

华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资  
基金  
2018年年度报告摘要

2018年12月31日

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

送出日期：2019年3月27日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰柏瑞生物医药混合
基金主代码	004905
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月16日
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
报告期末基金份额总额	143,563,062.21份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，把握生物医药相关的行业投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，依据市场不同表现，在大类资产中进行配置，把握生物医药的行业投资机会，保证整体投资业绩的持续性。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%
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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层及托管人住所

### § 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年8月16日(基金合同生效日)-2017年12月31日
本期已实现收益	33,666,934.57	4,022,163.72
本期利润	-1,697,198.84	28,934,061.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0103	0.0473
本期基金份额净值增长率	-12.01%	4.37%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0817	0.0066
期末基金资产净值	131,836,795.31	466,674,528.50
期末基金份额净值	0.9183	1.0437

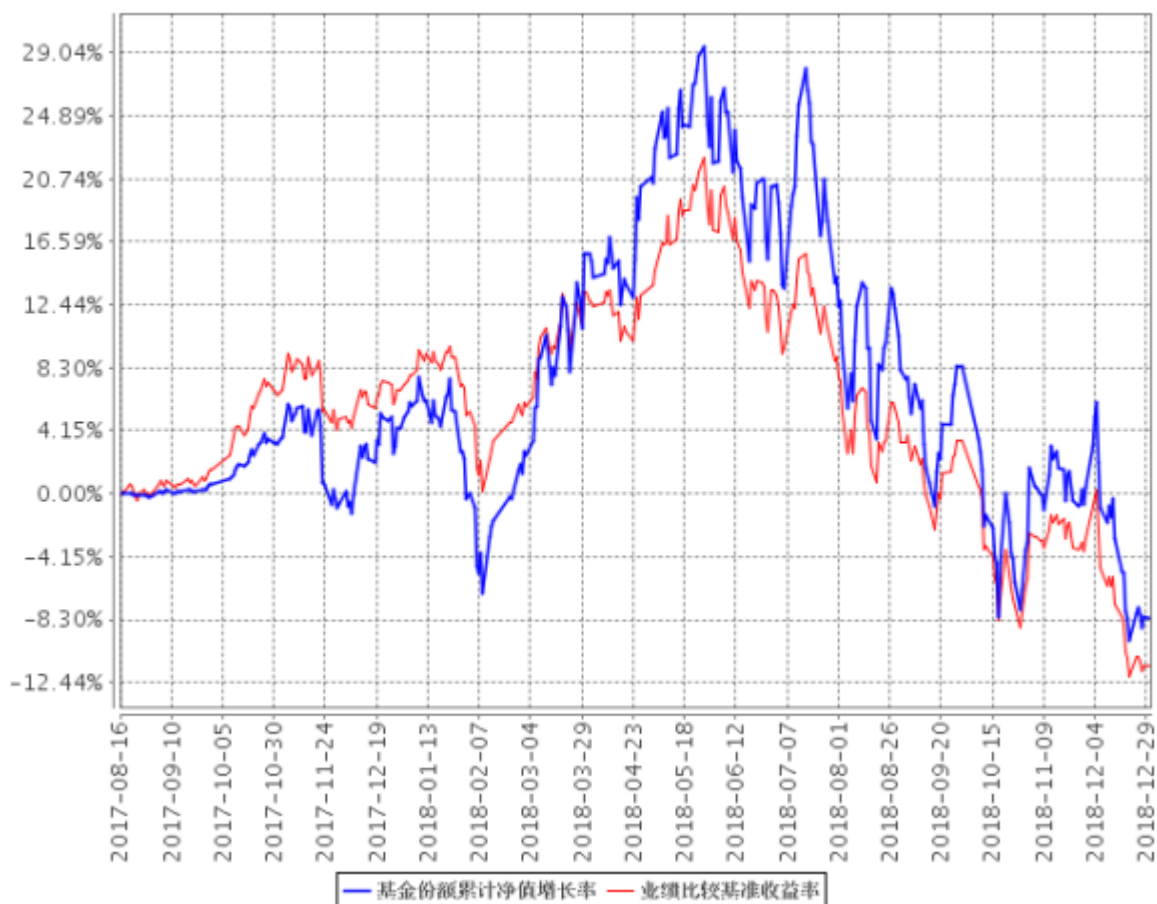
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-15.29%	1.95%	-14.28%	1.33%	-1.01%	0.62%
过去六个月	-23.63%	1.98%	-21.84%	1.27%	-1.79%	0.71%
过去一年	-12.01%	1.86%	-17.03%	1.18%	5.02%	0.68%
自基金合同生效起至今	-8.17%	1.64%	-11.32%	1.06%	3.15%	0.58%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

