

**华安全球稳健配置证券投资基金**  
**2018 年年度报告摘要**  
**2018 年 12 月 31 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：二〇一九年三月三十日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 6 月 29 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安全球稳健配置证券投资基金	
基金简称	华安全球稳健配置	
基金主代码	005440	
交易代码	005440	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 29 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	27,140,302.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安全球稳健配置 A	华安全球稳健配置 C
下属分级基金的交易代码	005440	005441
报告期末下属分级基金的份额总额	18,695,877.60 份	8,444,424.57 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理，实现组合资产的分散化投资，严格遵守投资纪律，力争实现投资组合的风险收益交换效率最大化，并追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金主要投资于股票与债券两大类资产，建仓完成后股债两类资产配置的目标比例为 50%/50%，偏离误差控制在±10%，并定期进行回顾和再平衡调整。在实际投资过程中，由于受全球宏观经济发展、资本市场变化等因素影响，基金管理人可适时对股债大类资产配置比例进行调整。</p> <p>当全球资本市场正常运行时，本基金维持 50%/50%的股债配比；当全球资本市场处于非正常状态，尤其是股票市场大幅动荡时，本基金将适当降低股票资产的配置比例，适当提高债券资产和现金的配置比例。</p> <p>本基金将全球股票市场分为成熟市场和新兴市场两类，将全球债券市场</p>

	分为美国市场、非美成熟市场和新兴市场三类。本基金将根据全球宏观经济走势、各区域和各主要经济体发展水平，并结合对各细分市场的深入分析，采用全球资产配置量化模型，确定各类资产项下的具体市场配置比例并进行定期调整，争取构建具备中长期发展潜力的资产组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准（经汇率调整）：明晟 MSCI 世界指数收益率×25% + 明晟 MSCI 新兴市场指数收益率×25% + 彭博巴克莱全球综合债券指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为基金中基金，预期风险与收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于全球股票型基金。本基金投资于境外市场证券，因此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	陆滢	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

### 2.4 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	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York, NY 1005
办公地址		140 Broadway New York, NY 1005
邮政编码		NY 1005

### 2.5 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联	<a href="http://www.huaan.com.cn">www.huaan.com.cn</a>
------------------	--

网网址	
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	
	华安全球稳健配置 A	华安全球稳健配置 C
本期已实现收益	-183,528.97	-201,099.37
本期利润	-242,281.19	-164,773.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0157	-0.0025
本期加权平均净值利润率	-1.58%	-0.25%
本期基金份额净值增长率	-1.40%	-1.89%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	
	华安全球稳健配置 A	华安全球稳健配置 C
期末可供分配利润	-261,508.27	-159,879.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0140	-0.0189
期末基金资产净值	18,434,369.33	8,284,544.73
期末基金份额净值	0.9860	0.9811

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、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折

算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1. 华安全球稳健配置 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.44%	0.19%	-5.15%	0.59%	3.71%	-0.40%
过去六个月	-1.40%	0.14%	-1.23%	0.51%	-0.17%	-0.37%
自基金合同生效起至今	-1.40%	0.14%	-0.11%	0.52%	-1.29%	-0.38%

