

华安全球美元收益债券型证券投资基金
2016 年半年度报告摘要
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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 3 月 23 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安美元收益债券(QDII)	
基金主代码	002391	
交易代码	002391	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 3 月 23 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,470,808,950.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安美元收益-A	华安美元收益-C
下属分级基金的交易代码	002391	002393
报告期末下属分级基金的份额总额	747,264,056.13 份	723,544,894.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严谨信用分析的基础上,通过分析来自全球各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面,寻求各类债券的投资机会。力争在严格控制风险的前提下,同时追求获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将根据对全球市场经济发展的判断,以及对不同国家和地区宏观经济、财政和货币政策、证券市场走势、金融市场环境的分析,确定基金资产在不同国家和地区的资产配置比例。 基于对经济周期及其变化趋势等特征的研究和判断,根据对政府债券、信用债、可转债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,确定不同经济周期阶段下的债券类属配置策略,并根据经济周期阶段变化及时进行调整。从而有效把握经济不同发展阶段的投资机会,实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	95%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。 本基金可投资于境外证券,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险等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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	钱鲲	王永民

负责人	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-

2.5 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

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 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日)	
	华安美元收益-A	华安美元收益-C
本期已实现收益	6,696,455.35	5,606,156.53
本期利润	28,939,533.65	27,014,873.81
加权平均基金份额本期利润	0.0383	0.0371
本期基金份额净值增长率	3.80%	3.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
	华安美元收益-A	华安美元收益-C
期末可供分配基金份额利润	0.0089	0.0077
期末基金资产净值	775,959,550.52	750,479,298.17
期末基金份额净值	1.038	1.037

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于

所列数字。

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

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）。

4、本基金于 2016 年 3 月 23 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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

华安美元收益-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	2.67%	0.37%	2.48%	0.47%	0.19%	-0.10%
过去三个月	3.80%	0.28%	4.66%	0.36%	-0.86%	-0.08%
自基金合同生效起至今	3.80%	0.26%	4.91%	0.35%	-1.11%	-0.09%

华安美元收益-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	2.67%	0.37%	2.48%	0.47%	0.19%	-0.10%
过去三个月	3.70%	0.28%	4.66%	0.36%	-0.96%	-0.08%
自基金合同生效起至今	3.70%	0.27%	4.91%	0.35%	-1.21%	-0.08%

注：本基金业绩比较基准：95%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率+5%×商业银行活期存款基准利率（税后）。

本基金投资于境内境外市场。

针对境内投资，本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他依法上市的股票），权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金以及经中国证监会批准允许基金投资的其他境内金融工具。

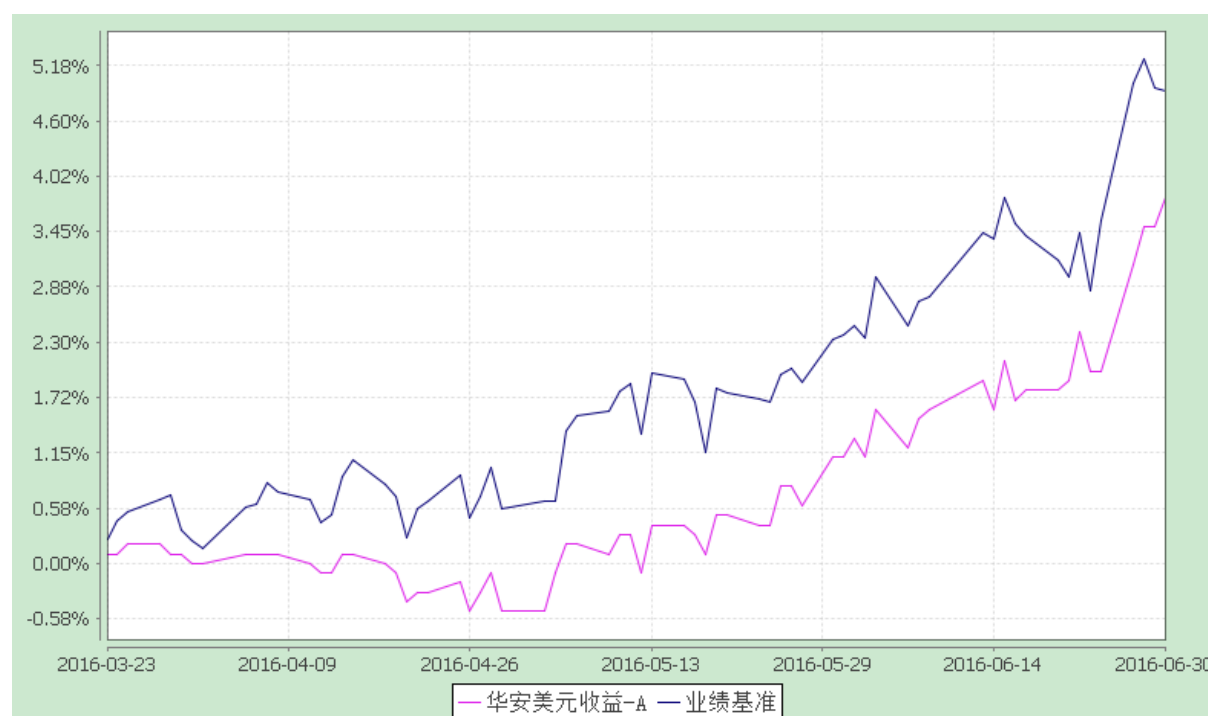
针对境外投资，本基金主要投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、

