

# 华夏全球精选股票型证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十八日

## §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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 24 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 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	30
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	31
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.....	31
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	55
7.11 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏全球精选股票型证券投资基金
基金简称	华夏全球股票(QDII)
基金主代码	000041
交易代码	000041
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月9日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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	18,635,145,883.42份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	主要通过在全球范围内进行积极的股票投资,追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	一般情况下,本基金主要在全球范围内进行积极的股票投资。但在特殊情况下(如基金遭遇巨额赎回、基金主要投资市场临时发生重大变故、不可抗力等),基金可将部分资产临时性地投资于低风险资产,如债券、债券基金、货币市场基金、银行存款等。基金临时性投资的主要目标是保持基金资产的安全性和流动性。
业绩比较基准	摩根士丹利资本国际全球指数(MSCI All Country World Index)。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时,本基金为全球证券投资基金,除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外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		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	崔雁巍	尹东
	联系电话	400-818-6666	010-67595003
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A区	北京市西城区金融大街 25号

办公地址	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	王东明	王洪章

## 2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	摩根大通银行
注册地址		1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		270 Park Avenue, New York, New York 10017-2070
邮政编码		10017

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-416,123,627.72
本期利润	239,860,019.49
加权平均基金份额本期利润	0.0127
本期加权平均净值利润率	1.64%
本期基金份额净值增长率	1.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-4,977,910,525.52
期末可供分配基金份额利润	-0.2671
期末基金资产净值	13,657,235,357.90
期末基金份额净值	0.733
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-26.70%

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，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期末可供分配利润为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。

### 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.81%	1.02%	4.74%	1.27%	-2.93%	-0.25%
过去三个月	-7.91%	0.98%	-6.36%	1.11%	-1.55%	-0.13%
过去六个月	1.52%	0.91%	4.21%	0.93%	-2.69%	-0.02%
过去一年	-19.36%	1.27%	-8.69%	1.41%	-10.67%	-0.14%
过去三年	6.08%	1.12%	27.44%	1.16%	-21.36%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-26.70%	1.52%	-25.40%	1.51%	-1.30%	0.01%

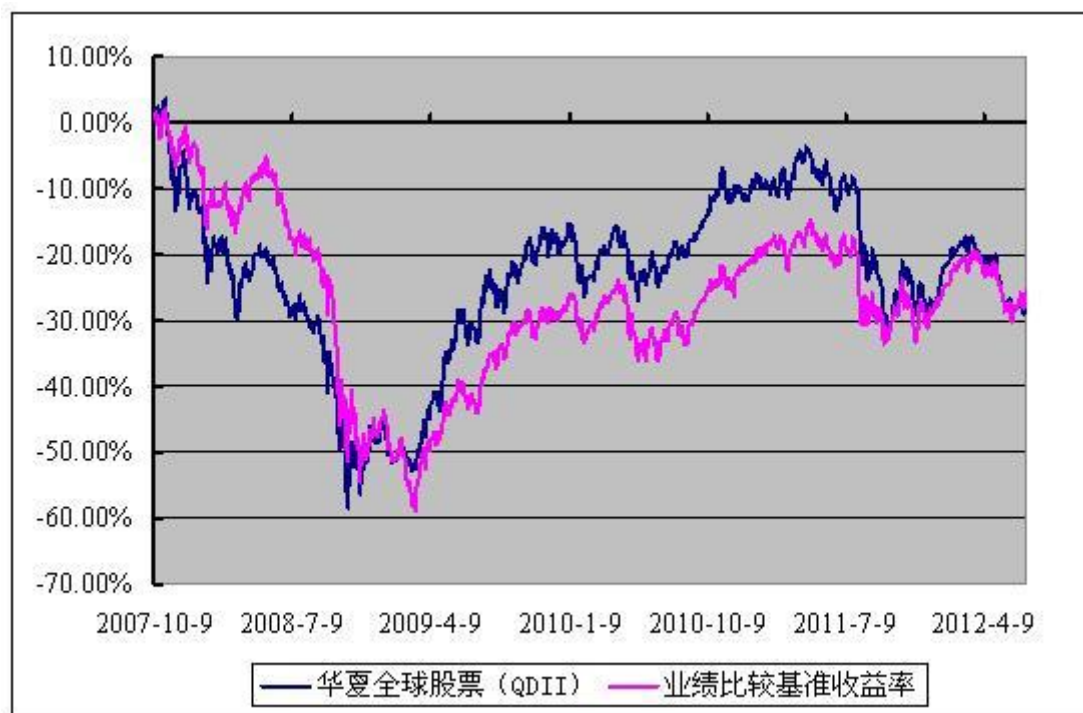
注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

#### 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

华夏全球精选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2007年10月9日至2012年6月30日）



注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

## §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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州和广州设有分公司，在香港设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2012 年上半年，华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础，高度重视风险管理，同时积极把握投资机会，旗下大部分主动管理的股票型、混合型基金表现优于市场平均水平，债券型基金全部取得正收益。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告（截至 2012 年 6 月 29 日数据），今年以来，华夏盛世股票、华夏成长混合等 9 只基金净值增长率超过了 5%。

2012 年 3 月，在《中国证券报》主办的“第九届中国基金业金牛奖”评选中，华夏基金第七次荣获年度“金牛基金管理公司奖”，所管理的基金荣获 6 个

单项奖；在《证券时报》主办的“2011 年度中国基金业明星基金奖”评选中，华夏基金第四次荣获“年度十大明星基金公司奖”，并获得评委会特别颁发的“五年持续回报明星基金公司奖”，所管理的基金荣获 5 个单项奖。2012 年 4 月，在《上海证券报》主办的第九届中国“金基金”评选中，华夏基金第七次荣获年度“金基金·TOP 公司奖”，所管理的基金荣获 4 个单项奖。在上述评奖中，华夏基金均为获奖最多的基金公司。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨昌桁	本基金的基金经理	2007-10-09	-	22 年	中国台湾籍，美国田纳西州立大学财务金融专业硕士。自 1990 年开始从事台湾证券市场的投资管理工作，曾在国票投信投资本部、荷银投信、怡富证券投研部、京华证券研究部、元富证券等任职，具有 10 年以上的台湾证券市场投资管理经验。2005 年 1 月加入华夏基金管理有限公司，曾任公司研究主管等。
周全	本基金的基金经理、国际投资部总监	2007-10-09	-	12 年	中国人民银行研究生部金融专业硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任交易主管、行业研究员等。
崔强	本基金的基金经理、国际投资部副总监	2012-02-29	-	11 年	美国达特茅斯学院 MBA。曾任瑞士信贷第一波士顿投资银行经理，美国伊顿范思资产管理有限公司证券投资研究副总裁等。2008 年 2 月加入华夏基金管理有限公司，曾任宏观策略分析师、投资经理、国际投资部总经理助理、国际投资部副总经理等。



注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②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。

③根据本基金管理人于 2012 年 3 月 2 日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘华夏全球精选股票型证券投资基金基金经理的公告》，增聘崔强先生为本基金基金经理。

#### 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律、法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

#### 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

2012 年上半年，全球经济增长持续放缓，股票市场先扬后抑。

从宏观数据看，1 季度，美国经济数据良好：失业率明显下降，居民消费小幅增长，企业盈利创新高，房地产市场企稳；欧洲经济则步入衰退：制造业、服务业景气度降低，失业率持续上升；新兴市场增速放缓：持续的宏观紧缩政策，压低了通胀，也抑制了过热的经济增长。2 季度，美国经济复苏放缓：就业率、信心指数、制造业数据增长乏力；欧洲经济衰退显现：希腊、西班牙、意大利等国家继续压缩财政开支，银行不良资产问题爆发，等待救助，失业率继续攀升；

新兴市场增长进一步回落：基建、房地产投资逐步放缓，企业产能过剩，外需不景气，叠加效应导致经济压力增大。

从股票市场看，由于 2011 年底欧洲央行的数量宽松政策缓解了流动性危机，投资者信心在 2012 年 1 季度回升，全球股市普遍上涨：新兴市场、周期性行业出现大幅反弹，科技股、银行类公司股票持续上涨。2 季度，希腊大选危机，西班牙政府债务、银行不良资产等问题持续困扰股票市场；新兴市场增长放慢，美国复苏迟缓，投资者进一步撤离风险资产，全球股市出现明显调整。

报告期内，本基金继续跟踪分析全球宏观数据、股票市场和主要行业的发展动态。1 季度初，由于认为估值水平已经反映了投资者对欧债问题的悲观预期，加之美国经济回升强劲，新兴经济体基本稳定，本基金增加了美国金融行业、新兴市场金融行业、中国互联网行业的投资；2 季度，由于观察到欧债问题可能恶化，本基金减持了部分能源原材料、金融行业股票，但减持力度不足，此外该季度配置的中国互联网、可选消费品、全球石油类公司表现欠佳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.733 元，本报告期份额净值增长率为 1.52%，同期业绩比较基准增长率以美元计为 4.21%（不包含人民币汇率变动等因素产生的效应）。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

通过政府、银行、个人的债务提升，可以激发广泛的投资、消费需求，但资产负债表的扩张有约束边界：一旦债权人不再信任债务人还款能力，削减其信贷，刺激出来的需求就会萎缩，就如 2008 年以后，欧美的个人、金融机构信贷扩张结束，被迫缩减负债，导致全球经济快速衰退，但好在政府及时扩大支出，缓和了经济下滑，推动了经济短期回升。目前，政府负债能力难以持续，部分欧洲政府偿债能力受到质疑，这将导致新一轮的需求减弱，但我们判断，现阶段的调整，不会带来全球性的经济衰退，因为主要经济体—美国、中国、日本、德国，以及其他新兴市场的政府、私营部门不存在大规模去杠杆压力。

展望下半年，我们认为，全球经济仍将行驶在缓慢增长的轨道上。全球化红利、科技红利、新兴市场红利未来一段时间还会持续。资源全球配置、互联网应用、通讯及 IT 技术带来的效率提升，将提高人们的实际收入，带动最终消费。

新兴市场国家仍会以增长为主要目标，庞大的内部需求会源源不断地释放。但欧美政府、银行、个人负债率已经较高，无法再回归到依赖负债快速增长的旧经济模式，未来相当长的一段时间，全球经济很大程度上将处于一种对负债增长周期的自我纠正状态。

基于上述判断，我们认为，下半年全球股市以震荡为主，主要原因在于：目前的估值水平已经在很大程度上反映了投资者对欧债危机、新兴市场成长性和美国经济复苏前景的悲观。全球通胀压力缓解，经济政策倾向于促进经济增长，大部分企业资产负债表良好，新兴市场的潜在需求仍然较大，科技创新仍在激发新的需求。但是欧洲债务解决还要拉锯很久，欧元可持续性问题愈发突出，美国财政赤字上限谈判艰难，中国制造业产能过剩，诸多因素还会困扰投资者。

从“自下而上”的角度看，很多行业、区域的股票已经处于明显低估的状态，比如新兴市场可选消费品、新兴市场互联网行业、石油等紧缺资源股票，都处于极具投资价值的区间。中长期看，在投资者信心恢复常态，经济前景稳定后，很多公司的股价有明显的上升空间。下半年，本基金计划提高股票仓位，重点投资一批低估的成长型股票，等待估值的修复及盈利的持续增长。通过深入研究成长型公司，把握低估值时的投资机会，仍是我们的主要策略。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，近三分之二的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、证券研究、合规、

会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### §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关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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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：华夏全球精选股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,135,403,850.53	1,679,175,511.71
结算备付金		-	-

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	11,535,779,983.82	12,064,492,468.52
其中：股票投资		10,681,732,931.08	10,144,988,293.78
基金投资		324,969,198.63	968,171,828.61
债券投资		529,077,854.11	951,332,346.13
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		597,354.67	119,270,926.71
应收利息	6.4.7.5	10,946,078.70	16,123,883.19
应收股利		70,022,980.92	1,993,923.43
应收申购款		1,279,536.92	1,230,752.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,754,029,785.56	13,882,287,465.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年6月30日</b>	<b>上年度末 2011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		56,039,636.25	4,669,464.68
应付赎回款		16,209,255.61	5,338,813.68
应付管理人报酬		20,316,518.85	22,163,040.03
应付托管费		3,843,665.73	4,193,007.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	385,351.22	213,900.30
负债合计		96,794,427.66	36,578,226.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	18,635,145,883.42	19,187,361,067.49
未分配利润	6.4.7.10	-4,977,910,525.52	-5,341,651,828.04

所有者权益合计		13,657,235,357.90	13,845,709,239.45
负债和所有者权益总计		13,754,029,785.56	13,882,287,465.71

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.733 元，基金份额总额 18,635,145,883.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏全球精选股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		431,590,567.05	507,434,441.96
1.利息收入		24,200,681.12	42,346,590.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	922,036.71	2,025,376.87
债券利息收入		23,278,644.41	36,382,056.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,939,157.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-258,335,137.66	1,290,023,460.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-111,596,528.08	1,120,692,656.63
基金投资收益	6.4.7.13	-241,265,941.02	-23,185,295.59
债券投资收益	6.4.7.14	-37,015,655.36	-8,433,639.16
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	68,462.68	23,612,547.09
股利收益	6.4.7.16	131,474,524.12	177,337,191.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	655,983,647.21	-791,657,207.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		9,049,194.87	-35,501,788.66
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	692,181.51	2,223,387.46
<b>减：二、费用</b>		191,730,547.56	228,737,271.75
1.管理人报酬		134,803,259.68	173,328,182.70
2.托管费		25,503,319.36	32,791,818.35
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	31,086,031.33	22,017,028.92
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6.其他费用	6.4.7.20	337,937.19	600,241.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		239,860,019.49	278,697,170.21
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		239,860,019.49	278,697,170.21

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏全球精选股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	19,187,361,067.49	-5,341,651,828.04	13,845,709,239.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	239,860,019.49	239,860,019.49
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）	-552,215,184.07	123,881,283.03	-428,333,901.04
其中：1.基金申购款	160,819,923.50	-35,463,042.18	125,356,881.32
2.基金赎回款	-713,035,107.57	159,344,325.21	-553,690,782.36
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）	18,635,145,883.42	-4,977,910,525.52	13,657,235,357.90
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	21,472,103,738.79	-2,203,752,555.81	19,268,351,182.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	278,697,170.21	278,697,170.21
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）	-1,653,504,338.14	127,996,069.66	-1,525,508,268.48
其中：1.基金申购款	275,899,565.93	-22,820,314.83	253,079,251.10

2.基金赎回款	-1,929,403,904.07	150,816,384.49	-1,778,587,519.58
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）	19,818,599,400.65	-1,797,059,315.94	18,021,540,084.71

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：

<u>王东明</u>	<u>崔雁巍</u>	<u>崔雁巍</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华夏全球精选股票型证券投资基金（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”）证监基金字[2007]258号《关于同意华夏全球精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》和《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。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 30,048,564,114.29 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2007）第 131 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 10 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 30,055,638,128.26 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行（JPMorgan Chase Bank, National Association）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括银行存款、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、资产支持证券等固定收益类证券，在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、房地产信托凭证等权益类证券，以及基



金、结构性投资产品、金融衍生产品和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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”)、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日发布的《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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[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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

2、基金买卖股票的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3、基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

#### 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 2012年6月30日
活期存款	2,135,403,850.53
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,135,403,850.53

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	11,912,013,900.64	10,681,732,931.08	-1,230,280,969.56	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	OTC 市场	513,036,657.23	529,077,854.11	16,041,196.88
	合计	513,036,657.23	529,077,854.11	16,041,196.88
资产支持证券	-	-	-	
基金	322,842,175.53	324,969,198.63	2,127,023.10	
其他	-	-	-	
合计	12,747,892,733.40	11,535,779,983.82	-1,212,112,749.58	

##### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	58,508.26
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	10,887,570.44
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	10,946,078.70

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用余额。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	61,088.00
预提费用	324,263.22
其他	-
合计	385,351.22

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,187,361,067.49	19,187,361,067.49
本期申购	160,819,923.50	160,819,923.50
本期赎回（以“-”号填列）	-713,035,107.57	-713,035,107.57
本期末	18,635,145,883.42	18,635,145,883.42

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,316,099,777.04	-2,025,552,051.00	-5,341,651,828.04
本期利润	-416,123,627.72	655,983,647.21	239,860,019.49
本期基金份额交易产生的变动数	106,145,606.46	17,735,676.57	123,881,283.03
其中：基金申购款	-30,230,207.80	-5,232,834.38	-35,463,042.18
基金赎回款	136,375,814.26	22,968,510.95	159,344,325.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,626,077,798.30	-1,351,832,727.22	-4,977,910,525.52

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	921,915.68
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	121.03
合计	922,036.71

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	6,023,472,272.87
减：卖出股票成本总额	6,135,068,800.95
买卖股票差价收入	-111,596,528.08

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	576,646,397.73
减：卖出/赎回基金成本总额	817,912,338.75
基金投资收益	-241,265,941.02

#### 6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	879,180,276.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	905,619,061.71
减：应收利息总额	10,576,870.14
债券投资收益	-37,015,655.36

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	68,462.68
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	68,462.68

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本报告期无其他衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	131,631,465.36
基金投资产生的股利收益	-156,941.24
合计	131,474,524.12

注：基金投资产生的股利收益为根据实际到账金额对除权日确认收益的调整。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	655,983,647.21
——股票投资	429,282,239.60
——债券投资	96,206,016.12

——资产支持证券投资	-
——基金投资	130,495,391.49
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	655,983,647.21