##### 2. 华安全球稳健配置 C:

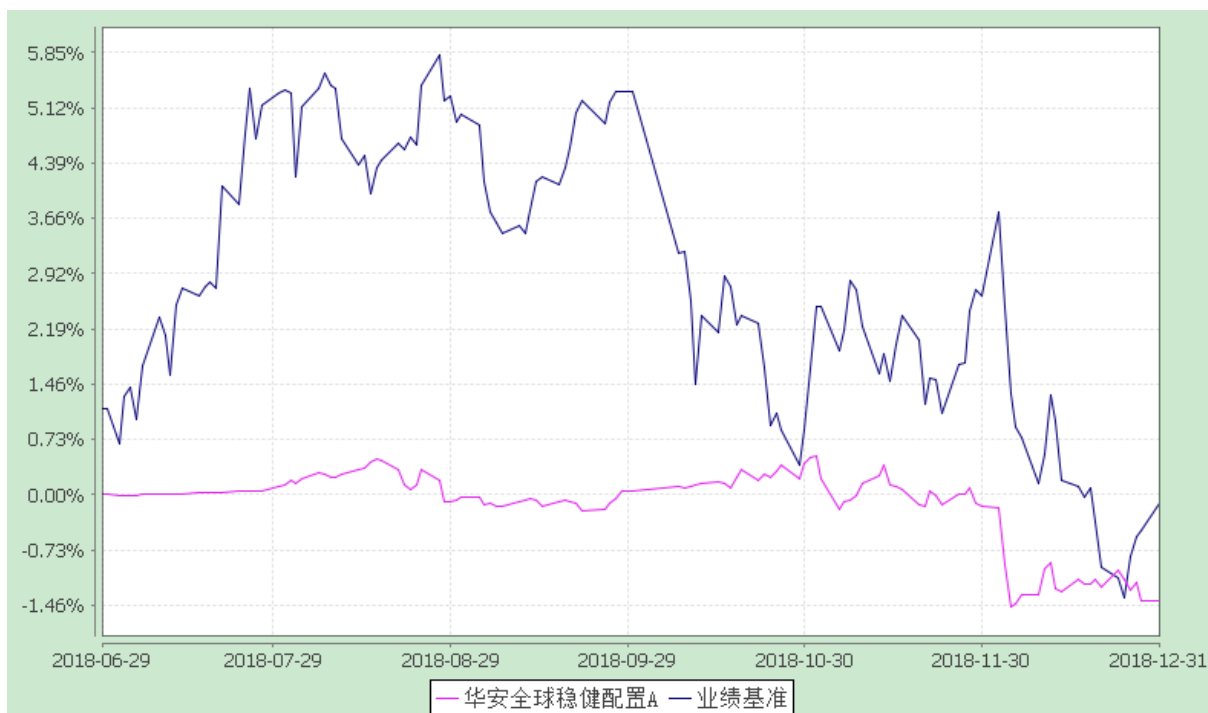
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.53%	0.19%	-5.15%	0.59%	3.62%	-0.40%
过去六个月	-1.89%	0.14%	-1.23%	0.51%	-0.66%	-0.37%
自基金合同生效起至今	-1.89%	0.14%	-0.11%	0.52%	-1.78%	-0.38%

