

华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十四日

- 重要提示
 - 重要提示

基金管理人的董事会、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法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

基金简称	华安中证细分医药ETF
场内简称	医药ETF
基金代码	012330
交易简称	医药ETF
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2015年12月24日
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
报告期末基金份额总额	69,747,309.00元
基金合同存续期	不定期
基金销售机构	上海浦东发展银行股份有限公司
上市日期	2016年11月24日

基金简称	华安中证细分医药ETF
场内简称	医药ETF
基金代码	012330
交易简称	医药ETF
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2015年12月24日
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
报告期末基金份额总额	69,747,309.00元
基金合同存续期	不定期
基金销售机构	上海浦东发展银行股份有限公司
上市日期	2016年11月24日

基金简称	华安中证细分医药ETF
场内简称	医药ETF
基金代码	012330
交易简称	医药ETF
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2015年12月24日
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
报告期末基金份额总额	69,747,309.00元
基金合同存续期	不定期
基金销售机构	上海浦东发展银行股份有限公司
上市日期	2016年11月24日

基金简称	华安中证细分医药ETF
场内简称	医药ETF
基金代码	012330
交易简称	医药ETF
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2015年12月24日
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
报告期末基金份额总额	69,747,309.00元
基金合同存续期	不定期
基金销售机构	上海浦东发展银行股份有限公司
上市日期	2016年11月24日

注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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。

2. 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可能低于所列数字。

3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现

的交易价格公允性进行审核,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时点予以交易价格分析。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不投资组合,在不同时间窗下(日、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 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》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、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同向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制,同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内,因组合间流动性管理或投资策略调整需要,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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%的次数为3次,未出现异常交易。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,医药行业表现亮眼,一度成为中信一级行业中涨幅最高的行业。虽然后来经历了几回调,医药行业的表现仍然优于市场的整体表现。医药行业的涨幅印证了我们年初的判断,即需求拉动医药行业的营业收入和净利润保持高速增长,医药行业的整体估值水平低于历史平均水平,医改政策支持医药行业健康发展,未来发展空间巨大。随着仿制药一致性评价、创新药评审审批加速等行业利好政策的影响,以及贸易战下其他板块的估值、医药作为避险领域,基金持仓比例有望继续提高。综合以上考虑,我们认为,医药行业在中长期内,仍然是一个比较理想的配置方向。

投资管理人,基金采取完全复制的管理方法跟踪指数,并利用量化工具进行精细化管理,从而控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年06月30日,本基金份额净值为1.71元,本报告期份额净值增长率为6.94%,同期业绩比较基准增长率为7.02%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在老龄化社会 and 消费升级的背景下,医药的需求巨大。目前,我国的医药支出占GDP的比重较高,很多制药业水平参差不齐,医药研发水平有待提高。在国家政策的大力推动下,基本小城市居民已经全面的纳入社保。同时,医改政策的推出,也将促进我国的医药审批制度与国际接轨。为了解决制药业水平参差不齐的问题,国家还在推行一致性评价。中国医药行业在一致性评价、创新药优先审评、两票制、支付方式改革等政策强力推动下,迎来行业去芜存菁的大分化,这一分化伴随着资本市场看好预期的变化,也将进一步反映在二级市场的价格分化上。未来,我们重点看好创新药及传统制药龙头、生物科技等细分行业龙头公司的表现。

作为基金管理人,我们将继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪偏离和跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人对于报告期内基金投资组合运作情况的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的规定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,负责在证券投资基金构成有严重影响证券价格的重大事件时,评估重大事件对投资品种价格的影响程度、评估对基金估值的影响程度,确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值;同时所采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成,具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内,中国建设银行履行受托人职责的情况说明

本报告期内,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

会计主体:华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元

单位:人民币元