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	692,181.51
合计	692,181.51

注：本基金的赎回费率为赎回金额的 0.5%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	31,086,031.33
银行间市场交易费用	-
合计	31,086,031.33

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	94,481.66
信息披露费	39,781.56
银行费用	16,157.64
税务顾问费	9,618.00
其他	177,898.33
合计	337,937.19

注：“其他”主要包含支付给存托凭证托管机构的存托服务费用。

### 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

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	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(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中信证券	-	-	4,770,000,000.00	100.00%

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	134,803,259.68	173,328,182.70
其中：支付销售机构的客户维护费	19,589,665.16	25,181,041.73

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.85% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.85% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,503,319.36	32,791,818.35

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
----	--	---



期初持有的基金份额	-	2,354,528.21
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	-	2,354,528.21
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：本基金管理人于上年度可比期间经代销机构赎回本基金，适用费率为 0.5%。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	258,774,626.20	873,474.26	246,386,828.54	1,799,017.47
摩根大通银行	1,876,629,224.33	48,441.42	1,334,855,684.62	17,840.94

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人摩根大通银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2012 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 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需披露的暂时停牌股票。

##### 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

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止, 本基金没有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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止, 本基金没有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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律监察部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后, 通过正式报告的方式, 将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会, 协助制定风险控制决策, 实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法, 估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重性; 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的金融工具特征, 通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告, 确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时对各种风险进行监督、检查和评估, 并制定相应决策, 将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 债券发行人信用评级降低导致债券价格下降, 或基金在交易过程中发生交收违约, 而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库, 对发行人及债券投资进行内部评级, 对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度, 以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下, 基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合, 从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基

金所投资的证券在境外证券交易所上市，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合 Beta 值等指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	2,135,403,850.53	-	-	2,135,403,850.53
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
债券投资	47,138,000.00	360,981,770.78	120,958,083.33	529,077,854.11
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	73,414.29	-	-	73,414.29
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,679,175,511.71	-	-	1,679,175,511.71
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
债券投资	-	831,746,052.79	119,586,293.34	951,332,346.13
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	59,342.03	-	-	59,342.03
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
----	---

	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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：人民币元）	
		本期末 （2012 年 6 月 30 日）	上年度末 （2011 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	5,423,527.48	8,110,792.02
	利率上升 25 个基点	-5,422,568.53	-8,109,424.48

#### 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。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控，并通过外汇远期投资交易对上述外汇风险进行管理。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	645,980,015.85	1,122,894,113.12	107,755,095.36	1,876,629,224.33
交易性金融资产	4,671,341,265.61	4,671,386,933.74	2,145,913,784.47	11,488,641,983.82
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	597,354.67	-	-	597,354.67
应收利息	10,529,412.82	10,793.60	-	10,540,206.42
应收股利	7,949,438.29	26,015,686.04	4,901,965.49	38,867,089.82
其他资产	-	-	-	-
资产合计	5,336,397,487.24	5,820,307,526.50	2,258,570,845.32	13,415,275,859.06
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	9,807,956.08	34,915,594.63	11,316,085.54	56,039,636.25
应付换汇款	-	-	-	-
负债合计	9,807,956.08	34,915,594.63	11,316,085.54	56,039,636.25
项目	上年度末 2011 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

银行存款	710,600,011.63	592,013,434.56	125,368,277.96	1,427,981,724.15
交易性金融资产	4,481,533,111.94	5,248,397,560.91	2,291,832,595.67	12,021,763,268.52
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	6,558,029.59	112,712,897.12	-	119,270,926.71
应收利息	15,699,282.88	4,327.55	-	15,703,610.43
应收股利	328,206.51	349,840.73	1,315,876.19	1,993,923.43
其他资产	-	-	-	-
资产合计	5,214,718,642.55	5,953,478,060.87	2,418,516,749.82	13,586,713,453.24
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	4,669,464.68	4,669,464.68
应付换汇款	-	-	-	-
负债合计	-	-	4,669,464.68	4,669,464.68

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除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：人民币元）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
分析	所有外币相对人民币升值 5%	667,961,811.14	679,102,199.43
分析	所有外币相对人民币贬值 5%	-667,961,811.14	-679,102,199.43

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	10,681,732,931.08	78.21	10,144,988,293.78	73.27
交易性金融资产-基金投资	324,969,198.63	2.38	968,171,828.61	6.99
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	11,006,702,129.71	80.59	11,113,160,122.39	80.26

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为摩根士丹利资本国际全球指数(MSCI All Country World Index)变动时,股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定摩根士丹利资本国际全球指数(MSCI All Country World Index)变化5%,其他市场变量均不发生变化。		
	3、Beta系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去100个交易日与其对应的指数数据回归加权得出,对于交易少于100个交易日的资产,默认其波动与市场同步。		
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:人民币元)	
		本期末 (2012年6月30日)	上年度末 (2011年12月31日)
	+5%	582,154,444.74	542,756,873.72
	-5%	-582,154,444.74	-542,756,873.72

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定,以公允价值计量的金融工具,其公允价值的计量可分为三个层级:

第一层级:对存在活跃市场报价的金融工具,可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级:对估值日活跃市场无报价的金融工具,可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值;对估值日不存在活跃市场的金融工具,可以或相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层级:对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具,可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

##### 6.4.14.2 各层级金融工具公允价值

截至2012年6月30日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为11,535,779,983.82元,第二层级的余额为0元,第三层级的余额为0元。(截至2011年12月31日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为12,064,492,468.52元,第二层级的余额为0元,第三层级的余额

为 0 元。)

#### 6.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

#### 6.4.14.4 第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

## §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	10,681,732,931.08	77.66
	其中：普通股	9,367,222,648.00	68.11
	存托凭证	1,313,731,215.85	9.55
2	基金投资	324,969,198.63	2.36
3	固定收益投资	529,077,854.11	3.85
	其中：债券	529,077,854.11	3.85
	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	2,135,403,850.53	15.53
8	其他各项资产	82,845,951.21	0.60
9	合计	13,754,029,785.56	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

