

华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金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：2019-04-20

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。
基金管理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18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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。
基金业绩表现并不构成对本基金未来表现的保证。投资者有风险，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。

本报告期末基金份额净值为1.357元。

本基金自2019年1月1日起至3月31日止。

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Rows include 基金简称, 场内简称, 基金主代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 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, 基金托管人, 下属基金的基金简称, 下属基金的场内简称, 下属基金的交易代码, 报告期末下属基金的份额总额, 下属基金的风险收益特征.

Table with 2 columns: 基金名称 and 基金代码. Rows include 基金名称, 基金主代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金份额上市的证券交易所, 上市日期, 基金管理人名称, 基金托管人名称.

Table with 2 columns: 投资目标 and 业绩比较基准. Rows include 投资目标, 业绩比较基准, 风险收益特征.

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 基金资产. Rows include 主要财务指标, 基金资产, 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

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（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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上期公允价值变动收益。

Table with 2 columns: 阶段 and 净值增长率. Rows include 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-②, ③-④.

Table with 2 columns: 阶段 and 净值增长率. Rows include 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-②, ③-④.

Table with 2 columns: 阶段 and 净值增长率. Rows include 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-②, ③-④.

Table with 2 columns: 阶段 and 净值增长率. Rows include 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-②, ③-④.

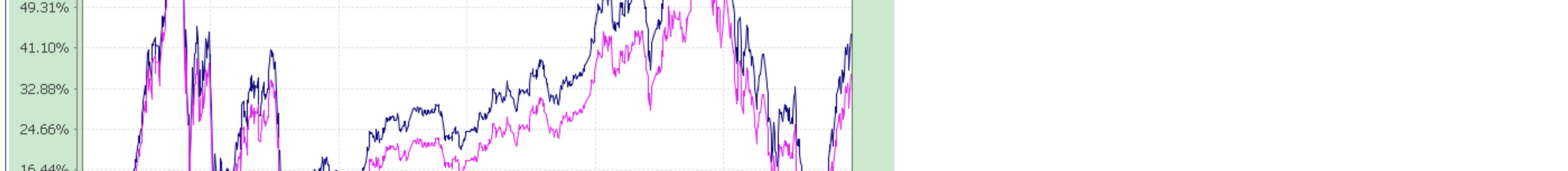
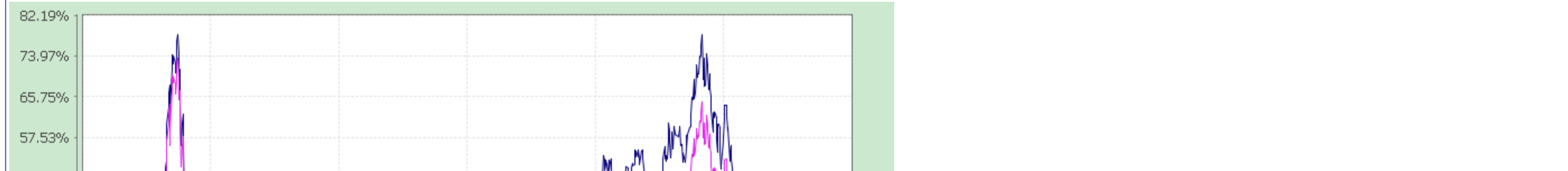


Table with 2 columns: 其他指标 and 报告期末. Rows include 其他指标, 报告期末 (2019-01-01至2019-03-31), 其他指标, 报告期末 (2019-03-31).

Table with 2 columns: 姓名 and 职务. Rows include 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明.

注：此处的任职日期和离任日期均指公告日期，即以公告为准。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。

管理人对本报告期内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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。

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指导意见》，公司合规稽核部按合同基金投资、交易部门制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间市场的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了系统的自动控制。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度，中证细分医药产业主题指数（代码：009814.SH）上涨29.49%，跑赢上证综指（23.93%）和沪深300指数（28.62%）。一季度受市场春季行情驱动，医药行业呈现较强的行业性，行业中竞争力较强的龙头企业和有创新能力的优质公司表现突出。

投资策略方面，本基金坚持“自上而下”的资产配置思路，在宏观政策宽松、流动性充裕、市场情绪乐观、利率下行、估值合理、业绩稳健的背景下，把握结构性机会，精选个股，重点配置医药行业中具有核心竞争力、成长性较好的优质上市公司。

截至2019年3月31日，华安中证细分医药ETF联接A份额净值为1.357元，份额净值为1.332元；华安中证细分医药ETF联接B份额净值为1.357元，份额净值为1.332元；华安中证细分医药ETF联接C份额净值为1.357元，份额净值为1.332元。

管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，基于前期货币宽松、宽财政力度较大，部分悲观预期有望改善，中美贸易摩擦有望阶段性缓和，A股市场成交量温和放大，风险偏好企稳回升，债市企稳、流动性充裕、估值合理、业绩稳健的背景下，把握结构性机会，精选个股，重点配置医药行业中具有核心竞争力、成长性较好的优质上市公司。

作为基金管理人，我们将坚持积极稳健的资产配置原则，降低跟踪误差和跟踪偏离度，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不在基金持有人人数少于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号 and 项目. Rows include 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

Table with 2 columns: 国家（地区） and 公允价值(元). Rows include 国家（地区）, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资分布

Table with 2 columns: 行业类别 and 公允价值(元). Rows include 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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及存托凭证投资明细

Table with 2 columns: 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 and 序号. Rows include 序号, 公司名称(英文), 公司名称(中文), 证券代码, 所在证券市场, 所属国家(地区), 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

报告期末按信用评级等级分类的债券投资组合

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 2 columns: 序号 and 债券名称. Rows include 序号, 债券名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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金融衍生品投资明细

Table with 2 columns: 序号 and 基金名称. Rows include 序号, 基金名称, 基金类型, 运作方式, 管理人, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

投资组合报告附注

受到调查及处罚情况

本报告期内，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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

基金投资的前十名股票是否存在超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

其他资产构成

Table with 2 columns: 序号 and 名称. Rows include 序号, 名称, 金额(元), 单位: 人民币元

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：本基金本报告期末未持有在流通受限情况的股票。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 and 基金资产. Rows include 项目, 基金资产, 报告期初基金份额总额, 报告期间基金份额申购总额, 报告期间基金份额赎回总额, 报告期间基金份额变动, 报告期末基金份额总额

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 and 基金资产. Rows include 项目, 基金资产, 报告期初持有人的基金份额, 报告期间买入/申购总份额, 报告期间卖出/赎回总份额, 报告期末持有人持有的基金份额, 报告期末持有人的基金份额占基金份额总额比例(%)

基金管理人运用固有资金投资交易明细

Table with 2 columns: 序号 and 交易方式. Rows include 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额(份), 交易金额(元), 适用费率

注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 2 columns: 项目 and 基金份额. Rows include 项目, 基金份额, 持有份额总数, 持有份额占基金份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金份额比例, 发起份额承诺持有期限

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 2 columns: 投资者类别 and 持有基金份额. Rows include 投资者类别, 持有基金份额, 期初份额, 申购份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

1. 《华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
2. 《华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
3. 《华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

存放地点

基金管理人及基金托管人的办公场所，并登录于基金管理人互联网网站http://www.huainan.com.cn。

查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网网站，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。