

# 华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金产 品资料概要更新

编制日期：2023年7月27日

送出日期：2023年8月10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	华泰紫金智能量化股票发起	基金代码	005502
下属基金简称	华泰紫金智能量化股票发起 A	下属基金代码	005502
	华泰紫金智能量化股票发起 C		014629
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2018-02-01		
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	毛甜	开始担任本基金基金经理的日期	2018-03-10
		证券从业日期	2010-07-12
	姚石	开始担任本基金基金经理的日期	2022-12-27
		证券从业日期	2015-11-02

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金通过量化选股模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单）、权证、资产支持证券、股指期货、国债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（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。

**主要投资策略**

本基金是一只采取主动管理投资模式的股票基金。在投资策略上，管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，然后充分利用量化模型，先将原始行业数据进行深层次的加工、计算，建立各个行业的分析逻辑，再通过模型构造，建立起因子分析框架，然后挖掘数据形成因子，通过因子拟合趋势，进行回溯和验证，从而挖掘出不同行业的敏感因子，提取合成不同行业的观察指标，结合管理人线下的研究进行行业配置和个券选择，构建合理的投资组合。

1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券类资产投资策略；4、中小企业私募债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、衍生品投资策略

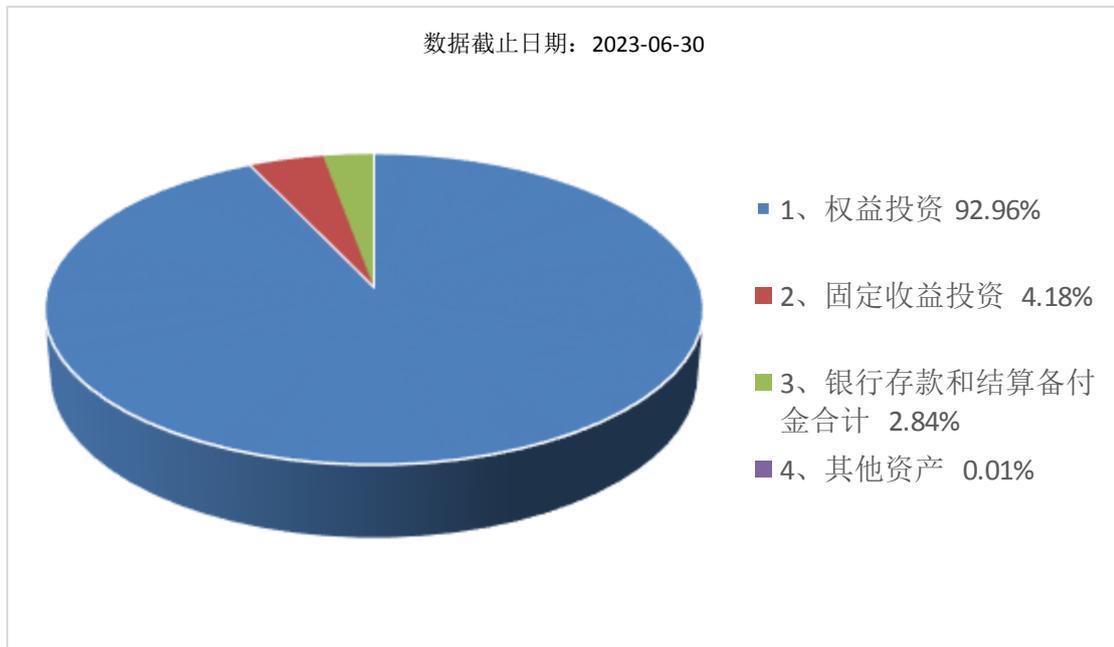
**业绩比较基准**

中证 800 指数收益率\*90%+上证国债指数收益率\*10%。

**风险收益特征**

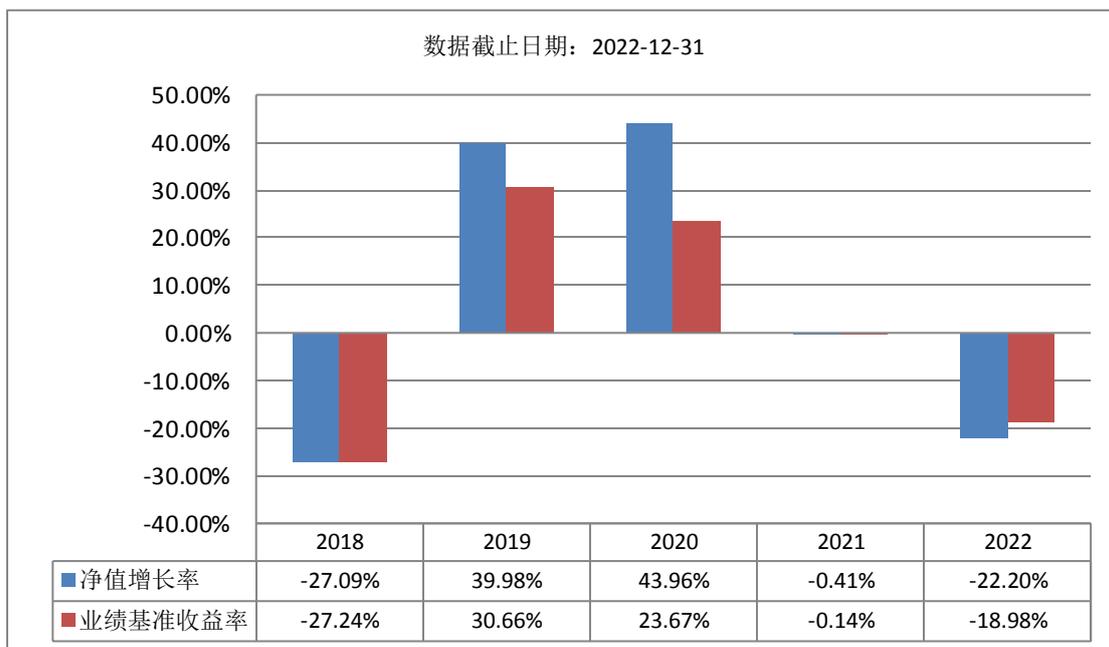
本基金为股票型基金。基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

