

重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国建设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。

本报告中的财务资料未经审计。

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 columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金简称 (华泰柏瑞消费成长混合), 基金代码 (001099), 基金运作方式 (契约型开放式), etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 报告期 (2019-01-01 to 2019-03-31), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

注：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。

基金净值表现

本报告期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

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Std Dev), etc.

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



注：注：图示日期为2015年5月20日至2019年3月31日。

其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (2019-01-01 to 2019-03-31), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理日期 (Tenure), 证券从业年限 (Securities Industry Experience), 说明 (Remarks).

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法律法规、基金合同的规定，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。

异常交易行为的专项说明

报告期内，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%的日反向交易共1次。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度，沪深300指数上涨28.62%，中证500指数上涨33.1%，创业板指数上涨35.43%，本基金上涨33.25%。

2019年一季度，“贸易战”缓和，货币政策由紧到松，经济复苏预期发酵，A股触底反弹，从估值上看，A股估值水平依旧处于历史低位区域。

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1.110元，本报告期基金份额净值33.25%，同期本基金的业绩比较基准上涨28.08%。

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 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets).

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table with columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：注：本基金本报告期末持有港股投资股票。

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 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：注：本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：注：本基金本报告期末未持有债券。

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：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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metal Code), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量 (份) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：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：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

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

注：注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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

注：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 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Statement).

注：注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

其他资产构成

Table with columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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：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 (Item), 数量 (Quantity), 单位: 份 (Unit: Shares).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金份额 (Fund Shares), 单位: 份 (Unit: Shares).

注：注：无。

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 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Transaction Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in RMB Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

注：注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额总数 (Total Shares Issued), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Issued), 发起承诺锁定期限 (Lock-in Period).

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 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Start Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Shares), 份额占比 (Percentage of Shares).

注：注：本基金报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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件、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，也可按工本费购买复印件。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.htb.com