中国香港	4,671,386,933.74	34.20
美国	3,136,862,415.45	22.97
英国	931,844,728.49	6.82
中国台湾	489,636,938.56	3.59
韩国	393,440,306.92	2.88
新加坡	293,892,104.13	2.15
印度尼西亚	219,825,067.96	1.61
印度	153,396,106.06	1.12
日本	96,351,937.17	0.71
泰国	90,494,223.59	0.66
马来西亚	85,400,430.26	0.63
加拿大	82,718,341.48	0.61
法国	23,537,292.30	0.17
澳大利亚	12,847,879.42	0.09
菲律宾	98,225.55	0.00
合计	10,681,732,931.08	78.21

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
金融	2,481,918,869.60	18.17
能源	2,023,781,372.38	14.82
非必需消费品	1,981,633,972.73	14.51
信息技术	1,928,751,790.77	14.12
材料	869,677,125.43	6.37
必需消费品	656,451,361.32	4.81
工业	513,565,143.47	3.76
保健	95,213,369.46	0.70
电信服务	74,884,607.52	0.55
公用事业	55,855,318.40	0.41
合计	10,681,732,931.08	78.21

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价值	占基金 资产净 值比例
----	--------------	--------------	------	------------	------------------	-----------	------	-------------------



								(%)
1	IMAX CORP	-	IMAX	纽约	美国	3,178,800	483,137,378.60	3.54
2	CHINA LIFE INSURANCE CO	中国人寿保险股份有限公司	02628	香港	中国香港	26,080,000	424,465,194.24	3.11
3	INTIME DEPARTMENT STORE	银泰百货(集团)有限公司	01833	香港	中国香港	54,591,000	338,305,144.77	2.48
4	SINA CORP	-	SINA	纳斯达克	美国	1,019,154	333,969,702.01	2.45
5	CNOOC LTD	中国海洋石油有限公司	00883	香港	中国香港	24,690,000	310,038,602.79	2.27
6	IND & COMM BK OF CHINA	中国工商银行股份有限公司	01398	香港	中国香港	82,663,000	289,162,795.78	2.12
7	SOHU.COM INC	-	SOHU	纳斯达克	美国	976,000	275,567,291.11	2.02
8	BANK OF AMERICA CORP	-	BAC	纽约	美国	5,000,000	258,688,409.98	1.89
9	CHINA FOODS LTD	中国食品有限公司	00506	香港	中国香港	40,856,000	253,521,305.11	1.86
10	GAZPROM OAO	-	OGZD	伦敦国际金融期货期权	英国	3,600,000	214,717,705.18	1.57
11	ROSNEFT OJSC	-	ROSN	伦敦国际金融期货期权	英国	4,621,300	182,975,169.90	1.34
12	PING AN INSURANCE GROUP CO	中国平安保险(集团)股份有限公司	02318	香港	中国香港	3,373,000	169,697,508.29	1.24
13	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY	中联重科股份有限公司	01157	香港	中国香港	20,469,800	163,406,847.49	1.20
14	LUKOIL OAO	-	LKOD	伦敦国际金融期货	英国	436,000	153,739,344.29	1.13

				期权				
15	CHINA SHENHUA ENERGY CO	中国神华能源股份有限公司	01088	香港	中国香港	6,842,000	150,912,182.37	1.10
16	BANK OF CHINA LTD	中国银行股份有限公司	03988	香港	中国香港	62,402,000	149,595,937.52	1.10
17	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	恒大地产集团有限公司	03333	香港	中国香港	45,496,000	145,794,025.01	1.07
18	CHINA COAL ENERGY CO	中国中煤能源股份有限公司	01898	香港	中国香港	27,244,000	140,842,618.19	1.03
19	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	02601	香港	中国香港	6,863,200	139,347,750.48	1.02
20	CHINA MERCHANTS BANK	招商银行股份有限公司	03968	香港	中国香港	10,036,500	118,338,086.40	0.87
21	FOCUS MEDIA HOLDING	-	FMCN	纳斯达克	美国	796,100	118,227,737.85	0.87
22	WHITBREAD PLC	-	WTB	伦敦	英国	580,275	116,752,902.23	0.85
23	NHN CORP	-	035420	韩国	韩国	82,900	114,449,049.68	0.84
24	CTRIPO M INTERNATIONAL	-	CTRP	纳斯达克	美国	1,074,900	113,945,122.76	0.83
25	SEMBCORP MARINE LTD	-	SMM	新加坡	新加坡	4,518,000	107,840,010.38	0.79
26	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	百丽国际控股有限公司	01880	香港	中国香港	9,945,000	106,392,884.31	0.78

27	BANK OF COMMUNICATIONS CO	交通银行股份有限公司	03328	香港	中国香港	24,860,000	105,206,468.43	0.77
28	LOCK&LO CK CO LTD	-	115390	韩国	韩国	552,292	102,629,325.04	0.75
29	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	中国雨润食品集团有限公司	01068	香港	中国香港	17,700,000	97,420,644.74	0.71
30	CORNING INC	-	GLW	纽约	美国	1,190,500	97,360,229.30	0.71
31	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	安徽海螺水泥股份有限公司	00914	香港	中国香港	5,665,000	96,773,823.85	0.71
32	NETEASE.COM INC	-	NTES	纳斯达克	美国	252,000	93,799,531.97	0.69
33	MAIL.RU GROUP	-	MAIL	伦敦国际金融期货期权	英国	433,677	92,959,038.34	0.68
34	YANDEX NV-A	-	YNDX	纳斯达克	美国	756,200	91,114,042.68	0.67
35	PIGEON CORP	-	7956	东京	日本	328,400	90,852,582.88	0.67
36	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURER	台湾积体电路制造股份有限公司	2330	台湾	中国台湾	5,255,000	90,458,730.51	0.66
37	BANYAN TREE HOLDINGS LTD	-	BTH	新加坡	新加坡	32,800,000	90,082,894.23	0.66
38	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易及结算所有限公司	00388	香港	中国香港	1,000,000	89,694,671.87	0.66
39	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	-	POT	纽约	美国	319,280	88,228,200.80	0.65

