

华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金
2016 年半年度报告
2016 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

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。本半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 2016 年 8 月 23 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末投资目标基金明细	40
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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股票投资明细	40
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.7 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	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.9 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	41
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	41
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.13 投资组合报告附注	42
8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，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分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。	43
8.3 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	43
9 开放式基金份额变动	43
10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	46
11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录	49
11.2 存放地点	49
11.3 查阅方式	49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金	
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	362,352,892.37 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	107,445,754.54 份	254,907,137.83 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华安易富黄金交易型开放式证券投资基金
基金主代码	518880
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2013 年 7 月 18 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 7 月 29 日
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标主要通过目标 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	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%
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。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标主要是紧密跟踪国内黄金现货价格的表现。
投资策略	本基金通过将绝大部分基金财产投资并持有上海黄金交易所挂牌交易的黄金现货合约等黄金品种，来实现跟踪国内黄金现货价格表现的目标。若因特殊情况(如上海黄金交易所市场流动性不足、黄金现货合约存量不足、法律法规禁止或限制等)导致无法获得足够数量的黄金现货合约时，基金管理人将采用合理方法进行替代投资，以达到跟踪国内黄金现货价格的目的。 为更好地实现投资目标，本基金可以适当参与流动性好、交易活跃的黄金现货延期交收合约和黄金远期。在风险可控的前提下，本基金本着审慎原则，主要以提高投资效率、降低交易成本、风险管理等为目的，而非用于投机。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为国内黄金现货价格收益率。
风险收益特征	本基金属于黄金 ETF，其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	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		朱学华	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）	
	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	2,242,096.71	4,879,251.66
本期利润	14,056,002.46	20,644,991.03
加权平均基金份额本期利润	0.1716	0.1201
本期加权平均净值利润率	17.67%	12.31%
本期基金份额净值增长率	25.32%	25.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
	华安黄金易(ETF 联接) A	华安黄金易(ETF 联接) C
期末可供分配利润	-18,527,439.08	-44,465,996.36
期末可供分配基金份额利润	-0.1724	-0.1744
期末基金资产净值	112,697,724.92	266,682,140.54
期末基金份额净值	1.0489	1.0462
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
	华安黄金易(ETF 联接) A	华安黄金易(ETF 联接) C
基金份额累计净值增长率	4.89%	4.62%

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

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
过去一个月	9.40%	1.38%	9.10%	1.34%	0.30%	0.04%
过去三个月	9.95%	1.01%	9.59%	0.98%	0.36%	0.03%
过去六个月	25.32%	1.00%	25.01%	0.98%	0.31%	0.02%
过去一年	19.60%	0.94%	18.84%	0.92%	0.76%	0.02%
自基金合同生效起至今	4.89%	0.86%	3.29%	0.86%	1.60%	0.00%

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
过去一个月	9.40%	1.38%	9.10%	1.34%	0.30%	0.04%
过去三个月	9.89%	1.01%	9.59%	0.98%	0.30%	0.03%
过去六个月	25.44%	1.00%	25.01%	0.98%	0.43%	0.02%
过去一年	19.70%	0.94%	18.84%	0.92%	0.86%	0.02%
自基金合同生效起至今	4.62%	0.85%	3.29%	0.86%	1.33%	-0.01%

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牌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%。

