

华安中证银行指数分级证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月三十日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、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。本报告已经二〇一九年三月三十日通过基金管理人董事会审议。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2019年3月26日复核了本报告中基金净值、投资组合、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告,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,投资者在投资前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力自主进行投资决策。投资者在投资前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力自主进行投资决策。投资者在投资前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力自主进行投资决策。

2 基金简介

2.1 基金基本情况	华安中证银行指数分级证券投资基金	
场内简称	银行分级	
基金代码	018018	018019
基金运作方式	上市开放式基金	
基金合同生效日期	2016年09月13日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
基金合同生效以来基金份额总额是否发生变化	是,基金份额总额增加	
基金存续期限	不定期	
基金上市的交易场所	深圳证券交易所	

2.2 基金产品说明	本基金为中证银行指数的跟踪基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
投资目标	本基金为中证银行指数的跟踪基金,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	本基金采用被动投资策略,采用完全复制的跟踪方法进行标的指数的跟踪。本基金采用被动投资策略,采用完全复制的跟踪方法进行标的指数的跟踪。	
业绩比较基准	95%×中证银行指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)	
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,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	

3 主要财务指标和基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标和基金净值表现

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期基金份额净值增长率	39.64%,76.16%	68.47%,014.14%	-25.48%,69.27%
同期业绩比较基准收益率	-137.77%,212.88%	162.38%,207.69%	-6.177%,466.27%
基金份额持有人数量	-0.100%	0.129%	-0.009%
本期基金份额净值增长率	-11.52%	16.03%	-2.07%
同期业绩比较基准收益率	-0.142%	-0.043%	-0.173%
基金份额持有人数量	961,794,370.00	939,421,672.20	923,216,166.02
期末基金份额净值	0.7436	0.7072	0.7734

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购及交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、基金赎回费、基金转换费、基金销售服务费),计入费用后将实际收益水平既有所下降。
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本期公允价值变动收益。
3.期末公允价值变动未实现损益为资产负债表末公允价值变动与期初公允价值变动之间的差额(为负数,表示公允价值变动未实现损失,不是当期损失)。
4.合用生效当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期间计算,不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率
过去三个月	-9.06%	1.20%	-8.86%
过去六个月	0.86%	1.30%	-1.14%
过去一年	-11.52%	1.21%	-13.94%
过去三年	0.04%	1.01%	-0.29%
基金成立以来	-16.22%	1.23%	-22.22%

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安中证银行指数分级证券投资基金 份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2016年09月13日至2018年12月31日)



3.3 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



4 基金管理人及基金托管人

4.1 基金管理人及基金托管人

4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

4.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况

基金管理人高级管理人员及基金经理简介

基金管理人高级管理人员及基金经理简介

4.3 基金管理人及基金托管人的内部控制制度

基金管理人及基金托管人的内部控制制度

4.4 基金管理人及基金托管人的风险管理

基金管理人及基金托管人的风险管理

4.5 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.6 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.7 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.8 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.9 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.10 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.11 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.12 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.13 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.14 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.15 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.16 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.17 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.18 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.19 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.20 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.21 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.22 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.23 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.24 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.25 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.26 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.27 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

华安中证银行指数分级证券投资基金

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月三十日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、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。本报告已经二〇一九年三月三十日通过基金管理人董事会审议。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2019年3月26日复核了本报告中基金净值、投资组合、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告,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,投资者在投资前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力自主进行投资决策。投资者在投资前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力自主进行投资决策。投资者在投资前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力自主进行投资决策。

2 基金简介

2.1 基金基本情况	华安中证银行指数分级证券投资基金	
场内简称	银行分级	
基金代码	018018	018019
基金运作方式	上市开放式基金	
基金合同生效日期	2016年09月13日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
基金合同生效以来基金份额总额是否发生变化	是,基金份额总额增加	
基金存续期限	不定期	
基金上市的交易场所	深圳证券交易所	

2.2 基金产品说明	本基金为中证银行指数的跟踪基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
投资目标	本基金为中证银行指数的跟踪基金,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	本基金采用被动投资策略,采用完全复制的跟踪方法进行标的指数的跟踪。本基金采用被动投资策略,采用完全复制的跟踪方法进行标的指数的跟踪。	
业绩比较基准	95%×中证银行指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)	
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,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	

3 主要财务指标和基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标和基金净值表现

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期基金份额净值增长率	39.64%,76.16%	68.47%,014.14%	-25.48%,69.27%
同期业绩比较基准收益率	-137.77%,212.88%	162.38%,207.69%	-6.177%,466.27%
基金份额持有人数量	-0.100%	0.129%	-0.009%
本期基金份额净值增长率	-11.52%	16.03%	-2.07%
同期业绩比较基准收益率	-0.142%	-0.043%	-0.173%
基金份额持有人数量	961,794,370.00	939,421,672.20	923,216,166.02
期末基金份额净值	0.7436	0.7072	0.7734

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购及交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、基金赎回费、基金转换费、基金销售服务费),计入费用后将实际收益水平既有所下降。
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本期公允价值变动收益。
3.期末公允价值变动未实现损益为资产负债表末公允价值变动与期初公允价值变动之间的差额(为负数,表示公允价值变动未实现损失,不是当期损失)。
4.合用生效当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期间计算,不按整个自然年度进行折算。

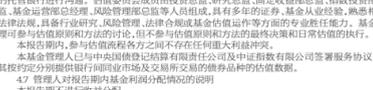
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率
过去三个月	-9.06%	1.20%	-8.86%
过去六个月	0.86%	1.30%	-1.14%
过去一年	-11.52%	1.21%	-13.94%
过去三年	0.04%	1.01%	-0.29%
基金成立以来	-16.22%	1.23%	-22.22%

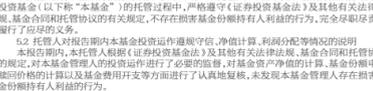
3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安中证银行指数分级证券投资基金 份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2016年09月13日至2018年12月31日)



3.3 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



4 基金管理人及基金托管人

4.1 基金管理人及基金托管人

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

4.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况

基金管理人高级管理人员及基金经理简介

基金管理人高级管理人员及基金经理简介

4.3 基金管理人及基金托管人的内部控制制度

基金管理人及基金托管人的内部控制制度

4.4 基金管理人及基金托管人的风险管理

基金管理人及基金托管人的风险管理

4.5 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.6 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.7 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.8 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.9 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.10 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.11 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.12 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.13 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.14 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.15 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.16 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.17 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.18 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.19 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.20 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.21 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.22 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.23 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.24 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.25 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.26 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.27 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.28 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.29 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

4.30 基金管理人及基金托管人的其他事项

基金管理人及基金托管人的其他事项

华安中证银行指数分级证券投资基金

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月三十日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、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。本报告已经二〇一九年三月三十日通过基金管理人董事会审议。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2019年3月26日复核了本报告中基金净值、投资组合、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告,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,投资者在投资前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力自主进行投资决策。投资者在投资前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力自主进行投资决策。投资者在投资前请仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的风险承受能力自主进行投资决策。

2 基金简介

2.1 基金基本情况	华安中证银行指数分级证券投资基金	
场内简称	银行分级	
基金代码	018018	018019
基金运作方式	上市开放式基金	
基金合同生效日期	2016年09月13日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
基金合同生效以来基金份额总额是否发生变化	是,基金份额总额增加	
基金存续期限	不定期	
基金上市的交易场所	深圳证券交易所	

2.2 基金产品说明	本基金为中证银行指数的跟踪基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
投资目标	本基金为中证银行指数的跟踪基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪	