

华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金（华泰柏瑞量化创享混合 C 份额）

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 1 月 22 日

送出日期：2021 年 1 月 22 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	华泰柏瑞量化创享混合	基金代码	010137
下属基金简称	华泰柏瑞量化创享混合C	下属基金代码	010138
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2020-12-30		
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	田汉卿	开始担任本基金基金经理的日期	2020-12-30
		证券从业日期	1994-06-01
		开始担任本基金基金经理的日期	2020-12-30
其他	盛豪	证券从业日期	2007-11-01
		其他	基金合同生效后，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50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，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述规定将取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

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，在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
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或注册上市的股票）、存托凭证、债券（国债、金融债、企业债、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、股指期货、股票期权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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

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。

本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

主要投资策略

1、股票投资策略

本基金主要利用定量投资模型，跟踪创业板指数和上证科创板50成份指数，通过主动管理，使用量化方法选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金运用的量化投资模型主要包括：

（1）多因子alpha模型（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）投资组合的优化和调整

2、债券投资策略3、资产支持证券投资策略4、金融衍生工具投资策略 5、融资业务的投资策略 6、存托凭证投资策略

业绩比较基准

创业板指数收益率*85%+上证科创板50成份指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*5%。

风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

注：详见《华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

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）	-	0	C类份额不收取申购费
赎回费	N<7天	1.5%	-
	7天≤N<30天	0.5%	-
	N≥30天	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	0.60%

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；基金费用包含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、本基金特有的风险和其它风险，其中本基金特有的风险为：

本基金在类别资产配置中，可能受到经济周期、市场环境、公司治理、制度建设等因素的不同影响，导致资产配置偏离最优化，这可能为基金投资绩效带来风险。

1、股票投资风险。此外，由于本基金可投资于创业板股票，还将面临如下特有的风险：

1) 退市风险 2) 股价波动风险

2、债券投资风险 3、衍生品投资风险4、资产支持证券投资风险5、参与融资交易风险

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

（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]

《华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金基金合同》、

《华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金托管协议》、

《华泰柏瑞量化创享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