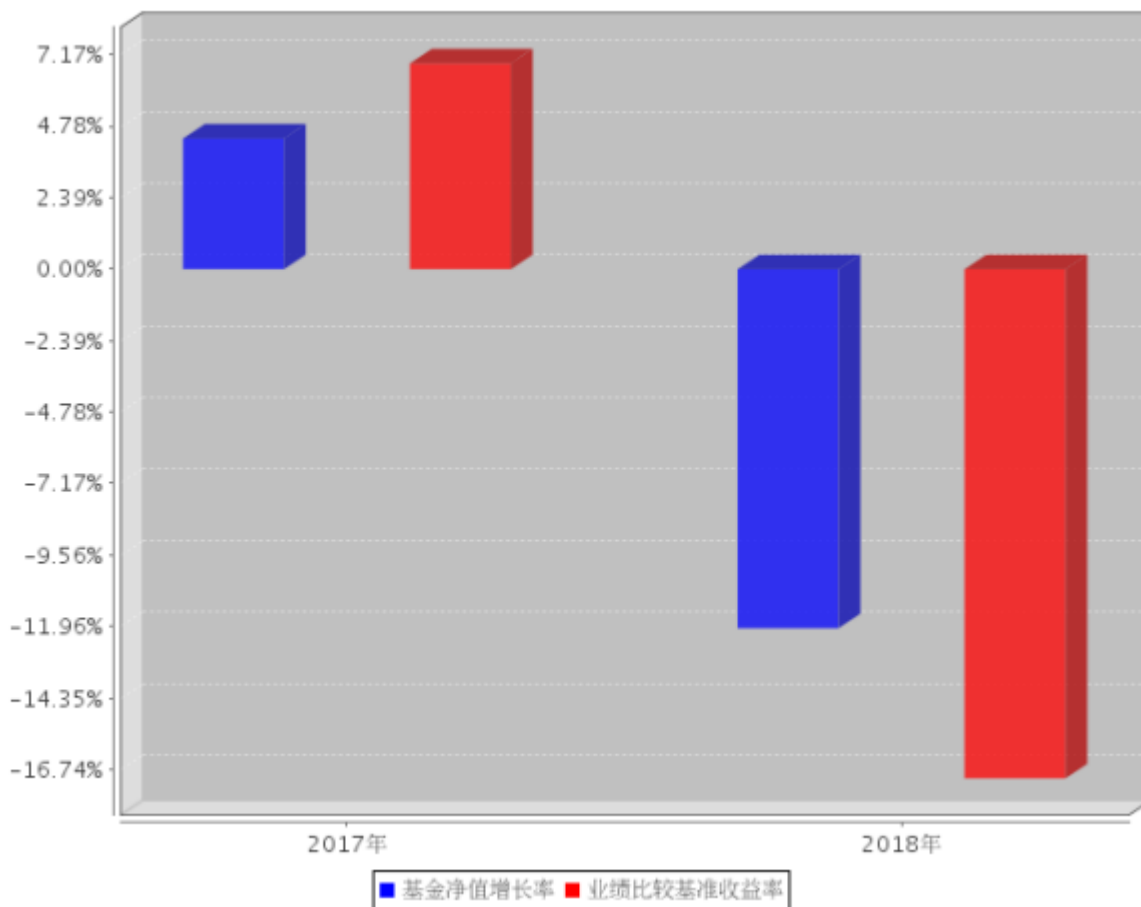
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为日为2017年8月16日至2018年12月31日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效日为2017年8月16日，2017年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金、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、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选30灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵

活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞MSCI中国A股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金。

截至2018年12月31日，公司基金管理规模为980.05亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐晓杰	本基金的基金经理	2017年8月16日	-	12年	博士研究生，12年证券（基金）从业经历。2006年7月至2007年9月任邦联资产管理有限公司研究员；2007年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014年4月至2015年5月任研究部总监助理。2015年5月至2018年5月任华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月至2018年5月任华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年10月起任华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年8月起任华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年6月起任华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金的基金经理。2018年8月起任华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金的基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金



的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量5%的同日反向交易共1次，系基于公司基本面分析买入。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年中国经济增长稳健，全年GDP增速6.6%。12月全国制造业PMI为49.4%，降至荣枯线以下。12月CPI同比降至1.9%，环比持平；12月PPI同比降至0.9%，环比下降1%。