#### 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

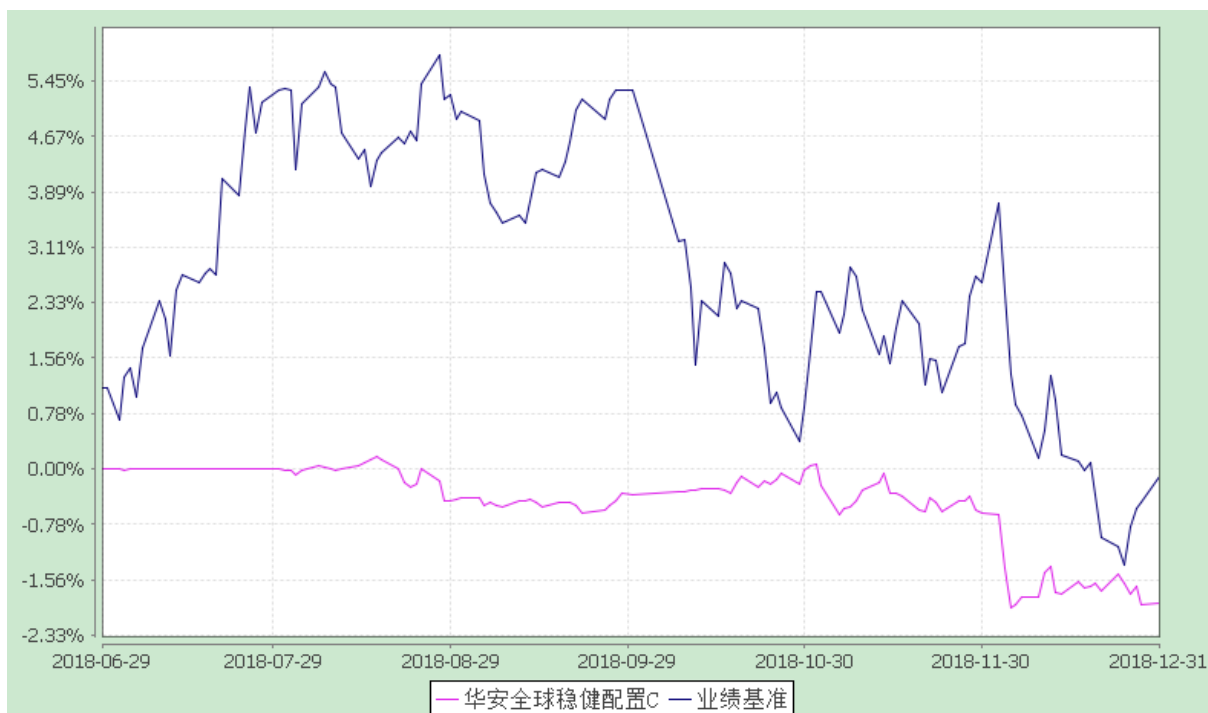
华安全球稳健配置证券投资基金

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

(2018 年 6 月 29 日至 2018 年 12 月 31 日)1、华安全球稳健配置 A



## 2、华安全球稳健配置 C

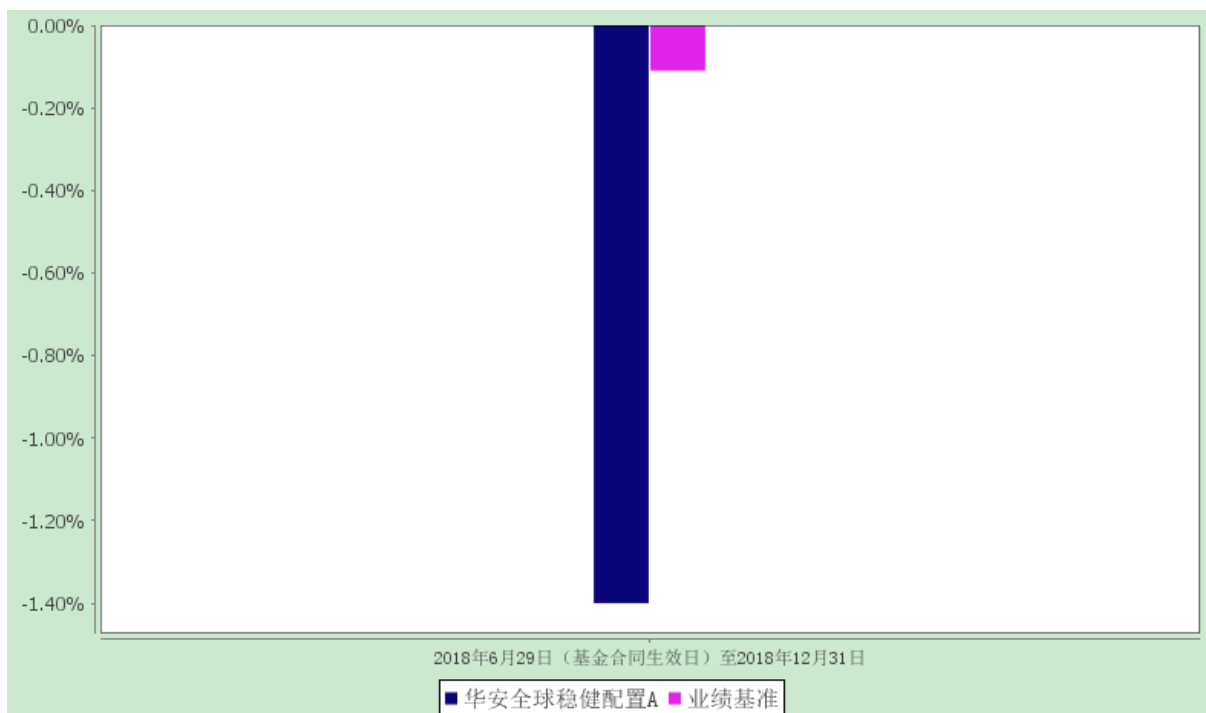


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

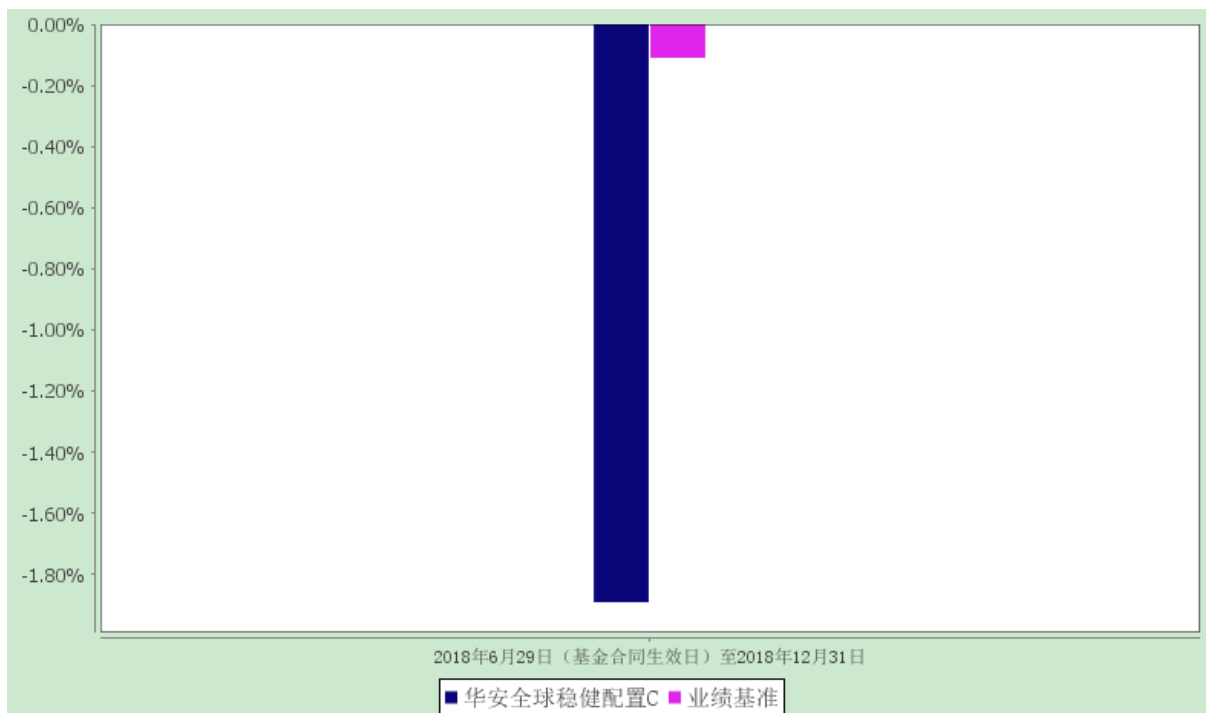
华安全球稳健配置证券投资基金

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、华安全球稳健配置 A



## 2、华安全球稳健配置 C



注：1、本基金于 2018 年 6 月 29 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年；

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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年没有利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2018 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 108 只开放式基金，管理资产规模达到 2756.06 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		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	2018-06-29	-	7 年	硕士研究生，7 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，同时担任本基金

					的基金经理。
--	--	--	--	--	--------

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公

司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 4 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年，全球经济增长动能整体减速，呈现美强欧弱、新兴市场势头放缓的局面。美联储于全年加息四次，符合市场预期；但点阵图显示，2019 年加息次数由 3 次下调至 2 次，显示加息节奏将明显放缓。欧央行于今年 12 月结束 QE，明确缩表启动的时点至少在首次加息后一段时间，而政策利率至少保持不变直至 2019 年下半年。受欧美经济预期差、货币政策预期差的影响，叠加全球贸易战、意大利组阁危机、英国脱欧进程摇摆、美国债务上限等外部宏观事件的袭扰，导致美元指数在年内大幅走高，推升了全球资本市场尤其是新兴市场的不确定性。

