

# 华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）

**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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 4 月 22 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
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	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	37
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	37
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 本报告期投资基金情况	38
7.12 投资组合报告附注	38
<b>8 基金份额持有人信息</b>	<b>39</b>

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
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>40</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>40</b>
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 .....	43
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>44</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>44</b>
12.1 备查文件目录 .....	44
12.2 存放地点 .....	45
12.3 查阅方式 .....	45

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）	
基金简称	华安全球精选债	
基金主代码	008357	
交易代码	008357	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 22 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	192,987,186.95 份	
下属分级基金的基金简称	华安全球精选债 A	华安全球精选债 C
下属分级基金的交易代码	008357	008358
报告期末下属分级基金的份额总额	192,964,828.89 份	22,358.06 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配置比例。 本基金将基于对经济周期及其变化趋势等特征的研究和判断，根据对利率债券、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	彭博巴克莱全球综合债券指数收益率（经汇率调整）×95%+商业银行活期存款基准利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。 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	兴业银行股份有限公司
信息披露	姓名	薛珍	林兴盛

负责人	联系电话	021-38969999	021-52629999-213707
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	linxingsheng@cib.com.cn
客户服务电话		4008850099	95561
传真		021-68863414	021-62159217
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	福州市湖东路154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	上海市银城路167号兴业大厦4 楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		朱学华	高建平

## 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	-	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

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 4 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日)	
	华安全球精选债 A	华安全球精选债 C

本期已实现收益	742,811.32	-52,392.74
本期利润	1,797,775.63	-52,257.65
加权平均基金份额本期利润	0.0087	-0.0056
本期加权平均净值利润率	0.87%	-0.56%
本期基金份额净值增长率	0.94%	7.36%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2020 年 6 月 30 日)</b>	
	华安全球精选债 A	华安全球精选债 C
期末可供分配利润	746,632.40	1,513.05
期末可供分配基金份额利润	0.0039	0.0677
期末基金资产净值	194,786,421.42	24,003.60
期末基金份额净值	1.0094	1.0736
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2020 年 6 月 30 日)</b>	
	华安全球精选债 A	华安全球精选债 C
基金份额累计净值增长率	0.94%	7.36%

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 2020 年 4 月 22 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

华安全球精选债 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	0.55%	0.14%	0.15%	0.18%	0.40%	-0.04%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.94%	0.13%	2.46%	0.25%	-1.52%	-0.12%

华安全球精选债 C

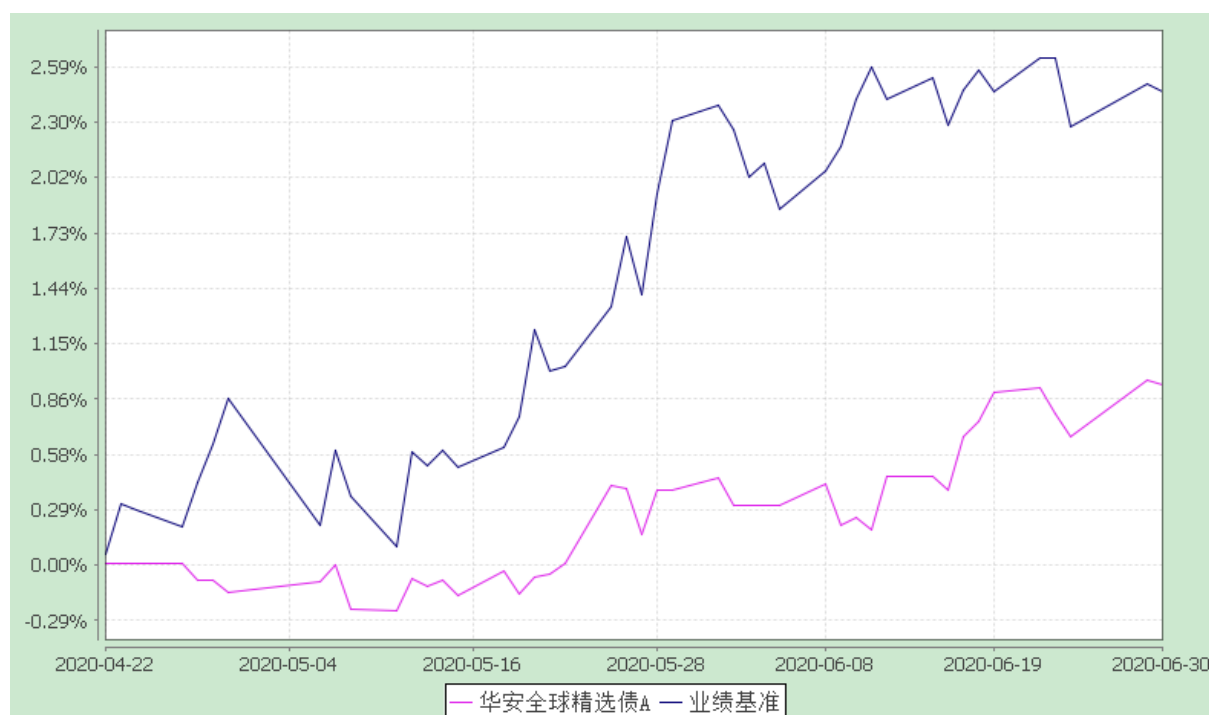
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.51%	0.14%	0.15%	0.18%	0.36%	-0.04%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	7.36%	0.96%	2.46%	0.25%	4.90%	0.71%

