华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月三十日

§1 重要提示

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。本年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安黄金易(ETF联接)	
基金主代码	000216	
交易代码	000216	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年8月22日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,899,404,900.91份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C
下属分级基金的交易代码	000216	000217
报告期末下属分级基金的份额总额	713,569,165.74份	1,185,835,735.17份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标主要通过对目标ETF基金份额的投资,紧密跟踪中国黄金现货价格的表现。
投资策略	本基金根据投资人申购、赎回的现金流情况,本基金将综合目标ETF的流动性、折溢价率等因素分析,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪国内黄金现货价格的表现。 其中本基金参与目标ETF二级市场交易将基于基金管理人对一二级市场折溢价率、二级市场流动性、综合成本、上海黄金交易所市场交易特征等研究和分析制定适当的交易策略。 本基金还将适度参与目标ETF 基金份额交易和申购、赎回的组合套利,以增强基金收益。
业绩比较基准	国内黄金现货价格收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金是目标ETF的联接基金,目标ETF为黄金ETF,因此本基金的风险收益特征与国内黄金现货价格的风险收益特征相似,不同于股票基金、混合基金、债券基金和货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆滢	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年		2017年		2016年	
	华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C	华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C	华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C
本期已实现收益	-34,082,352.44	-18,492,132.84	58,083,454.65	10,156,431.49	2,268,369.67	6,765,872.61
本期利润	-42,254,037.29	60,328,152.52	105,520,679.87	15,044,753.12	-17,805,270.51	-10,050,401.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0222	0.0772	0.0449	0.0311	-0.0892	-0.0357
本期加权平均净值利润率	-2.22%	7.78%	4.38%	3.05%	-8.77%	-3.51%
本期基金份额净值增长率	3.49%	3.56%	2.84%	2.55%	17.47%	17.49%
3.1.2期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
	华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C	华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C	华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C
期末可供分配基金份额利润	-0.1617	-0.1667	-0.1427	-0.1484	-0.1645	-0.1673
期末基金资产净值	746,661,354.23	1,234,053,155.84	2,670,806,094.61	372,568,778.11	508,538,064.46	464,692,253.10
期末基金份额净值	1.0464	1.0407	1.0111	1.0049	0.9832	0.9799

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

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

1.华安黄金易(ETF联接) A:

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
过去三个月	7.57%	0.43%	7.39%	0.42%	0.18%	0.01%
过去六个月	6.06%	0.38%	6.13%	0.37%	-0.07%	0.01%
过去一年	3.49%	0.39%	4.05%	0.38%	-0.56%	0.01%
过去三年	25.02%	0.63%	26.37%	0.62%	-1.35%	0.01%
过去五年	18.77%	0.72%	19.43%	0.71%	-0.66%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.64%	0.72%	4.41%	0.72%	0.23%	0.00%

2.华安黄金易(ETF联接) C:

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
过去三个月	7.69%	0.43%	7.39%	0.42%	0.30%	0.01%
过去六个月	6.17%	0.38%	6.13%	0.37%	0.04%	0.01%
过去一年	3.56%	0.39%	4.05%	0.38%	-0.49%	0.01%
过去三年	24.78%	0.63%	26.37%	0.62%	-1.59%	0.01%
过去五年	18.26%	0.72%	19.43%	0.71%	-1.17%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.07%	0.72%	4.41%	0.72%	-0.34%	0.00%

注:本基金的业绩比较基准为:国内黄金现货价格收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%

本基金的投资范围包括:本基金主要投资于目标ETF基金份额以及上海黄金交易所挂盘交易的黄金现货合约等黄金品种。此外,本基金还可以投资于固定收益类证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

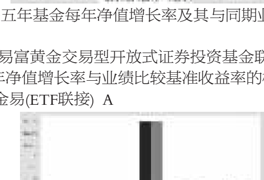
本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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

华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年8月22日至2018年12月31日)

1、华安黄金易(ETF联接) A

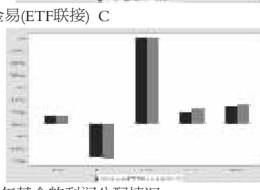
2、华安黄金易(ETF联接) C



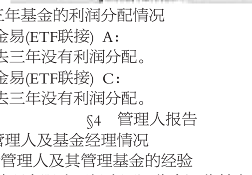
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金
过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、华安黄金易(ETF联接) A



2、华安黄金易(ETF联接) C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、华安黄金易(ETF联接) A:
本基金过去三年没有利润分配。
2、华安黄金易(ETF联接) C:
本基金过去三年没有利润分配。

