

华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数  
证券投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 31 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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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> .....	<b>6</b>
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> .....	<b>8</b>
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.....	9
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.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
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.....	41
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 .....	46
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.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</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 .....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	52

## § 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	744, 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市的德国企业，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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	40,257,200.15
本期利润	42,439,002.58
加权平均基金份额本期利润	0.0677
本期加权平均净值利润率	5.08%
本期基金份额净值增长率	4.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	251,345,254.08
期末可供分配基金份额利润	0.3375

期末基金资产净值	996,124,254.08
期末基金份额净值	1.337
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	33.70%

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）。

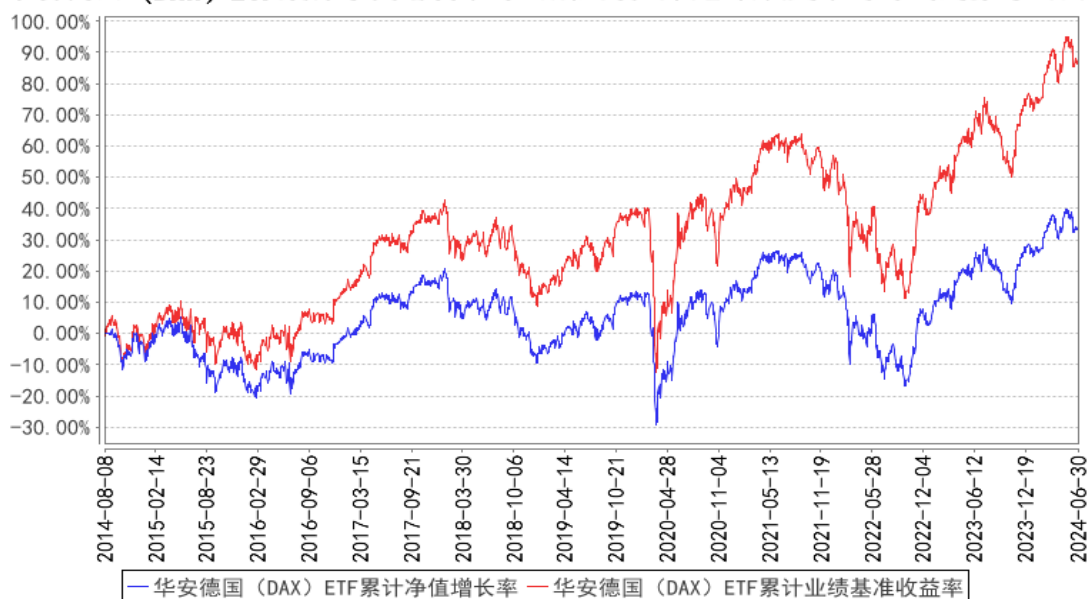
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-2.48%	0.93%	-2.32%	0.93%	-0.16%	0.00%
过去三个月	-2.69%	0.86%	-1.58%	0.87%	-1.11%	-0.01%
过去六个月	4.05%	0.76%	6.12%	0.76%	-2.07%	0.00%
过去一年	6.79%	0.80%	9.84%	0.81%	-3.05%	-0.01%
过去三年	8.26%	1.15%	17.04%	1.16%	-8.78%	-0.01%
自基金合同生效起至今	33.70%	1.26%	87.27%	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。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、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 2024 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 263 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,651.01 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	指数与量化投资部助理总监、本基金的基金经理	2018 年 9 月 10 日	-	13 年	硕士研究生，13 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（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、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日经 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



				<p>起,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月起,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月起,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。</p>
--	--	--	--	--

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《证券投资基金经营机构董事、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合规守信情况的说明

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格和投资策略，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市交易的投资品种、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，根据市场公认的第三方信息（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，欧洲经济整体呈现复苏趋势，主要来源于服务业的回暖，但制造业明显受到了欧元区持续高利率的负面影响，景气度有做走弱。欧元区通胀从高位回落趋势较为明显，因而欧央行 6 月议息会议首次开启降息，将关键利率下调 25BP，未来利率路径将根据数据调整，符合市场预期。得益于欧洲企业盈利的回升和降息周期的开启，指数报告期内表现较好。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.337 元，本报告期份额净值增长率为 4.05%，同期业绩比较基准增长率为 6.12%。