### 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

#### 华安全球精选债 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

(2020 年 4 月 22 日至 2020 年 6 月 30 日)

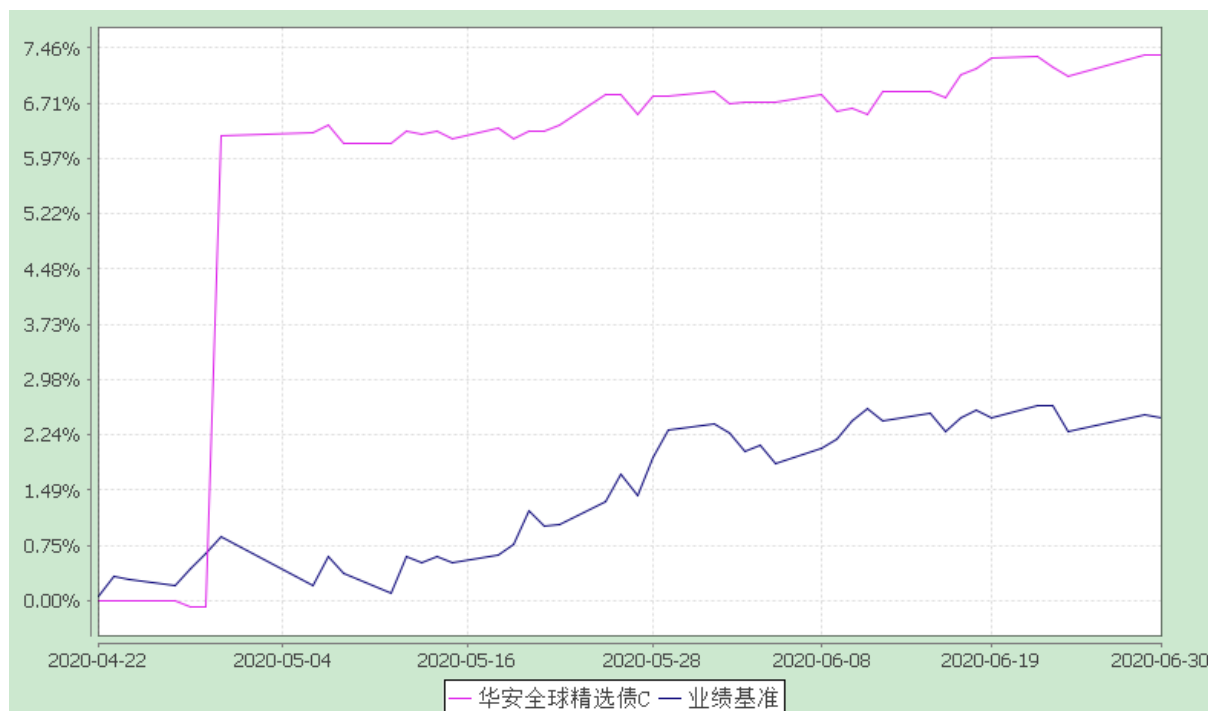


#### 华安全球精选债 C

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

(2020 年 4 月 22 日至 2020 年 6 月 30 日)





注：1、本基金于 2020 年 4 月 22 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	2020-04-22	-	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 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。

#### 4.3.2 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。

#### 4.4 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

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%。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，华安全球精选债 A 份额净值为 1.0094 元，C 份额净值为 1.0736 元；华安全球精选债 A 份额净值增长率为 0.94%，C 份额净值增长率为 7.36%，同期业绩比较基准增长率为 2.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度或下半年，我们认为市场在短期内会有一些波动，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。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

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

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）

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
<b>资产：</b>		-
银行存款	6.4.7.1	27,044,330.59
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	166,777,006.23
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		166,777,006.23
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	2,979,968.99
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>196,801,305.81</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		-
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		1,765,744.82
应付赎回款		6.09
应付管理人报酬		132,194.49
应付托管费		24,786.48
应付销售服务费		8.00
应付交易费用		-
应交税费		27,904.91
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	40,236.00
<b>负债合计</b>		<b>1,990,880.79</b>
<b>所有者权益：</b>		-
实收基金	6.4.7.8	192,987,186.95
未分配利润	6.4.7.9	1,823,238.07
<b>所有者权益合计</b>		<b>194,810,425.02</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>196,801,305.81</b>

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0094 元，基金份额总额 192,987,186.95 份，其中华安全球精选债 A 类基金份额净值 1.0094 元，份额总额 192,964,828.89 份；华安全球精选债 C 类基金份额净值 1.0736 元，份额总额 22,358.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）

本报告期：2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>2,177,661.99</b>
1.利息收入		1,377,197.72
其中：存款利息收入	6.4.7.10	174,185.39
债券利息收入		1,203,012.33
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）		120,747.72
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	120,747.72
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）	6.4.7.13	1,055,099.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-375,382.85
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-
<b>减：二、费用</b>		<b>432,144.01</b>
1. 管理人报酬		321,611.06
2. 托管费		60,302.08
3. 销售服务费		5,264.01
4. 交易费用		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		4,330.86