§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。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司,在香港和上海设有子公司——华安(香港)资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至2018年12月31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108只开放式基金,管理资产规模达到2756.06亿元人民币。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
许之彦	本基金的基金经理,指数与量化投资部高级总监,总经理助理	2013-08-22	-	15年	理学博士;15年证券、基金从业经验,CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作,2005年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部数量策略分析师,2008年4月至2012年12月担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理,2009年9月起同时担任上证180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。2010年11月至2012年12月担任上证龙头企业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。2011年9月起同时担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2013年6月起担任指数投资部高级总监。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理,2013年8月起同时担任本基金的基金经理。2014年11月至2015年12月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015年7月起担任华安创业板50指数分级证券投资基金的基金经理。2016年6月起担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017年12月起,同时担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金、华安沪深300量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018年11月起,同时担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
徐宜宜	本基金的基金经理,指数与量化投资部助理总监	2013-08-22	2018-09-28	12年	管理学硕士,CFA(国际金融分析师),FRM(金融风险管理师),12年证券、基金行业从业经历,具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5月至2012年12月担任上证龙头企业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职务。2012年3月至2018年9月同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2013年7月至2018年9月同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月至2018年9月同时担任本基金及华安纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。2013年12月至2016年9月同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014年8月至2018年9月同时担任华安国际龙头(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。2017年4月至2018年9月,同时担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年4月至2018年9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的基金经理。2018年5月至2018年9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联接基金的基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。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,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(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。通过内部共同的iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风险管理部投资监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间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。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,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4次,未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年黄金开盘价1302.61美元/盎司,最高价1366.06美元/盎司,最低价1160.00美元/盎司,截止12月31日收盘价1282.20美元/盎司,全年下跌20.43美元/盎司,跌幅为1.57%。上海黄金交易所au9999开盘价279.55元/克,最高价287.95元/克,最低价262.70元/克,截止12月28日收盘价284.60元/克,全年上涨10.05元/克,涨幅为3.62%。金价在报告期内触底回升,主要受到如下因素影响:1) 2018年全年美联储四次加息,导致利率水平抬升抑制了黄金价格;2) 2018年年底,全球经济增长放缓的担忧导致避险需求上升,经济数据包括房地产销售和联储信心指数均有所下行;3)2018年末美国股票市场出现回调,以纳斯达克市场科技企业为主的全球化企业率先下跌,引发了市场对美联储加息预期的逆转;4)受到原油价格回落影响,通胀预期先强后弱。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,华安黄金易(ETF联接)A份额净值为1.0464元,C份额净值为1.0407元;华安黄金易(ETF联接)A份额净值增长率为3.49%,C份额净值增长率为3.56%,同期业绩比较基准增长率为4.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看,美联储加息周期步入尾声,加息的概率大幅度下降,年底结束缩表计划的可能性增加。2019年美元在经济预期弱化的前提下或维持震荡偏弱的格局,黄金价格中期有所支撑。另一方面,中长期来看股票盈利增长受制于减税政策效果消退以及中美贸易摩擦谈判进程,市场波动率有所上升,经济增长担忧加剧,避险情绪回归。值得注意的是,随着利率水平的抬升,风险资产的风险溢价下降将具有持续性,风险资产的估值仍具有高估风险。黄金ETF联接作为与股票相关性不高且波动率低的资产配置品种,值得投资者密切关注。

作为黄金ETF联接基金的管理人,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。

4.6 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。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成,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。

4.7 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。

4.8 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

报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 蒋燕华 沈熙苑签字出具了安永华明(2019)审字第60971571_B03号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:	-	-
银行存款	83,169,186.38	72,774,263.22
结算备付金	13,108,613.36	97,607,008.41
存出保证金	8,746,504.18	11,131,016.25
交易性金融资产	1,893,618,997.36	2,885,682,664.18
其中:股票投资	-	-
基金投资	1,831,428,252.96	2,875,524,334.18
债券投资	53,083,544.40	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	9,107,200.00	10,158,330.00
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	101,214.24	-
应收利息	1,491,938.32	26,043.26
应收股利	-	-
应收申购款	16,781,743.26	4,584,734.63
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,017,018,197.10	3,071,805,729.95
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	18,388,627.40
应付赎回款	35,597,429.89	9,516,795.58
应付管理人报酬	47,948.71	91,894.79
应付托管费	9,589.72	18,378.94
应付销售服务费	337,013.81	110,770.25
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	311,704.90	304,390.27
负债合计	36,303,687.03	28,430,857.23
所有者权益:	-	-
实收基金	1,899,404,900.91	3,012,197,511.65
未分配利润	81,309,609.16	31,177,361.07
所有者权益合计	1,980,714,510.07	3,043,374,872.72
负债和所有者权益总计	2,017,018,197.10	3,071,805,729.95

