

华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数  
证券投资基金  
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 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

送出日期：2025 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期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本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§7 投资组合报告</b>	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	43

7.7 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 .....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	43
7.10 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 .....	44
7.11 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
11.1 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 .....	61
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安德国(DAX) ETF
场内简称	德国 ETF(扩位简称:德国 ETF)
基金主代码	513030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 8 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	729,779,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014 年 9 月 5 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	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票及其权重的变动进行相应调整。为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。
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	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、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。 本基金为境外证券投资的基金，主要投资德国证券市场上述的德国企业，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。

### 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	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	400-61-95555
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	4008850099		400-61-95555
传真	021-68863414		0755-83195201
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼		深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

	2118 室	
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	朱学华	缪建民

## 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	英文	-	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-	NY 10005

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期内(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	27,718,986.56
本期利润	307,161,857.05
加权平均基金份额本期利润	0.4338
本期加权平均净值利润率	26.01%
本期基金份额净值增长率	31.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	619,843,653.53
期末可供分配基金份额利润	0.8494

期末基金资产净值	1,362,339,424.25
期末基金份额净值	1.8668
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	86.68%

- 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，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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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）。

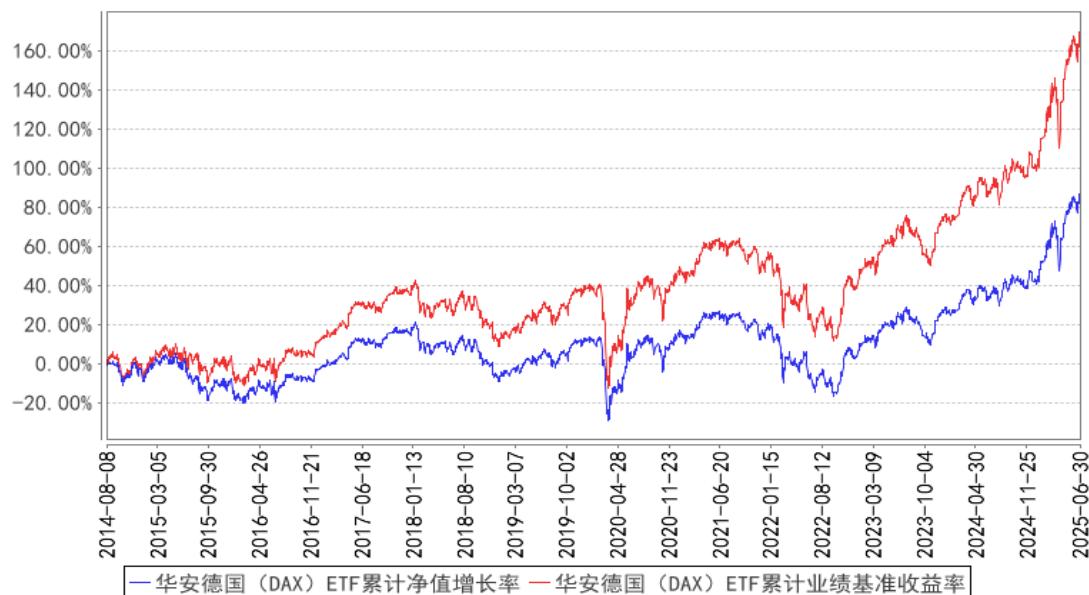
### 3.2 基金净值表现

#### 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	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.43%	0.98%	2.57%	1.00%	-0.14%	-0.02%
过去三个月	14.75%	1.66%	16.27%	1.67%	-1.52%	-0.01%
过去六个月	31.26%	1.53%	34.08%	1.54%	-2.82%	-0.01%
过去一年	39.63%	1.23%	43.79%	1.23%	-4.16%	0.00%
过去三年	106.28%	1.08%	124.23%	1.08%	-	0.00%
自基金合同生效起至今	86.68%	1.26%	169.29%	1.30%	-	-0.04%

