华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金报告2019年第1季度报告

2019-03-31

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2019-04-19

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 审计报告
§7 财务报表
§8 投资组合报告
§9 开放式基金份额变动
§10 重大事件揭示
§11 影响投资决策的其他重要信息
§12 备查文件目录

§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，但不保证本基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期2019年01月01日至2019年03月31日。

§2 基金简介

基金基本情况

项目	数据		
基金名称	华安中证细分医药ETF联接		
场内简称			
基金主代码	000273		
基金运作方式	契约型开放式		
成立日期	2014-12-28		
最新规模			42,481,888.20
投资目标	通过投资于标的ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。		
投资策略	本基金通过投资于标的指数成分股及其备选成分股，根据标的指数的组成成分股及权重，构建与标的指数收益特征相似的投资组合，以期获得与标的指数收益相似的回报。本基金可以投资于其他法律法规允许投资的证券品种，但投资规模应以满足标的ETF的投资目的为原则，在保证投资组合流动性的前提下，力争实现对标的指数的有效跟踪。本基金可以选择其他适合跟踪标的指数的证券品种进行投资。		
业绩比较基准	95%*中证细分医药产业指数收益率+5%*银行活期存款税后利息收益率		
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。		
基金管理人	华安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属两类基金的基金简称	华安中证细分医药ETF联接A	华安中证细分医药ETF联接C	
下属两类基金的场内简称			
下属两类基金的交易代码	000273	000274	
报告期末下属两类基金的份额总额	32,481,888.20[]	29,472,002.20[]	
下属两类基金的风险收益特征			

目标基金基本情况

基金名称	华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	515330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021-12-04
基金管理人名称	上海证券交易所
上市日期	2021-01-08
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用以下策略：一、指数成分股及其备选成分股的选取标准及流程 1、产业链相关的指数成分股及其备选成分股的选取标准 (1)、指数编制方法、本基金所跟踪的标的指数为中证细分医药产业指数，该指数编制方法为：以沪深证券交易所上市的医药产业相关上市公司证券为样本，以自由流通市值为权重，采用分层抽样方法编制而成。本基金将以指数成分股及权重为依据，按照证券市场实际情况，在充分考虑流动性、市场冲击成本、成交成本等因素的基础上，采用最优化方法确定投资组合的成分股及权重，以期获得与标的指数收益特征相似的投资组合。 2、成分股调整规则 (1)、指数成分股调整原则 中证指数公司定期对指数成分股进行调整，调整时间为每年的6月和12月的第一个交易日。 (2)、指数成分股调整方法 1、本基金将以指数成分股及其备选成分股的市值、流动性、行业代表性等因素为依据，对指数成分股及其备选成分股进行筛选，筛选时间为每年的6月和12月的第一个交易日。 2、本基金将以指数成分股及其备选成分股的市值、流动性、行业代表性等因素为依据，对指数成分股及其备选成分股进行筛选，筛选时间为每年的6月和12月的第一个交易日。 3、本基金将以指数成分股及其备选成分股的市值、流动性、行业代表性等因素为依据，对指数成分股及其备选成分股进行筛选，筛选时间为每年的6月和12月的第一个交易日。
业绩比较基准	中证细分医药产业指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种。风险收益特征高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

§3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	主基金(元)	华安中证细分医药ETF联接A(元) 2019-01-01 - 2019-03-31	华安中证细分医药ETF联接C(元) 2019-01-01 - 2019-03-31
本期已实现利益		-326,393.98	-443,414.20
本期利润		8,907,401.19	8,008,432.92
加权平均基金份额本期利润		0.2002	0.2717
期末基金资产净值		44,773,555.30	28,229,189.15
期末基金份额净值		1.3788	1.3918

注：1、利息收益金额指扣除不包括利息入应税或交易基金的各项费用（例如：回购成本摊销等）后的利息收益。本期利息收益：计入费用后实现的基金净额收益；计入费用后实现的基金净额亏损以“-”号填列。

2、本期已实现利益指本期利息收益、本期实现的投资收益、公允价值变动损益等扣除应计入当期的费用后的余额。本期利润为本期利息收益与本期已实现利益之和。

§4 管理人报告

基金净值表现

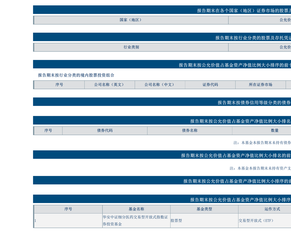
本期及最近三个月基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	27.98 %	1.48 %	28.92 %	1.72 %	-0.94 %	-0.25 %

本期及最近三个月基金份额净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	26.98 %	1.48 %	28.92 %	1.72 %	-1.95 %	-0.25 %

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较



自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-01-01至2019-03-31）
其他指标	报告期（2019-01-31）

注：此处的报告期为报告期内的最后一个完整的自然月，即自公告日为准，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。

管理人对报告期内本基金运作遵守有关法律法规情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同，积极谨慎管理本基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。不存在违法违规或未履行基金合同义务的情况。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度导则第1号》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，具体的试点期、开展试点期、开展常态化阶段的公平交易管理，投资决策、交易执行等方面各项制度的执行情况，报告期内，公司各投资组合的交易管理制度执行情况良好。

异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度导则第1号》，公司对日频监测模块进行参数设置，专项对日内、日间、周、月、季、年等时间维度，特别关注同向交易、反向交易、交易价差、成交量、成交金额、成交价格、成交时间、成交对手方、证券品种、投资组合、投资经理、交易方向、交易价格、交易数量