全年，全球股票市场整体下跌，发达市场相对跑赢，MSCI 发达市场指数下跌 10.44%（美元计价收益，下同），MSCI 新兴市场指数下跌 16.63%。发达市场中，美国相对跑赢（S&P500：-6.24%）、

日股其次（NIKKEI225：-10.35%）、法英德最弱（CAC40：-15.17%、FTSE：-17.52%、DAX30：-22.21%）。债市方面，受制于 G7 国债收益率的全面上行，衡量全球债市综合表现的彭博巴克莱全球债券综合指数下跌 1.20%。

本基金成立于年中，下半年逐步完成了建仓工作。在换汇方面，我们选择了分批换汇以平滑换汇成本，避免一次性换汇可能造成的业绩拖累。基于审慎的原则，我们在建仓期以配置固定收益品种为主（利率债、短期限信用债、货币市场工具等），规避了权益资产带来的下行风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，华安全球稳健配置 A 份额净值为 0.9860 元，C 份额净值为 0.9811 元；华安全球稳健配置 A 份额净值增长率为-1.40%，C 份额净值增长率为-1.89%，同期业绩比较基准增长率为-0.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，我们认为全球经济较 18 年有明显起色的可能性不高，但谈全球衰退仍为时尚早。与 18 年美强欧弱、新兴市场放缓的局面不同，我们认为 19 年美国已大概率触顶，欧元区经济已差无可差，而新兴市场在中国经济企稳的带动下，有望获得边际改善。

我们预计美联储在 19 年将更偏鸽派，最多加息一次甚至不加息，而缩表进程也有望于年底停止。美联储货币紧缩进程的中止，将在很大程度上为全球资本市场提供有力支撑。

对于全球股市，我们并不悲观，在经历了 18 年的大幅调整后，全球股票市场已显露出一定的投资机会与价值。相较已处于高位的美股而言，我们更偏好新兴股市与欧股。对新兴股市而言，1) 在经历 18 年的调整后，估值已处于历史低位；2) 美联储的鸽派转向，可能带来弱势美元，对新兴资产形成有利支撑；3) 中国经济有望企稳，带动新兴经济体改善。对欧股而言，一方面由于欧洲基本面已差无可差，任何边际上的改善都将对欧股形成利好；另一方面，我们认为欧央行已关注并意识到欧元区面临的下行风险，仍显宽松的货币政策将是欧股的有力支撑。

对于全球债市，我们认为本轮联储加息进程基本结束，叠加可能的缩表中止，使得利率风险大为降低；在信用债方面，我们更偏好新兴债券，主要由于：1) 经历 18 年的调整后，新兴债市已具备充分投资价值；2) 同新兴市场股票一样，可能的弱势美元将对新兴市场债券形成有利支撑。

展望未来，对于权益资产，我们将密切关注全球股市的发展，适时捕捉潜在的交易机会；对于固定收益资产，我们将进一步优化组合配置，提供稳健的回报。总体而言，我们将在兼顾风险与收益的平衡下，努力为投资者创造超额回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值连续超过 20 个工作日低于 5000 万元。

## §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合规守信、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。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师 蒋燕华 沈熙苑签字出具了安永华明（2019）审字第 60971571\_B51 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安全球稳健配置证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	-
银行存款	3,530,970.52
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	21,477,698.08
其中：股票投资	-
基金投资	21,477,698.08
债券投资	-

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	2,002,556.16
应收利息	304.59
应收股利	9,944.78
应收申购款	369.93
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>27,021,844.06</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>	-
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	25,512.36
应付管理人报酬	36,567.11
应付托管费	7,999.07
应付销售服务费	2,846.30
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	230,005.16
<b>负债合计</b>	<b>302,930.00</b>

<b>所有者权益：</b>	-
实收基金	27,140,302.17
未分配利润	-421,388.11
<b>所有者权益合计</b>	<b>26,718,914.06</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>27,021,844.06</b>