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0428元,基金份额总额1,899,404,900.91份,其中A类基金份额净值1.0464元,基金份额总额713,569,165.74份;C类基金份额净值1.0407元,基金份额总额1,185,835,735.17份。

7.2 利润表

会计主体:华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	27,652,485.68	132,402,163.36
1.利息收入	2,374,456.71	941,160.19
其中:存款利息收入	699,071.45	941,160.19
债券利息收入	1,675,385.26	-
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)	-50,286,376.00	78,068,084.65
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-50,771,762.36	55,183,869.82
债券投资收益	145,128.36	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	1,069,065.99	706,829.17
衍生工具收益	-728,807.99	22,177,385.66
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	70,648,600.51	52,325,546.85
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	4,915,804.46	1,067,371.67
减:二、费用	9,578,370.45	11,836,730.37
1. 管理人报酬	825,127.61	1,084,077.08
2. 托管费	165,025.61	216,815.44
3. 销售服务费	2,696,359.08	1,725,454.74
4. 交易费用	5,569,826.20	8,487,084.27
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	1,257.41	-
7. 其他费用	320,774.54	323,298.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	18,074,115.23	120,565,432.99
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	18,074,115.23	120,565,432.99

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,012,197,511.65	31,177,361.07	3,043,374,872.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,074,115.23	18,074,115.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,112,792,610.74	32,058,132.86	-1,080,734,477.88
其中:1.基金申购款	5,046,876,623.71	-21,329,410.55	5,025,547,213.16
2.基金赎回款	-6,159,669,234.45	53,387,543.41	-6,106,281,691.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,899,404,900.91	81,309,609.16	1,980,714,510.07
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	991,448,429.71	-18,218,112.15	973,230,317.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	120,565,432.99	120,565,432.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	2,020,749,081.94	-71,169,959.77	1,949,579,122.17
其中:1.基金申购款	5,470,704,271.27	58,796,216.75	5,529,500,488.02
2.基金赎回款	-3,449,955,189.33	-129,966,176.52	-3,579,921,365.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,012,197,511.65	31,177,361.07	3,043,374,872.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:朱学华,主管会计工作负责人:赵敏,会计机构负责人:陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金(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[2013]771号文《关于核准华安易富黄金交易型开放式证券投资基金及联接基金募集的批复》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2013年8月22日正式生效,首次设立募集规模为410,885,288.67份基金份额。本基金为契约型开放式,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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资于目标ETF基金份额以及上海黄金交易所挂盘交易的黄金现货合约等黄金品种。此外,本基金还可以投资于固定收益类证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。正常情况下,本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为:国内黄金现货价格收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。

7.4.2 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、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券投资基金业协会制定的《黄金交易型开放式证券投资基金及联接基金会计核算和估值业务指引(试行)》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《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《年度报告和半年度报告》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 增值税

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《关于资产管理产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,本基金的基金管理人运营本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。对本基金在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,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011年修订)》、《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)及地方教育费附加。?

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,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、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
华安易富黄金交易型开放式证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东(2018年12月5日前)
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东(2018年12月5日前)
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东(自2018年12月5日起)
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东(自2018年12月5日起)
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注:1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.根据华安基金管理有限公司于2018年12月7日发布的公告,经华安基金管理有限公司股东会第五十六次会议决议、第五十九次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2018]2012号文核准,华安基金管理有限公司股东国泰君安创新投资有限公司、上海国际信托有限公司将各持有的华安基金管理有限公司20%的股权分别转让给国泰君安证券股份有限公司和上海上国投资产管理有限公司。自2018年12月5日起,华安基金管理有限公司股东变更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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	825,127.61	1,084,077.08
其中:支付销售机构的客户维护费	2,261,258.00	1,748,582.04

注:本基金投资目标ETF部分不收取管理费。在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的0.50%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分,若为负数,则E取0。

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	165,025.61	216,815.44

注:本基金投资目标ETF部分不收取托管费。在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分,若为负数,则E取0。

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C	合计
华安基金管理有限公司	-	30,457.19	30,457.19
建设银行	-	36,475.81	36,475.81
合计	-	66,933.00	66,933.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C	合计
华安基金管理有限公司	-	47,445.99	47,445.99
中国建设银行	-	51,856.77	51,856.77
合计	-	99,302.76	99,302.76