### 3.2.2 自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

华安德国(DAX) ETF 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[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1.5亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、上海上国投资资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至2025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、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等283只证券投资基金，管理资产规模达到7,488.16亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
倪斌	指数投资部副总监、本基金的基金经理	2018年9月10日	-	14年	硕士研究生，14年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010年7月加入华安基金，历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018年9月起，同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金管理人。

				(LOF)、华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018 年 9 月至 2025 年 3 月，同时担任华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018 年 9 月至 2022 年 12 月，同时担任华安纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月起，同时担任华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)(由华安纳斯达克 100 指数证券投资基金转型而来)的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安三菱日联经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2020 年 5 月起，同时担任华安法国 CAC40 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月至 2025 年 3 月，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月至 2023 年 11 月，同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2021 年 6 月至 2025 年 3 月，同时担任华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月至 2025 年 3 月，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 4 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2023 年 1 月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 12 月起，同时担任华安恒生港股通中国央企红利交易型开放式指数证券投资基金的基金
--	--	--	--	--

				经理。2024年2月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、华安三菱日联日经225交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。2024年4月起，同时担任华安恒生港股通中国央企红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年5月起，同时担任华安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年6月起，同时担任华安法国CAC40交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年11月至2024年12月，同时担任华安恒生香港上市生物科技指数型发起式证券投资基金(QDII)的基金经理。2024年12月起，同时担任华安恒生生物科技指数型发起式证券投资基金(QDII)(由华安恒生香港上市生物科技指数型发起式证券投资基金(QDII)转型而来)的基金经理。2025年5月起，同时担任华安恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	---

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类

投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风险和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易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。(1) 交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行行业务申报，由集中交易部对外进行申报。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比例分配原则进行分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。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交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合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，根据市场公认第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议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同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.4.2 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》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的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。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，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，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。

#### 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

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，德国宣布 5000 亿欧元财政刺激计划，同时欧盟宣布“重新武装欧洲”计划。货币政策方面，欧洲央行继续多次降息。尽管美国关税政策也对欧元区企业的投资与出口产生一定负面

影响，但整体看，受益于德国和欧盟的新一轮财政计划使，欧元区的财政与经济前景预期持续改善，尤其德国在国防与基础设施领域的投资逐步发挥带动作用，为欧元区经济增长注入更多动能，而欧央行流动性宽松的预期支撑欧股风险偏好持续回升，报告期，德国指数表现较好。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.8668 元，本报告期份额净值增长率为 31.26%，同期业绩比较基准增长率为 34.08%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，欧元区的制造业与服务业 PMI 有望继续回升，通胀整体预计可控，有望回落至 2% 的目标区间，在持续多次降息后，欧央行的降息步伐下半年预计逐步放缓，但大概率仍将维持宽松。德国积极的财政扩张政策有望继续对本国乃至整个欧元区的经济增长产生正向拉动作用，欧洲面临的长期投资不足、经济增长疲弱的局面或将逐步迎来改善，但同时也需要特别关注地缘局势等不确定因素对欧股产生的扰动。作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部门负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金无需要说明的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	72,253,957.31	57,792,272.69
结算备付金		36,869,256.80	16,614,528.60
存出保证金		9,717,658.00	7,708,753.62
交易性金融资产	6.4.7.2	1,244,803,910.24	783,852,829.72
其中：股票投资		1,244,803,910.24	783,852,829.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	3,506.74
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,363,644,782.35	865,971,891.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年6月30日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,094,355.53
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		876,878.36	594,758.45
应付托管费		219,219.59	148,689.62
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	167,998.58
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	209,260.15	292,878.42
负债合计		1,305,358.10	2,298,680.60
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	729,779,000.00	607,279,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	632,560,424.25	256,394,210.77
净资产合计		1,362,339,424.25	863,673,210.77
负债和净资产总计		1,363,644,782.35	865,971,891.37