注：(1)报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9845 元，基金份额总额 27,140,302.17 份,其中 A 类基金份额净值 0.9860 元，份额总额 18,695,877.60 份；C 类基金份额净值 0.9811 元，份额总额 8,444,424.57 份。

(2)本基金基金合同于 2018 年 6 月 29 日生效。

## 7.2 利润表

会计主体：华安全球稳健配置证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>746,302.39</b>
1.利息收入	736,081.62
其中：存款利息收入	157,015.40
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	579,066.22
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	72,158.76
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-100,054.20
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-



衍生工具收益	-
股利收益	172,212.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-22,426.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-68,270.50
5.其他收入（损失以“-”号填列）	28,758.84
<b>减：二、费用</b>	<b>1,153,357.06</b>
1. 管理人报酬	637,342.79
2. 托管费	139,418.82
3. 销售服务费	127,624.31
4. 交易费用	11,610.41
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	145.73
7. 其他费用	237,215.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-407,054.67</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-407,054.67</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安全球稳健配置证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	296,372,424.79	-	296,372,424.79

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-407,054.67	-407,054.67
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）	-269,232,122.62	-14,333.44	-269,246,456.06
其中：1.基金申购款	24,316,090.25	-57,614.24	24,258,476.01
2.基金赎回款	-293,548,212.87	43,280.80	-293,504,932.07
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）	27,140,302.17	-421,388.11	26,718,914.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安全球稳健配置证券投资基金(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〕868号《关于准予华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》及证监许可〔2017〕2110号《关于准予华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司自2018年5月17日至2018年6月26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(2018)验字第60971571\_B04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2018年6月29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)为人民币296,294,821.64元，在募集期间产生的存款利息为人民币77,603.15元，以上实收基金(本息)合计为人民币296,372,424.79元，折合296,372,424.79份基金份额，其中A类基金份额10,678,687.32份，C类基金份额285,693,737.47份。

本基金的基金管理人和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，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）。

本基金投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括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证券监管机构登记注册的境外公募基金（包括 ETF），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证券市场公开发行和挂牌交易的股票，以及政府债券、公司债券、可转换债券、现金、银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具、远期合约、互换，境内货币市场工具（包括现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购等）及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等用于组合避险或有效管理的金融衍生工具和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。。

本基金的基金投资不低于本基金资产的 80%，股票、股票型公募基金（包括股票型 ETF）的投资不超过基金资产的 60%，债券、债券型公募基金（包括债券型 ETF）的投资亦不超过基金资产的 60%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。

本基金业绩比较基准（经汇率调整）：明晟 MSCI 世界指数收益率×25%+明晟 MSCI 新兴市场指数收益率×25%+彭博巴克莱全球综合债券指数收益率×50%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2018 年 6 月 29 日（基金合同生效日）起至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 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。

##### 7.4.4.1 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自 2018 年 6 月 29 日（基金合同生效日）起至 2018 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 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。

##### 7.4.4.3 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、债券投资、基金投资和衍生工具等；

###### (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。

##### 7.4.4.4 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。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券、基金等，以及不作为

有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

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，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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；

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。

#### 7.4.4.5 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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整

的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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）”。

#### 7.4.4.9 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) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（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；

(4) 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；

(5) 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；

(6) 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；

(7) 权证收益/（损失）于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账；

(8) 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适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；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

(10)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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的

则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；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；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(5) 基金可供分配利润为正的前提下，方可进行收益分配；

(6) 投资者的现金红利的金额和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

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。

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、营业税的单位和个体，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发展费附加的单位外）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，在境内暂免征收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。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(建设银行)	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.)	基金境外托管人
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东 (2018 年 12 月 5 日前)
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东 (2018 年 12 月 5 日前)
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东 (自 2018 年 12 月 5 日起)、基金销售机构
上海上国投资资产管理有限公司	基金管理人的股东 (自 2018 年 12 月 5 日起)
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

**7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.4.8.1.1 股票交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

**7.4.8.1.2 权证交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.4.8.1.3 债券交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

