华安全球美元票息债券型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：二〇二〇年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 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 2020 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 5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 6
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 7
4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
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 10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 18
7 投资组合报告 36
7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 36
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 37
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 37
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 37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 38
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 38
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 38
7.11 投资组合报告附注 38
8 基金份额持有人信息 39

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 39
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 39
9 开放式基金份额变动 39
10 重大事件揭示 40
10.1 基金份额持有人大会决议 40
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 40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 40
10.4 基金投资策略的改变 40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 40
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 40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 40
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 42
10.8 其他重大事件 44
11 影响投资者决策的其他重要信息 45
12 备查文件目录 45
12.1 备查文件目录 45
12.2 存放地点 46
12.3 查阅方式 46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安全球美元票息债券型证券投资基金	
基金简称	华安全球美元票息债券	
基金主代码	002426	
交易代码	002426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 6 月 3 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	141,310,549.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安美元票息债-A	华安美元票息债-C
下属分级基金的交易代码	002426	002429
报告期末下属分级基金的份额总额	135,985,640.88 份	5,324,908.52 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配置比例。 同时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	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	薛珍	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31－32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31－32层	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	田国立

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	-	State Street Bank and Trust Company
	中文	-	美国道富银行
注册地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
办公地址		-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
邮政编码		-	02111

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

2.6 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、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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）	
	华安美元票息债-A	华安美元票息债-C
本期已实现收益	5,237,467.31	323,337.60
本期利润	2,961,436.52	-389,670.29
加权平均基金份额本期利润	0.0194	-0.0461
本期加权平均净值利润率	1.67%	-4.04%
本期基金份额净值增长率	1.20%	1.05%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2020 年 6 月 30 日)**	
	华安美元票息债-A	华安美元票息债-C
期末可供分配利润	24,889,299.17	853,006.21
期末可供分配基金份额利润	0.1830	0.1602
期末基金资产净值	160,874,940.05	6,177,914.73
期末基金份额净值	1.183	1.160
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2020 年 6 月 30 日)**	
	华安美元票息债-A	华安美元票息债-C
基金份额累计净值增长率	18.30%	16.00%

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

华安美元票息债-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	0.94%	0.15%	-0.10%	0.22%	1.04%	-0.07%

过去三个月	5.81%	0.22%	2.68%	0.28%	3.13%	-0.06%
过去六个月	1.20%	0.44%	7.32%	0.41%	-6.12%	0.03%
过去一年	4.23%	0.32%	11.38%	0.35%	-7.15%	-0.03%
过去三年	8.63%	0.27%	20.96%	0.30%	-12.33%	-0.03%
自基金合同生效起至今	18.30%	0.26%	26.20%	0.30%	-7.90%	-0.04%

华安美元票息债-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	0.87%	0.16%	-0.10%	0.22%	0.97%	-0.06%
过去三个月	5.74%	0.20%	2.68%	0.28%	3.06%	-0.08%
过去六个月	1.05%	0.43%	7.32%	0.41%	-6.27%	0.02%
过去一年	3.85%	0.32%	11.38%	0.35%	-7.53%	-0.03%
过去三年	7.01%	0.26%	20.96%	0.30%	-13.95%	-0.04%
自基金合同生效起至今	16.00%	0.26%	26.20%	0.30%	-10.20%	-0.04%

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

华安美元票息债-A

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

(2016 年 6 月 3 日至 2020 年 6 月 30 日)

华安美元票息债-C

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

(2016 年 6 月 3 日至 2020 年 6 月 30 日)

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、西安、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 2020 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 138 只开放式基金，管理资产规模达到 4,157.70 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		
庄宇飞	本基金的基金经理	2017-03-16	-	9 年	硕士研究生，9 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 月起担任华安全球美元收益债券型证券投资基金、华安全球美元票息债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月起，同时担任华安全球稳健配置证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月起，同时担任华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）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

