

华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金（A 类份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 7 日

送出日期：2024 年 6 月 7 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	华泰柏瑞量化增强混合	基金代码	000172
下属基金简称	华泰柏瑞量化增强混合 A	下属基金交易代码	000172
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	2013 年 8 月 2 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	徐帅宇	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 8 月 5 日
		证券从业日期	2017 年 4 月 6 日
基金经理	田汉卿	开始担任本基金基金经理的日期	2013 年 8 月 2 日
		证券从业日期	1994 年 6 月 1 日
其他	本合同存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。		

注：本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金”

二、基金投资与净值表现

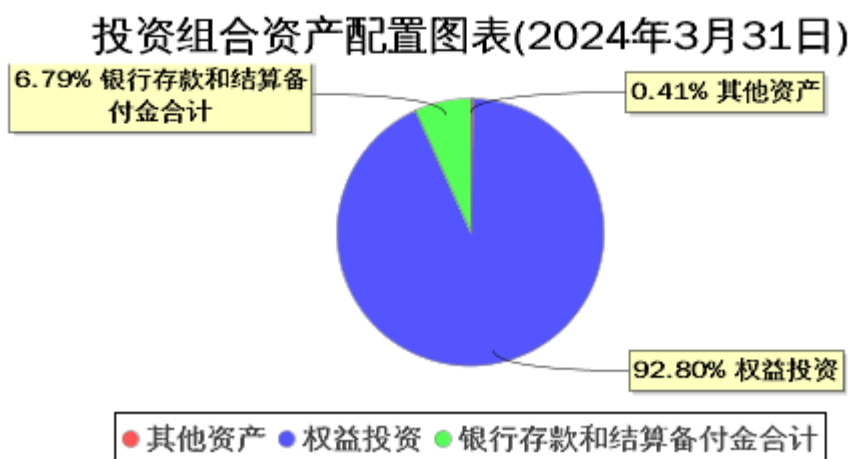
（一）投资目标与投资策略

投资目标	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。 本基金力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在 8% 以内。
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、存托凭证、债券、权证、股指期货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（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（包括公告等）后，可以将其纳入投资范围。 本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；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率不低于基金资产净值的5%。
主要投资策略	<p>本基金利用量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。</p> <p>1、比较基准的标的指数：本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深300指数</p> <p>2、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略：本基金利用定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在严格控制组合预期跟踪误差的基础上，力求超越标的指数投资回报。一般情况下，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的85%。</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（5）投资组合的调整</p> <p>3、存托凭证投资策略 4、债券投资策略 5、金融衍生工具投资策略 6、融资融券和转融资转融券</p>
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+2.5%（指年收益率，评价时按期间折算）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金

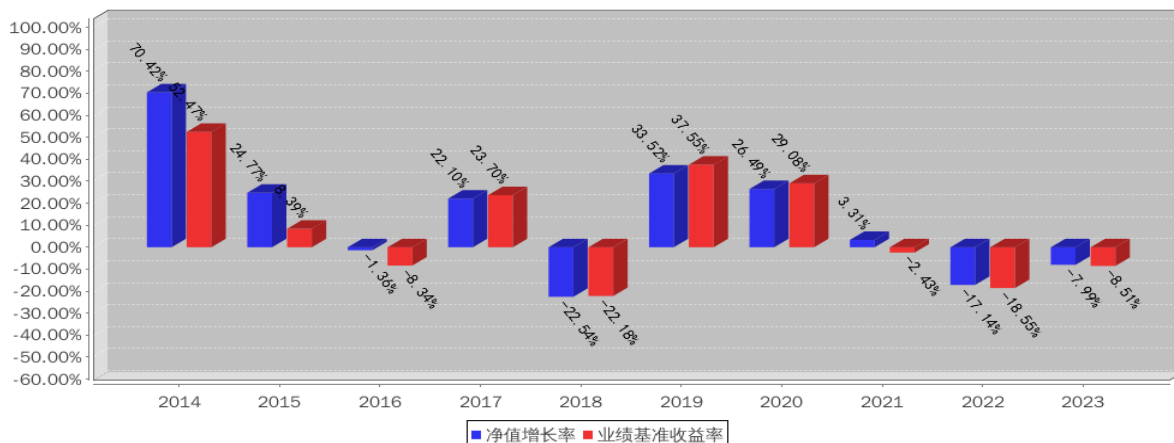
注：详见《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金招募说明书》第十部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

华泰柏瑞量化增强混合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（2023年12月31日）



注：业绩表现截止日期 2023 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	1.2%
	1,000,000 ≤ M < 3,000,000	0.8%
	3,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.4%
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔
赎回费	N < 7 天	1.5%
	7 天 ≤ N < 365 天	0.5%
	365 天 ≤ N < 730 天	0.25%
	N ≥ 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/年费率或金额	收取方
管理费	1%	基金管理人和销售机构
托管费	0.2%	基金托管人
审计费用	100,000.00 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：

华泰柏瑞量化增强混合 A

基金运作综合费率（年化）
1.22%

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。

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、其它风险、特有风险和投资科创板风险。

（一）投资组合风险（二）管理风险（三）投资合规性风险（四）其它风险

（五）本基金的特有风险

本基金的特有风险是在投资风格上的风险暴露。由于本基金的投资组合比例中，股票资产占基金资产的 60%—95%。在该投资范围的指引下，本基金利用量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。可见，本基金的特有风险是基准的波动风险和跟踪误差风险，同时本基金也存在一定的模型风险，即模型误差导致的风险。

（六）基金投资科创板风险

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

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。

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]

《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金基金合同》、
《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金托管协议》、
《华泰柏瑞量化增强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