华宝中证医疗指数分级证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018年8月24日

§1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月23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01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝中证医疗指数分级		
场内简称	医疗分级		
基金主代码	162412		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年5月21日		
基金管理人	华宝基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	444,378,346.30份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015年6月8日		
下属分级基金的基金简称	医疗A	医疗B	华宝中证医疗指数分级
下属分级基金场内简称:	医疗A	医疗B	医疗分级
下属分级基金的交易代码	150261	150262	162412
报告期末下属分级基金份额总额	69,237,627.00份	69,237,627.00份	305,903,092.30份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成分股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。 在标的指数成分股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成分股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成分股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。		
业绩比较基准	中证医疗指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。		
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	华宝医疗A份额具有较低风险、较盈利稳定的特征。	华宝医疗B份额具有较高风险、较高预期收益的特征。	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	王永民
	联系电话	021-38505888	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588,021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-32,900,507.80
本期利润	45,862,781.62
加权平均基金份额本期利润	0.1043
本期基金份额净值增长率	12.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1898
期末基金资产净值	440,512,992.84
期末基金份额净值	0.9913

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)

3.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。

4.期末可供分配利润采用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。

3.2 基金净值表现

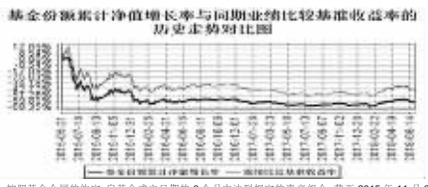
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-7.67%	2.08%	-7.48%	2.03%	-0.19%	0.05%
过去三个月	-1.51%	1.75%	-1.51%	1.72%	0.00%	0.03%
过去六个月	12.57%	1.67%	12.99%	1.63%	-0.42%	0.04%
过去一年	9.79%	1.44%	10.14%	1.42%	-0.35%	0.02%
过去三年	-48.24%	2.04%	-34.96%	1.98%	-13.28%	0.06%
自基金合同生效日起至今	-60.71%	2.10%	-42.75%	2.08%	-17.96%	0.02%

注：1.本基金业绩比较基准为：中证医疗指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

2.净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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


基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
-60.71%
-42.75%
-17.96%
-0.02%
-0.35%
-0.19%
-13.28%
-0.42%
-0.00%
-0.19%
-0.35%
-0.42%
-0.00%
-0.19%
-0.35%
-0.42%
-0.00%
-0.19%
-0.35