无。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1） 交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2） 交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，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）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日

反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，全球资本市场跌宕起伏，走出了一轮“深 V”行情。具体而言，一季度受全球疫情大爆发，叠加原油价格战等因素的冲击，全球流动性紧缺下各大类资产被无差别抛售。庆幸的是，美联储及时行动（两次降息合计 150bps、增加与其他央行的美元互换操作、无限量 QE 和直接购买投资级信用债等）在三月底有效止住了流动性紧张下资产急速且无差别抛售可能对金融体系造成更大冲击的风险。随后在二季度，受益于全球财政与货币政策支持的延续，以及疫情阶段性拐点后复工的推进，全球资本市场得以从三月的巨幅动荡中摆脱，并在二季度开启修复之旅。

上半年，亚洲美元债市场先抑后扬，彭博巴克莱亚洲美元投资级债券指数在 Q1、Q2 分别录得-0.69%、+4.65%的季度回报，上半年总回报 3.92%；彭博巴克莱亚洲美元高收益债指数在 Q1、Q2 分别录得-12.29%、+12.85%的季度回报，上半年总回报-1.02%。

回顾基金在报告期内的操作，我们在一季度提前做好了流动性储备应对，在市场大幅下跌、流动性枯竭的极端行情下，并未遭受较大冲击。随后，在一级新发重启，二级流动性逐步恢复正常水平的情况下；本基金一方面积极参与新债发行，利用优质新债替换了组合中的部分存量持仓；另一方面也适时把握了部分交易性机会。总体来看，组合配置在信用分布、期限分布等方面处于较为均衡的水平，以中短期投资级债券及质地较佳的高收益债为主，聚焦于收益率曲线中短端所带来的确定性收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，华安全球美元票息债 A 份额净值为 1.183 元，C 份额净值为 1.160 元；华安全球美元票息债 A 份额净值增长率为 1.20%， C 份额净值增长率为 1.05%，同期业绩比较基准增长率为 7.32%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度或下半年，我们认为市场在短期内会有一定波动，但这些波动更多由市场情绪所主导，可能受以下几点因素所冲击：1）全球疫情二次大爆发、2）中美关系继续波折、3）其他的地缘政治事件等。我们觉得上述因素对中资美元债市场基本面的影响可控，市场若有调整的话反而提供较好的买点。

从中长期来看，我们对中资美元债市场仍保持乐观看法，当前时点买入仍具备较好的中长期配置价值。从估值角度来看，中资美元债利差虽然自三月高点已大幅修复，但较历史中枢仍有较大提升。从全球资金流的角度看，美联储的政策组合操作（2022 年前保持 0 利率、信用债直接购买等），将驱使全球的美元套利资金涌向一切有较高收益的资产上，亚洲美元债尤其是中资美元债将是受益标的之一。

总体而言，我们将密切关注美元债券市场利率端与信用端的演变，适时捕捉市场可能的交易性机会。在信用债方面，继续对违约风险保持高度关注；在做好组合流动性管理的基础上，审慎精选信用债，从自下而上的角度严防信用风险。在聚焦于收益率曲线中短端所带来的确定性收益的基础上，力争为投资者创造超额回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按

约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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：华安全球美元票息债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-

银行存款	6.4.7.1	16,973,178.05	26,980,522.59
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	151,016,435.71	209,260,888.47
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		151,016,435.71	209,260,888.47
资产支持证券投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,585,729.98	3,516,662.10
应收股利		-	-
应收申购款		49,091.88	98,640.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		**170,624,435.62**	**239,856,713.91**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 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		1,793,716.70	-
应付赎回款		1,501,071.47	1,671,123.48
应付管理人报酬		123,818.70	184,583.72
应付托管费		34,394.12	51,273.25
应付销售服务费		2,026.53	5,139.57
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		25,950.59	33,129.41
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	90,602.73	181,593.25
负债合计		**3,571,580.84**	**2,126,842.68**
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	141,310,549.40	203,595,494.98
未分配利润	6.4.7.10	25,742,305.38	34,134,376.25
所有者权益合计		**167,052,854.78**	**237,729,871.23**
负债和所有者权益总计		**170,624,435.62**	**239,856,713.91**

