因子 alpha 模型——股票超额回报预测
- (2) 风险估测模型——有效控制预期风险
- (3) 交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩
- (4) 投资组合的优化
- (5) 投资组合的调整

2、量化对冲策略

3、固定收益资产投资策略

4、其他金融衍生工具投资策略

业绩比较基准

1 年期银行定期存款收益率(税后)

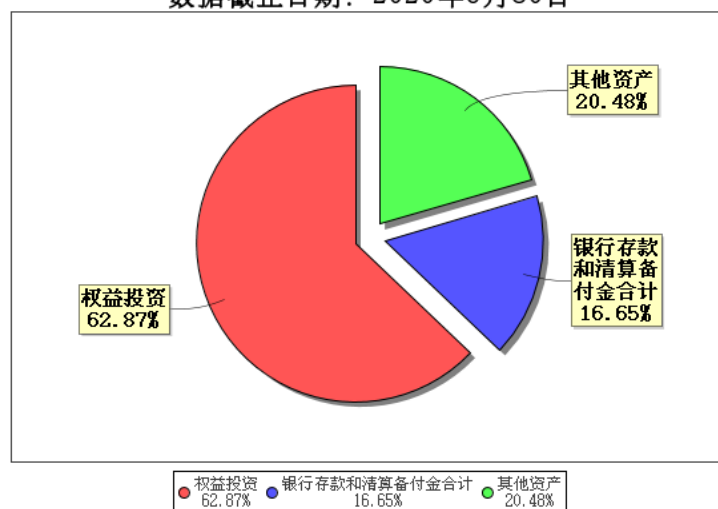
风险收益特征

本基金为特殊的混合型基金,通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险,因此相对股票型基金和一般的混合型基金,其预期风险较小。

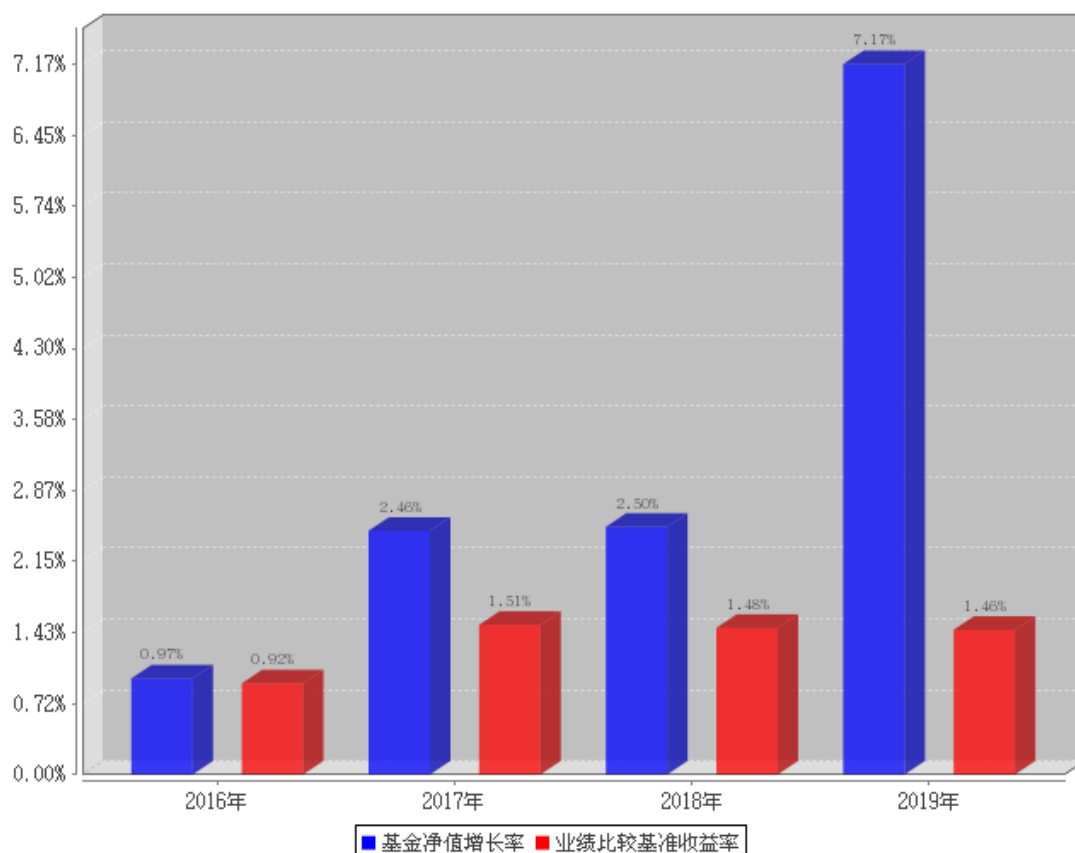
注:详见《华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期: 2020年6月30日



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图
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：业绩表现截止日期 2019 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

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	金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式 / 费率	备注
申购费 (前端收费)	M < 100 万	1.50%	
	100 万 ≤ M < 200 万	1.00%	
	200 万 ≤ M < 500 万	0.80%	
	M ≥ 500 万	1000 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 180 天	0.75%	
	180 天 ≤ N < 330 天	0.50%	
	N ≥ 330 天	0.00%	

(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%

注：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；基金费用包括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。

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。

本基金的投资风险包括投资组合的风险、管理风险、投资合规性风险、本基金特有的风险、基金投资科创板风险和其它风险。

本基金特有的风险包括：1、非开放日不能赎回的风险；2、巨额赎回风险；3、绝对收益策略失败风险；4、卖空风险；5、股票选择风险；6、本金损失风险；7、基差风险；8、杠杆风险；9、到期日风险；10、对手方风险；11、盯市结算风险；12、平仓风险；13、连带风险；14、基金资产投资特定投资对象的其他风险；15、发起式基金自动终止的风险

基金资产投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于：1、退市风险；2、市场风险；3、流动性风险；4、系统性风险；5、政策风险

（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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见华泰柏瑞基金官方网站 [www.huatai-pb.com] [客服电话：400-888-0001]

- 《华泰柏瑞量化对冲文件收益定期开放混合型证券投资基金基金合同》、
《华泰柏瑞量化对冲文件收益定期开放混合型证券投资基金托管协议》、
《华泰柏瑞量化对冲文件收益定期开放混合型证券投资基金招募说明书》
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料