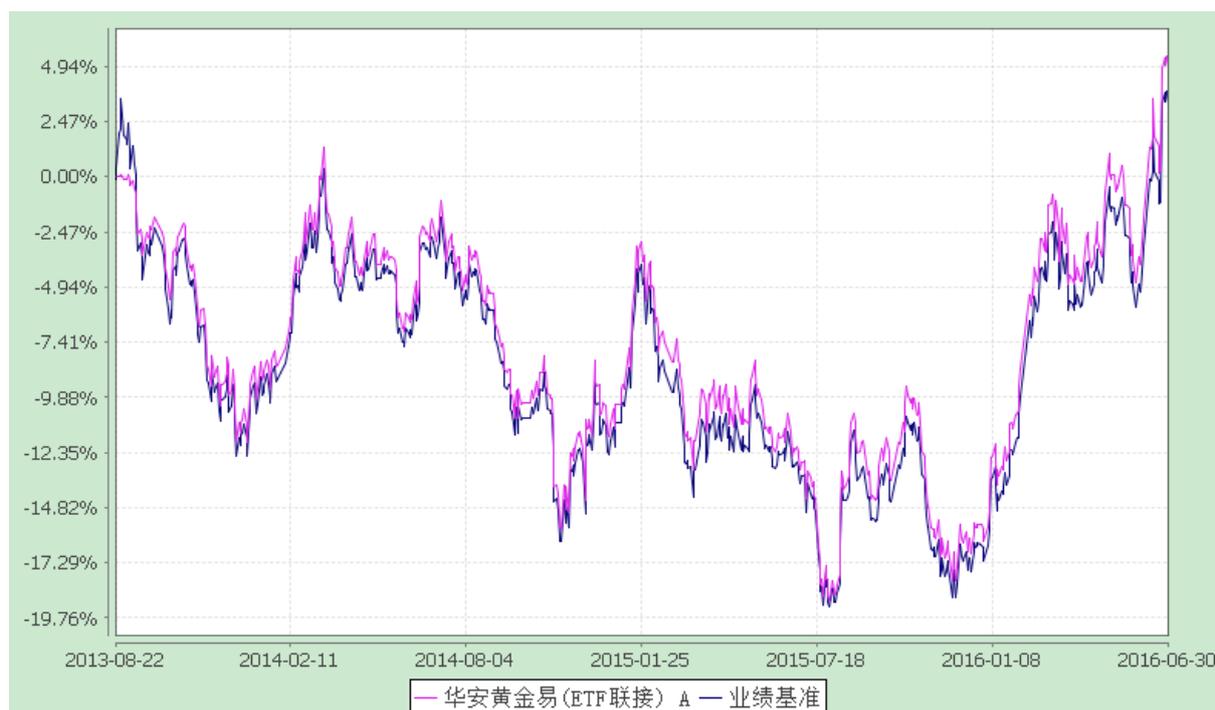
3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金

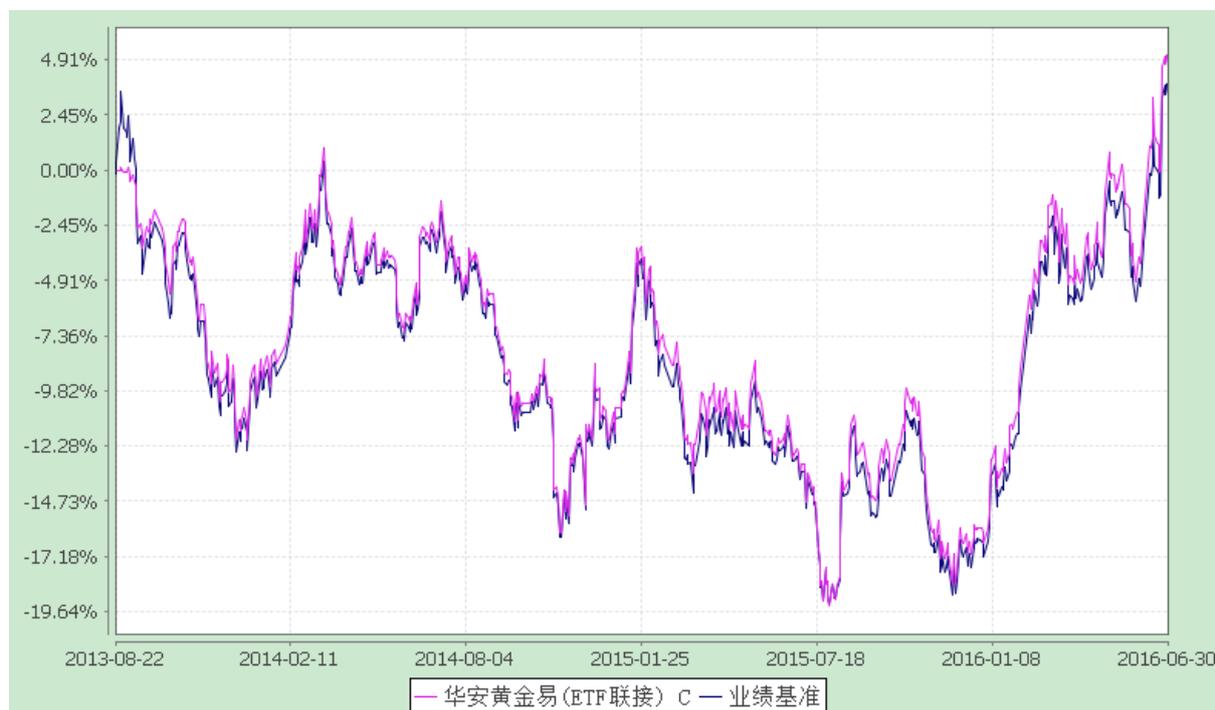
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 8 月 22 日至 2016 年 6 月 30 日)