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8668 元，基金份额总额 729,779,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
<b>一、营业收入</b>		313,233,681.52	46,947,962.92
1. 利息收入		95,739.08	68,756.81
其中：存款利息收入	6.4.7.9	95,739.08	68,756.81
债券利息收入		—	—
资产支持证券 利息收入		—	—
买入返售金融 资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		30,740,993.38	47,430,067.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-75,763.90	26,092,824.23
基金投资收益	6.4.7.11	—	—
债券投资收益	6.4.7.12	—	—
资产支持证券 投资收益		—	—
贵金属投资收 益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.13	7,992,077.36	1,993,885.78
股利收益	6.4.7.14	22,824,679.92	19,343,357.11
以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益		—	—
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填 列)	6.4.7.15	279,442,870.49	2,181,802.43
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)		532,252.79	-6,994,757.66
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	6.4.7.16	2,421,825.78	4,262,094.22
<b>减：二、营业总支出</b>		6,071,824.47	4,508,960.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,657,892.31	3,329,154.54
其中：暂估管理人报 酬		—	—
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,164,473.14	832,288.58

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		35,024.21	7,370.01
8. 其他费用	6.4.7.18	214,434.81	340,147.21
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		307,161,857.05	42,439,002.58
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		307,161,857.05	42,439,002.58
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		307,161,857.05	42,439,002.58

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	607,279,000.00	-	256,394,210.77	863,673,210.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	607,279,000.00	-	256,394,210.77	863,673,210.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	122,500,000.00	-	376,166,213.48	498,666,213.48
(一)、综合收益总额	-	-	307,161,857.05	307,161,857.05
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	122,500,000.00	-	69,004,356.43	191,504,356.43

其中：1. 基金申购款	131,000,000.00	-	73,209,963.96	204,209,963.96
2. 基金赎回款	-8,500,000.00	-	-4,205,607.53	-12,705,607.53
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	729,779,000.00	-	632,560,424.25	1,362,339,424.25
项目	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	411,779,000.00	-	117,216,177.41	528,995,177.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	411,779,000.00	-	117,216,177.41	528,995,177.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	333,000,000.00	-	134,129,076.67	467,129,076.67
(一)、综合收益总额	-	-	42,439,002.58	42,439,002.58
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	333,000,000.00	-	91,690,074.09	424,690,074.09
其中：1. 基金申购款	493,500,000.00	-	148,733,991.24	642,233,991.24
2. 基金赎回款	-160,500,000.00	-	-57,043,917.15	-217,543,917.15

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	744,779,000.00	-	251,345,254.08	996,124,254.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

朱学华

朱学华

陈松一

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安国际龙头(DAX)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[2014]347号的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于2014年8月8日生效，首次设立募集规模为337,779,000.00份基金份额。本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金、依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以相应将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制，不需经基金份额持有人大会审议。

本基金的标的指数为德国DAX指数(DAXIndex)收益率(经汇率调整后的总收益指数收益率)。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日的经营成果和净资产变动情况。

## 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融

债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定；

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	72,253,957.31
等于：本金	72,249,086.91
加：应计利息	4,870.40
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	72,253,957.31

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	865,635,533.29	-	1,244,803,910.24	379,168,376.95
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	865,635,533.29	-	1,244,803,910.24	379,168,376.95

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	92,442,875.78	-	-	-
其中：股指期货投资	92,442,875.78	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	92,442,875.78	-	-	-

### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
FDAX2509	FDAX2509	19.00	95,982,925.86	3,540,050.08
合计				3,540,050.08
减：可抵销期货暂收款				3,540,050.08
净额				0.00

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	179,507.37
合计	209,260.15

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日

	基金份额(份)	账面金额
上年度末	607,279,000.00	607,279,000.00
本期申购	131,000,000.00	131,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-8,500,000.00	-8,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	729,779,000.00	729,779,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	492,791,802.81	-236,397,592.04	256,394,210.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	492,791,802.81	-236,397,592.04	256,394,210.77
本期利润	27,718,986.56	279,442,870.49	307,161,857.05
本期基金份额交易产生的变动数	99,332,864.16	-30,328,507.73	69,004,356.43
其中：基金申购款	106,320,295.29	-33,110,331.33	73,209,963.96
基金赎回款	-6,987,431.13	2,781,823.60	-4,205,607.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	619,843,653.53	12,716,770.72	632,560,424.25

