

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责任。
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4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中的财务数据未经审计。
本报告自2019年1月30日起至2019年3月31日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Rows include: 基金简称 (华泰柏瑞核心优势), 场内简称, 基金主代码 (006643), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2019-01-30), 报告期末基金份额总额 (64,830,658.22), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准 (沪深300指数收益率*60%+国债综合收益率*40%), 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 (中国银行股份有限公司).

主要财务指标

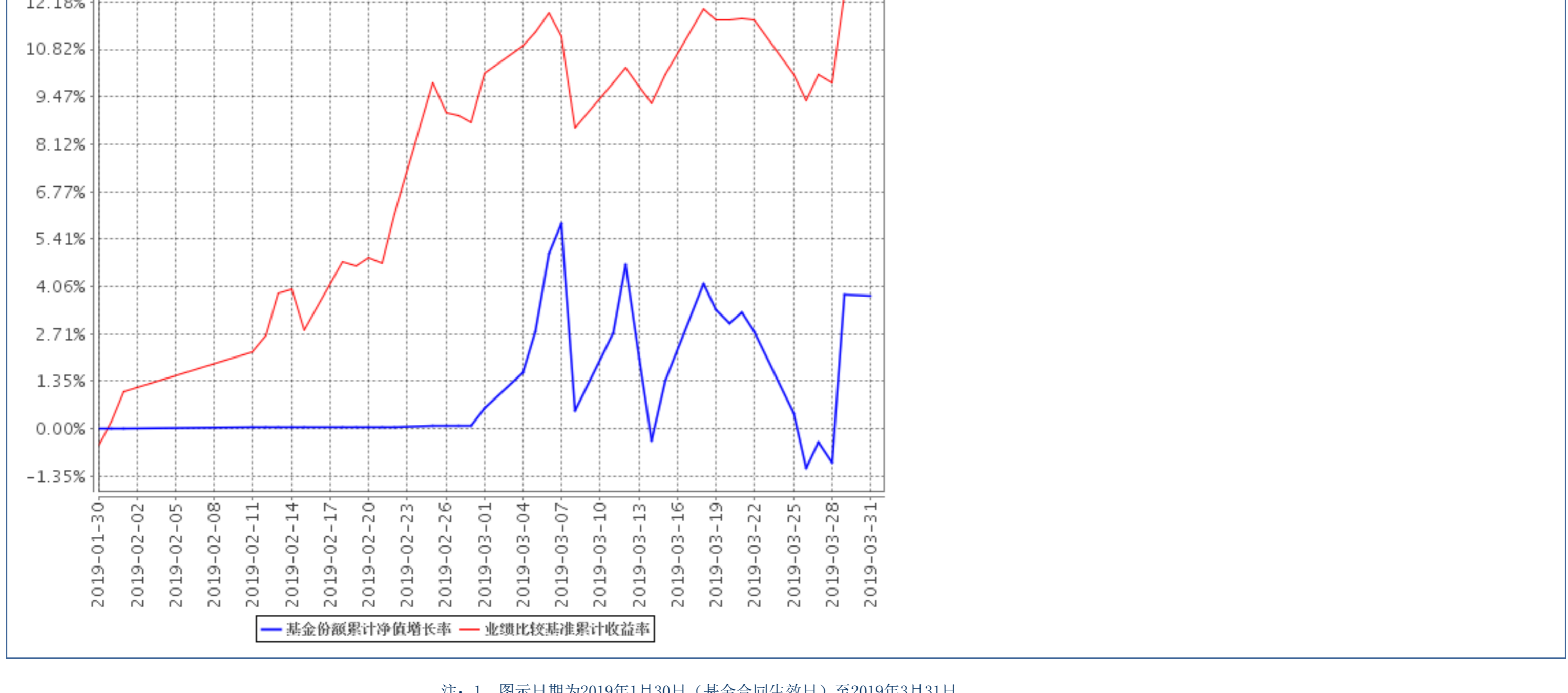
Table with columns: 主要财务指标, 报告期 (2019-01-30至2019-03-31), 单位: 人民币元. Rows include: 本期已实现收益 (1,539,011.89), 本期利润 (4,602,722.14), 加权平均基金份额本期利润 (0.0333), 期末基金资产净值 (67,295,968.37), 期末基金份额净值 (1.0386).