A股市场18年整体表现较差。

本基金为医药行业基金，申万医药行业指数18年下跌27.16%，在18年下半年表现相对较差。18年全年，本基金净值下跌12.01%。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9183元；本报告期基金份额净值增长率为-12.01%，业绩比较基准收益率为-17.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

18年全年市场整体表现相对较差，本基金重点持仓了医药行业，四季度跌幅较大，表现较差。从长期来看，我们看好医药行业在深化医疗制度改革的大背景下带来的优秀企业的投资机会。同时我们也在思考由于政策推进力度的超预期使得行业变革将加速，在加快变革的过程中，我们更要精挑细选具备核心竞争优势，能够持续胜出的企业。我们希望能够与优秀的企业共成长，见证中国医药企业由小到大，区域性成长为全国性，国内领先做到全球标准，从优秀到卓越的整个历程。我们也坚信必定有这样的优秀企业带领中国的医药行业进入到更规范、更有竞争力的生态环境。

医药行业投资策略上，19年我们继续看好创新药企业的长期发展空间，长期看好政策影响相对较小的医疗服务类相关公司，同时我们也看好各细分行业的龙头公司。基金操作上，我们仍将精选个股以追求绝对收益；更加灵活控制仓位以降低系统性风险；进行合理资产配置以实现更好的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多12次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满3个月，收益可不分配。截止本报告期末，本基金可分配收益为24521378.48。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第21836号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人；
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞生物医药基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞生物医药基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞生物医药基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞生物医药基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞生物医药基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞生物医药基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞生物医药基金的财务报告过</p>

	程。
--	----

<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰柏瑞生物医药基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞生物医药基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>

注册会计师的姓名	单峰	曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼	
审计报告日期	2019年3月26日	



## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	16,034,469.20	21,751,731.08
结算备付金		348,026.01	2,859,942.07
存出保证金		103,898.92	268,437.33
交易性金融资产	7.4.7.2	116,767,705.83	447,707,012.08
其中：股票投资		116,767,705.83	437,713,012.08
基金投资		-	-
债券投资		-	9,994,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,860,026.94	2,098,937.32
应收利息	7.4.7.5	5,985.72	321,543.18
应收股利		-	-
应收申购款		24,138.08	46,720.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		135,144,250.70	475,054,323.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,355,161.53	618,981.75
应付赎回款		130,842.73	6,346,960.16
应付管理人报酬		173,949.74	632,848.44
应付托管费		28,991.62	105,474.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	258,198.73	477,629.11
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	360,311.04	197,901.07
负债合计		3,307,455.39	8,379,795.25

<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	143,563,062.21	447,129,909.55
未分配利润	7.4.7.10	-11,726,266.90	19,544,618.95
所有者权益合计		131,836,795.31	466,674,528.50
负债和所有者权益总计		135,144,250.70	475,054,323.75

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.9183元，基金份额总额143,563,062.21份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年8月16日(基金 合同生效日)至2017 年12月31日
<b>一、收入</b>		4,358,679.56	33,955,948.49
1. 利息收入		248,463.36	4,945,240.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	143,104.46	517,317.86
债券利息收入		105,358.90	111,133.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	4,316,789.99
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		38,134,707.36	3,164,513.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	37,352,386.68	3,145,333.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-19,560.00	19,179.90
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-

股利收益	7.4.7.16	801,880.68	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-35,364,133.41	24,911,897.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,339,642.25	934,296.97
<b>减：二、费用</b>		6,055,878.40	5,021,887.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,686,216.11	3,507,748.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	447,702.73	584,624.64
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,509,755.83	731,260.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	412,203.73	198,254.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,697,198.84	28,934,061.34
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,697,198.84	28,934,061.34

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	447,129,909.55	19,544,618.95	466,674,528.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-1,697,198.84	-1,697,198.84

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-303,566,847.34	-29,573,687.01	-333,140,534.35
其中: 1. 基金申购款	175,012,949.42	22,227,222.04	197,240,171.46
2. 基金赎回款	-478,579,796.76	-51,800,909.05	-530,380,705.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	143,563,062.21	-11,726,266.90	131,836,795.31
项目	上年度可比期间 2017年8月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	711,836,300.57	-	711,836,300.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,934,061.34	28,934,061.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-264,706,391.02	-9,389,442.39	-274,095,833.41
其中: 1. 基金申购款	14,695,219.65	492,814.57	15,188,034.22
2. 基金赎回款	-279,401,610.67	-9,882,256.96	-289,283,867.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	447,129,909.55	19,544,618.95	466,674,528.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____ 韩勇 _____	_____ 房伟力 _____	_____ 赵景云 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1070号关于准予华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本