7. 其他费用	6.4.7.14	40,636.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,745,517.98</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,745,517.98</b>

注：本基金于 2020 年 4 月 22 日成立，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）

本报告期：2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）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）	270,093,172.07	-	270,093,172.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,745,517.98	1,745,517.98
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）	-77,105,985.12	77,720.09	-77,028,265.03
其中：1.基金申购款	24,899,002.01	99,019.08	24,998,021.09
2.基金赎回款	-102,004,987.13	-21,298.99	-102,026,286.12
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）	192,987,186.95	1,823,238.07	194,810,425.02

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

华安全球精选债券型证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)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[2019]2234 号《关于准予华安全球精选债券型证券投资基金(QDII)注册的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安全球精选债券型证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 270,084,611.66 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0306 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安全球精选债券型证券投资基金(QDII)基金合同》于 2020 年 4 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 270,093,172.07 份，其中认购资金利息折合 8,560.41 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华安全球精选债券型证券投资基金(QDII)招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取前后端认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C

类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安全球精选债券型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，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：债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、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，本基金的投资范围为包括政府债券、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；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；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；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、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中债券资产占基金资产的比例不低于 80%，保持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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：彭博巴克莱全球综合债券指数收益率(经汇率调整) $\times 95\%$ +商业银行活期存款基准利率(税后) $\times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2020 年 8 月 25 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安全球精选债券型证券投资基金(QDII)基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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。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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生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其估值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未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 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入账。