注：1、上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。
3、基金合同自2019年1月30日起生效。

基金净值表现

Table with 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. Rows include: 过去三个月 (3.80%, 1.59%, 12.42%, 1.06%, -8.62%, 0.53%).

自基金合同生效以来基金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
基金合同生效以来基金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



注：1、图示日期为2019年1月30日（基金合同生效日）至2019年3月31日。
2、本基金合同规定：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仍在建仓期。
3、自基金合同生效日起本报告期末不满一年。

其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-01-30至2019-03-31), 单位: 人民币元. Rows include: 其他指标, 报告期 (2019-01-30至2019-03-31).

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 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. Row for 方伦旭: 本基金的基金经理, 2019-01-30, 19年.

管理人对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相关法律法规、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的利益输送，首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

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%

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.038元，本报告期份额净值增长率为2.80%，同期业绩比较基准增长率为12.42%。

报告期内基金持有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 columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Rows include: 权益类投资 (60,340,671.89), 其中: 股票 (60,340,671.89), 固定收益投资 (199,920.00), 其中: 债券 (199,920.00), 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, 其中: 买断式回购的买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计 (10,731,893.84), 其他资产 (10,340.03), 合计 (71,282,825.67).

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include: A 农、林、牧、渔业, B 采矿业, C 制造业, 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, 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, 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, R 文化、体育和娱乐业, S 综合, 合计 (60,340,671.80).

Table with columns: 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include: A 基础材料, B 消费者非必需品, C 消费者必需品, D 金融, 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 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 (%). Rows include: 1 300498 润民股份, 2 600030 中信证券, 3 600857 海通证券, 4 000783 长江证券, 5 002032 苏泊尔, 6 300347 泰格医药, 7 601318 中国平安, 8 002110 三钢闽光, 9 000732 泰禾集团, 10 300166 东方财富.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include: 1 国家债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 4 企业债券, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债 (可交换债), 8 同业存单, 9 其他, 10 合计 (199,920.00).

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 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 (%). Row: 1 019611 19国债01, 2,000, 199,920.00, 0.30.

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

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
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
公允价值变动总额合计 (元) -
股指期货投资本期收益 (元) -
股指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

本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 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. Rows include: 国债期货投资总额合计 (元), 国债期货投资本期收益 (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

无。

投资组合报告附注

受到调查及处罚情况
报告期内本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，或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中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

Table with columns: 序号, 名称, 金额 (元). Rows include: 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他费用, 8 其他, 9 合计 (10,340.03).

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 columns: 项目, 数量. Rows include: 基金合同生效日的基金份额总额 (207,902,413.85), 基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额 (800,704.70), 减: 基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额 (143,872,460.33), 基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列), 报告期末基金份额总额 (64,830,658.22).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目, 基金份额. Rows include: 基金管理人持有本基金份额变动情况, 基金合同生效日起至报告期末基金管理人申购总份额, 基金合同生效日起至报告期末基金管理人赎回总份额, 报告期末基金管理人持有本基金份额, 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 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. Rows include: 合计.

报告期末发起式基金及持有份额情况

Table with 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. Rows include: 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人股东, 基金管理人职员, 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 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. Rows include: 机构, 个人.

产品特有风险
本基金报告期内有一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赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，对基金资产产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险；（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计入基金资产，基金份额净值出现数倍五入等现象，这些都可能导致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可能导致基金规模过小，不能满足持续的条件，基金将面临被赎回或暂停交易、交易所暂停交易等风险，从而使得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大额赎回，审慎评估大额赎回对基金持有集中度、影响，同时完善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. 本基金的基金合同
2. 本基金的招募说明书
3. 本基金的托管协议
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弄证大五道口广场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，客户服务热线：400-888-0001（免长话费）、021-3878 6638 公司网址：www.htab.com