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.182 元，基金份额总额 141,310,549.40 份，

其中华安美元票息债 A 类基金份额净值 1.183 元，份额总额 135,985,640.88 份；华安美元票息债 C 类基金份额净值 1.160 元，份额总额 5,324,908.52 份。

6.2 利润表

会计主体：华安全球美元票息债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		**3,785,216.89**	**12,061,311.96**
1.利息收入		4,790,623.09	5,875,138.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	35,260.74	49,783.62
债券利息收入		4,755,362.35	5,825,355.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,700,695.07	779,636.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-91,326.25
债券投资收益	6.4.7.14	1,700,695.07	868,205.87
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益		-	2,756.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,989,038.68	5,409,285.21
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		134,650.52	-29,539.03
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	148,286.89	26,790.33
减：二、费用		**1,213,450.66**	**1,371,887.05**
1．管理人报酬		842,035.48	960,620.48
2．托管费		233,898.81	266,839.00
3．销售服务费		19,178.51	19,983.72
4．交易费用		-	1,167.07
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		17,119.40	19,223.70
7．其他费用	6.4.7.19	101,218.46	104,053.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**2,571,766.23**	**10,689,424.91**
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**2,571,766.23**	**10,689,424.91**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安全球美元票息债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	203,595,494.98	34,134,376.25	237,729,871.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,571,766.23	2,571,766.23
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）	-62,284,945.58	-10,963,837.10	-73,248,782.68
其中：1.基金申购款	25,348,985.66	2,844,331.64	28,193,317.30
2.基金赎回款	-87,633,931.24	-13,808,168.74	-101,442,099.98
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）	141,310,549.40	25,742,305.38	167,052,854.78
项目	**上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	214,276,170.55	16,534,122.12	230,810,292.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,689,424.91	10,689,424.91
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）	-25,709,480.06	-2,110,044.27	-27,819,524.33
其中：1.基金申购款	20,957,511.30	2,317,910.12	23,275,421.42
2.基金赎回款	-46,666,991.36	-4,427,954.39	-51,094,945.75
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）	188,566,690.49	25,113,502.76	213,680,193.25

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

华安全球美元票息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]149 号《关于准予华安全球美元票息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 5 月 16 日到 2016 年 5 月 30 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_B12 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 6 月 3 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 1,478,706,401.82 元，在募集期间产生的存款利息折合人民币 239,360.95 元，以上实收基金（本息）合计共折合人民币 1,478,945,762.77 元，折合 1,478,945,762.77 份基金份额，其中 A 类人民币份额 693,622,716.75 份，A 类美元现汇份额 10,187,770.71 份，C 类份额 775,135,275.31 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行(State Street Bank and Trust Company)。

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》、《公开募集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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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

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《关于资管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。

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。

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；

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	16,973,178.05
定期存款	-
其他存款	-
合计	16,973,178.05

注：截止至 2020 年 6 月 30 日，活期存款中人民币活期存款为人民币 3,686,479.28 元，外币活期存款折合人民币 13,286,698.77 元。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
债券	交易所市场	150,040,014.02	151,016,435.71	976,421.69
	银行间市场	-	-	-
	合计	150,040,014.02	151,016,435.71	976,421.69
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		150,040,014.02	151,016,435.71	976,421.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	824.14
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	-
应收债券利息	2,584,905.84
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	2,585,729.98

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,095.13
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
合计	90,602.73

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华安美元票息债-A	
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日

	基金份额	账面金额
上年度末	191,451,657.79	191,451,657.79
本期申购	20,716,703.70	20,716,703.70
本期赎回（以“-”号填列）	-76,182,720.61	-76,182,720.61
本期末	135,985,640.88	135,985,640.88

