华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金对冲策略执行情况公告

公告送出日期:2020 年 6 月 10 日

1.公告基本信息

基金名称 华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

基金简称 华泰柏瑞量化绝对收益混合

基金主代码 001073

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2015 年 6 月 29 日

基金管理人名称 华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人名称 中国建设银行股份有限公司

基金注册登记机构名称 华泰柏瑞基金管理有限公司

公告依据 《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》以及《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书》

2.对冲策略执行情况说明

投资策略 在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等多种策略对冲投资组合的市场风险，以求获得不依赖市场整体走向的比较稳定的长期资产增值。

对冲策略的限制 本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围为 80%-120%。

对冲策略的执行情况 本基金管理人严格遵照合同约定，运用量化多因子选股模型构建股票现货组合，并在此基础上采用套保账户卖出相应股指期货合约对冲系统性风险，对冲比例在基金运作期间均符合相关要求，未发生基金投资策略与对冲策略发生偏离的情形。

股票资产的规模（单位：元） 674,304,984.33

股票资产占基金资产净值的比例 63.65%

运用股指期货进行对冲的空头合约市值（单位：元） 655,270,560.00

股指期货占基金资产净值的比例 61.86%

3.其它需要提示的事项

本公告仅对本基金对冲策略执行情况予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况，请登录本公司网站（www.huatai-pb.com）或拨打本公司客服电话 400-888-0001。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。公司在此提醒广大投资者，投资者应了解基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，投资者需自行负担。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2020 年 6 月 10 日