华安黄金易(ETF 联接) A



华安黄金易(ETF 联接) C



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。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安外延增长、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息、华安创业板 50ETF 等 77 只开放式基金。管理资产规模达到 1403.87 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	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
徐宜宜	基金经理	2013-07-18	-	10 年	<p>管理学硕士，CFA（国际金融分析师），FRM（金融风险管理师），10 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 月起同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金的基金经理。2013 年 7 月起同时担任本基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接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 月起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 月起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。</p>
许之彦	基金经理，指数与量化投资事业总部高级总监	2013-07-18	-	13 年	<p>理学博士，13 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</p>

					<p>年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任本基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月起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 7 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。</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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。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、发送邮件、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，则投资部门在风控部门的监督参与下，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；风险管理部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。

4.3.2 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，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 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

报告期以来，黄金市场呈现出一个震荡走高的趋势。以美元计价的国际金价上涨 26.56%，国内金交所 AU9999 金价上涨 27.53%。黄金价格受到如下因素影响：1) 期初人民币汇率出现一定波动，国内对黄金投资的需求得以恢复。2) 以朝核为代表的地缘政治风险不断暴露，恐怖袭击事件时有发生，刺激了全球避险需求，利好黄金。3) 脱欧派以 52% 的得票率在英国是否脱离欧盟的公投中胜出，

刺激了全球避险需求，利好黄金。4) 非农就业数据疲弱，导致经济增长预期减缓，利好黄金。5) 美国提早加息的预期迅速降温，引发的避险情绪不断升温，利好黄金。6) 美国提早加息的预期迅速降温，引发的避险情绪不断升温，利好黄金。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，华安黄金易（ETF 联接）A 份额净值为 1.0489 元，C 份额净值为 1.0462 元；华安黄金易（ETF 联接）A 份额净值增长率为 25.32%，C 份额净值增长率为 25.44%，同期业绩比较基准增长率为 25.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

影响黄金价格的正面因素包括股市债市资金流出，全球负利率扩散以及黄金价格本身技术上的反弹。此外，地缘政治的不确定性在全球范围内均有所加强，而金融体系在未来加息的预期下仍然存在不稳定的因素。这些因素均构成了对黄金作为避险工具的实质性利好。我们预计黄金价格在 2016 年全年将保持稳定向上的态势。中长期看，强势美元并不意味着黄金价格将在目前的水平下继续下跌，建议投资者更加关注避险情绪的提升带来的阶段性机会。

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

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责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；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历:

翁启森，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利混合、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网主题股票、华安宝利配置混合、华安生态优先混合的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安策略优选混合、华安国企改革灵活配置、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，理学博士，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，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数 (LOF)、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理,指数投资部高级总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

(2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

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关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 托管人对本半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 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	15,378,375.22	3,384,624.36
结算备付金		16,576,216.89	141,881.65
存出保证金		1,255,704.65	250,314.20
交易性金融资产	6.4.7.2	363,297,240.56	49,575,502.80
其中：股票投资		-	-
基金投资		363,297,240.56	49,352,642.80
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	222,860.00
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,937,975.28	-
应收利息	6.4.7.5	3,896.26	795.73
应收股利		-	-
应收申购款		11,457,644.66	277,192.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		409,907,053.52	53,630,311.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		-	-
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		-	-
应付证券清算款		-	446,620.09
应付赎回款		30,322,211.30	755,044.74
应付管理人报酬		6,641.29	1,387.62
应付托管费		1,328.25	277.54
应付销售服务费		66,712.08	6,410.25

应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	130,295.14	290,208.38
负债合计		30,527,188.06	1,499,948.62
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	362,352,892.37	62,376,586.31
未分配利润	6.4.7.10	17,026,973.09	-10,246,223.82
所有者权益合计		379,379,865.46	52,130,362.49
负债和所有者权益总计		409,907,053.52	53,630,311.11