## 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，德国、法国等欧元区主要经济体有望继续呈现温和复苏态势，尤其服务业有望继续保持良好增长。鉴于当前通胀整体回落的宏观环境，预计欧央行大概率维持降息节奏，以提振略显疲态的欧洲制造业。对欧洲股市而言，相对宽松的货币政策，整体有利于估值的进一步提升。但同时也需要特别关注下半年美国大选等政治事件和中东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、固定收益部负责人、绝对收益投资部负责人、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

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。

## § 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

托管人声明：

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

本年度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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	88,461,203.47	26,008,461.50
结算备付金		8,584,758.55	5,905,472.75
存出保证金		7,908,213.97	3,463,077.89
交易性金融资产	6.4.7.2	906,170,499.47	502,032,918.22
其中：股票投资		906,170,499.47	502,032,918.22
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		-	38,885.76
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		1,011,124,675.46	537,448,816.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		14,029,220.73	7,747,375.33
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		610,544.12	346,489.30
应付托管费		152,636.03	86,622.30
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	12,383.78

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	208,020.50	260,768.00
负债合计		15,000,421.38	8,453,638.71
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	744,779,000.00	411,779,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	251,345,254.08	117,216,177.41
净资产合计		996,124,254.08	528,995,177.41
负债和净资产总计		1,011,124,675.46	537,448,816.12

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.337 元，基金份额总额 744,779,000.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		46,947,962.92	79,855,885.04
1. 利息收入		68,756.81	20,360.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	68,756.81	20,360.42
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）		47,430,067.12	49,007,753.13
其中：股票投资收益	6.4.7.10	26,092,824.23	37,271,571.25
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		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	1,993,885.78	3,574,883.92
股利收益	6.4.7.14	19,343,357.11	8,161,297.96
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	2,181,802.43	30,126,607.76
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-6,994,757.66	1,610,889.59
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	4,262,094.22	-909,725.86
<b>减：二、营业总支出</b>		4,508,960.34	2,315,150.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,329,154.54	1,646,738.59
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	832,288.58	411,684.59
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		7,370.01	12,885.04
8. 其他费用	6.4.7.18	340,147.21	243,841.83
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		42,439,002.58	77,540,734.99
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		42,439,002.58	77,540,734.99
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		42,439,002.58	77,540,734.99

### 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	461,279,000.00	-	14,338,879.07	475,617,879.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	461,279,000.00	-	14,338,879.07	475,617,879.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 118,500,000.00	-	71,881,976.91	-46,618,023.09



（一）、综合收益总额	-	-	77,540,734.99	77,540,734.99
（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）	- 118,500,000.00	-	-5,658,758.08	-124,158,758.08
其中：1. 基金申购款	54,000,000.00	-	11,474,892.68	65,474,892.68
2. 基金赎回款	- 172,500,000.00	-	-17,133,650.76	-189,633,650.76
（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	342,779,000.00	-	86,220,855.98	428,999,855.98

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”)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《关于核准华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币337,779,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第446号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于 2014 年 8 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 337,779,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人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。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证基字[2014]497 号文审核同意，本基金 337,779,000.00 份基金份额于 2014 年 9 月 5 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金的标的指数为德国 DAX 指数(DAX Index)，本基金的主要投资范围为标的指数成份股、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。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%。本基金的业绩比较基准为德国 DAX 指数(DAX Index)收益率。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2014 年 8 月 12 日募集成立了华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“华安国际龙头 ETF 联接基金”）。华安国际龙头 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2024 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前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，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前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，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2024年6月30日
活期存款	88,461,203.47
等于：本金	88,456,460.66
加：应计利息	4,742.81
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	88,461,203.47

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	821,666,462.83	-	906,170,499.47	84,504,036.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	场				
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		821,666,462.83	-	906,170,499.47	84,504,036.64

