

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（A 类份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 22 日

送出日期：2024 年 6 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	华泰柏瑞中证 500ETF 联接	基金代码	001214
下属基金简称	华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A	下属基金交易代码	001214
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	2015 年 5 月 13 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	柳军	开始担任本基金基金经理的日期	2015 年 5 月 13 日
		证券从业日期	2001 年 5 月 25 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

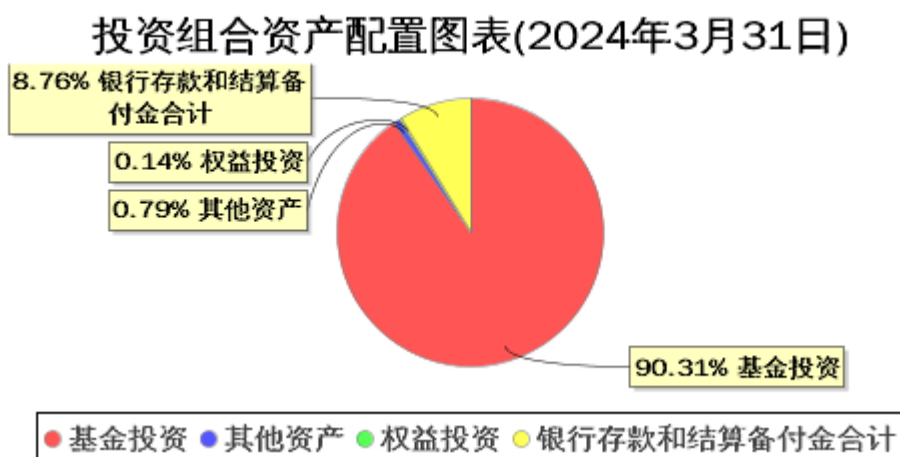
（一）投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	<p>本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、存托凭证、债券（包括国债、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、权证、股指期货、货币市场工具以及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的相关规定）。</p> <p>正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；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）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。</p> <p>本基金的标的指数为中证 500 指数。</p>

<p>主要投资策略</p>	<p>在正常市场情况下，本基金与业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>本基金为华泰柏瑞中证 500ETF 的联接基金。华泰柏瑞中证 500ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞中证 500ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>95%*中证 500 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为中证 500ETF 的联接基金，采用主要投资于华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p>

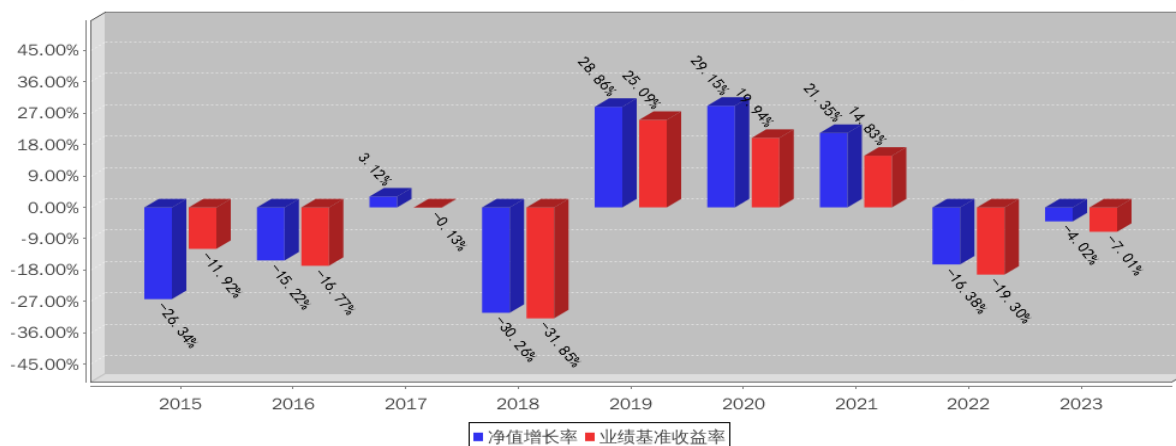
注：详见《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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

华泰柏瑞中证500ETF联接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	1.0%
	1,000,000≤M<5,000,000	0.6%
	M≥5,000,000	1,000 元/笔
赎回费	N<7 天	1.5%
	7 天≤N<365 天	0.25%
	365 天≤N<730 天	0.10%
	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	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	55,000.00 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。

3. 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。

（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：

华泰柏瑞中证 500ETF 联接 A

基金运作综合费率（年化）
0.27%

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。本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费、托管费，基金财产实际承担的基金运作综合费率可能低于上述测算值。

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、投资的合规性风险以及其他风险。

作为一只股票指数联接型基金，本基金特有的风险主要包括被动跟踪指数的风险，主要表现在以下几方面：1、指数下跌风险；2、目标 ETF 的风险；3、标的指数的风险；4、跟踪偏离风险。本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险。

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]

《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、

《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》、

《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》

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