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0470 元，基金份额总额 362,352,892.37 份，其中 A 类基金的基金份额净值 1.0489 元，份额总额 107,445,754.54 份；C 类基金的基金份额净值 1.0462 元，份额总额 254,907,137.83 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		35,445,253.70	-659,221.63
1.利息收入		46,380.63	11,367.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	46,380.63	11,367.34
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）		7,255,061.46	-725,626.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	5,748,542.96	-708,236.99
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-124,173.32	-22,906.42
衍生工具收益	6.4.7.17	1,630,691.82	5,516.92
股利收益	6.4.7.18	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	27,579,645.12	20,068.57

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	564,166.49	34,968.95
减：二、费用		744,260.21	212,907.99
1. 管理人报酬		30,532.15	6,905.71
2. 托管费		6,106.37	1,381.21
3. 销售服务费		282,224.03	21,646.10
4. 交易费用	6.4.7.21	300,804.65	39,014.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.22	124,593.01	143,960.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,700,993.49	-872,129.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,700,993.49	-872,129.62

6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	62,376,586.31	-10,246,223.82	52,130,362.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,700,993.49	34,700,993.49
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）	299,976,306.06	-7,427,796.58	292,548,509.48
其中：1.基金申购款	1,224,236,828.80	-25,538,406.52	1,198,698,422.28
2.基金赎回款	-924,260,522.74	18,110,609.94	-906,149,912.80
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）	362,352,892.37	17,026,973.09	379,379,865.46
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	48,711,161.18	-5,018,273.54	43,692,887.64

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-872,129.62	-872,129.62
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)	323,420.42	-193,282.13	130,138.29
其中: 1.基金申购款	80,082,281.27	-7,685,929.64	72,396,351.63
2.基金赎回款	-79,758,860.85	7,492,647.51	-72,266,213.34
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)	49,034,581.60	-6,083,685.29	42,950,896.31

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:

基金管理人负责人: 朱学华, 主管会计工作负责人: 章国富, 会计机构负责人: 陈林

6.4 报表附注

6.4.1 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%。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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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（以下合称“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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

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

6.4.6.1 营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	15,378,375.22
定期存款	-
其他存款	-
合计	15,378,375.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	338,831,455.51	363,297,240.56	24,465,785.05
其他	-	-	-
合计	338,831,455.51	363,297,240.56	24,465,785.05

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	-	-	-	-
其他衍生工具	15,794,240.00	-	-	注
合计	-	-	-	-

注： 其他衍生工具具体如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日

	持仓量（买/卖）（克）	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
黄金现货延期交收合约	56,000.00	15,722,938.74	15,794,240.00	71,301.26
总额合计				71,301.26
减：可抵销期货暂收款				71,301.26
黄金期货投资净额				-

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,732.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,143.55
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	20.25
合计	3,896.26

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,980.04
预提账户维护费	-
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	99,452.08
合计	130,295.14

6.4.7.9 实收基金

华安黄金易(ETF 联接) A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	37,416,470.78	37,416,470.78
本期申购	252,677,173.56	252,677,173.56
本期赎回（以“-”号填列）	-182,647,889.80	-182,647,889.80
本期末	107,445,754.54	107,445,754.54

华安黄金易(ETF 联接) C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	24,960,115.53	24,960,115.53
本期申购	971,559,655.24	971,559,655.24
本期赎回（以“-”号填列）	-741,612,632.94	-741,612,632.94
本期末	254,907,137.83	254,907,137.83

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

华安黄金易(ETF 联接) A

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	-7,366,059.78	1,261,315.85	-6,104,743.93
本期利润	2,242,096.71	11,813,905.75	14,056,002.46
本期基金份额交易产生的变动数	-13,403,476.01	10,704,187.86	-2,699,288.15
其中：基金申购款	-47,355,683.65	41,369,457.87	-5,986,225.78
基金赎回款	33,952,207.64	-30,665,270.01	3,286,937.63
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	-18,527,439.08	23,779,409.46	5,251,970.38

华安黄金易(ETF 联接) C

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	-4,980,473.20	838,993.31	-4,141,479.89
本期利润	4,879,251.66	15,765,739.37	20,644,991.03
本期基金份额交易产生的变动数	-44,364,774.82	39,636,266.39	-4,728,508.43
其中：基金申购款	-184,019,907.65	164,467,726.91	-19,552,180.74
基金赎回款	139,655,132.83	-124,831,460.52	14,823,672.31
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	-44,465,996.36	56,240,999.07	11,775,002.71

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,019.55
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	8,150.48
其他	210.60
合计	46,380.63