### 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 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	78,221,083.12	-	-	-
其中： 股指期货投资	78,221,083.12	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	78,221,083.12	-	-	-

#### 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
FDAX2409	FDAX2409	22.00	77,549,045.81	-672,037.31
合计				-672,037.31
减：可抵销期货暂收款				-672,037.31
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 2024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	-
预提费用	208,020.50
合计	208,020.50

##### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	411,779,000.00	411,779,000.00
本期申购	493,500,000.00	493,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-160,500,000.00	-160,500,000.00
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	744,779,000.00	744,779,000.00

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	278,930,361.68	-161,714,184.27	117,216,177.41

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	278,930,361.68	-161,714,184.27	117,216,177.41
本期利润	40,257,200.15	2,181,802.43	42,439,002.58
本期基金份额交易产生的变动数	232,978,720.67	-141,288,646.58	91,690,074.09
其中：基金申购款	346,179,678.19	-197,445,686.95	148,733,991.24
基金赎回款	-113,200,957.52	56,157,040.37	-57,043,917.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	552,166,282.50	-300,821,028.42	251,345,254.08

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	68,756.81
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	68,756.81

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	26,092,824.23
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	26,092,824.23

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	194,462,409.53
减：卖出股票成本总额	167,987,738.41
减：交易费用	381,846.89
买卖股票差价收入	26,092,824.23

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	217,543,917.15
减：现金支付赎回款总额	217,543,917.15
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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	1,993,885.78

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	19,343,357.11
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	19,343,357.11

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,908,060.86
股票投资	2,908,060.86
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	-726,258.43
权证投资	-
期货投资	-726,258.43
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	2,181,802.43

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	4,261,649.69
其他	444.53
合计	4,262,094.22

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

审计费用	34,201.74
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	37,630.94
指数许可费	208,642.19
合计	340,147.21

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数使用许可费，按前一日基金资产净值及指数使用许可费率每日计提，按季度支付。计算方法如下：

1. 当前一日的基金资产净值 < 1.5 亿欧元时：  
 每日应计提的指数使用许可费 = 前一日的基金资产净值 × 0.05% / 365；
2. 当前一日的基金资产净值 ≥ 1.5 亿欧元时：每日应计提的指数使用许可费 = 1.5 亿欧元 × 0.05% / 365 + (前一日的基金资产净值 - 1.5 亿欧元) × 0.045% / 365；

若一个季度累计计提指数使用许可费金额 / 该季度最后一日（如为节假日取最近一日）中国人民银行或其授权机构公布的汇率中间价小于指数使用许可协议规定的费用下限，则基金于该季度最后一日补提指数使用许可费至指数使用许可协议规定的费用收取下限。本基金指数使用许可费收取下限为每季度 8,750 欧元。

#### 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

无。

##### 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（“华安基金公司”）	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券投资基金联接基金（“华安国际龙头 ETF 联接基金”）	本基金的联接基金
布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）	境外资产托管人
国泰君安证券股份有限公司	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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,329,154.54	1,646,738.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	60,597.97	-
应支付基金管理人的净管理费	3,268,556.57	1,646,738.59

注：支付基金管理人华安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	832,288.58	411,684.59

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

**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自有资金投资本基金的情况**

无。

**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 2024年6月30日		上年度末 2023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（%）
国泰君安证 券股份有限 公司	700,000.00	0.09	-	-
招商银行一 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	183,694,276.00	24.66	161,234,776.00	39.16

**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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	42,621,445.74	-	38,370,233.19	-
招商银行股份有限公司	45,839,757.73	68,756.81	16,788,533.82	20,360.42

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 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（2024 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行以及境外次托管行布朗兄弟哈里曼银行,因而与该等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。

于 2024 年 6 月 30 日,本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日:同)。

### 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，由于部分成分股流动性差，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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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》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期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。

