

华安全球美元收益债券型证券投资基金
2017 年半年度报告摘要
2017 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：二〇一七年八月二十五日

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 2017 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 2017 年 1 月 1 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	1,542,759,914.40 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	1,307,485,701.38 份	235,274,213.02 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		境外投资顾问	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（2017 年 1 月 1 日至 2017 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	32,939,756.50	19,595,840.69
本期利润	8,204,989.48	17,141,811.40
加权平均基金份额本期利润	0.009	0.028
本期基金份额净值增长率	1.74%	1.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 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	0.0816	0.0753
期末基金资产净值	1,453,911,034.16	260,153,706.59
期末基金份额净值	1.112	1.106

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）。

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	-1.33%	0.23%	-1.32%	0.29%	-0.01%	-0.06%
过去三个月	-0.36%	0.20%	-0.37%	0.22%	0.01%	-0.02%
过去六个月	1.74%	0.24%	-0.11%	0.29%	1.85%	-0.05%
过去一年	7.13%	0.24%	1.77%	0.29%	5.36%	-0.05%
自基金合同生效起至今	11.20%	0.24%	6.77%	0.30%	4.43%	-0.06%

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	-1.25%	0.22%	-1.32%	0.29%	0.07%	-0.07%
过去三个月	-0.45%	0.19%	-0.37%	0.22%	-0.08%	-0.03%
过去六个月	1.47%	0.23%	-0.11%	0.29%	1.58%	-0.06%
过去一年	6.65%	0.24%	1.77%	0.29%	4.88%	-0.05%
自基金合同生效起至今	10.60%	0.24%	6.77%	0.30%	3.83%	-0.06%

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 2017 年 6 月 30 日)

华安美元收益-A



华安美元收益-C



注：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。

3.2.2.1 自基金合同生效以来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

华安全球美元收益债券型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、华安美元收益-A



2、华安美元收益-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。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 2017 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 96 只开放式基金，管理资产规模达到 1478.85 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	本基金的 基金经 理、全球 投资部助 理总监	2016-03-23	-	13 年	博士研究生，13 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 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。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、本基金的基金经理。 2016 年 6 月起同时担任华安全球美元票息债券型证券投资
--	--	--	--	--	--

					资基金的基金经理。2017 年 2 月起,同时担任华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 2017 年 5 月起,同时担任华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月起,同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
庄宇飞	本基金的基金经理	2017-03-16	-	6 年	硕士研究生,6 年证券、基金从业经历,持有基金从业资格证书。历任上海证券创新发展总部分析师,上海吉金资产管理有限

					公司金融顾问事业部项目经理，上海证券创新发展总部创新实验室负责人。2016 年 6 月加入华安基金，任全球投资部基金经理助理。2017 年 3 月起担任本基金、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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

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。

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，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

2017 年上半年，全球经济增长势头良好，美国经济复苏虽有所放缓但依然稳健，欧元区的复苏步伐则不断改善，中国已连续两个季度维持了 6.9% 的经济增速。虽然全球经济基本面较为良好，但上半年频发的宏观事件仍然给市场带来一定冲击，例如英国开启退欧进程、法国两轮总统大选、英国提前举行议会选举、特朗普“通俄门”等事件，使得市场的短期波动率陡然提升，也在一定程度上推高了市场的短期避险情绪。

全球主要经济体的通胀水平仍然较为温和，美国上半年的通胀前高后低、势头明显放缓，不管是整体通胀还是剔除食品能源后的核心通胀，都显著低于联储设定的 2.0% 的通胀目标；而欧元区虽然摆脱了通缩的局面，但上半年月均 1.0% 的核心通胀仍属低迷。我们认为，欧美发达经济体的短期通胀仍将维持在现有的温和水平上；但伴随着经济的进一步复苏、劳动力市场的收紧与收入水平的提升，长期通胀的上行空间仍然存在。

美联储分别于今年 3 月、6 月各加息 25 基点，符合市场预期；6 月的 FOMC 会议还公布了缩表操作的相关细节，包括缩表方式、缩表规模等。但基于美联储资产负债表的现状（持仓分布、到期期限分布等），我们认为缩表初期的步伐会比较缓慢，对市场的短期影响仍属于可控范围内。值得注意的是，除美联储外，欧洲央行、日本央行、英国央行等全球主要央行也在上半年末接连释放出了鹰派立场，这意味着全球主要央行已经在集体转向，全球货币的紧缩周期已经在事实上开启，这也对未来的债券投资带来了严峻挑战。