可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括 ETF）；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他境外融工具。

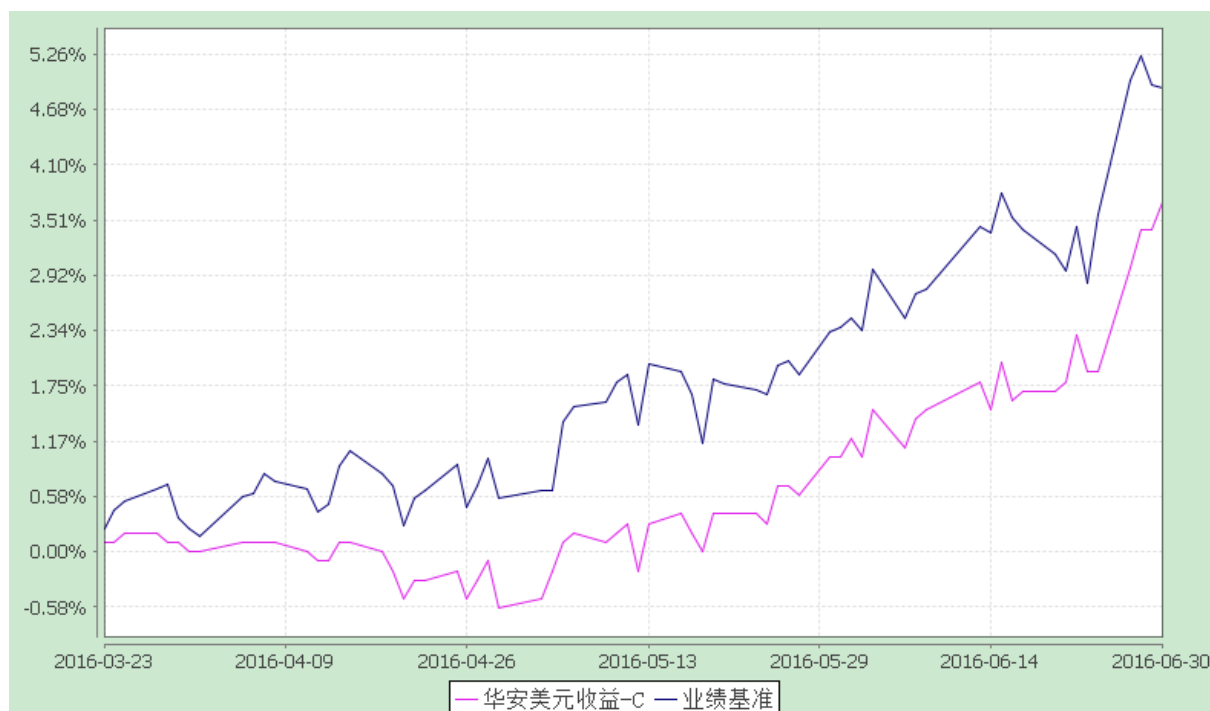
3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安全球美元收益债券型证券投资基金
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
(2016 年 3 月 23 日至 2016 年 6 月 30 日)