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期末无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	242,981,302.39
减：卖出/赎回基金成本总额	237,232,759.43

基金投资收益	5,748,542.96
--------	--------------

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 贵金属投资收益

6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-405,272.59
贵金属投资收益——赎回差价收入	-
贵金属投资收益——申购差价收入	281,099.27
合计	-124,173.32

6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出贵金属成交总额	22,672,544.50
减：卖出贵金属成本总额	23,077,817.09
买卖贵金属差价收入	-405,272.59

6.4.7.16.3 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
申购贵金属份额总额	478,527,090.00
减：现金支付申购款总额	158,560.62
减：申购贵金属成本总额	478,087,430.11
申购差价收入	281,099.27

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
黄金现货延期合约	1,630,691.82

6.4.7.18 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	27,417,526.94
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	27,418,286.94
——贵金属投资	-760.00
——其他	-
2.衍生工具	162,118.18
——权证投资	-
——黄金现货延期交收合约	162,118.18
4.其他	-
合计	27,579,645.12

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	533,822.52
转换费收入	30,343.97
合计	564,166.49

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	300,804.65
银行间市场交易费用	-
合计	300,804.65

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	99,452.08
银行汇划费用	130.00
其他费用	147.91
合计	124,593.01

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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、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

注：以下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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	30,532.15	6,905.71
其中：支付销售机构的客户维护费	223,112.54	39,850.60

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：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,106.37	1,381.21

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：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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，按月支付。基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 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 2016年1月1日至2016年6月30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	-	11,022.49	11,022.49
建设银行	-	18,282.73	18,282.73
合计	-	29,305.22	29,305.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	-	5,939.08	5,939.08
建设银行	-	9,305.14	9,305.14
合计	-	15,244.22	15,244.22

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：：

$$H = E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度均无投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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
中国建设银行	15,378,375.22	38,019.55	1,499,103.46	9,395.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末，本基金持有 129,103,497.00 份额目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 7.96%。本基金持有 22,101,497.00 目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 6.90%

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 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

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。

6.4.12.2 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。

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

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于黄金 ETF 联接基金，其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、债券基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括目标 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、固定收益证券、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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督

察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，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监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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。

本公司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，并根据本公司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。本基金在银行间同业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；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密

监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此均能以合理价格适时变现。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。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,378,375.22	-	-	-	15,378,375.22
结算备付金	16,576,216.89	-	-	-	16,576,216.89
存出保证金	150,107.85	-	-	1,105,596.80	1,255,704.65
交易性金融资产	-	-	-	363,297,240.56	363,297,240.56

					6
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,937,975.28	1,937,975.28
应收利息	-	-	-	3,896.26	3,896.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	11,457,644.66	11,457,644.66
资产总计	32,104,699.96	-	-	377,802,353.56	409,907,053.52
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	30,322,211.30	30,322,211.30
应付管理人报酬	-	-	-	6,641.29	6,641.29
应付托管费	-	-	-	1,328.25	1,328.25
应付销售服务费	-	-	-	66,712.08	66,712.08
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	130,295.14	130,295.14
负债总计	-	-	-	30,527,188.06	30,527,188.06
利率敏感度缺口	32,104,699.96	-	-	347,275,165.50	379,379,865.46
上年度末					
2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,384,624.36	-	-	-	3,384,624.36
结算备付金	141,881.65	-	-	-	141,881.65
存出保证金	109,824.20	-	-	140,490.00	250,314.20
交易性金融资产	-	-	-	49,575,502.80	49,575,502.80

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	795.73	795.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	277,192.37	277,192.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,636,330.21	-	-	49,993,980.90	53,630,311.11
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	-	-	-	446,620.09	446,620.09
应付赎回款	-	-	-	755,044.74	755,044.74
应付管理人报酬	-	-	-	1,387.62	1,387.62
应付托管费	-	-	-	277.54	277.54
应付销售服务费	-	-	-	6,410.25	6,410.25
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	290,208.38	290,208.38
负债总计	-	-	-	1,499,948.62	1,499,948.62
利率敏感度缺口	3,636,330.21	-	-	48,494,032.28	52,130,362.49

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为黄金 ETF 投资基金，于 2016 年 6 月 30 日及 2015 年 12 月 31 日未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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，所面临的其他价格风险来源于所持有的金融工具的价格波动的影响。