### 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受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时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、结算备付金和存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	88,461,203.47	-	-	-	88,461,203.47
结算备付金	-	-	-	8,584,758.55	8,584,758.55
存出保证金	-	-	-	7,908,213.97	7,908,213.97
交易性金融资产	-	-	-	-906,170,499.47	906,170,499.47
资产总计	88,461,203.47	-	-	-922,663,471.99	1,011,124,675.46
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	610,544.12	610,544.12
应付托管费	-	-	-	152,636.03	152,636.03
应付清算款	-	-	-	14,029,220.73	14,029,220.73
其他负债	-	-	-	208,020.50	208,020.50
负债总计	-	-	-	15,000,421.38	15,000,421.38
利率敏感度缺口	88,461,203.47	-	-	-907,663,050.61	996,124,254.08
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	26,008,461.50	-	-	-	26,008,461.50
结算备付金	-	-	-	5,905,472.75	5,905,472.75
存出保证金	-	-	-	3,463,077.89	3,463,077.89
交易性金融资产	-	-	-	-502,032,918.22	502,032,918.22
应收清算款	-	-	-	38,885.76	38,885.76
资产总计	26,008,461.50	-	-	-511,440,354.62	537,448,816.12
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	346,489.30	346,489.30
应付托管费	-	-	-	86,622.30	86,622.30
应付清算款	-	-	-	7,747,375.33	7,747,375.33
应交税费	-	-	-	12,383.78	12,383.78
其他负债	-	-	-	260,768.00	260,768.00
负债总计	-	-	-	8,453,638.71	8,453,638.71
利率敏感度缺口	26,008,461.50	-	-	-502,986,715.91	528,995,177.41

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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2023 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（2023 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



金持有不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 2024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	1,894,463.94	-	40,727,519.73	42,621,983.67
结算备付金	-	-	8,584,758.55	8,584,758.55
存出保证金	-	-	7,908,213.97	7,908,213.97
交易性金融资产	-	-	906,170,499.47	906,170,499.47
资产合计	1,894,463.94	-	963,390,991.72	965,285,455.66
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	12,083,588.10	12,083,588.10
负债合计	-	-	12,083,588.10	12,083,588.10
资产负债表外 外汇风险敞口净额	1,894,463.94	-	951,307,403.62	953,201,867.56
项目	上年度末 2023年12月31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	1,731,323.24	-	8,119,866.79	9,851,190.03
结算备付金	-	-	5,905,472.75	5,905,472.75
存出保证金	-	-	3,463,077.89	3,463,077.89

交易性金融资产	-	-	502,032,918.22	502,032,918.22
资产合计	1,731,323.24	-	519,521,335.65	521,252,658.89
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	1,731,323.24	-	519,521,335.65	521,252,658.89

#### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	47,660,000.00	26,060,000.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-47,660,000.00	-26,060,000.00

#### 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，所面临的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%。为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。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 2024年6月30日		上年度末 2023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	906,170,499.47	90.97	502,032,918.22	94.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	906,170,499.47	90.97	502,032,918.22	94.90

#### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	49,215,922.12	20,277,683.08
业绩比较基准下降 5%	-49,215,922.12	-20,277,683.08	

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	906,170,499.47	502,032,918.22
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	906,170,499.47	502,032,918.22

##### 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。  
 本基金本期及上年度可比期间持有的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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2023 年 12 月 31 日：同）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	906,170,499.47	89.62

	其中：普通股	906,170,499.47	89.62
	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	97,045,962.02	9.60
8	其他各项资产	7,908,213.97	0.78
9	合计	1,011,124,675.46	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	906,170,499.47	90.97
合计	906,170,499.47	90.97

## 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	53,702,668.60	5.39
工业	222,124,718.24	22.30
非日常生活消费品	108,600,032.82	10.90
日常消费品	18,327,673.55	1.84
医疗保健	59,411,575.48	5.96
金融	177,256,167.49	17.79
信息技术	164,044,599.86	16.47
通信服务	57,895,080.73	5.81
公用事业	31,997,318.81	3.21
房地产	12,810,663.89	1.29
合计	906,170,499.47	90.97