	HEWAN							
40	SHIMAO PROPERTY HOLDING S LTD	世茂房地 产控股有 限公司	00813	香港	中国 香港	8,369,000	80,797,743.21	0.59
41	CHINA MERCHANTS CHINA DIRECT	招商局中 国基金有 限公司	00133	香港	中国 香港	9,682,000	78,631,828.89	0.58
42	TENCENT HOLDING S LTD	腾讯控股 有限公司	00700	香港	中国 香港	403,600	74,376,126.57	0.54
43	HOLLYSY S AUTOMA TION TECHNOL OGY	-	HOLI	纳斯达克	美国	1,292,042	69,625,750.51	0.51
44	CHINA PETROLE UM & CHEMICA L	中国石油 化工股份 有限公司	00386	香港	中国 香港	12,170,000	68,273,627.25	0.50
45	ICICI BANK LTD	-	IBN	纽约	美国	323,400	66,293,768.90	0.49
46	TRAVELS KY TECHNOL OGY LTD	中国民航 信息网络 股份有限 公司	00696	香港	中国 香港	19,792,000	64,554,070.75	0.47
47	FREPOR T-MCMOR AN COPPER & GOLD INC	-	FCX	纽约	美国	297,369	64,079,850.43	0.47
48	BANK OF AYUDHY A PCL	-	BAY	泰国	泰国	10,826,400	63,986,754.48	0.47
49	GEELY AUTOMO BILE HOLDING	吉利汽车 控股有限 公司	00175	香港	中国 香港	28,200,000	62,085,021.06	0.45

	S LT							
50	NC SOFT CORPORATION	-	036570	韩国	韩国	41,085	61,938,914.51	0.45
51	EXXON MOBIL CORP	-	XOM	纽约	美国	110,879	60,010,120.09	0.44
52	CHINA TELECOM CORP LTD	中国电信 股份有限公司	00728	香港	中国 香港	21,660,000	59,519,916.52	0.44
53	INDOCEM ENT TUNGGAL PRAKARS A	-	INTP	印度尼西亚	印度尼 西亚	5,028,000	58,492,386.74	0.43
54	URALKAL I	-	URKA	伦敦国际 金融期货 期权	英国	236,000	57,139,652.59	0.42
55	TRANSOC EAN LTD	-	RIG	纽约	美国	200,000	56,582,555.40	0.41
56	CHINA NATIONA L MATERIA LS	中国中材 股份有限公司	01893	香港	中国 香港	29,119,000	56,510,268.89	0.41
57	ZHONGSH ENG GROUP HOLDING S	中升集团 控股有限 公司	00881	香港	中国 香港	7,245,500	55,240,033.33	0.40
58	HON HAI PRECISIO N INDUSTR Y	鸿海精密 工业股份 有限公司	2317	台湾	中国 台湾	2,900,000	54,893,729.68	0.40
59	MAOYE INTERNA TIONAL HLDGS	茂业国际 控股有限 公司	00848	香港	中国 香港	47,689,000	54,829,121.65	0.40
60	NOBLE CORP	-	NE	纽约	美国	265,000	54,523,484.20	0.40
61	CHEVRON CORP	-	CVX	纽约	美国	79,124	52,797,621.39	0.39

62	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	-	OXY	纽约	美国	88,958	48,258,529.45	0.35
63	AIRASIA BHD	-	AIRA	马来西亚	马来西亚	6,788,900	48,241,192.42	0.35
64	SYNUTRA INTERNATIONAL INC	-	SYUT	纳斯达克	美国	1,389,860	47,469,917.77	0.35
65	WILMAR INTERNATIONAL LTD	-	WIL	新加坡	新加坡	2,592,000	46,724,858.72	0.34
66	CHANGYOU.COM LTD	-	CYOU	纳斯达克	美国	349,000	46,598,005.01	0.34
67	HOLCIM INDONESIA TBK PT	-	SMCB	印度尼西亚	印度尼西亚	28,652,500	46,588,514.05	0.34
68	MONSANTO CO	-	MON	纽约	美国	83,340	43,634,759.00	0.32
69	ANADARKO PETROLEUM CORP	-	APC	纽约	美国	103,384	43,287,747.15	0.32
70	SOTHEBY'S	-	BID	纽约	美国	204,000	43,043,727.45	0.32
71	APACHE CORP	-	APA	纽约	美国	73,892	41,076,227.40	0.30
72	BEIJING CAPITAL LAND LTD	首创置业股份有限公司	02868	香港	中国香港	21,162,000	39,515,379.09	0.29
73	CHEIL WORLDWIDE INC	-	030000	韩国	韩国	390,340	39,231,245.61	0.29
74	ADARO ENERGY TBK PT	-	ADRO	印度尼西亚	印度尼西亚	40,193,000	39,077,162.42	0.29
75	COMBA TELECOM SYSTEMS HOLDIN	京信通信系统控股有限公司	02342	香港	中国香港	14,862,000	39,021,781.15	0.29

76	BG GROUP PLC	-	BG/	伦敦	英国	300,000	38,692,828.74	0.28
77	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	-	MSIL	印度	印度	287,598	38,236,722.22	0.28
78	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	紫金矿业集团股份有限公司	02899	香港	中国香港	17,726,000	37,580,110.54	0.28
79	NATIONAL OILWELL VARCO INC	-	NOV	纽约	美国	90,000	36,681,890.04	0.27
80	EXIDE INDUSTRIES LTD	-	EXID	印度	印度	2,350,502	36,506,651.64	0.27
81	HDFC BANK LTD	-	HDFCB	印度	印度	557,475	35,707,512.00	0.26
82	PETROLEO BRASILEIRO	-	PBR/A	纽约	美国	304,900	34,982,300.86	0.26
83	YANZHOU COAL MINING CO	兖州煤业股份有限公司	01171	香港	中国香港	3,548,000	34,658,869.23	0.25
84	TECK RESOURCES LTD	-	TCK	纽约	美国	94,000	18,395,086.16	0.13
			TCK/B	多伦多	加拿大	78,800	15,416,041.08	0.11
85	SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DEVELOPMENT GROUP LTD	上海实业城市开发集团有限公司	00563	香港	中国香港	26,970,000	32,987,254.10	0.24
86	CLP HOLDING	中电控股有限公司	00002	香港	中国香港	600,000	32,167,770.96	0.24