华安美元收益-A



华安美元收益-C



注：1、本基金于 2016 年 3 月 23 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2、根据本基金基金合同，本基金建仓期为 6 个月。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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		
苏圻涵	基金经 理、全球 投资部助 理总监	2016-03-24	-	12 年	博士研究生，12 年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书。2004 年 6 月加入华安基金管理有限公司，曾先后于研究发展部、战略策划部工作，担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于

					全球投资部，担任基金经理职务。 2010 年 9 月起担任本基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 2016 年 3 月起同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金、华安全球美元收益债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起同时担任华安全球美元票息
--	--	--	--	--	---

					债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券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

2016 年上半年，全球市场波动加剧，各种宏观事件频发；美国 5 月非农就业数据的意外惨淡，导致市场对美联储加息的预期进一步削弱；英国于 6 月 23 日举行全民公投，决定退出欧盟，成为全球上半年最大的“黑天鹅”事件。总体而言，上半年全球市场以避险情绪为主导，资金大量流入债券、黄金等避险资产中。与此同时，全球主要经济体的货币政策仍显宽松并有进一步加码的态势，市场最为关注的美联储，其加息步伐也变得更加谨慎与缓慢。目前，全球主要经济体的通胀水平仍在低位运行，欧元区 2016 年 1、2 季度调和 CPI 分别为 0.03%、-0.07%，1、2 季度核心 CPI 分别为 0.93%、0.80%，距欧洲央行“2%”的通胀目标相距甚远。美国 1、2 季度 CPI 分别为 1.10%、1.03%，距美联储“2%”的通胀目标也有所距离。货币宽松预期不改，附加低通胀水平，上述因素意味着全球主要国家债券收益率处于历史低点的时间仍将随之延长。虽然市场情绪以避险为主导，但由于原油价格的大幅反弹，信用违约事件未如预期中的大幅增多，信用利差随之收窄；受益于上述原因，信用债受到追捧，成为本基金报告期内的重点投资方向。

本基金成立于一季度末，成立后大部分时间处于建仓期内；本基金重点控制投资风险，在谨慎和严谨分析的基础上，保持了组合的平均信用等级，择机增持了估值相对合理的金融债，增厚了组

合平均收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，华安全球美元收益债 A 份额净值为 1.038 元，C 份额净值为 1.037 元；华安全球美元收益债 A 份额净值增长率为 3.80%，C 份额净值增长率为 3.70%，同期业绩比较基准增长率为 4.91%。

4.5 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，英国脱欧影响深远，孤立和民粹主义盛行不利于全球经济的合作发展。预期各国央行利率仍将保持较低水平，货币政策仍将继续维持偏宽松的基调。尽管全球经济前景并不乐观，但资金的充裕将使全球信用利差继续收窄。下半年风险预期主要来自地缘政治和一些不可预见的黑天鹅事件。由于原油价格由低位回升，以油气行业为代表的过剩产能行业违约风险有一定缓和，但仍然要密切关注过剩产能行业债券的违约风险，投资运作上以防范违约信用风险作为首要任务。本基金将以中高等级信用债为主构建核心组合，动态调整组合久期和种类。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人的利益。

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，台湾保德信投信任基金经理。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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安全球美元收益债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

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：华安全球美元收益债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日
资 产：	-
银行存款	98,491,911.46
结算备付金	1,929,523.81
存出保证金	-
交易性金融资产	1,428,608,016.05
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	1,428,608,016.05
资产支持证券投资	-
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	17,279,596.19
应收股利	-
应收申购款	4,654,577.94
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,550,963,625.45
负债和所有者权益	本期末 2016 年 6 月 30 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	-
应付赎回款	22,581,438.40
应付管理人报酬	1,113,364.31
应付托管费	346,380.01
应付销售服务费	242,450.27
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	241,143.77
负债合计	24,524,776.76
所有者权益：	-
实收基金	1,470,808,950.19
未分配利润	55,629,898.50
所有者权益合计	1,526,438,848.69
负债和所有者权益总计	1,550,963,625.45