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

无。

### 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	91,746	133,219,355.80	13.37
2	SIEMENS AG-REG	西门子	SIE GY	德国	德国	67,548	89,905,747.92	9.03
3	ALLIANZ SE-REG	安联保险有限公司	ALV GY	德国	德国	35,150	69,885,621.92	7.02
4	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	德国电信	DTE GY	德国	德国	321,824	57,895,080.73	5.81
5	AIRBUS SE	空中客车有限公司	AIR GY	德国	德国	52,494	51,585,310.07	5.18
6	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	慕尼黑再保险公司	MUV2 GY	德国	德国	11,950	42,757,266.11	4.29
7	MERCEDES-BENZ GROUP AG	梅赛德斯-奔驰集团	MBG GY	德国	德国	66,409	32,853,592.79	3.30
8	INFINEON TECHNOLOGIES AG	英飞凌科技有限公司	IFX GY	德国	德国	117,280	30,825,244.06	3.09

9	BASF SE	巴斯夫欧洲公司	BAS GY	德国	德国	80,153	27,748,480.87	2.79
10	DHL GROUP	德国邮政股份公司	DHL GY	德国	德国	89,495	25,911,992.37	2.60
11	ADIDAS AG	阿迪达斯公司	ADS GY	德国	德国	14,912	25,478,033.30	2.56
12	DEUTSCHE BOERSE AG	德意志交易所集团	DB1 GY	德国	德国	16,976	24,855,425.17	2.50
13	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	德意志银行	DBK GY	德国	德国	179,182	20,466,279.81	2.05
14	BAYERISCHE MOTORENWERKE AG	宝马汽车股份公司	BMW GY	德国	德国	26,797	18,145,348.61	1.82
15	BAYER AG-REG	拜耳股份公司	BAYN GY	德国	德国	88,249	17,836,503.64	1.79
16	E.ON SE	E.ON 有限公司	EOAN GY	德国	德国	182,423	17,128,449.55	1.72
17	VOLKSWAGEN AG-PREF	大众汽车股份公司	VOW3 GY	德国	德国	18,487	14,929,050.77	1.50
18	RWE AG	莱茵集团	RWE GY	德国	德国	60,741	14,868,869.26	1.49
19	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	戴姆勒卡车控股股份公司	DTG GY	德国	德国	51,750	14,737,643.88	1.48
20	RHEINMETALL AG	德国莱茵金属股份有限公司	RHM GY	德国	德国	3,900	14,214,215.69	1.43

21	MERCK KGAA	德国默 克集团	MRK GY	德国	德国	11,589	13,740,475.54	1.38
22	VONOV IA SE	Vonovi a 有限 公司	VNA GY	德国	德国	62,977	12,810,663.89	1.29
23	SIEME NS ENERG Y AG	西门子 能源公 司	ENR GY	德国	德国	59,500	11,082,227.66	1.11
24	SIEME NS HEALT HINEE RS AG	西门子 医疗系 统有限 公司	SHL GY	德国	德国	24,904	10,265,415.35	1.03
25	SYMRI SE AG	德之馨 股份公 司	SY1 GY	德国	德国	11,275	9,873,881.80	0.99
26	COMME RZBAN K AG	德国商 业银行 股份公 司	CBK GY	德国	德国	88,900	9,661,759.97	0.97
27	HANNO VER RUECK SE	汉诺威 再保险 有限公 司	HNR1 GY	德国	德国	5,310	9,629,814.51	0.97
28	HENKE L AG & CO KGAA VOR- PREF	汉高有 限公司	HEN3 GY	德国	德国	14,612	9,316,708.72	0.94
29	MTU AERO ENGIN ES AG	MTU Aero 发动机 股份有 限公司	MTX GY	德国	德国	4,987	9,124,284.82	0.92
30	BEIER SDORF AG	拜尔斯 道夫股 份有限 公司	BEI GY	德国	德国	8,613	9,010,964.83	0.90
31	HEIDE LBERG MATER IALS AG	海德堡 材料股 份公司	HEI GY	德国	德国	12,083	8,963,239.41	0.90



