

重要提示

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。基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月17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预示其未来表现，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。本报告中财务资料未经审计。本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金名称 (Fund Name), 场内简称 (Intra-market Abbreviation), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金资产总额 (Report End Fund Assets Total), 投资目标 (Investment Objective), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Performance Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian), 境外资产托管人 (Overseas Asset Custodian).

目标基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 基金上市证券交易所 (Fund Listing Exchange), 上市日期 (Listing Date), 基金管理人名称 (Fund Manager Name), 基金托管人名称 (Fund Custodian Name).

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的最小化。本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。投资策略：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。业绩比较基准：德国DAX指数 (DAX Index) 收益率 (经汇率调整后的总收益收益率)。风险收益特征：本基金为境外证券投资的基金，主要投资德国证券市场上市的企业，需要承担汇率风险、境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

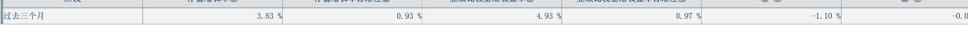
主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31) (Reporting Period). Includes 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Period Profit), 加权平均基金份额本期利润 (Weighted Average Share Profit), 期末基金资产净值 (End of Period Net Assets), 期末基金份额净值 (End of Period Net Asset Value).

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。

基金净值表现

Table with 2 columns: 本报告期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 (Comparison of Net Value Growth Rate and Benchmark Return). Includes 阶段 (Period) and 净值增长率 (Net Value Growth Rate).



基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Term as Fund Manager), 说明 (Remarks). Includes 倪斌 (Ni Bin) as the fund manager.

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

Table with 3 columns: 姓名 (Name), 在境外投资顾问网任职职务 (Position at Overseas Advisor), 证券从业年限 (Years of Experience). Note: 无 (None).

报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况：根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将对封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理。风险控制包括：在研究环节，研究员在公司管理的各类投资组合提供投资建议。投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录或研究管理信息系统等方式来确保各投资组合可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合根据既定的风格和投资策略，制定并严格执行投资决策机制，以保证投资决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易部二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达而下的投资组合在交易时机上的公平性。交易部一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报，若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量超过无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督下，进行公平协商分配。若中签量超过无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风控部门的监督下，进行公平协商分配，交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的品种，进行场外非公开发行股票申购、以公司名义发行的债券一级市场申购，不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场的第三方信息（如：中债的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间以竞价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的反向交易和交易价差进行分析。报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

异常交易行为的专项说明：根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间市场同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查，风险管理部开发了反向交易分析系统，对相关反向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的反向交易行为进行了重点分析。报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为0次，未出现异常交易。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望：我们预计2019年二季度欧洲经济有望平稳增长，欧央行于2018年底结束量化宽松的购债政策，并将在今年9月份重启新一轮的再融资操作，为市场提供低成本资金，鼓励金融机构向实体经济提供贷款。目前来看，德国经济景气程度在底部出现反弹，经济经过多年来的改革与去杠杆后韧性较强。德国作为欧洲成员国的代表，经济表现较为稳健，尤其在汽车、先进制造、精密仪器及化工等领域处于世界前列，是国内投资者多资产配置的有效补充，作为市场上唯一的纯欧ETF基金，能够有效分散全球投资风险，享受欧洲经济增长红利。作为DAX ETF联接基金的管理人，我们将坚持积极稳健回报与指数跟踪相结合的原则，降低跟踪偏离度和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Includes 权益投资 (Equity Investment), 基金投资 (Fund Investment), 固定收益投资 (Fixed Income Investment), 金融衍生品投资 (Financial Derivatives Investment), 买入返售金融资产 (Repurchase Agreements), 其他各项资产 (Other Assets).

报告期末在各个国家 (地区) 证券市场的股票及存托凭证投资分布

Table with 3 columns: 国家 (地区) (Country/Region), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Note: 本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

Table with 3 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Note: 本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

报告期末按行业分类的权益投资组合

Table with 3 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

Table with 8 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 股票名称 (Stock Name), 证券代码 (Security Code), 所在证券市场 (Market), 所属国家 (地区) (Country/Region), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Note: 本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Note: 本基金本报告期末未持有债券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Note: 本基金本报告期末未持有债券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 基金类型 (Fund Type), 运作方式 (Operation Mode), 管理人 (Manager), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Note: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 基金类型 (Fund Type), 运作方式 (Operation Mode), 管理人 (Manager), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Note: 本基金本报告期末未持有金融衍生品。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

Table with 8 columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 基金类型 (Fund Type), 运作方式 (Operation Mode), 管理人 (Manager), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况：报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库：本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

其他资产构成：Table with 2 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan). Includes 存出保证金 (Outstanding Margin), 应收证券清算款 (Receivable Settlements), 应收股利 (Receivable Dividends), 应收利息 (Receivable Interest), 其他应收款 (Other Receivables), 待摊费用 (Prepaid Expenses), 其他 (Others), 合计 (Total).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细：注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明：注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 报告期初基金份额总额 (Total Shares at Start), 报告期期间基金总申购份额 (Total Subscriptions), 减：报告期期间基金总赎回份额 (Total Redemptions), 报告期期间基金净申购份额 (Net Subscriptions), 报告期末基金份额总额 (Total Shares at End).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Mode), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Shares), 交易金额 (元) (Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 6 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额总数 (Total Shares by Initiator), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares by Initiator), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period).

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 6 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Start Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (End Shares), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录：1. 《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招募说明书》; 2. 《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招募说明书》; 3. 《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托管协议》。

存放地点

基金管理人及基金托管人的办公场所，并载于基金管理人互联网网站http://www.huanan.com.cn.

查阅方式

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