

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金（华泰柏瑞量化智慧混合 A 份额）

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 11 月 4 日

送出日期：2021 年 11 月 4 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 | 华泰柏瑞量化智慧混合 | 基金代码 | 001244 |
| 下属基金简称 | 华泰柏瑞量化智慧混合 A | 下属基金交易代码 | 001244 |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 3 日 | | |
| 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 | 笪篁 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021 年 9 月 17 日 |
| | | 证券从业日期 | 2014 年 6 月 24 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 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、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。 | | |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

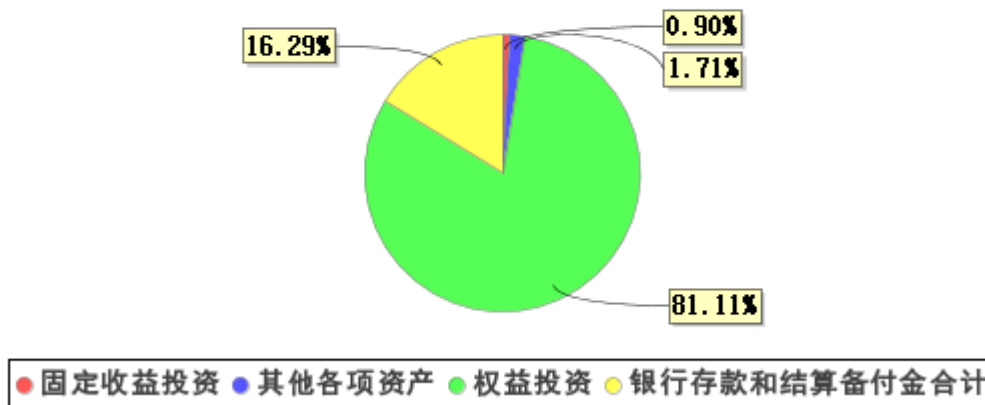
| | |
|------|---|
| 投资目标 | 利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资范围 | 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。 如法律法规或监管机构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。 本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货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 |

| | |
|--------|---|
| | <p>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%。</p> <p>待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理，届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会审议。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金主要通过定量投资模型，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。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。</p> <p>本基金运用的量化投资模型主要包括：</p> <p>（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）投资组合的优化和调整。</p> <p>2、固定收益资产投资策略 3、资产支持证券投资策略 4、权证投资策略 5、其他金融衍生工具投资策略 6、存托凭证投资策略</p> |
| 业绩比较基准 | 95%*中证 500 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 |

注：详见《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

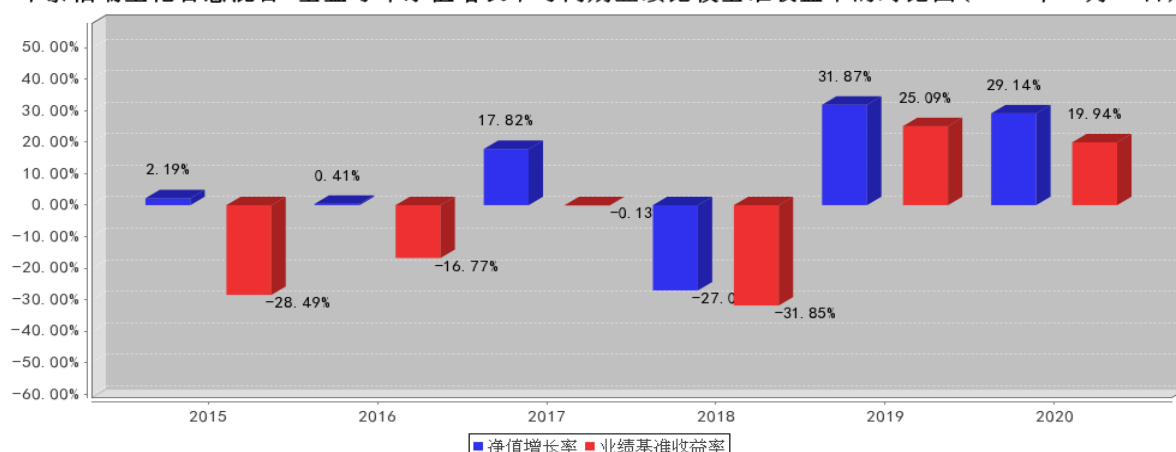
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表（2021年9月30日）



(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

华泰柏瑞量化智慧混合A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(2020年12月31日)



注:业绩表现截止日期 2020 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 |
|--------------|--------------------------------|-----------|
| 申购费 (前收费) | $M < 1,000,000$ | 1.5% |
| | $1,000,000 \leq M < 2,000,000$ | 1.0% |
| | $2,000,000 \leq M < 5,000,000$ | 0.8% |
| | $M \geq 5,000,000$ | 1,000 元/笔 |
| 赎回费 | $N < 7$ 天 | 1.5% |
| | $7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天 | 0.75% |
| | $30 \text{ 天} \leq N < 365$ 天 | 0.50% |
| | $365 \text{ 天} \leq N < 730$ 天 | 0.25% |
| | $N \geq 730$ 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% |

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、基金投资科创板风险和其他风险。

本基金采用特定的量化投资模型进行个股超额收益的预测、组合构建和调整、交易成本和风险控制，因此本基金投资过程中的多个环节将依赖于投资模型，从而导致本基金所面临的模型风险高于传统混合型基金。此外，本基金可投资于股指期货。

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。

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]

- 1、《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合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