6.2 利润表

会计主体：华安全球美元收益债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	61,650,558.45
1.利息收入	14,006,061.03
其中：存款利息收入	134,144.84
债券利息收入	11,459,357.75
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,412,558.44
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,299,327.03
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	1,299,327.03
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	43,651,795.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	2,655,267.09
5.其他收入（损失以“-”号填列）	38,107.72
减：二、费用	5,696,150.99
1. 管理人报酬	3,635,200.06
2. 托管费	1,130,951.14
3. 销售服务费	791,740.88
4. 交易费用	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	138,258.91

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	55,954,407.46
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	55,954,407.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安全球美元收益债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 23 日（基金合同生效日）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）	1,484,948,681.08	-	1,484,948,681.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	55,954,407.46	55,954,407.46
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）	-14,139,730.89	-324,508.96	-14,464,239.85
其中：1.基金申购款	8,022,253.19	239,336.98	8,261,590.17
2.基金赎回款	-22,161,984.08	-563,845.94	-22,725,830.02
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）	1,470,808,950.19	55,629,898.50	1,526,438,848.69

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

华安全球美元收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]138 号《关于准予华安全球美元收益债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自 2016 年 2 月 22 日到 2016 年 3 月 18 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2016）验字第 60971571_B10 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 3 月 23 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金

（本金）折合人民币 1,484,552,975.02 元，在募集期间产生的存款利息折合人民币 395,706.06 元，以上实收基金（本息）合计共折合人民币 1,484,948,681.08 元，折合 1,484,948,681.08 份基金份额，其中 A 类人民币份额 504,518,752.72 份，A 类美元现汇份额 252,546,712.84 份，C 类份额 727,883,215.52 份。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，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

针对境内投资，本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他依法上市的股票），权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金以及经中国证监会批准允许基金投资的其他境内金融工具。

针对境外投资，本基金主要投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括 ETF）；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他境外融工具。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于美元债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以相应将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制。

本基金的业绩比较基准为：95%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率。

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。

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 3 月 23 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 2016 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、基金

投资和债券投资等；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融

工具的估值方法如下：

(1)存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值；有充足证据表明最近市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对最近市场交易价格进行调整，确定公允价值。

(2)不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分

配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)基金投资收益/(损失)于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(8)权证投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9)股票股利收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地使用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(10)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的 0.90%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.28%的年费率逐日计提；

(3)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 类基金份额资产净值的 0.40%年费率计提；

(4)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，各类基金份额每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对某一类别基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。如果基金份额持有人选择或默认选择现金分红形式，则某一币种的份额相应的以该币种进行现金分红；如果选择红利再投资形式，则同一类别基金份额的分红资金将按红利派发日（具体以届时的基金分红公告为准）该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费；

(3)基金收益分配基准日人民币份额的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值；对于外币份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后外币份额基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能；

(4)由于本基金各类基金份额分别以其认购或申购时的币种计价，每类基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同类别/币种的每份基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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。

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》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局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 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税；

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

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 债券交易

无。

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,635,200.06
其中：支付销售机构的客户维护费	568,102.75

注：支付基金管理人 华安基金公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.90%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.90% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,130,951.14

注：支付基金托管人 中国银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.28%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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.28% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2016年3月23日（基金合同生效日）至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华安基金管理有限公司	683,331.92
中国银行股份有限公司	3,181.01
合计	686,512.93

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 类基金份额资产净值的 0.40%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金管理有限公司，再由华安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。。销售服务费的计算方法如下：

日销售服务费 = 本基金 C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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

无。

6.4.8.5 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 2016 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	82,749,146.18	80,486.29
中银香港	15,742,765.28	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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	-	-
	其中：普通股	-	-
	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	1,428,608,016.05	92.11
	其中：债券	1,428,608,016.05	92.11
	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	100,421,435.27	6.47
8	其他各项资产	21,934,174.13	1.41
9	合计	1,550,963,625.45	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

