

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。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。
投资策略: 本基金采用完全复制法，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。
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指数收益率)
风险收益特征: 本基金属于股票型基金，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。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

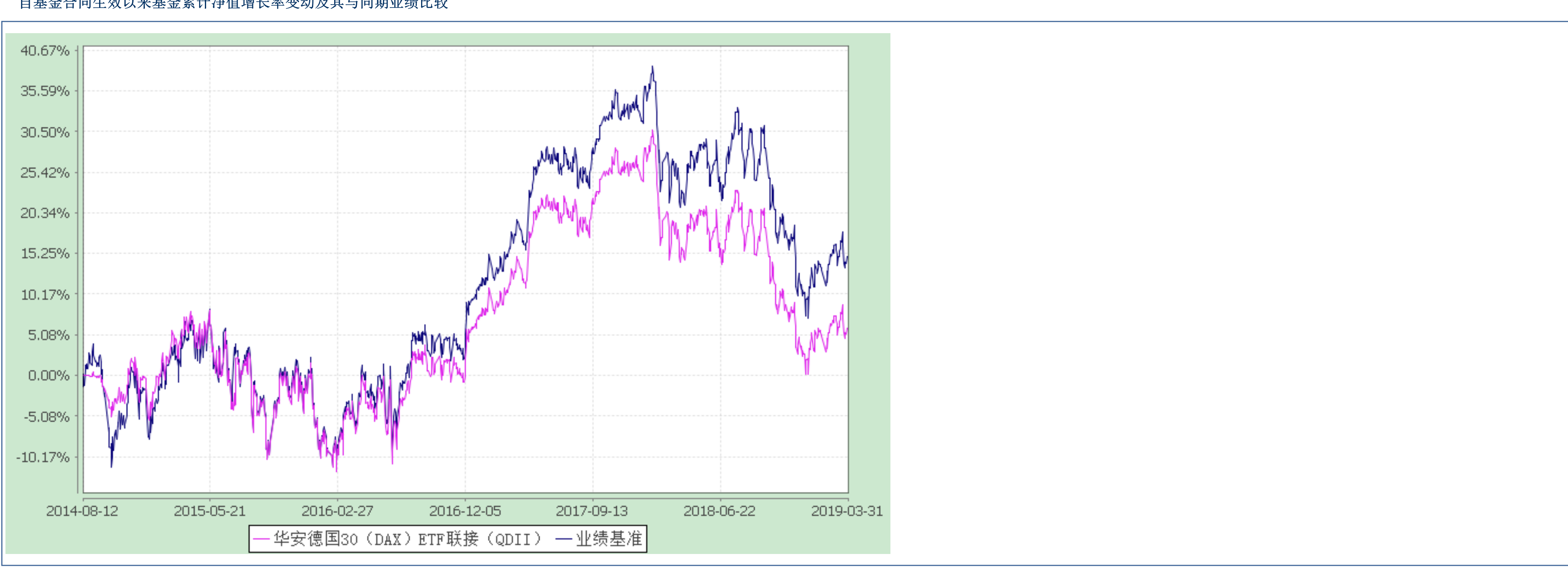
主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31) 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan). 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 Rate). 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 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Term as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Lists the fund manager 倪斌 (Ni Bin).

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), 在境外投资顾问所任职务 (Position at Overseas Advisor), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). 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中。
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》，公司合规稽核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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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领先地位。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股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。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

作为DAX ETF联接基金的管理人，我们始终坚持积极将基金回报与指数相综合的原则，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 RMB Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Lists various asset categories like 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 RMB 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 RMB 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有股票及存托凭证。

报告期末积极投资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 RMB 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有股票及存托凭证。

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), 公司名称 (英文名称) (Company Name - English), 公司名称 (中文) (Company Name - Chinese), 证券代码 (Security Code), 所在证券市场 (Listing Market), 所属国家 (地区) (Country/Region), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB 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 RMB 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 RMB 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债券支持证券投资明细

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 RMB 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有债券支持证券投资。

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 RMB 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 7 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 RMB 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: 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 RMB Yuan). Lists 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 (Other), 合计 (Total).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细: 本基金本报告期末未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: 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: 无 (None).

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value) 单位: 份 (Unit: Shares). 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 Shares Purchased), 减: 报告期期间基金总赎回份额 (Total Shares Redeemed), 报告期期间基金净申购份额 (Net Shares Purchased), 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 RMB Yuan), 适用费率 (Applicable Rate). Note: 无 (None).

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 Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额总数 (Total Shares Initiated), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Initiated), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period for Initiated Shares).

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 Period Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (End Period 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托管协议》; 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。