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	95,739.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-

合计	95,739.08
----	-----------

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-75,763.90
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-75,763.90

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	-
减：卖出股票成本总额	-
减：交易费用	75,763.90
买卖股票差价收入	-75,763.90

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	12,705,607.53
减：现金支付赎回款总额	12,705,607.53
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无。

**6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无。

**6.4.7.13 衍生工具收益****6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	7,992,077.36

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	22,824,679.92
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	22,824,679.92

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	273,462,877.79
股票投资	273,462,877.79
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	5,979,992.70
权证投资	—
期货投资	5,979,992.70
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	279,442,870.49

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	2,421,170.23
其他	655.55
合计	2,421,825.78

#### 6.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	11,754.10
指数许可费	113,420.56
合计	214,434.81

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

##### 6.4.9 关联方关系

###### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经中国证监会于2025年1月17日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自吸收合并交割日（即2025年3月14日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务。

根据国泰海通证券股份有限公司于2025年4月4日发布《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，本公司股东的公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

###### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证	本基金的联接基金

券投资基金联接基金(“华安国际龙头 ETF 联接基金”)	
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.)	境外资产托管人
国泰海通证券股份有限公司 (“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 基金交易

无。

###### 6.4.10.1.5 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,657,892.31	3,329,154.54
其中：应支付销售机构的客户维 护费	463,547.73	60,597.97
应支付基金管理人的净管理费	4,194,344.58	3,268,556.57

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,164,473.14	832,288.58

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)

国泰海通证券股份有限公司	700,000.00	0.10	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	700,000.00	0.12
招商银行—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	152,939,276.00	20.96	223,694,276.00	36.84

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
布朗兄弟哈里曼银行	22,153,216.56	-	42,621,445.74	-
招商银行	50,100,740.75	95,739.08	45,839,757.73	68,756.81

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末(2025年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是股票型基金，预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金；本基金在股票型基金中属于指数型基金，主要采用完全复制法紧密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，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的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，但因特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，从而能够紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行及其委托的境外托管行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致的公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1年内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	72,253,957.31	-	-	-	72,253,957.31
结算备付金	-	-	-	36,869,256.80	36,869,256.80
存出保证金	-	-	-	9,717,658.00	9,717,658.00
交易性金融资产	-	-	-	1,244,803,910.24	1,244,803,910.24
资产总计	72,253,957.31	-	-	1,291,390,825.04	1,363,644,782.35
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	876,878.36	876,878.36
应付托管费	-	-	-	219,219.59	219,219.59
其他负债	-	-	-	209,260.15	209,260.15
负债总计	-	-	-	1,305,358.10	1,305,358.10
利率敏感度缺口	72,253,957.31	-	-	1,290,085,466.94	1,362,339,424.25
上年度末 2024年12月31日	1年内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	57,792,272.69	-	-	-	57,792,272.69

结算备付金	-	-	-	16,614,528.60	16,614,528.60
存出保证金	-	-	-	7,708,753.62	7,708,753.62
交易性金融资产	-	-	-	783,852,829.72	783,852,829.72
应收清算款	-	-	-	3,506.74	3,506.74
资产总计	57,792,272.69	-	-	808,179,618.68	865,971,891.37
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	594,758.45	594,758.45
应付托管费	-	-	-	148,689.62	148,689.62
应付清算款	-	-	-	1,094,355.53	1,094,355.53
应交税费	-	-	-	167,998.58	167,998.58
其他负债	-	-	-	292,878.42	292,878.42
负债总计	-	-	-	2,298,680.60	2,298,680.60
利率敏感度缺口	57,792,272.69	-	-	805,880,938.08	863,673,210.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	268,904.3 6	-	21,884,902.80	22,153,807.16
结算备付金	-	-	36,869,256.80	36,869,256.80
存出保证金	-	-	9,717,658.00	9,717,658.00
交易性金融资 产	-	-	1,244,803,910.24	1,244,803,910.24

