

华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2018年6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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安德国(DAX)ETF联接(QDII)
基金代码	000614
交易代码	000614
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月12日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106,272,372,919份

2.2 基金产品说明

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	本基金为华安国际龙头(DAX)ETF的联接基金,所投资的标的基金为华安国际龙头(DAX)ETF,该基金的投资策略为完全复制法,即主要投资于标的基金,同时保留一定比例的现金,以备支付赎回款。本基金将根据标的基金的资产配置情况,在正常情况下,本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	人民币汇率调整的德国DAX指数(DAX Index)收益率×95%+人民币定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金为境外证券投资的基金,主要投资于证券市场上上市的德国企业,需要承担汇率风险、境外证券市场投资的特别投资风险。

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	华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	钱鹏	张燕
联系电话	021-38969999	0755-83190084
电子邮箱	qianpeng@huamax.com.cn	yan_zhang@cmcbchina.com
客户服务电话	4009895009	95555
传真	021-6893414	0755-83196201

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	-	Brown Brothers Harriman Co.
中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址	140 Broadway New York, NY 1005	
办公地址	140 Broadway New York, NY 1005	
邮政编码	-	NY 1005

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告的互联网网址	www.huamax.com.cn
基金半年度报告置备地点	32层

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

3.11 利润数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	705,015.09
本期利润	-8,705,242.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0965
本期基金份额净值增长率	-7.23%

3.12 利润数据和指标

报告期(2018年6月30日)

本期可供分配基金份额利润 0.0106

期末基金份额净值 122,506,724.14

期末基金份额净值 1.154

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、红利再投费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将有所下降。

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 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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差③	①-③	②-④
过去一个月	-0.17%	10.8%	-0.14%	1.10%	-0.03%
过去三个月	-0.26%	0.92%	0.58%	0.96%	-0.04%
过去六个月	-7.23%	0.98%	-6.22%	1.02%	-1.01%
过去一年	-31.1%	0.83%	-1.2%	0.96%	-1.03%
过去三年	16.21%	1.11%	24.21%	1.15%	-8.00%
自基金合同生效起至今	16.40%	1.12%	23.57%	1.22%	-8.17%
过去一年	-0.17%	10.8%	-0.14%	1.10%	-0.03%

3.2.2 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

华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金联接基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图

(2014年8月12日至2018年6月30日)



注:根据《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》,本基金建仓期为6个月。基金管理人自基金合同

生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约

定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1998]20号文批

准于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本15亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安

投资管理有限公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)

有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安创新投资

有限公司。公司在上海、北京、沈阳、成都、广州等地设有分公司,在香港

和上海设有子公司—华安(香港)资产管理有限公司、华安未来资产管

理有限公司。截至2018年6月30日,公司旗下共管理华安创新混合、华

安MSCI中国A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易

ETF、华安沪深300增强混合、华安全球美元收益债券等103只开放

式基金,管理资产规模达到2,460.80亿元人民币。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

4.2 基金管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.3 管理人对报告期内基金运作指标的说明

4.4 管理人对报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.6 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.7 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.8 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.9 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.10 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.11 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.12 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.13 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.14 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.15 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.16 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.17 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.18 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.19 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.20 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.21 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.22 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.23 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.24 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.25 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.26 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.27 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.28 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.29 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.30 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.31 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.32 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明