

华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 清算报告

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：2021 年 3 月 29 日

§1 重要提示

华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]278 号《关于准予华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的注册，于 2018 年 09 月 27 日成立并正式运作。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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合同》的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，提议终止《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合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据管理人 2021 年 03 月 10 日发布的《关于华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2021 年 03 月 09 日表决通过了《关于华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2021 年 03 月 09 日，自 2021 年 03 月 10 日进入清算期。

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、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2021 年 03 月 10 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金简称	华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF
基金主代码	512860
交易代码	512860

基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 09 月 27 日
报告期末（2021 年 03 月 09 日）基金份额总额	12,626,372.00 份
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、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、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。 本基金力争日均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 股国际指数收益率（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。
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

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2018]278 号注册，由基金管理人华安基金管理有限公司依照法律法规、《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合同》等规定于 2018 年 08 月 01 日至 2018 年 09 月 18 日向社会公开发行募集，基金合同于 2018 年 09 月 27 日生效。基金合同生效日

的基金总份额为 321,626,372.00 份基金份额。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

为适应市场环境变化，更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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合同》的有关规定，经与本基金托管人协商一致，提议终止《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合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据管理人 2021 年 03 月 10 日发布的《关于华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2021 年 03 月 09 日表决通过了《关于华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2021 年 03 月 09 日，自 2021 年 03 月 10 日进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 03 月 09 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2021年03月09日
资 产：	
银行存款	2,196,037.03
结算备付金	89,300.41
存出保证金	7,566.90
交易性金融资产	5,241.00
应收利息	3,096.67
证券清算款	18,205,489.79
资产总计	20,506,731.80

负债和所有者权益	最后运作日 2021年03月09日
负 债:	
证券清算款	390.66
应付交易费	30,484.42
应付管理费	3,160.70
应付托管费	632.15
其他负债	11,177.84
负债合计	45,845.77
所有者权益:	
实收基金	12,626,372.00
未分配利润	7,834,514.03
所有者权益合计	20,460,886.03
负债和所有者权益总计	20,506,731.80

注 1：本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于基金最后运作日，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

注 2：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师许康玮、楼茜蓉签字出具了普华永道中天特审字(2021)第 1187 号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2021 年 03 月 10 日至 2021 年 03 月 24 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金 89,300.41 元，存出保证金为人民币 7,566.90 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳和上海分公司的最低备付金和结算保证金。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司先行垫付，垫款人民币 275,000.00 元已于 2021 年 03 月 10 日划入托管户，垫付资金孳生的利息归华安基金管理有限公司所有。上述垫款将于中国证券登记结算有限责任公司深圳和上海分公司调整结算保证金和最低备付金后退还华安基金管理有限公司。

5.1.2 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 5,241.00 元，为停牌股票，该资产于 2021 年 03 月 16 日恢复流通并变现后划入托管户。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为人民币 3,096.67 元，其中应收银行存款利息人民币 3,004.18 元，应收备付金利息 77.42 元，应收保证金利息 15.07 元。该款项将于对应的结息日划入托管账户。

5.1.4 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 18,205,489.79 元，已于 2021 年 3 月 10 日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 390.66 元，已于 2021 年 3 月 10 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 30,484.42 元，为应付佣金，已于 2021 年 03 月 17 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付管理费为人民币 3,160.70 元，应付托管费为人民币 632.15 元，已于 2021 年 3 月 10 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债为人民币 11,177.84 元，为预提年度财务报表审计费，该款项将于本基金年度财务报表审计报告出具后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2021年03月10日 至2021年03月24日 止清算期间
----	---------------------------------------

一、清算收益	
1、利息收入（注1）	5,816.07
2、投资收益（注2）	-4,927.87
清算收入小计	888.20
二、清算费用	
三、清算净收益	888.20

注 1：利息收入系计提的自 2021 年 03 月 10 日至 2021 年 03 月 24 日止清算期间的银行存款利息、最低备付金利息和结算保证金利息。该款项将于对应的结息日划入托管账户。

注 2：截至 2021 年 03 月 24 日止，投资收益为人民币-4,927.87 元。其中，卖出股票红利补税金额为人民币 4,402.87 元，这笔款项已于 2021 年 03 月 11 日由基金托管人代为扣收；2021 年 03 月 16 日停牌股票变现产生的投资收益为人民币-525.00 元。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2021年03月09日基金净资产	20,460,886.03
加：清算期间净收益	888.20
二、2021年03月24日基金净资产	20,461,774.23

根据本基金的基金合同及《关于华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的约定，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、关于《华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 (<http://www.huaan.com.cn>)、中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)，清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二一年三月二十四日（清算报告出具日）