资产合计	268,904.3 6	-	1,313,275,727.84	1,313,544,632.20
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	268,904.3 6	-	1,313,275,727.84	1,313,544,632.20
上年度末 2024年12月31日				
项目	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	113,738.6 0	-	26,669,197.19	26,782,935.79
结算备付金	-	-	16,614,528.60	16,614,528.60
存出保证金	-	-	7,708,753.62	7,708,753.62
交易性金融资产	-	-	783,852,829.72	783,852,829.72
资产合计	113,738.6 0	-	834,845,309.13	834,959,047.73
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	113,738.6 0	-	834,845,309.13	834,959,047.73

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2025年6月30日)	上年度末(2024年12月 31日)
	所有外币相对人民 币升值5%	65,677,231.61	41,747,952.39

	所有外币相对人民币贬值 5%	-65,677,231.61	-41,747,952.39
--	----------------	----------------	----------------

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的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。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	1,244,803,910.24	91.37	783,852,829.72	90.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	1,244,803,910.24	91.37	783,852,829.72	90.76
----	------------------	-------	----------------	-------

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2025年6月30日)	
	业绩比较基准上升5%	67,553,100.22	42,674,657.02
	业绩比较基准下降5%	-67,553,100.22	-42,674,657.02

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	1,244,803,910.24	783,852,829.72
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,244,803,910.24	783,852,829.72

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报

告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 08 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,244,803,910.24	91.29
	其中：普通股	1,244,803,910.24	91.29
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	109,123,214.11	8.00
8	其他各项资产	9,717,658.00	0.71
9	合计	1,363,644,782.35	100.00

## 7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
德国	1,244,803,910.24	91.37
合计	1,244,803,910.24	91.37

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
原材料	57,139,332.60	4.19
工业	376,560,817.86	27.64
非日常生活消费品	102,368,060.69	7.51
日常消费品	15,743,796.52	1.16
医疗保健	71,055,962.03	5.22
金融	266,961,406.88	19.60
信息技术	210,339,377.78	15.44
通信服务	84,042,183.72	6.17
公用事业	44,700,264.61	3.28
房地产	15,892,707.55	1.17
合计	1,244,803,910.24	91.37

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

### 7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	SAP SE	SAP 公司	SAP GY	德国	德国	80,499	174,608,735.50	12.82
2	SIEMENS	西门子	SIE GY	德国	德国	67,820	124,028,019.66	9.10

	AG-REG							
3	ALLIANZ SE-REG	安联保险有限公司	ALV GY	德国	德国	34,775	100,543,769.59	7.38
4	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	德国电信	DTE GY	德国	德国	322,963	84,042,183.72	6.17
5	AIRBUS SE	空中客车有限公司	AIR GY	德国	德国	52,981	78,892,593.99	5.79
6	RHEINMETALL AG	德国莱茵金属股份有限公司	RHM GY	德国	德国	3,837	57,935,295.81	4.25
7	MUENCHENER RUECKVERAG-REG	慕尼黑再保险公司	MUV2 GY	德国	德国	12,044	55,719,897.18	4.09
8	SIEMENS ENERGY AG	西门子能源公司	ENR GY	德国	德国	59,708	49,195,770.35	3.61
9	DEUTSCHE BOERSE AG	德意志交易所集团	DB1 GY	德国	德国	16,959	39,457,225.91	2.90
10	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERTED	德意志银行	DBK GY	德国	德国	179,856	38,037,459.11	2.79
11	INFINEON TECHNOLOGIES AG	英飞凌科技有限公司	IFX GY	德国	德国	117,747	35,730,642.28	2.62
12	DHL	德国邮	DHL GY	德国	德国	89,751	29,569,194.29	2.17