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.35%/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日 华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C
期初持有的基金份额	19,343,263.37	-	19,343,263.37	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	19,343,263.37	-	19,343,263.37	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.02%	-	0.64%	-

7.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行	83,169,186.38	535,617.72	72,774,263.22	728,458.38

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末,本基金持有648,339,087.00份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为24.59%。上年度末2017年12月31日,本基金持有1,054,967,287.00份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为56.74%。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币1,840,535,452.96元,属于第二层次的余额为人民币53,083,544.40元,属于第三层次的余额为人民币0.00元(于2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币2,885,682,664.18元,属于第二层次的余额为人民币0.00元,属于第三层次的余额为人民币0.00元)。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 比较数据

若干比较数据已进行重述,以符合本年度之列报要求。

7.4.14.5 财务报表的批准

本财务报表已于2019年3月26日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	1,831,428,252.96	90.80
3	固定收益投资	53,083,544.40	2.63
	其中:债券	53,083,544.40	2.63
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	9,107,200.00	0.45
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	96,277,799.74	4.77
8	其他各项资产	27,121,400.00	1.34
9	合计	2,017,018,197.10	100.00

8.2期末投资目标基金明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华安易富黄金交易型开放式证券投资基金	黄金ETF	交易型、开放式	华安基金管理有限公司	1,831,428,252.96	92.46

8.3期末按行业分类的股票投资组合

8.3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.3.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.5报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末买入股票。

8.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末卖出股票。

8.6期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	53,083,544.40	2.68
	其中:政策性金融债	53,083,544.40	2.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	53,083,544.40	2.68

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	528,510	53,083,544.40	2.68

8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	AU9999	AU9999	32,000	9,107,200.00	0.46

8.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

基金本报告期没有投资股指期货。

8.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.12报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.12.1 本期国债期货投资政策

无。

8.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

8.12.3 本期国债期货投资评价

无。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1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。

8.13.2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。

8.13.3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	8,746,504.18
2	应收证券清算款	101,214.24
3	应收股利	-
4	应收利息	1,491,938.32
5	应收申购款	16,781,743.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,121,400.00

8.13.4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。

8.13.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
华安黄金易(ETF联接) A	92,026	7,754.00	318,301,400.48	44.61%	395,267,765.26	55.39%
华安黄金易(ETF联接) C	6,040,168	196.32	15,872,246.38	1.34%	1,169,963,488.79	98.66%
合计	6,132,194	309.74	334,173,646.86	17.59%	1,565,231,254.05	82.41%

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)。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安黄金易(ETF联接) A	690,696.90	0.10%
	华安黄金易(ETF联接) C	716,008.67	0.06%
	合计	1,406,704.57	0.07%

9.3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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安黄金易(ETF联接) A	0~10
	华安黄金易(ETF联接) C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华安黄金易(ETF联接) A	0~10
	华安黄金易(ETF联接) C	0~10
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安黄金易(ETF联接) A	华安黄金易(ETF联接) C
基金合同生效日(2013年8月22日)基金份额总额	319,252,743.65	91,632,545.02
本报告期期初基金份额总额	2,641,459,188.79	370,738,322.86
本报告期基金总申购份额	1,311,047,351.94	3,735,829,271.77
减:本报告期基金总赎回份额	3,238,937,374.99	2,920,731,859.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	713,569,165.74	1,185,835,735.17

§11 重大事件揭示

11.1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。

11.2 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:

2018年2月13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变更的公告》,翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币50000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限:自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2018年4月,针对上海证监局向公司出具的《关于对华安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,公司高度重视,逐一落实各项整改要求,针对性地制定、实施整改措施,进一步提升公司内部控制和风险管理能力。2018年5月,公司已通过上海证监局的检查验收。

除上述情况外,本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
银河证券	2	-	-	-	-	-

注:1、券商专用交易单元选择标准:

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其交易单元供本基金证券买卖专用,选择标准为:

(1)内部管理规范、严谨;具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(2)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能够针对本基金业务需要,提供高质量的研究报告和较为全面的服务;

(3)具有战略规划和定位,能够积极推动多边业务合作,最大限度地调动整体资源,为基金投资赢取机会;

(4)其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序:

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》,对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 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。

(3) 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。

(4)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、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

无

11.7.2 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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	210,881,200.50	100.00%	-	-	-	-

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180822	2,059,682,113.31	0.00	2,059,682,113.31	0.00	0.00%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司
二〇一九年三月三十日