

华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金（C 类份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 21 日

送出日期：2024 年 6 月 21 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 | 华泰柏瑞上证 50 指数增强 | 基金代码 | 016697 |
| 下属基金简称 | 华泰柏瑞上证 50 指数增强 C | 下属基金交易代码 | 016698 |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 3 月 14 日 | | |
| 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 | 曾鸿 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023 年 09 月 04 日 |
| | | 证券从业日期 | 2013 年 7 月 15 日 |
| 基金经理 | 盛豪 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023 年 3 月 14 日 |
| | | 证券从业日期 | 2007 年 11 月 1 日 |
| 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，管理人应及时通知基金托管人，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会审议。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

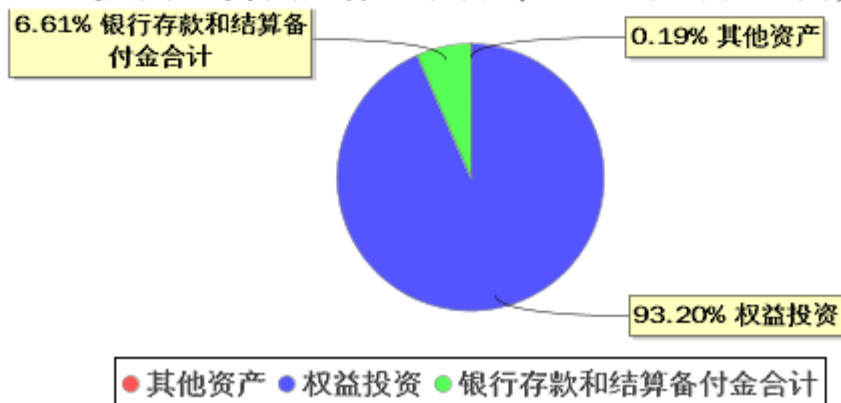
| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。 |
| 投资范围 | 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款（包括定期存款、 |

| | |
|----------------------|---|
| | <p>协议存款、通知存款等)、资产支持证券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。在符合法律法规规定的情况下,本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例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。</p> |
| <p>主要投资策略</p> | <p>1、股票投资策略 本基金为增强型指数基金,主要利用量化投资模型,在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。 本基金运用的量化投资模型主要包括: (1) 多因子 alpha 模型——股票超额回报预测 多因子 alpha 模型以中国股票市场较长期的回测研究为基础,结合前瞻性市场判断,用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处,以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲,本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类:价值(value)、质量(quality)、动量(momentum)、成长(growth)、市场预期等等。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化,并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。 多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库,科学地考虑了大量的各类信息,包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等等多方的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断,适合调整各因子类别的具体组成及权重。 (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 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金根据投资需要或市场环境变化,选择将部分资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资于港股。 2、债券投资策略;3、资产支持证券投资策略;4、衍生品投资策略:(1)股指期货投资策略;(2)股票期权投资策略;(3)国债期货投资策略;5、存托凭证投资策略;6、融资及转融通证券出借业务的投资策略。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>上证 50 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。</p> |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金是一只股票指数增强型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票,除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险,还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p> |

注:详见《华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

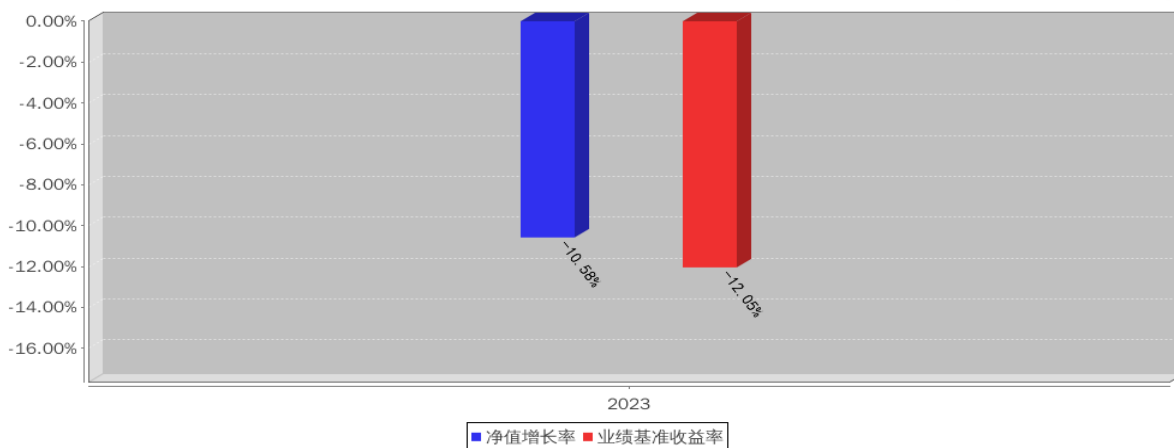
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年3月31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

华泰柏瑞上证50指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2023年12月31日）



注：基金合同生效日为 2023 年 3 月 14 日，2023 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。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 类基金份额申购费率为 0 |
| 赎回费 | N < 7 日 | 1.5% | - |
| | 7 日 ≤ N < 30 日 | 0.5% | - |
| | N ≥ 30 日 | 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 | 收费方式/年费率或金额 | 收取方 |
|-----|-------------|-----|
|-----|-------------|-----|

| | | |
|-------|-------------------|------------|
| 别 | | |
| 管理费 | 1.2% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.1% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.4% | 销售机构 |
| 审计费用 | 60,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 元 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 详见招募说明书的基金费用与税收章节 | 相关服务机构 |

注：1. 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。

2. 审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（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：

华泰柏瑞上证 50 指数增强 C

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 1.82% |

注：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。

投资本基金可能遇到的主要风险包括：本基金特有风险、投资组合的风险、管理风险、投资合规性风险性、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险及其他风险。

其中，本基金的特定风险包括指数增强型基金的特定风险（标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、量化增强策略的风险），股指期货投资风险，股票期权投资风险，国债期货的投资风险，资产支持证券投资风险，港股通标的股票投资风险，存托凭证投资风险，融资及转融通证券出借业务的风险。

基金合同生效后，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，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议。因此，基金份额持有人将可能面临基金合同自动终止的风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见本基金的招募说明书“侧袋机制”章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

（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。

本基金的争议解决处理方式为仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见基金合同的具体约定。

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。

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]

1、《华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金托管协议》、《华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金招募说明书》

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