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，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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前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，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前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，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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	27,044,330.59
定期存款	-
其他存款	-
合计	27,044,330.59

### 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	165,721,906.83	166,777,006.23
	银行间市场	-	-
	合计	165,721,906.83	166,777,006.23
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	165,721,906.83	166,777,006.23	1,055,099.40

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

### 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	38,437.17
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	2,941,531.82
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	2,979,968.99

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	40,236.00
合计	40,236.00

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

华安全球精选债 A		
项目	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	210,066,610.74	210,066,610.74
本期申购	24,898,997.33	24,898,997.33
本期赎回（以“-”号填列）	-42,000,779.18	-42,000,779.18

本期末	192,964,828.89	192,964,828.89
-----	----------------	----------------

金额单位：人民币元

华安全球精选债C		
项目	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	60,026,561.33	60,026,561.33
本期申购	4.68	4.68
本期赎回（以“-”号填列）	-60,004,207.95	-60,004,207.95
本期末	22,358.06	22,358.06

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

华安全球精选债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	742,811.32	1,054,964.31	1,797,775.63
本期基金份额交易产生的变动数	3,821.08	19,995.82	23,816.90
其中：基金申购款	27,558.09	71,460.67	99,018.76
基金赎回款	-23,737.01	-51,464.85	-75,201.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	746,632.40	1,074,960.13	1,821,592.53

单位：人民币元

华安全球精选债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-52,392.74	135.09	-52,257.65
本期基金份额交易产生的变动数	53,905.79	-2.60	53,903.19
其中：基金申购款	0.30	0.02	0.32
基金赎回款	53,905.49	-2.62	53,902.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,513.05	132.49	1,645.54

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30

	日
活期存款利息收入	174,185.39
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	-
合计	174,185.39

#### 6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月22日（基金合同生效日）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	42,574,360.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	41,934,141.81
减：应收利息总额	519,471.38
买卖债券差价收入	120,747.72

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1.交易性金融资产	1,055,099.40
——股票投资	-
——债券投资	1,055,099.40
——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	1,055,099.40

#### 6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	18,188.80
信息披露费	22,047.20
证券出借违约金	-
其他费用	400.00
合计	40,636.00

**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（“华安基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外托管人

**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4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	321,611.06
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,302.08

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 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4月22日（基金合同生效日）至2020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	5,264.01
兴业银行股份有限 公司	-
合计	5,264.01

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：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为本基金 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为本基金 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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 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 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,153,756.35	174,185.39
布朗兄弟哈里曼银行	25,890,574.24	0.00

注：本基金的银行存款分别由基金托管人兴业银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率计息。

#### 6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 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、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不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	1,153,756.35	-	-	25,890,574.24	27,044,330.59
交易性金融资产	17,676,131.00	114,546,441.01	34,554,434.22	-	166,777,006.23
应收利息	-	-	-	2,979,968.99	2,979,968.99
资产总计	18,829,887.35	114,546,441.01	34,554,434.22	28,870,543.23	196,801,305.81
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,765,744.82	1,765,744.82
应付赎回款	-	-	-	6.09	6.09
应付管理人报酬	-	-	-	132,194.49	132,194.49
应付托管费	-	-	-	24,786.48	24,786.48
应付销售服务费	-	-	-	8.00	8.00
应交税费	-	-	-	27,904.91	27,904.91
其他负债	-	-	-	40,236.00	40,236.00
负债总计	-	-	-	1,990,880.79	1,990,880.79
利率敏感度缺口	18,829,887.35	114,546,441.01	34,554,434.22	26,879,662.44	194,810,425.02

#### 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
	市场利率下降25个基点	增加约81
	市场利率上升25个基点	减少约81

#### 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	25,890,859.40	25,890,859.40
交易性金融资产	166,777,006.23	166,777,006.23
应收利息	2,941,531.82	2,941,531.82
资产合计	195,609,397.45	195,609,397.45
以外币计价的负债		
应付证券清算款	1,765,744.82	1,765,744.82
负债合计	1,765,744.82	1,765,744.82
资产负债表外汇风险敞口净额	193,843,652.63	193,843,652.63