	GROUP	政股份 公司						
13	BASF SE	巴斯夫 欧洲公 司	BAS GY	德国	德国	80,398	28,277,943.46	2.08
14	ADIDA S AG	阿迪达 斯公司	ADS GY	德国	德国	16,183	26,916,456.96	1.98
15	E.ON SE	E.ON 有限公 司	EOAN GY	德国	德国	202,391	26,571,408.45	1.95
16	MERCE DES-BENZ GROUP AG	梅赛德 斯-奔 驰集团	MBG GY	德国	德国	62,429	26,065,059.92	1.91
17	COMMERZBANK AG	德国商 业银行 股份公 司	CBK GY	德国	德国	93,879	21,124,302.60	1.55
18	HEIDELBERG MATERIALE IALS AG	海德堡 材料股 份公司	HEI GY	德国	德国	12,172	20,398,551.85	1.50
19	BAYER AG-REG	拜耳股 份公司	BAYN GY	德国	德国	88,553	18,999,514.11	1.39
20	RWE AG	莱茵集 团	RWE GY	德国	德国	60,897	18,128,856.16	1.33
21	BAYERISCHE MOTORWERKE AG	宝马汽 车股份 公司	BMW GY	德国	德国	26,873	17,038,694.08	1.25
22	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	戴姆勒 卡车控 股股份 公司	DTG GY	德国	德国	49,085	16,567,385.57	1.22
23	VONOVIA SE	Vonovi a有限 公司	VNA GY	德国	德国	63,238	15,892,707.55	1.17
24	MTU	MTU	MTX GY	德国	德国	4,782	15,156,000.41	1.11

	AERO ENGIN ES AG	Aero 发动机 股份有 限公司						
25	VOLKS WAGEN AG- PREF	大众汽 车股份 公司	VOW3 GY	德国	德国	18,508	13,936,951.31	1.02
26	FRESE NIUS SE & CO KGAA	费森尤 斯集团	FRE GY	德国	德国	37,307	13,378,828.61	0.98
27	HANNO VER RUECK SE	汉诺威 再保险 有限公 司	HNR1 GY	德国	德国	5,380	12,078,752.49	0.89
28	MERCK KGAA	德国默 克集团	MRK GY	德国	德国	11,601	10,722,386.66	0.79
29	SIEME NS HEALT HINEE RS AG	西门子 医疗系 统有限 公司	SHL GY	德国	德国	25,057	9,907,962.37	0.73
30	SYMRI SE AG	德之馨 股份公 司	SY1 GY	德国	德国	11,299	8,462,837.29	0.62
31	HENKE L AG & CO KGAA VOR- PREF	汉高有 限公司	HEN3 GY	德国	德国	14,599	8,176,958.06	0.60
32	BEIER SDORF AG	拜尔斯 道夫股 份有限 公司	BEI GY	德国	德国	8,448	7,566,838.46	0.56
33	FRESE NIUS MEDIC AL CARE AG	费森尤 斯医疗 保健有 限公司	FME GY	德国	德国	17,900	7,317,104.00	0.54
34	QIAGE N	德国 QIAGEN	QIA GY	德国	德国	19,575	6,724,641.37	0.49

	N. V.	公共有限公司						
35	CONTI NENTA L AG	德国大陆集团	CON GY	德国	德国	9,668	6,019,469.28	0.44
36	BRENN TAG SE	Brenntag	BNR GY	德国	德国	11,047	5,216,557.78	0.38
37	ZALAN DO SE	Zaland o股份公司	ZAL GY	德国	德国	21,397	5,025,022.97	0.37
38	SARTO RIUS AG-VORZUG	赛多利斯有限公司	SRT3 GY	德国	德国	2,207	4,005,524.91	0.29
39	PORSC HE AUTOMOBIL HLDG-PRF	保时捷汽车控股有限公司	PAH3 GY	德国	德国	13,717	3,882,965.23	0.29
40	DR ING HC F PORSC HE AG	Dr Ing hc F Porsche AG	P911 GY	德国	德国	9,885	3,483,440.94	0.26