报告期内，本基金继续保持稳健的投资风格，基于管控利率风险的目标，逐步降低了利率敞口；本基金通过分散行业配置、精选个券的方式投资于中高信用等级信用债，通过信用利差的收窄及较为可观的票息收入增厚收益，为投资者创造了可观的回报。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，华安全球美元收益债 A 份额净值为 1.112 元，C 份额净值为 1.106 元；华安全球美元收益债 A 份额净值增长率为 1.74%，C 份额净值增长率为 1.47%，同期业绩比较基准增长率为 -0.11%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球经济将依然处于温和复苏阶段，主要经济体的短期通胀水平预计仍将保持在现有区间。基于最新的联储点阵图，我们预计美国年内仍将有一次加息操作（大概率发生于今年 12 月）；预计美联储将于 9 月的议息会议上宣布开启缩表操作，但我们认为缩表初期的步伐会比较缓慢，对市场的短期影响仍属于可控范围内。我们预计欧洲央行会从下半年开始为明年逐步退出 QE 做准备，可能于今年 9 月宣布削减 QE 规模的细节；但同美联储类似，我们认为欧央行在退出宽松初期的步伐将非常缓慢，加息也要在 QE 结束一段时间且经过与市场的充分沟通后才会实施。

我们认为，当前全球温和的经济增长与通胀水平，有利于信用债的投资环境。一方面，经济的复苏及持续增长，将提升企业盈利并改善财务状况；另一方面，温和的通胀不会促使货币当局快速收紧货币政策，在市场流动性保持相对充裕及稳定的情况下，企业信用状况不会突然恶化，违约率有望维持在较低水平。

总体而言，我们对下半年的美元债券市场保持谨慎乐观态度，仍将以防范风险作为投资的主基调。本基金将继续把利率敞口维持在现有水平甚至之下；在管控利率风险的同时，精选信用债品种，严守信用风险，对组合持仓进行持续优化，力争为持有人提供稳定可观的投资回报。

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。

4.8 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

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的真实、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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：	-	-
银行存款	328,778,610.31	157,204,789.62
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,604,489,447.56	1,628,560,837.04

其中：股票投资	-	-
基金投资	144,308,201.06	27,618,278.10
债券投资	1,460,181,246.50	1,600,942,558.94
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	14,132,993.05	18,041,721.83
应收股利	-	-
应收申购款	12,781,090.23	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,960,182,141.15	1,803,807,348.49
负债和所有者权益	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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	121,939,200.00	27,592,271.29
应付赎回款	122,068,613.82	6,225,393.00
应付管理人报酬	1,333,614.13	1,368,344.37
应付托管费	414,902.13	425,707.12
应付销售服务费	139,226.56	291,479.43
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	221,843.76	395,564.97
负债合计	246,117,400.40	36,298,760.18
所有者权益：	-	-
实收基金	1,542,759,914.40	1,619,260,553.15
未分配利润	171,304,826.35	148,248,035.16
所有者权益合计	1,714,064,740.75	1,767,508,588.31
负债和所有者权益总计	1,960,182,141.15	1,803,807,348.49

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.111 元，基金份额总额 1,542,759,914.40 份。其中 A 类基金份额净值 1.112 元，基金份额总额 1,307,485,701.38 份；C 类基金份额净值 1.106 元，基金份额总额 235,274,213.02 份。

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 3 月 23 日（基金合 同生效日）至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	36,991,826.79	61,650,558.45
1.利息收入	42,762,296.51	14,006,061.03
其中：存款利息收入	242,693.75	134,144.84
债券利息收入	42,519,602.76	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）	24,404,707.31	1,299,327.03
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	132,556.74	-
债券投资收益	21,447,046.83	1,299,327.03
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,825,103.74	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-27,188,796.31	43,651,795.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-3,374,787.86	2,655,267.09
5.其他收入（损失以“-”号填列）	388,407.14	38,107.72
减：二、费用	11,645,025.91	5,696,150.99
1. 管理人报酬	7,632,713.55	3,635,200.06
2. 托管费	2,374,621.96	1,130,951.14
3. 销售服务费	1,375,887.57	791,740.88
4. 交易费用	31,745.79	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	230,057.04	138,258.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	25,346,800.88	55,954,407.46
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	25,346,800.88	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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,619,260,553.15	148,248,035.16	1,767,508,588.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,346,800.88	25,346,800.88
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）	-76,500,638.75	-2,290,009.69	-78,790,648.44
其中：1.基金申购款	754,176,697.18	92,062,899.24	846,239,596.42
2.基金赎回款	-830,677,335.93	-94,352,908.93	-925,030,244.86
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）	1,542,759,914.40	171,304,826.35	1,714,064,740.75
项目	上年度可比期间 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：赵敏，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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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