	S LTD							
87	KANGWON LAND INC	-	035250	韩国	韩国	237,880	31,987,076.36	0.23
88	POLYHONG KONG INVESTMENTS	保利(香港)投资有限公司	00119	香港	中国香港	9,000,000	30,455,418.13	0.22
89	TOP GLOVE CORP BHD	-	TOPG	马来西亚	马来西亚	2,841,800	29,413,537.54	0.22
90	TAOMEE HOLDINGS LTD	-	TAOM	纽约	美国	1,068,495	29,262,677.03	0.21
91	CHINA LILANG LTD	中国利郎有限公司	01234	香港	中国香港	6,695,000	28,878,871.19	0.21
92	KINGSOFT CORP LTD	金山软件有限公司	03888	香港	中国香港	9,915,000	27,811,545.37	0.20
93	JASAMARGA (PERSERO) TBK PT	-	JSMR	印度尼西亚	印度尼西亚	7,556,000	27,358,375.35	0.20
94	HALLIBURTON CO	-	HAL	纽约	美国	150,000	26,934,586.65	0.20
95	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO	-	QIHU	纽约	美国	244,215	26,706,746.99	0.20
96	BIOSENSORS INTERNATIONAL GROUP LTD	-	BIG	新加坡	新加坡	4,605,000	26,099,446.30	0.19
97	JIANGXI COPPER CO LTD	江西铜业股份有限公司	00358	香港	中国香港	1,846,000	25,498,760.10	0.19
98	MAGIC HOLDINGS	美即控股国际有限公司	01633	香港	中国香港	11,529,600	25,383,526.91	0.19



	INTERNATIONAL							
99	AUTONAVI HOLDINGS LTD	-	AMAP	纳斯达克	美国	298,900	25,351,774.10	0.19
100	SUNCOR ENERGY INC	-	SU	纽约	美国	76,097	13,933,806.25	0.10
			SU	多伦多	加拿大	60,000	10,960,029.60	0.08
101	CHINDEX INTERNATIONAL INC	-	CHDX	纳斯达克	美国	400,000	24,793,608.00	0.18
102	GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	广州富力地产股份有限公司	02777	香港	中国香港	2,959,600	24,567,148.84	0.18
103	EOG RESOURCES INC	-	EOG	纽约	美国	43,000	24,507,279.77	0.18
104	NOBLE ENERGY INC	-	NBL	纽约	美国	45,000	24,141,510.81	0.18
105	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向(集团)有限公司	03818	香港	中国香港	41,877,000	23,902,733.11	0.18
106	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	-	FM	多伦多	加拿大	213,000	23,788,922.93	0.17
107	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	电能实业有限公司	00006	香港	中国香港	500,000	23,687,547.44	0.17
108	AREVA SA	-	AREVA	法国	法国	286,659	23,537,292.30	0.17
109	HESS CORP	-	HES	纽约	美国	84,294	23,165,416.19	0.17
110	ACE HARDWARE	-	ACES	印度尼西亚	印度尼西亚	6,836,500	23,148,869.73	0.17

	RE INDONESI A							
111	X5 RETAIL GROUP NV	-	FIVE	伦敦国际 金融期货 期权	英国	160,350	23,072,998.01	0.17
112	BHP BILLITON PLC	-	BLT	伦敦	英国	128,577	23,038,113.23	0.17
113	FMC TECHNOL OGIES INC	-	FTI	纽约	美国	92,836	23,035,009.27	0.17
114	MEDIATE K INC	联发科技 股份有限 公司	2454	台湾	中国 台湾	376,000	21,733,902.51	0.16
115	HTC CORP	宏达国际 电子股份 有限公司	2498	台湾	中国 台湾	260,000	21,442,135.33	0.16
116	UNITED MICROEL ECTRONI CS CORP	联华电子 股份有限 公司	2303	台湾	中国台 湾	7,700,000	21,031,374.56	0.15
117	BAYTEX ENERGY CORP	-	BTE	多伦多	加拿大	79,000	21,023,538.20	0.15
118	QUIMICA Y MINERA CHIL	-	SQM	纽约	美国	56,000	19,718,002.25	0.14
119	LONGFOR PROPERTI ES	龙湖地产 有限公司	00960	香港	中国 香港	2,000,000	19,667,595.32	0.14
120	SINOTRU K HONG KONG LTD	中国重汽 (香港)有 限公司	03808	香港	中国 香港	5,000,000	18,835,881.09	0.14
121	BBMG CORPORA TION	北京金隅 股份有限 公司	02009	香港	中国 香港	4,000,000	17,514,923.20	0.13
122	SCHLUMB ERGER LTD	-	SLB	纽约	美国	42,000	17,243,068.88	0.13
123	CANADIA N	-	CNQ	纽约	美国	101,038	17,158,633.36	0.13