本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。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于二级市场折溢价率、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。本基金也可以通过买入黄金现货合约来跟踪国内黄金现货价格的表现。为了更好地实现投资目标，基金还可投资于债券、货币市场工具等产品，并在法规允许的条件下参与证券借贷，以增加收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中目标 ETF 的投资比例不低于基金资产的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府证券不低于基金资产净值的 5%。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	363,297,240. 56	95.76	49,352,642.80	94.67
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	222,860.00	0.43

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	363,297,240.	95.76	49,575,502.80	95.10
	56			

注：本基金以目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产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%。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较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：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	比较基准上升 5%	增加约 1,920	增加约 266
	比较基准下降 5%	减少约 1,920	减少约 266

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 8 月 23 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	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	363,297,240.56	88.63
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
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	31,954,592.11	7.80
8	其他各项资产	14,655,220.85	3.58
9	合计	409,907,053.52	100.00

7.2 报告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	363,297,240.56	95.76

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 报告期内股票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 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

基金本报告期没有投资国债期货。

7.12.3 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.13.3 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	1,255,704.65
2	应收证券清算款	1,937,975.28
3	应收股利	-
4	应收利息	3,896.26
5	应收申购款	11,457,644.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,655,220.85

7.13.4 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。

7.13.5 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。

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

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		个人投资者		
			持有份额	占总份	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
华安黄金易(ETF 联接) A	15,895	6,759.72	10,528,643.10	9.80%	96,917,111.44	90.20%
华安黄金易(ETF 联接) C	57,577	4,427.24	1,318,057.39	0.52%	253,589,080.44	99.48%
合计	73,472	4,931.85	11,846,700.49	3.27%	350,506,191.88	96.73%

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）。

8.2 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	128,247.97	0.12%
	华安黄金易(ETF 联接) C	234,184.98	0.09%
	合计	362,432.95	0.10%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，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分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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	-
	华安黄金易(ETF 联接) C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	华安黄金易(ETF 联接) A	-
	华安黄金易(ETF 联接) C	0~10
	合计	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

9 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	37,416,470.78	24,960,115.53
本报告期基金总申购份额	252,677,173.56	971,559,655.24
减：本报告期基金总赎回份额	182,647,889.80	741,612,632.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	107,445,754.54	254,907,137.83

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

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

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

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。

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	
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副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《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。

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		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
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-04
2	华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06
3	关于旗下部分基金增加金牛网为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-14
4	华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-19
5	关于旗下部分基金增加泰信财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-25
6	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-03
7	关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-23
8	关于旗下部分基金增加中正为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-25
9	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-28
10	关于旗下华安黄金联接基金增加湘财证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-16
11	关于旗下华安黄金联接基金增加东莞银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-19
12	关于旗下华安黄金联接基金增加广州证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-21
13	关于旗下部分基金增加苏州银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-23
14	华安基金管理有限公司关于参加深圳新兰德	《上海证券报》、《证券时	2016-03-24

	费率优惠的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
15	华安基金管理有限公司关于以自有资金购买基金所涉风险资产的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
16	华安基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-11
17	关于基金电子交易平台暂停部分基金赎回转申购业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-12
18	关于旗下部分基金增加扬州国信嘉利为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-12
19	关于旗下华安黄金联接基金增加国信证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-14
20	华安基金管理有限公司关于华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金参与广州证券费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-14
21	关于华安易富黄金交易型开放式证券投资基金及其联接基金调整基金份额净值计算位数并修改基金合同、托管协议的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-16
22	华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同（更新）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-16
23	华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金托管协议（更新）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-16
24	关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-19
25	关于旗下部分基金增加格上理财为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-26
26	关于旗下部分基金增加中经北证为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-29
27	关于旗下华安黄金联接基金 C 类增加微众银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-04
28	华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05

29	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
30	华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-06
31	关于旗下部分基金增加金观诚为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-10
32	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-10
33	关于华安旗下部分基金参加民生银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-14
34	华安基金管理有限公司关于参加中正费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-18
35	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加泉州银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-25
36	关于旗下部分基金增加大连银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-28
37	关于旗下部分基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-02
38	关于旗下部分基金增加晟视天下为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-03
39	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-08
40	关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-14
41	关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-21
42	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-23
43	关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-28

		司网站	
44	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-28

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》
- 2、《华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金招募说明书》
- 3、《华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金设立的文件；
- 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；

11.2 存放地点

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

11.3 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办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一六年八月二十六日