金额单位：人民币元

华安美元票息债-C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	12,143,837.19	12,143,837.19
本期申购	4,632,281.96	4,632,281.96
本期赎回（以“-”号填列）	-11,451,210.63	-11,451,210.63
本期末	5,324,908.52	5,324,908.52

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

单位：人民币元

华安美元票息债-A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,381,721.49	2,950,359.83	32,332,081.32
本期利润	5,237,467.31	-2,276,030.79	2,961,436.52
本期基金份额交易产生的变动数	-9,415,862.55	-988,356.12	-10,404,218.67
其中：基金申购款	3,640,728.27	-1,505,140.76	2,135,587.51
基金赎回款	-13,056,590.82	516,784.64	-12,539,806.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,203,326.25	-314,027.08	24,889,299.17

单位：人民币元

华安美元票息债-C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,617,593.27	184,701.66	1,802,294.93
本期利润	323,337.60	-713,007.89	-389,670.29
本期基金份额交易产生的变动数	-1,076,129.66	516,511.23	-559,618.43
其中：基金申购款	675,405.91	33,338.22	708,744.13

基金赎回款	-1,751,535.57	483,173.01	-1,268,362.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	864,801.21	-11,795.00	853,006.21

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	34,857.92
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	402.82
合计	35,260.74

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	194,692,157.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	189,273,618.27
减：应收利息总额	3,717,843.97
买卖债券差价收入	1,700,695.07

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-2,989,038.68
——股票投资	-
——债券投资	-2,989,038.68
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,989,038.68

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	148,286.89
合计	148,286.89

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,360.00
银行汇划费	2,350.86
合计	101,218.46

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(建设银行)	基金托管人、基金代销机构
道富银行	基金境外托管人
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2关联方报酬

6.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	842,035.48	960,620.48
其中：支付销售机构的客户维护费	242,668.36	389,873.19

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.90%的年费率计提。计算方法如下：

H=E ×0.90%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	233,898.81	266,839.00

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国泰君安证券股份有限公司	7.25
华安基金管理有限公司	5,910.68
中国建设银行股份有限公司	413.25
合计	6,331.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	2,543.84
建设银行	925.49
合计	3,469.33

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。销售服务费的计算方法如下：

H=E×0.40%/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，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

无。

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
期初持有的基金份额	26,815,543.07	26,815,543.07
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	26,815,543.07	26,815,543.07
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	18.98%	14.22%

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
道富银行	9,419,805.36	4,710.99	13,649,265.32	28,024.58
建设银行	7,553,372.69	30,146.93	15,773,644.80	21,758.04

注：本基金的银行存款分别由基金托管人建设银行和境外资产托管人道富银行保管，按适用利率或约定利率计息。

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

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行收益分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

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。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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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控制委员会，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；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由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管理、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总

裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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，并根据本基金的基金管理人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，有效保障基金份额持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%，持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一只境外基金得超过该境外基金总份额的 20%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券在证券交易所上市，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资产净值的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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、存出保证金等，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	7,553,372.69	-	-	9,419,805.36	16,973,178.05
交易性金融资产	14,216,485.54	101,936,952.41	34,862,997.76	-	151,016,435.71
应收利息	-	-	-	2,585,729.98	2,585,729.98
应收申购款	10.00	-	-	49,081.88	49,091.88
资产总计	21,769,868.23	101,936,952.41	34,862,997.76	12,054,617.22	170,624,435.62
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,793,716.70	1,793,716.70
应付赎回款	-	-	-	1,501,071.47	1,501,071.47
应付管理人报酬	-	-	-	123,818.70	123,818.70
应付托管费	-	-	-	34,394.12	34,394.12
应付销售服务费	-	-	-	2,026.53	2,026.53
应交税费	-	-	-	25,950.59	25,950.59
其他负债	-	-	-	90,602.73	90,602.73
负债总计	-	-	-	3,571,580.84	3,571,580.84
利率敏感度缺口	21,769,868.23	101,936,952.41	34,862,997.76	8,483,036.38	167,052,854.78
上年度末 2019 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	26,980,522.59	-	-	-	26,980,522.59
交易性金融资产	31,374,168.90	100,956,838.01	76,929,881.56	-	209,260,888.47
应收利息	-	-	-	3,516,662.10	3,516,662.10
应收申购款	-	-	-	98,640.75	98,640.75
资产总计	58,354,691.49	100,956,838.01	76,929,881.56	3,615,302.85	239,856,713.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,671,123.48	1,671,123.48
应付管理人报酬	-	-	-	184,583.72	184,583.72
应付托管费	-	-	-	51,273.25	51,273.25
应付销售服务费	-	-	-	5,139.57	5,139.57
应交税费	-	-	-	33,129.41	33,129.41
其他负债	-	-	-	181,593.25	181,593.25
负债总计	-	-	-	2,126,842.68	2,126,842.68
利率敏感度缺口	58,354,691.49	100,956,838.01	76,929,881.56	1,488,460.17	237,729,871.23

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 77	减少约 101
	市场利率下降 25 个基点	增加约 77	增加约 101

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	13,286,698.77	13,286,698.77
交易性金融资产	151,016,435.71	151,016,435.71
应收利息	2,584,963.11	2,584,963.11
应收申购款	211.11	211.11
资产合计	166,888,308.70	166,888,308.70
以外币计价的负债		
应付赎回款	748,634.82	748,634.82
应付证券清算款	1,793,716.70	1,793,716.70
其他负债	535.21	535.21
负债合计	2,542,886.73	2,542,886.73
资产负债表外汇风险敞口净额	164,345,421.97	164,345,421.97
项目	上年度末 2019年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	25,477,141.55	25,477,141.55
交易性金融资产	209,260,888.47	209,260,888.47
应收利息	3,516,200.41	3,516,200.41
应收申购款	32,035.76	32,035.76
资产合计	238,286,266.19	238,286,266.19
以外币计价的负债		
应付赎回款	969,182.05	969,182.05
其他负债	1,192.93	1,192.93
负债合计	970,374.98	970,374.98
资产负债表外汇风险敞口净额	237,315,891.21	237,315,891.21

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除该单一汇率以外的其他市场变量保持不变

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	美元相对人民币升值 5%	增加约 825	增加约 1,187
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 825	减少约 1,187

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金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%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

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。

3 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 8 月 25 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：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	151,016,435.71	88.51
	其中：债券	151,016,435.71	88.51
	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	16,973,178.05	9.95
8	其他各项资产	2,634,821.86	1.54
9	合计	170,624,435.62	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所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

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-	3,231,225.40	1.93
BBB+至 BBB-	47,730,785.47	28.57
BB+至 BB-	46,841,281.67	28.04
B+至 B-	49,865,300.72	29.85
未评级	3,347,842.45	2.00

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	XS1508493498	YUZHOU PROPERTIES CO LTD	3,893,725	3,755,030.52	2.25
2	XS1954740285	KWG GROUP HOLDINGS	3,539,750	3,662,968.70	2.19
3	XS1945401674	TIMES CHINA HLDG LTD	3,539,750	3,628,279.15	2.17
4	XS2027337786	LOGAN PROPERTY HOLDINGS	3,539,750	3,624,527.01	2.17
5	XS1880734840	BI HAI CO LTD	3,539,750	3,607,323.83	2.16

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

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	2,585,729.98
5	应收申购款	49,091.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,634,821.86

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

本基金本报告期末未持有股票。

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
华安美元票息债-A	1,703	79,850.64	55,657,750.57	40.93%	80,327,890.31	59.07%
华安美元票息债-C	755	7,052.86	0.00	0.00%	5,324,908.52	100.00%
合计	2,458	57,490.05	55,657,750.57	39.39%	85,652,798.83	60.61%