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末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

无。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

无。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

无。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA	67,358,469.67	4.41
A+至 A-	246,016,326.38	16.12
BBB+至 BBB-	576,828,678.47	37.79
BB+至 BB-	434,711,936.64	28.48
B+至 B-	103,692,604.89	6.79

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	US404280AS86	HSBC HOLDINGS PLC	150,000	93,322,866.96	6.11
2	USY54788AA57	MALAYSIA SUKUK GLOBAL	110,000	74,542,114.94	4.88
3	US912828P790	US TREASURY N/B	100,000	67,358,469.67	4.41
4	XS1257592037	BANK OF COMMUNICATIONS	100,000	66,343,166.64	4.35
5	XS1415758991	361 DEGREES INTERNATIONAL	90,000	61,906,893.84	4.06

注：债券代码为 ISIN 码。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,279,596.19
5	应收申购款	4,654,577.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,934,174.13

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

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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安美元收益-A	2,844	262,751.07	270,015,000.00	36.13%	477,249,056.13	63.87%
华安美元收益-C	813	889,969.12	670,166,500.00	92.62%	53,378,394.06	7.38%

合计	3,657	402,190.03	940,181,500.00	63.92%	530,627,450.19	36.08%
----	-------	------------	----------------	--------	----------------	--------

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	华安美元收益-A	201,204.88	0.03%
	华安美元收益-C	3.00	0.00%
	合计	201,207.88	0.01%

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）。

8.3 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	华安美元收益-A	0~10
	华安美元收益-C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华安美元收益-A	0
	华安美元收益-C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安美元收益-A	华安美元收益-C
基金合同生效日（2016 年 3 月 23 日）基金份额总额	757,065,465.56	727,883,215.52
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,044,278.25	2,977,974.94
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	14,845,687.68	7,316,296.40
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	747,264,056.13	723,544,894.06

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

本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

本报告期内无改聘会计师事务所情况。

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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰金融控股（香港）	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-
中金（香港）CICC	-	-	-	-	-	-
中信证券（香港）CITIS	-	-	-	-	-	-
海通国际	-	-	-	-	-	-
国泰君安（香港）	-	-	-	-	-	-
Nomura	-	-	-	-	-	-

BNP	-	-	-	-	-	-
CITI	-	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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）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；

（2）具备高效、安全的通讯条件；可靠、诚信，能够公平对待所有客户，有效执行投资指令，取得较高质量的交易成交结果，交易差错少，并能满足基金运作高度保密的要求；

（3）交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

（4）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；

（5）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、QDII 券商选择程序：

(1) 对候选券商的综合服务进行评估

由全球投资部、指数与量化投资事业总部牵头并组织有关人员依据券商选择标准和《券商服务评价办法》，对候选券商研究服务质量和综合实力进行评估。

(2) 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。

(3) 候选券商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。

(4) 与相关券商进行开户工作

交易部 QDII 交易员与对应选择券商进行开户工作，完成后，通知 IT 以及运营部门完成后续相关设置。

3.报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2016 年上半年完成法巴 BNP、高盛 Goldman Sachs、花旗 CITI、摩根 JP Morgan、美林 Merrill Lynch、摩根史坦利 Morgan Stanley、野村 Nomura、国泰君安（香港）、海通国际、中金（香港）、中信证

券（香港）、华泰金融控股（香港）有限公司等券商的开户工作。

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
安信证券	-	-	9,039,100,000.00	100.00%	-	-	-	-
华泰金融控股（香港）	27,454,078.88	1.78%	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	126,653,402.97	8.21%	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	273,713,767.62	17.74%	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	255,279,664.53	16.55%	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	92,730,568.19	6.01%	-	-	-	-	-	-
中金（香港）CICC	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券（香港）CITIS	487,092,154.12	31.57%	-	-	-	-	-	-
海通国际	144,207,208.23	9.35%	-	-	-	-	-	-
国泰	115,4	7.49%	-	-	-	-	-	-

君安 (香港)	94,918.10							
Nomura	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI	20,111,373.80	1.30%	-	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日