32	FRESENIUS SE & CO KGAA	费森尤斯集团	FRE GY	德国	德国	37,168	7,939,389.43	0.80
33	COVESTRO AG	科思创股份公司	1COV GY	德国	德国	16,951	7,117,066.52	0.71
34	QIAGEN N.V.	德国 QIAGEN 公共有限公司	QIA GY	德国	德国	20,100	5,936,706.55	0.60
35	BRENNTAG SE	Brenntag	BNR GY	德国	德国	11,533	5,563,295.83	0.56
36	DR ING HC F PORSCHE AG	Dr Ing hc F Porsche AG	P911 GY	德国	德国	9,900	5,273,149.70	0.53
37	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	保时捷汽车控股有限公司	PAH3 GY	德国	德国	13,695	4,428,967.89	0.44
38	CONTINENTAL AG	德国大陆集团	CON GY	德国	德国	9,674	3,920,910.22	0.39
39	SARTORIUS AG-VORZUG	赛多利斯有限公司	SRT3 GY	德国	德国	2,201	3,693,084.97	0.37
40	ZALANDO SE	Zalando 股份公司	ZAL GY	德国	德国	21,292	3,570,979.54	0.36

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无。

### 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	79,178,060.04	14.97
2	SIEMENS AG-REG	SIE GY	56,694,654.46	10.72
3	ALLIANZ SE-REG	ALV GY	43,010,242.56	8.13
4	AIRBUS SE	AIR GY	42,419,690.63	8.02
5	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	DTE GY	35,822,794.42	6.77
6	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	MUV2 GY	23,497,606.17	4.44
7	MERCEDES-BENZ GROUP AG	MBG GY	21,697,651.21	4.10
8	INFINEON TECHNOLOGIES AG	IFX GY	19,600,828.61	3.71
9	DHL GROUP	DHL GY	18,061,270.00	3.41
10	BASF SE	BAS GY	17,855,545.22	3.38
11	DEUTSCHE BOERSE AG	DB1 GY	15,139,271.85	2.86
12	ADIDAS AG	ADS GY	13,709,503.99	2.59
13	BAYER AG-REG	BAYN GY	12,700,705.64	2.40
14	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	BMW GY	12,472,538.20	2.36
15	DEUTSCHE BANK AG- REGISTERED	DBK GY	11,419,824.55	2.16
16	E.ON SE	EOAN GY	10,868,271.66	2.05
17	VOLKSWAGEN AG- PREF	VOW3 GY	10,319,412.46	1.95
18	RWE AG	RWE GY	10,198,648.95	1.93
19	MERCK KGAA	MRK GY	9,474,484.64	1.79
20	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	DTG GY	8,837,772.83	1.67

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	SIEMENS AG-REG	SIE GY	20,455,901.85	3.87
2	AIRBUS SE	AIR GY	18,492,396.18	3.50
3	SAP SE	SAP GY	16,778,640.67	3.17
4	ALLIANZ SE-REG	ALV GY	15,790,778.09	2.99
5	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	DTE GY	11,354,318.55	2.15
6	MERCEDES-BENZ GROUP AG	MBG GY	9,462,407.85	1.79

7	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	MUV2 GY	8,841,542.90	1.67
8	INFINEON TECHNOLOGIES AG	IFX GY	7,089,942.36	1.34
9	BASF SE	BAS GY	6,756,949.15	1.28
10	ADIDAS AG	ADS GY	4,961,494.45	0.94
11	DHL GROUP	DHL GY	4,957,359.59	0.94
12	DEUTSCHE BOERSE AG	DB1 GY	4,907,024.80	0.93
13	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	BMW GY	4,336,051.90	0.82
14	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	DBK GY	4,246,906.55	0.80
15	BAYER AG-REG	BAYN GY	4,233,727.56	0.80
16	MERCK KGAA	MRK GY	4,050,697.80	0.77
17	VOLKSWAGEN AG-PREF	VOW3 GY	3,811,557.19	0.72
18	E.ON SE	EOAN GY	3,624,674.59	0.69
19	RWE AG	RWE GY	3,477,386.69	0.66
20	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	DTG GY	3,165,076.21	0.60