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	华安美元票息债-A	138,516.65	0.10%
	华安美元票息债-C	1.00	0.00%
	合计	138,517.65	0.10%

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	华安美元票息债-A	0~10
	华安美元票息债-C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华安美元票息债-A	-
	华安美元票息债-C	-
	合计	-

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	华安美元票息债-A	华安美元票息债-C
基金合同生效日（2016 年 6 月 3 日）基金份额总额	703,810,487.46	775,135,275.31
本报告期期初基金份额总额	191,451,657.79	12,143,837.19

本报告期基金总申购份额	20,716,703.70	4,632,281.96
减：本报告期基金总赎回份额	76,182,720.61	11,451,210.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	135,985,640.88	5,324,908.52

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Ltd.	-	-	-	-	-	-
Nomura	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings	-	-	-	-	-	-
Mizuho	-	-	-	-	-	-
CEB International	-	-	-	-	-	-

Capital Corporation Limited						
Barclays Capital Group	-	-	-	-	-	-
CITICS	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered	-	-	-	-	-	-
ANZ Banking Group Limited	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
China International Capital	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-
Wells Fargo Securities	-	-	-	-	-	-
DBS Bank	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities	-	-	-	-	-	-
KGI	-	-	-	-	-	-
Merril Lynch	-	-	-	-	-	-
CNCBI	-	-	-	-	-	-
中泰国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东亚银行	-	-	-	-	-	-

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。

QDII 券商选择程序：

(1) 对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

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

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

完成在 CNCBI 的开户。

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
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Ltd.	67,256,703.63	21.03%	-	-	-	-	-	-
Nomura	41,162,931.34	12.87%	-	-	-	-	-	-
HSBC	31,988,861.58	10.00%	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	29,823,413.14	9.33%	-	-	-	-	-	-
Huatai Financi	19,889,562.73	6.22%	-	-	-	-	-	-

al Holdings								
Mizuho	19,433,425.75	6.08%	-	-	-	-	-	-
CEB International Capital Corporation Limited	16,105,939.17	5.04%	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital Group	13,227,741.82	4.14%	-	-	-	-	-	-
CITICS	12,401,833.49	3.88%	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan	12,205,493.15	3.82%	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered	11,281,371.79	3.53%	-	-	-	-	-	-
ANZ Banking Group Limited	11,234,134.24	3.51%	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	9,022,527.86	2.82%	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	8,822,359.82	2.76%	-	-	-	-	-	-

China International Capital	5,339,536.31	1.67%	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	5,122,134.87	1.60%	-	-	-	-	-	-
Wells Fargo Securities	3,624,895.51	1.13%	-	-	-	-	-	-
DBS Bank	1,848,326.44	0.58%	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI	-	-	-	-	-	-	-	-
Merril Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
CNCBI	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰国际	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚银行	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于华安全球美元票息债券型证券投资基金 2020 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定期定额投资的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-15
2	华安全球美元票息债券型证券投资基金基金合同（更新）	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
3	华安全球美元票息债券型证券投资基金托管	《证券日报》、中国证监	2020-03-07

	协议（更新）	会基金电子披露网站和公司网站	
4	关于华安全球美元票息债券型证券投资基金暂停大额申购、大额定期定额投资的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-23
5	关于华安全球美元票息债券型证券投资基金暂停申购、定期定额投资的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
6	华安基金关于旗下基金参加中信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-05-21
7	关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-16
8	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	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200319-20200324	26,815,543.07	0.00	0.00	26,815,543.07	18.98%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、《华安全球美元票息债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安全球美元票息债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安全球美元票息债券型证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准华安全球美元票息债券型证券投资基金设立的文件

5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件

6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

7、基金托管人业务资格批件和营业执照

8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十八日