#### 7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

#### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

##### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	SAP SE	SAP GY	28,587,113.33	3.31
2	SIEMENS AG-REG	SIE GY	19,548,650.95	2.26
3	ALLIANZ SE-REG	ALV GY	15,652,293.06	1.81
4	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	DTE GY	14,213,473.17	1.65
5	AIRBUS SE	AIR GY	11,656,944.89	1.35
6	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	MUV2 GY	8,752,062.77	1.01

7	DEUTSCHE BOERSE AG	DB1 GY	5,816,937.59	0.67
8	INFINEON TECHNOLOGIES AG	IFX GY	5,716,900.85	0.66
9	ADIDAS AG	ADS GY	5,453,646.32	0.63
10	MERCEDES-BENZ GROUP AG	MBG GY	5,128,038.77	0.59
11	BASF SE	BAS GY	5,124,394.05	0.59
12	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	DBK GY	4,626,142.16	0.54
13	SIEMENS ENERGY AG	ENR GY	4,474,031.08	0.52
14	DHL GROUP	DHL GY	4,315,707.58	0.50
15	RHEINMETALL AG	RHM GY	3,879,772.40	0.45
16	E.ON SE	EOAN GY	3,125,111.02	0.36
17	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	BMW GY	2,901,437.60	0.34
18	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	DTG GY	2,684,351.49	0.31
19	BAYER AG-REG	BAYN GY	2,540,794.38	0.29
20	VONOVA SE	VNA GY	2,438,543.46	0.28

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细无。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本(成交)总额	187,488,202.73
卖出收入(成交)总额	-

注：本项“买入成本(成交)总额”和“卖出收入(成交)总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	期货品种_股指	FDAX2509	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，根据《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为人民币 3,540,050.08 元，已包含在结算备付金中。

## 7.10 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

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,717,658.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,717,658.00

### 7.11.4 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持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
25,537	28,577.32	421,617,496.00	57.77	308,161,504.00	42.23

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额(份)	占总份额比例(%)
招商银行—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	152,939,276.00	20.96

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	BARCLAYS BANK PLC	51,871,668.00	7.11
2	UBS AG	19,771,609.00	2.71
3	杨祖贵	19,605,700.00	2.69
4	华泰证券资管—工商银行—华泰证券工商银行 1 号集合资产管理计划	8,681,500.00	1.19
5	平安银行股份有限公司—平安盈禧均衡配置 1 年持有期混合型基金中基金(FOF)	8,617,800.00	1.18
6	中国工商银行股份有限公司—广发养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基	7,501,100.00	1.03

7	上海洛书投资管理有限公司—洛书裕景天康私募证券投资基	6,000,000.00	0.82
8	中国工商银行股份有限公司—广发养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基	5,873,200.00	0.80
9	歌斐诺宝(上海)资产管理有限公司—歌斐大趋势主题私募基金	5,319,000.00	0.73
10	中国银行股份有限公司—华安盈瑞稳健优选 6 个月持有期混合型基金中基金(FOF)	5,025,600.00	0.69
11	招商银行—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	152,939,276.00	20.96

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年8月8日) 基金份额总额	337,779,000.00
本报告期期初基金份额总额	607,279,000.00
本报告期基金总申购份额	131,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	729,779,000.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
Instinet	-	97,577,938. 77	52.04	48,790.48	64.40	-
Morgan Stanley	-	84,054,631. 93	44.83	25,216.62	33.28	-
Goldman	-	5,855,632.0	3.12	1,756.80	2.32	-

Sachs		3					
国信证券	1	-	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准：

基金管理人负责选择证券公司，租用证券公司交易单元进行证券投资，或委托证券公司办理证券投资，选择标准为：

(1) 财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范，具备健全的内控制度；

(2) 提供研究服务的证券公司应当具备较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，提供高质量的研究报告和较为全面的投研服务与支持（被动股票型基金不适用）；

(3) 交易服务能力较强，具备证券交易所需的高效、安全的通讯条件，满足基金进行证券交易或结算的需要。

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

(1) 候选证券公司的尽职调查

根据证券公司选择标准及相关内控制度要求，对证券公司进行甄选并对其开展尽职调查。

(2) 候选证券公司的准入评估

对候选证券公司的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成证券公司准入。

(3) 候选证券公司的审批程序

依据各候选证券公司的综合评估结果，择优选出拟新增证券公司，公司领导对新增证券公司综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与入选的证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：无。