##### 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
	美元相对人民币升值 5%	增加约 969
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 969

##### 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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 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

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	166,777,006.23	84.74
	其中：债券	166,777,006.23	84.74
	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	27,044,330.59	13.74
8	其他各项资产	2,979,968.99	1.51
9	合计	196,801,305.81	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股票及存托凭证。

## 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股票及存托凭证。

## 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（%）
A+至 A-	3,552,316.11	1.82
BBB+至 BBB-	34,903,223.48	17.92
BB+至 BB-	75,162,396.70	38.58
B+至 B-	51,384,239.29	26.38
未评级	1,774,830.65	0.91

## 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	XS2178949561	COUNTRY GARDEN HLDGS	5,309,625	5,509,638.57	2.83
2	XS1969792800	CIFI HOLDINGS GROUP	5,309,625	5,448,843.37	2.80
3	XS2188034586	SEAZEN GROUP LTD	5,309,625	5,337,500.53	2.74
4	XS2140531950	CHINA CONSTRUCTION BANK	5,309,625	5,292,262.53	2.72
5	XS1950819729	RONSHINE CHINA	3,539,750	3,722,578.09	1.91

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 本报告期投资基金情况

##### 7.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 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。

**7.12.2** 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。

##### 7.12.3 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	-

3	应收股利	-
4	应收利息	2,979,968.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,979,968.99

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

### 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
华安全球精选债 A	134	1,440,036.04	192,895,581.30	99.96%	69,247.59	0.04%
华安全球精选债 C	96	232.90	0.00	0.00%	22,358.06	100.00%
合计	230	839,074.73	192,895,581.30	99.95%	91,605.65	0.05%

#### 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	华安全球精选债 A	314.34	0.00%
	华安全球精选债 C	21,145.75	94.58%
	合计	21,460.09	0.01%

#### 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

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。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安全球精选债 A	华安全球精选债 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 22 日）基金份额总额	210,066,610.74	60,026,561.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	24,898,997.33	4.68
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	42,000,779.18	60,004,207.95
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	192,964,828.89	22,358.06

## 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

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	
China CITIC Bank International Limited	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan	-	-	-	-	-	-



Securities (Hong Kong) Ltd.						
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
Mizuho	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital Group	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-
China International Capital	-	-	-	-	-	-
CITICS	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered	-	-	-	-	-	-
GS	-	-	-	-	-	-

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 GS、JP Morgan、Mizuho、MS、SCB、Barclays、CICC、Citics、GTJA、Haitong、HSBC、Huatai、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
China CITIC Bank International Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Ltd.	100,027,338.36	40.06%	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	32,404,910.15	12.98%	-	-	-	-	-	-
Mizuho	26,897,328.19	10.77%	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan	26,243,558.59	10.51%	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital Group	14,329,600.32	5.74%	-	-	-	-	-	-

Huatai Financial Holdings	10,648,825.98	4.26%	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	10,546,514.83	4.22%	-	-	-	-	-	-
HSBC	8,973,335.31	3.59%	-	-	-	-	-	-
China International Capital	8,943,353.47	3.58%	-	-	-	-	-	-
CITICS	8,875,828.26	3.55%	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered	1,820,344.69	0.73%	-	-	-	-	-	-
GS	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）基金份额发售公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-09
2	华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）基金合同	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-09
3	华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）基金合同及招募说明书提示性公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-09
4	华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）托管协议	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-09
5	华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）招募说明书	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-09
6	华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）提前结束募集的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-21
7	华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）基金合同生效公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-23
8	关于华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）开放申购、赎回及定投业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-28

9	关于华安全球精选债券型证券投资基金（QDII）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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-29
10	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
11	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29

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	20200430-20200630	0.00	49,999,000.00	0.00	49,999,000.00	25.91%
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、《华安全球精选债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安全球精选债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安全球精选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精选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