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

### 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	569,217,258.80
卖出收入（成交）总额	194,462,409.53

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	FDAX2409	-	-

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-672,037.31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	7,908,213.97
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	7,908,213.97

#### 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 (%)
19,565	38,066.91	400,787,246.00	53.81	343,991,754.00	46.19

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	183,694,276.00	24.66

### 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	38,550,240.00	5.18
2	上海浦东发展银行股份有限公司—南方富誉稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(F)	12,000,000.00	1.61
3	高来贤	10,281,300.00	1.38
4	成都银贝投资管理有 限公司—银贝价值发 现私募证券投资基金	9,634,500.00	1.29
5	东亚前海证券有限责 任公司	8,079,700.00	1.08
6	中国工商银行股份有 限公司—南方全天候 策略混合型基金中基 金（FOF）	8,000,000.00	1.07
7	上海浦东发展银行股 份有限公司—兴证全	7,395,400.00	0.99

	球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FO		
8	王颖	5,698,200.00	0.77
9	杭州复投私募基金管理合伙企业（有限合伙）—复投多策略 06 号私募证券投资基金	5,000,000.00	0.67
10	北京华创智业投资有限公司	4,716,900.00	0.63
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	183,694,276.00	24.66

### 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	411,779,000.00
本报告期基金总申购份额	493,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	160,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	744,779,000.00

## § 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：

2024 年 3 月 12 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》，范伊然女士新任本基金管理人的副总经理。

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：  
无。

### 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

本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

本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

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
Morgan Stanley	-	758,382,014.30	99.31	379,198.02	99.31	-
Goldman Sachs	-	5,297,654.16	0.69	2,649.03	0.69	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、券商选择标准：

选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持，具有良好声誉和财务状况的国内外

经纪商。具体标准如下：

（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）研究服务能力较强，有较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，能够针对本基金投资运作管理需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；能积极为投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；

（3）交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

## 2、券商选择程序：

境外券商：

（1）对候选券商的尽职调查

由相关部门牵头依据券商选择标准及相关内控制度要求，对候选券商开展尽职调查。

（2）完成候选券商的准入评估

对候选券商的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力等进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成券商准入。

（3）填写《新增券商申请审核表》

牵头部门汇总对各候选券商的综合评估结果，择优选出拟新增券商，填写《新增券商申请审核表》，对拟新增券商的必要性和合规性进行阐述。

（4）候选券商名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增券商申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

（5）与相关券商进行开户工作

集中交易部与对应选择券商进行开户工作，完成后，通知信息技术部以及运营部门完成后续相关设置。

境内券商：

（1）对交易单元候选券商的尽职调查

由相关部门牵头依据上述交易单元选择标准及相关内控制度要求，对候选券商开展尽职调



查。

(2) 完成候选券商的准入评估

对候选券商的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力等进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成券商准入。

(3) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(4) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(5) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金券商开户和租用券商交易单元的变更情况：

(1) 境外券商：

无。

(2) 境内券商：

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 (%)
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	华安国际龙头（DAX）ETF2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 1 月 19 日
2	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东兴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和公司网站等指定媒介	2024 年 2 月 2 日
3	关于旗下部分基金增加华鑫证券有限责任公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 2 月 2 日
4	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加甬兴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和公司网站等指定媒介	2024 年 2 月 2 日
5	华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 12 日
6	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通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和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 22 日
7	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申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 26 日
8	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 27 日
9	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 27 日
10	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华源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和公司网站等指定媒介	2024 年 4 月 19 日
11	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 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和公司网站等指定媒介	2024 年 4 月 22 日
12	华安德国（DAX）ETF2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 4 月 22 日
13	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联储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和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 7 日
14	华安基金管理有限公司关于旗下部	中国证监会基金电子披	2024 年 6 月 7 日

	分基金增加渤海证券股份有限公司为一级交易商的公告	露网站和公司网站等指定媒介	
15	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加爱建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和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 21 日
16	华安德国（DAX）ETF 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 28 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	20240101~20240630	161,234,776.00	32,400,000.00	9,940,500.00	183,694,276.00	24.66
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

2024 年 8 月 31 日