（1） 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2） 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增值税试点的通知》的规定。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，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理

人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

（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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 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	7,632,713.55	3,635,200.06
其中：支付销售机构的客户 维护费	1,473,811.32	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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.90\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 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	2,374,621.96	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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.28\% / \text{当年天数}。$$

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 2017年1月1日至2017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	1,008,863.96
中国银行股份有限公司	4,580.10
合计	1,013,444.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{本基金 C 类基金份额前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
中银香港	139,769,534.75	-	15,742,765.28	-
中国银行	189,009,075.56	225,848.02	82,749,146.18	80,486.29

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（2017 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	144,308,201.06	7.36
3	固定收益投资	1,460,181,246.50	74.49
	其中：债券	1,460,181,246.50	74.49
	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	328,778,610.31	16.77
8	其他各项资产	26,914,083.28	1.37
9	合计	1,960,182,141.15	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初基金资产净值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初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

无。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

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（%）
A+至 A-	52,885,843.97	3.09
BBB+至 BBB-	739,981,789.20	43.17
BB+至 BB-	554,913,784.70	32.37
B+至 B-	112,399,828.63	6.56

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	121,939,200	127,506,943.87	7.44
2	XS1415758991	361 DEGREES INTERNATIONAL	74,518,400	78,830,034.62	4.60
3	USG85381AA26	STUDIO CITY FINANCE LTD	74,518,400	77,493,919.71	4.52
4	USG11259AB79	BIOSTIME INTL HOLDINGS	71,808,640	75,254,018.55	4.39

5	XS1506066676	DNB BANK ASA	67,744,000	72,436,626.88	4.23
---	--------------	-----------------	------------	---------------	------

注：1.债券代码为 ISIN 码；

2.数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

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

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	ISHARES IBOXX USD HIGH YIELD	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	144,308,201.06	8.42

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 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,132,993.05
5	应收申购款	12,781,090.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,914,083.28

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	9,488	137,804.14	554,740,827.70	42.43%	752,744,873.68	57.57%
华安美元收益-C	10,414	22,592.11	72,030,323.75	30.62%	163,243,889.27	69.38%
合计	19,902	77,517.83	626,771,151.45	40.63%	915,988,762.95	59.37%

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	460,845.69	0.04%
	华安美元收益-C	223,910.67	0.10%
	合计	684,756.36	0.04%

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	10~50
	华安美元收益-C	0~10
	合计	10~50
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
--	----	---

注：本基金的基金经理持有本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
本报告期期初基金份额总额	846,230,562.28	773,029,990.87
本报告期基金总申购份额	636,398,543.71	117,778,153.47
减：本报告期基金总赎回份额	175,143,404.61	655,533,931.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,307,485,701.38	235,274,213.02

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、本基金管理人重大人事变动如下：

2017 年 8 月 9 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》，章国富先生不再担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 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	
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	13,566.93	44.99%	-
Merrill Lynch	-	-	-	16,585.43	55.01%	-
CICC	-	-	-	-	-	-
CITICS	-	-	-	-	-	-
Haitong	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan	-	-	-	-	-	-
Nomura	-	-	-	-	-	-
BNP	-	-	-	-	-	-
CITI	-	-	-	-	-	-
Huatai	-	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
BOCI Securities Ltd	-	-	-	-	-	-
SCB	-	-	-	-	-	-
Mizuho	-	-	-	-	-	-
KGI	-	-	-	-	-	-

注：QDII 基金与特定账户：

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。

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。

(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：

2017 年上半年完成 KGI(凯基证券)、SCB(渣打银行)、Mizuho（瑞穗银行）开户。

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
Goldman Sachs	14,531,890.99	1.48%	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	21,290,176.53	2.16%	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	92,725,971.49	9.43%	-	-	-	-	118,282,680.00	44.79%
Merill Lynch	58,887,523.71	5.99%	-	-	-	-	145,784,510.48	55.21%

h								
CICC	7,061,130.44	0.72%	-	-	-	-	-	-
CITI CS	170,461,784.35	17.33%	-	-	-	-	-	-
Haitong	107,120,455.97	10.89%	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan	41,377,218.76	4.21%	-	-	-	-	-	-
Nomura	14,678,048.00	1.49%	-	-	-	-	-	-
BNP	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI	232,432,079.22	23.63%	-	-	-	-	-	-
Huatai	28,215,010.01	2.87%	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC I Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
SCB	112,880,467.98	11.48%	-	-	-	-	-	-
Mizuho	21,649,790.99	2.20%	-	-	-	-	-	-
KGI	60,195,962.39	6.12%	-	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日