**7.4.8.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

**7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

**7.4.8.2 关联方报酬**

**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	637,342.79
其中：支付销售机构的客户维护费	57,595.71

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.60\% / \text{当年天数}$$

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,按月支付。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	139,418.82

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.35%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

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，按月支付。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2018年6月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华安基金管理有限公司	15,432.28
建设银行	1,188.55
合计	16,620.83

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：

$$H=E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期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未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	2,395,357.03	149,527.98
布朗兄弟哈里曼银行	1,135,613.49	-

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 21,477,698.08 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	21,477,698.08	79.48
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,530,970.52	13.07
8	其他各项资产	2,013,175.46	7.45
9	合计	27,021,844.06	100.00

### 8.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ISHARES SHORT	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	5,223,375.62	19.55

	TREASURY BOND					
2	SPDR BBG BARC 1-3 MONTH TBIL	ETF 基金	开放式	State Street Bank and Trust Company	5,021,666.18	18.79
3	PIMCO ENHANCED SHORT MATURIT	ETF 基金	开放式	PIMCO ETF Trust	4,849,880.28	18.15
4	ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	2,869,503.92	10.74
5	ISHARES 3-7 YEAR TREASURY BOND	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	2,082,981.20	7.80
6	ISHARES 7-10 YEAR TREASURY BOND	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,430,290.88	5.35

### 8.3 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股票及存托凭证。

### 8.4 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股票及存托凭证。

### 8.5 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股票及存托凭证。

### 8.6 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 8.6.1 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末未进行权益投资。

### 8.7 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。



**8.8 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**

本基金本报告期末未持有债券。

**8.9 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。

**8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名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。

**8.11 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 SHORT TREASURY BOND	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	5,223,375.62	19.55
2	SPDR BBG BARC 1-3 MONTH TBIL	ETF 基金	开放式	State Street Bank and Trust Company	5,021,666.18	18.79
3	PIMCO ENHANCED SHORT MATURIT	ETF 基金	开放式	PIMCO ETF Trust	4,849,880.28	18.15
4	ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	2,869,503.92	10.74
5	ISHARES 3-7 YEAR TREASURY BOND	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	2,082,981.20	7.80
6	ISHARES 7-10 YEAR TREASURY BOND	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,430,290.88	5.35

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

#### 8.12.3 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	2,002,556.16
3	应收股利	9,944.78
4	应收利息	304.59
5	应收申购款	369.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,013,175.46

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	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
华安全球稳健配 置 A	715	26,148.08	15,011,749.85	80.29%	3,684,127.75	19.71%
华安全球稳健配 置 C	394	21,432.55	4,222,420.02	50.00%	4,222,004.55	50.00%
合计	1,109	24,472.77	19,234,169.87	70.87%	7,906,132.30	29.13%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	华安全球稳健配置 A	2.87	0.00%
	华安全球稳健配置 C	-	-
	合计	2.87	0.00%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安全球稳健配置 A	华安全球稳健配置 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 29 日）基金份额总额	10,678,687.32	285,693,737.47
基金合同生效日起至报告期期末 基金总申购份额	15,233,182.59	9,082,907.66
减：基金合同生效日起至报告期 期末基金总赎回份额	7,215,992.31	286,332,220.56
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	18,695,877.60	8,444,424.57

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2018 年 2 月 13 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况：50,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	5,636.16	49.62%	-
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	-	-	-	993.48	8.75%	-
Instinet Pacific Services Ltd.	-	-	-	4,729.30	41.64%	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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：

完成野村证券、高盛、摩根斯坦利的开户。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	27,363,719.21	45.45%
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	-	-	-	-	-	-	8,466,897.06	14.06%
Instinet Pacific Services Ltd.	-	-	-	-	-	-	24,371,793.24	40.48%
兴业证券	-	-	1,026,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					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	20180809-20180816	0.00	8,002,160.00	8,002,160.00	0.00	0.00%
	2	20180830-20181231	0.00	15,012,511.26	0.00	15,012,511.26	55.31%

个人	1	20180817- 20180829	0.00	4,850, 654.75	4,850,65 4.75	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司

二〇一九年三月三十日