撤销交易单元的证券公司：无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
Instinet	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月7日
2	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月8日
3	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月8日
4	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月9日
5	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月10日
6	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月10日
7	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月13日

8	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月13日
9	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月14日
10	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月15日
11	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月15日
12	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月16日
13	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月16日
14	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月17日
15	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月17日
16	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月20日
17	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月20日
18	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月21日

19	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月21日
20	华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月22日
21	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月22日
22	华安基金管理有限公司旗下部分基金2024年第4季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月22日
23	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月22日
24	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及停牌公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月23日
25	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月24日
26	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月27日
27	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月27日
28	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月5日
29	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月5日
30	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025年2月6日

	投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	站	
31	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月6日
32	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月7日
33	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月7日
34	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月10日
35	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月10日
36	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月11日
37	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月12日
38	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月12日
39	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月13日
40	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月13日
41	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025年2月19日

	投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	站	
42	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月19日
43	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月20日
44	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月20日
45	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月21日
46	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月21日
47	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月24日
48	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月24日
49	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月25日
50	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月25日
51	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月26日
52	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025年2月26日

	投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	站	
53	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月27日
54	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月27日
55	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月27日
56	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月28日
57	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月3日
58	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月4日
59	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月5日
60	关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金暂停申购的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月6日
61	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月6日
62	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月10日
63	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月12日

64	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月13日
65	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月14日
66	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月17日
67	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月18日
68	关于华安基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月19日
69	华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金基金合同(更新)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月19日
70	华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金托管协议(更新)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月19日
71	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月19日
72	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月20日
73	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月20日
74	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江海证券有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月20日
75	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月20日
76	华安国际龙头(DAX)交易型开放式指	中国证监会基金电子披	2025年3月21日

	数证券投资基金更新的招募说明书 (2025年第1号)	露网站及基金管理人网 站	
77	华安国际龙头(DAX)交易型开放式 指数证券投资基金基金产品资料概 要更新	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月21日
78	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月21日
79	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月21日
80	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月24日
81	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月25日
82	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月25日
83	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月26日
84	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月26日
85	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月27日
86	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月27日
87	华安基金管理有限公司关于华安国 际龙头(DAX)交易型开放式指数证券 投资基金二级市场交易价格溢价风 险提示公告	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2025年3月28日

	险提示公告		
88	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月28日
89	华安基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024年度)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月29日
90	华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金2024年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月31日
91	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月31日
92	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月31日
93	华安基金管理有限公司旗下部分基金2024年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年3月31日
94	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月1日
95	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月2日
96	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月2日
97	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月3日
98	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月8日
99	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025年4月9日

	投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	站	
100	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月10日
101	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月11日
102	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月11日
103	关于华安德国(DAX)ETF二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月14日
104	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月14日
105	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月15日
106	关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金因境外主要市场节假日暂停赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月15日
107	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月15日
108	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月16日
109	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月17日
110	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月18日

111	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月21日
112	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月22日
113	华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月22日
114	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月22日
115	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月23日
116	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月24日
117	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月24日
118	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月25日
119	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月29日
120	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年4月30日
121	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月7日
122	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025年5月8日

	投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	站	
123	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月9日
124	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月12日
125	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月13日
126	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月13日
127	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月14日
128	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月15日
129	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月16日
130	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月19日
131	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月20日
132	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月21日
133	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025年5月23日

	投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	站	
134	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月26日
135	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月27日
136	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月29日
137	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年5月30日
138	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年6月3日
139	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年6月16日
140	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年6月16日
141	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年6月20日
142	华安基金管理有限公司关于华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年6月24日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
联接基金	1	20250101~20250630	223,694,276.00	1,000,000.00	71,755,000.00	152,939,276.00	20.96
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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基金合同》
- 2、《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

### 12.3 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住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日