

2019-03-31
基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2019-04-20

重要提示
<p>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。</p> <p>基金托管人中国农业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。</p> <p>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。</p> <p>基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。</p> <p>本报告自财务资料截止日起，至本报告期末止。</p> <p>本报告自2019年3月1日起至3月31日止。</p>

基金基本情况			
项目	数值		
基金简称	华安MSCI中国A股国际ETF联接		
场内简称			
基金代码	005747		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018-10-24		
报告期末基金份额总额	18,383,042.87		
投资目标	通过投资于目标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	本基金通过完全复制法跟踪标的指数的紧密跟踪的全被动指数基金。本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF，标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	50%×MSCI中国A股国际指数收益（经汇率调整）+50%商业银行税后活期存款利率		
风险收益特征	本基金属于目标ETF的联接基金，目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的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。本基金主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相近。		
基金管理人	华安基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属二级基金的基金简称	华安MSCI中国A股国际ETF联接A	华安MSCI中国A股国际ETF联接C	
下属二级基金的场内简称			
下属二级基金的交易代码	005747	005748	
报告期末下属二级基金的份额总额		14,180,735.28	4,202,307.59
下属二级基金的风险收益特征			

目标基金基本情况			
基金名称	华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金		
基金代码	012869		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2018-09-27		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2018-10-26		
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，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。		
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数。实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份权重由于自由流通股调整而发生变化、成份股发生数量、配股及增发、数量长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。 本基金力争日跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。		
业绩比较基准	MSCI中国A股国际指数收益（经汇率调整）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。		

主要财务指标			
主要财务指标	主基金(元)	华安MSCI中国A股国际ETF联接A(元) 2019-01-01 - 2019-03-31	华安MSCI中国A股国际ETF联接C(元) 2019-01-01 - 2019-03-31
本期已实现收益		4,586,815.40	780,497.87
本期利润		11,139,941.76	2,257,495.76
加权平均基金份额本期利润		0.2470	0.2197
期末基金资产净值		16,651,280.81	4,916,292.88
期末基金份额净值		1.1742	1.1709

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本期公允价值变动收益。

3、本基金于2018年10月24日成立，截止本报告期末，本基金成立不足一年。

3、本基金于2018年10月24日成立，截止本报告期末，本基金成立不足一年。

基金净值表现

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	24.89 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.82 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

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	25.30 %	1.42 %	26.71 %	1.44 %	-1.41 %	-0.02 %

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细						
序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	