

重要提示

基金管理人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责任。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。基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。本报告自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金名称 (华泰柏瑞医疗健康), 场内简称, 基金代码 (005895), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2018-06-25), 报告期末基金总份额 (242,181,996.38), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人 (华泰柏瑞基金管理有限公司), 基金托管人 (中国建设银行股份有限公司).

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31). Includes 本期已实现收益 (29,409,846.18), 本期利润 (89,073,606.82), 加权平均基金份额本期利润 (0.3128), 期末基金资产净值 (279,202,415.76), 期末基金份额净值 (1.1529).

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 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. Includes 过去三个月 (36.96%, 1.70%, 18.48%, 1.15%, 18.48%, 0.55%).

本基金报告期内净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1、图示日期为2018年6月25日至2019年3月31日。2、按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告期末本基金的资产配置比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 and 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31). Includes 其他指标 (报告期 (2019-03-31)).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes 徐晓杰 (华泰柏瑞基金基金经理, 2018-06-25, 13年).

管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的投资运作符合法律法规以及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况 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，通过科学完善的制度和流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程确保公平对待不投资组合。其次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，在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块，确保公平交易的实现。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和评估分析。 报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

异常交易行为的专项说明 报告期内未发现本基金存在异常交易行为；本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度中国经济增长企稳，通胀温和，19年1-2月，规模以上工业企业营业收入同比增长3.3%，2019年3月中国制造业PMI为50.8%，前值49.6%，略超预期。2月CPI同比降1.5%；2月PPI同比降0.1%，环比下降0.4%，通胀仍处第一季度整体表现良好，2019年一季度，上证指数涨23.93%，沪深300上涨28.62%，创业板涨35.43%。本基金为医药行业基金，申万医药行业指数19年一季度上涨31.47%，表现相对较好。19年一季度市场整体表现较好，本基金重点持仓了医药行业，一季度表现相对较好。从长期来看，我们看好医药行业在深化医疗体制改革的大背景下带来的优秀企业的投资机会。同时我们在思考由于政策倒逼下度的持续提升使得行业变革将加速。在快速变革的过程中，我们要提前挖掘具备核心竞争优势、能够持续创新的企业。我们希望能够与优秀的企业共同成长。更证中国药企由小而大、区域性药企为全国性的企业，从低毛利向高毛利转型。我们也坚信必定有这样的优秀企业带领中国医药行业进入大发展期。更有竞争力的生态环境，医药行业投资策略上，19年我们持续关注创新药企的长期发展空间。国内看好政策影响相对较小的医疗服务类相关企业，同时我们也看好各细分行业的龙头企业。基金操作上，我们仍精选个股以追求绝对收益，更加灵活控制仓位以规避系统性风险；进行资产配置以实现更好的收益。

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1.1529元，基金份额净值增长36.96%，本基金的业绩比较基准增长18.48%。

报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Includes 权益类投资 (253,549,424.42), 固定收益投资 (10,003,000.00), 资产支持证券, 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计 (12,187,697.00), 其他资产 (8,243,127.16), 合计 (283,953,248.58).

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 农、林、牧、渔业, 采矿业, 制造业 (177,762,222.95), 电力、热力、燃气及水生产和供应业, 建筑业, 批发和零售业 (26,372,200.94), 交通运输、仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息传输、软件和信息技术服务业 (32,902.94), 金融业 (134,343.00), 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业 (2,489,572.89), 水利、环境和公共设施管理业, 居民服务、修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作 (46,758,181.70), 文化、体育和娱乐业, 综合, 合计 (253,549,424.42).

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 4 columns: 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes A 基础材料, B 消费品-必需品, C 消费品-消费品, D 能源, E 金融, F 医疗保健, G 工业, H 信息技术, I 电信服务, J 公用事业, K 房地产.

报告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

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量 (股), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 000661 (长春高新), 600763 (通策医疗), 300347 (泰格医药), 002821 (凯莱英), 300630 (普利制药), 600438 (片仔癀), 300725 (药石科技), 300595 (欧普康视), 600276 (恒瑞医药), 002727 (一心堂).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 国家债券, 央行票据, 金融债券 (10,003,000.00), 其中：政策性金融债 (10,003,000.00), 企业债券, 企业短期融资券, 中期票据, 可转债 (可交换债), 同业存单, 其他, 合计 (10,003,000.00).

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债券投资明细

Table with 6 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量 (张), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 160415 (16收发15).

报告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。

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。

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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未持有股指期货合约。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险说明. Includes 公允价值变动总额合计 (元), 公允价值变动本期收益 (元), 国债期货投资本期公允价值变动 (元).

本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

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国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险说明. Includes 公允价值变动总额合计 (元), 公允价值变动本期收益 (元), 国债期货投资本期公允价值变动 (元).

本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况 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情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库 基金投资的前十名股票，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额 (元). Includes 存出保证金 (231,692.72), 应收证券清算款 (7,322,986.42), 应收股利, 应收利息 (297,435.27), 应收申购款 (391,012.75), 其他应收款, 其他, 合计 (8,243,127.16).

报告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。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 注：截至本报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 数值. Includes 报告期初基金份额总额 (314,604,813.35), 报告期间基金总申购份额 (136,232,334.19), 减：报告期间基金总赎回份额 (206,655,151.14), 报告期间基金份额变动份额 (份额减少以“-”填列), 报告期末基金份额总额 (242,181,996.38).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目, 基金份额. Includes 报告期末管理人持有的本基金份额, 报告期间买入/申购的基金份额, 报告期间卖出/赎回的基金份额, 报告期末管理人持有的本基金份额, 报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Includes 合计.

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 5 columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限. Includes 基金管理人自有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金经理等人员, 基金管理人股东, 其他, 合计.

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

Table with 4 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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. Includes 机构 (20190313-20190331), 个人.

产品特有风险 本基金报告期内有一机构投资者持有基金份额超过20%的情形，如果这些份额持有比例较大的投资者发生赎回，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不利影响，同时可能产生大额赎回费用计入基金资产、基金份额净值波动幅度较大等问题，这些都可能造成基金资产净值的较大波动。（2）基金净值大幅波动的影响，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，这将对基金资产产生不利影响，同时可能产生大额赎回费用计入基金资产、基金份额净值波动幅度较大等问题。（3）基金投资项目偏离的风险，单一投资者大额赎回后可能导致基金资产规模过小，不能满足后续的条件，基金将面临投资方向调整、交易变现困难等风险，从而使基金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，不能满足后续的条件，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影响，同时持有流动性风险管理机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1. 本基金的中国证监会批准募集文件
2. 本基金的《基金合同》
3. 本基金的《招募说明书》
4. 本基金的《托管协议》
5. 基金管理人业务资格批复、营业执照
6. 本基金的公告

存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄正大五道口广场1号楼17层

查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司，客户服务电话：400-888-0001（免长话费）021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com