基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币711,516,247.23元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第796号验资报告予以验证。

经向中国证监会备案，《华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年8月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为711,836,300.57份基金份额，其中认购资金利息折合320,053.34份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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)。本基金还可以在条件允许的情况下在履行适当的程序后参与融资业务。本基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例占基金资产的0-95%，其中投资于生物医药主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终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%。本基金的业绩比较基准为中证医药卫生指数收益率\*70%+上证国债指数收益率\*30%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2019年3月26日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华

泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的



市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)

的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
PineBridgeInvestmentLLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、基金销售机构
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年8月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	74,611,493.04	4.79%	-	-

##### 7.4.8.1.2 权证交易

注：无。

### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	67,993.37	4.75%	25,855.21	10.01%
关联方名称	上年度可比期间 2017年8月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年8月16日(基金合同生效日) 至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,686,216.11
其中：支付销售机构的客户维护费	1,422,479.28	2,378,195.71

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年8月16日(基金合同生效日) 至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	447,702.73

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年8月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	16,034,469.20	130,280.79	21,751,731.08	400,050.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

-

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金截至2017年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.9.1.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为116,767,705.83元，无属于第二或第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次437,596,827.08元，第二层次10,110,185.00元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	116,767,705.83	86.40
	其中：股票	116,767,705.83	86.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,382,495.21	12.12
8	其他各项资产	1,994,049.66	1.48
9	合计	135,144,250.70	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	84,366,599.52	63.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,281,707.68	10.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	85,680.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,033,718.63	14.44
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	116,767,705.83	88.57

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未投资港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300760	迈瑞医疗	83,000	9,065,260.00	6.88
2	002821	凯莱英	130,559	8,858,428.15	6.72
3	000661	长春高新	45,300	7,927,500.00	6.01
4	600763	通策医疗	166,989	7,926,967.83	6.01
5	300347	泰格医药	138,162	5,906,425.50	4.48
6	300595	欧普康视	140,000	5,423,600.00	4.11
7	300015	爱尔眼科	197,731	5,200,325.30	3.94
8	600276	恒瑞医药	98,200	5,180,050.00	3.93
9	600436	片仔癀	45,500	3,942,575.00	2.99
10	600511	国药股份	154,300	3,587,475.00	2.72

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www. Huatai-pb. com网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300122	智飞生物	25,653,209.95	5.50
2	300347	泰格医药	24,654,849.32	5.28
3	000661	长春高新	20,367,777.05	4.36
4	002821	凯莱英	20,129,119.00	4.31
5	600276	恒瑞医药	19,783,831.45	4.24
6	600436	片仔癀	17,493,233.28	3.75
7	002044	美年健康	17,184,417.16	3.68
8	300003	乐普医疗	16,511,643.75	3.54
9	603939	益丰药房	15,760,485.74	3.38
10	603883	老百姓	15,360,524.00	3.29
11	002727	一心堂	14,811,511.34	3.17
12	002422	科伦药业	14,579,642.00	3.12

13	002007	华兰生物	14,484,705.63	3.10
14	600763	通策医疗	13,788,345.00	2.95
15	300298	三诺生物	13,385,855.99	2.87
16	300015	爱尔眼科	12,396,882.00	2.66
17	300326	凯利泰	12,160,511.16	2.61
18	601607	上海医药	12,155,236.75	2.60
19	300529	健帆生物	11,187,387.00	2.40
20	600521	华海药业	10,000,694.25	2.14
21	000963	华东医药	9,873,482.89	2.12
22	600196	复星医药	9,732,358.00	2.09
23	300630	普利制药	9,689,234.00	2.08
24	603387	基蛋生物	9,660,757.80	2.07
25	002462	嘉事堂	9,472,308.00	2.03
26	300760	迈瑞医疗	9,389,905.08	2.01

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	49,184,618.15	10.54
2	600521	华海药业	39,461,908.60	8.46
3	600196	复星医药	34,891,273.30	7.48
4	600056	中国医药	32,616,374.51	6.99
5	000661	长春高新	31,956,903.68	6.85
6	600867	通化东宝	26,470,090.93	5.67
7	600062	华润双鹤	26,369,787.73	5.65
8	002044	美年健康	25,729,491.32	5.51
9	300347	泰格医药	24,604,813.27	5.27
10	000513	丽珠集团	23,541,971.07	5.04
11	300122	智飞生物	21,917,536.40	4.70
12	603883	老百姓	21,359,813.28	4.58
13	600566	济川药业	21,249,941.94	4.55
14	300015	爱尔眼科	20,282,111.32	4.35
15	600436	片仔癀	18,044,955.92	3.87
16	603233	大参林	17,969,425.40	3.85
17	603707	健友股份	17,492,921.97	3.75