**(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**

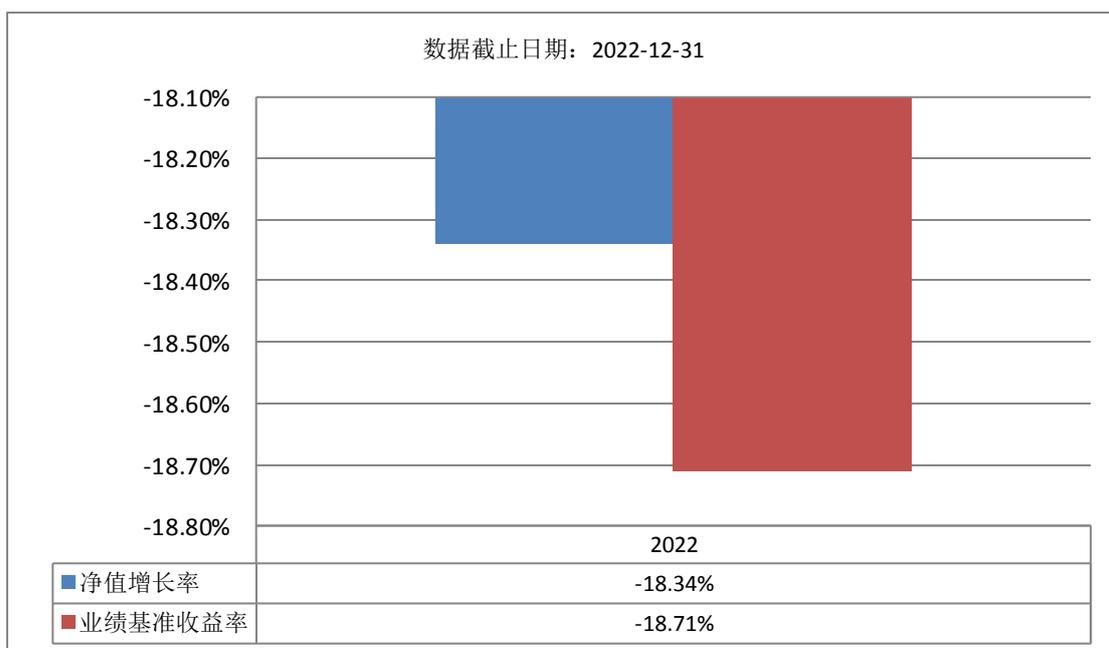


**(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图**

华泰紫金智能量化股票发起 A



### 华泰紫金智能量化股票发起 C



注：1、基金的过往业绩不代表未来表现；2、本基金成立于2018年2月1日，华泰紫金智能量化股票发起A的2018年数据非完整年度数据；3、华泰紫金智能量化股票发起C自2022年1月5日生效，2022年数据非完整年度数据。

## 三、投资本基金涉及的费用

### （一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

华泰紫金智能量化股票发起A

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）	M < 500 万元	1.50%
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔
赎回费	N < 7 日	1.50%
	7 日 ≤ N < 30 日	0.75%
	30 日 ≤ N < 1 年	0.50%
	1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
	N ≥ 2 年	0.00%

注：1年按365天计算。

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

华泰紫金智能量化股票发起C

费用类型	份额（S）或金额（M） /持有期限（N）	收费方式/费率	备注
赎回费	N < 7 日	1.50%	
	7 日 ≤ N < 30 日	0.50%	
	N ≥ 30 日	0.00%	

## （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	1.20%
托管费	0.25%
销售服务费（华泰紫金智 能量化股票发起C）	0.20%

注：本基金交易证券、基金（如有）等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 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。投资者可能损失投资本金。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。投资于本基金的主要风险有：

1、市场风险，主要包括：（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）利率风险；（4）通货膨胀风险；（5）再投资风险；（6）杠杆风险；（7）债券收益率曲线风险；2、信用风险；3、流动性风险；4、操作风险；5、管理风险；6、合规风险；7、本基金的特有风险：（1）采用量化模型构建投资组合，分别蕴含了数据风险、模型风险和编程风险；（2）股指期货等金融衍生品投资风险；（3）中小企业私募债券投资风险；（4）资产支持证券投资风险；（5）流通受限证券投资风险；（6）证券交易资金前端控制的风险。

### （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

以下资料详见基金管理人网站 <https://htamc.htsc.com.cn/>，客服电话：4008895597

基金合同、托管协议、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