18	300003	乐普医疗	16,966,201.60	3.64
19	000538	云南白药	15,751,216.73	3.38
20	603658	安图生物	15,643,444.59	3.35
21	002223	鱼跃医疗	15,509,356.34	3.32
22	600585	海螺水泥	14,915,569.00	3.20
23	002007	华兰生物	14,622,421.00	3.13
24	603939	益丰药房	14,587,933.10	3.13
25	300298	三诺生物	14,304,108.28	3.07
26	002727	一心堂	13,166,831.90	2.82
27	600703	三安光电	12,624,807.80	2.71
28	002821	凯莱英	11,202,360.20	2.40
29	300630	普利制药	11,146,361.48	2.39
30	601607	上海医药	11,063,258.30	2.37
31	002422	科伦药业	10,518,721.09	2.25
32	300326	凯利泰	10,287,186.52	2.20
33	603387	基蛋生物	10,225,061.70	2.19
34	000786	北新建材	9,922,115.57	2.13
35	601398	工商银行	9,800,727.65	2.10
36	300529	健帆生物	9,409,957.50	2.02

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	617,836,404.51
卖出股票收入（成交）总额	940,771,944.03

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	103,898.92
2	应收证券清算款	1,860,026.94
3	应收股利	-
4	应收利息	5,985.72
5	应收申购款	24,138.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,994,049.66

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,264	33,668.64	38,627,793.06	26.91%	104,935,269.15	73.09%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	250,942.28	0.1748%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年8月16日）基金份额总额	711,836,300.57
本报告期期初基金份额总额	447,129,909.55
本报告期期间基金总申购份额	175,012,949.42
减:本报告期期间基金总赎回份额	478,579,796.76
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	143,563,062.21

## § 11重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，2018年8月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2018年8月20日，公司任命李晓西先生为公司副总经理，李晓西先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为62000元人民币，该事务所已向本基金提供了2年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	382,722,187.05	24.59%	352,489.48	24.63%	-
兴业证券	2	142,137,993.88	9.13%	127,579.11	8.92%	-
海通证券	2	120,855,024.50	7.76%	111,028.73	7.76%	-
华安证券	2	116,082,116.30	7.46%	108,107.42	7.56%	-
长江证券	1	92,564,714.65	5.95%	86,205.34	6.02%	-
华泰证券	2	74,611,493.04	4.79%	67,993.37	4.75%	-



银河证券	1	66,853,002.09	4.30%	62,261.17	4.35%	-
华鑫证券	1	66,409,960.09	4.27%	60,519.43	4.23%	-
瑞银证券	2	63,506,556.30	4.08%	57,987.82	4.05%	-
光大证券	2	58,798,340.30	3.78%	53,874.20	3.76%	-
西藏东方财富	2	48,286,191.49	3.10%	44,130.32	3.08%	-
国都证券	1	43,540,800.56	2.80%	40,548.71	2.83%	-
东方证券	3	38,887,449.68	2.50%	35,438.19	2.48%	-
齐鲁证券	1	37,792,743.90	2.43%	35,196.16	2.46%	-
安信证券	2	32,755,871.80	2.10%	30,505.24	2.13%	-
中信建投	2	29,683,213.43	1.91%	27,084.69	1.89%	-
中银国际	3	26,936,325.46	1.73%	25,086.14	1.75%	-
万联证券	1	21,808,660.49	1.40%	19,874.31	1.39%	-
民生证券	1	15,347,929.55	0.99%	13,986.53	0.98%	-
国泰君安	1	14,257,298.04	0.92%	13,277.77	0.93%	-
西南证券	1	13,719,747.21	0.88%	12,777.14	0.89%	-
新时代证券	1	12,994,841.39	0.83%	11,842.54	0.83%	-
恒泰证券	1	9,713,660.50	0.62%	9,046.37	0.63%	-
国元证券	1	8,960,317.00	0.58%	8,344.63	0.58%	-
华创证券	1	8,767,599.02	0.56%	7,989.92	0.56%	-
中投证券	1	5,120,869.60	0.33%	4,666.65	0.33%	-
华融证券	1	3,384,502.00	0.22%	3,084.36	0.22%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

华安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180920-20181231	0.00	34,479,104.05	0.00	34,479,104.05	24%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019年3月27日