	NATURAL RESOURCES							
124	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	统一企业股份有限公司	1216	台湾	中国台湾	1,470,000	14,815,336.16	0.11
125	RIO TINTO PLC	-	RIO	伦敦	英国	49,406	14,798,192.80	0.11
126	STANDARD FOODS CORP	佳格食品股份有限公司	1227	台湾	中国台湾	800,000	14,482,492.90	0.11
127	ANGLO AMERICAN PLC	-	AAL	伦敦	英国	67,367	13,958,783.18	0.10
128	CHONGQING IRON & STEEL CO	重庆钢铁股份有限公司	01053	香港	中国香港	16,288,000	13,812,588.07	0.10
129	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地有限公司	01109	香港	中国香港	1,054,000	13,579,121.00	0.10
130	AIRMEDIA GROUP INC	-	AMCN	纳斯达克	美国	878,827	13,229,213.08	0.10
131	MAKEMY TRIP LTD	-	MMYT	纳斯达克	美国	126,500	13,145,640.53	0.10
132	ILUKA RESOURCES LTD	-	ILU	澳大利亚	澳大利亚	175,000	12,847,879.42	0.09
133	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	台塑石化股份有限公司	6505	台湾	中国台湾	740,000	12,675,569.01	0.09
134	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国控股有限公司	03900	香港	中国香港	1,895,500	12,457,554.36	0.09
135	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	-	010140	韩国	韩国	60,000	12,358,840.68	0.09

	ES							
136	CHINA TAIPING INSURAN CE HOLD	中国太平 保险控股 有限公司	00966	香港	中国 香港	1,189,000	12,157,753.99	0.09
137	WALTER ENERGY INC	-	WLT	纽约	美国	43,000	12,010,226.11	0.09
138	DELTA ELECTRO NICS INC	台达电子 工业股份 有限公司	2308	台湾	中国 台湾	620,000	11,932,811.92	0.09
139	MEGA FINANCIA L HOLDING CO LTD	兆丰金融 控股股份 有限公司	2886	台湾	中国台 湾	2,570,000	11,889,724.38	0.09
140	FORMOSA PLASTICS CORP	台湾塑料 工业股份 有限公司	1301	台湾	中国 台湾	700,000	11,827,369.20	0.09
141	SIMPLO TECHNOL OGY CO LTD	新普科技 股份有限 公司	6121	台湾	中国 台湾	270,000	11,633,634.10	0.09
142	JARDINE CYCLE & CARRIAG E LTD	-	JCNC	新加坡	新加坡	50,000	11,562,469.05	0.08
143	FOXCONN TECHNOL OGY CO LTD	鸿准精密 工业股份 有限公司	2354	台湾	中国 台湾	502,500	11,437,517.01	0.08
144	HISENSE KELON ELEC HLD	海信科龙 电器股份 有限公司	00921	香港	中国 香港	10,000,000	11,415,685.51	0.08
145	PETROCHI NA CO LTD	中国石油 天然气股 份有限公 司	00857	香港	中国 香港	1,400,000	11,358,607.08	0.08
146	BAKER HUGHES INC	-	BHI	纽约	美国	43,000	11,177,995.77	0.08
147	AIR CHINA LTD	中国国际 航空股份 有限公司	00753	香港	中国 香港	3,000,000	11,105,831.19	0.08

148	FORMOSA INTERNA TIONAL HOTELS	晶华国际 酒店股份 有限公司	2707	台湾	中国 台湾	165,000	11,074,660.69	0.08
149	CHINATR UST FINANCIA L HOLDING	中国信托 金融控股 股份有限 公司	2891	台湾	中国 台湾	2,938,271	10,576,159.52	0.08
150	SKYWOR TH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码 控股有限 公司	00751	香港	中国 香港	3,772,000	10,518,934.49	0.08
151	SAMSUNG ELECTRO NICS CO LTD	-	005930	韩国	韩国	1,550	10,279,982.07	0.08
152	PTT EXPLOR & PROD PUBLIC CO	-	PTTEP	泰国	泰国	300,000	10,097,515.63	0.07
153	CHINA MINSHEN G BANKING	中国民生 银行股份 有限公司	01988	香港	中国 香港	1,800,000	10,083,311.93	0.07
154	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	正新橡胶 工业股份 有限公司	2105	台湾	中国 台湾	620,000	9,845,554.39	0.07
155	ANGANG STEEL CO LTD	鞍钢股份 有限公司	00347	香港	中国 香港	2,800,000	9,634,838.57	0.07
156	CHINA MENGNIU DAIRY CO	中国蒙牛 乳业有限 公司	02319	香港	中国 香港	580,000	9,624,238.29	0.07
157	ADVANCE D SEMICON DUCTOR ENGR	日月光半 导体制造 股份有限 公司	2311	台湾	中国 台湾	1,850,028	9,577,328.58	0.07
158	ASTRA	-	ASII	印度尼西	印度尼	2,000,000	9,185,972.94	0.07

	INTERNATIONAL TBK PT			亚	西亚			
159	CHIMEI INNOLUX CORP	奇美电子 股份有限 公司	3481	台湾	中国 台湾	3,500,000	9,115,077.77	0.07
160	TATA MOTORS LTD	-	TTMT	印度	印度	330,000	9,093,642.34	0.07
161	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	-	DD	纽约	美国	28,000	8,955,805.40	0.07
162	AU OPTRONICS CORP	友达光电 股份有限 公司	2409	台湾	中国 台湾	3,500,000	8,929,811.96	0.07
163	TIANJIN ZHONG XIN PHARM CO	-	TIAN	新加坡	新加坡	2,000,000	8,918,109.00	0.07
164	IMPERIAL OIL LTD	-	IMO	多伦多	加拿大	33,000	8,720,557.52	0.06
165	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	国泰金融 控股股份 有限公司	2882	台湾	中国 台湾	1,400,000	8,670,439.83	0.06
166	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	-	BBRI	印度尼西亚	印度尼西亚	2,000,000	8,515,463.97	0.06
167	BRILLIANT CHINA AUTOMOTIVE	华晨中国 汽车控股 有限公司	01114	香港	中国 香港	1,530,000	8,408,630.87	0.06
168	TIANNEN G POWER INTL LTD	天能动力 国际有限 公司	00819	香港	中国 香港	2,500,000	8,317,142.30	0.06
169	AJISEN CHINA HOLDING S LTD	味千(中国) 控股有限 公司	00538	香港	中国 香港	1,894,000	8,231,540.97	0.06
170	CAREER TECHNOL	嘉联益科 科技股份有	6153	台湾	中国 台湾	800,000	8,189,807.39	0.06

	OGY CO LTD	限公司						
171	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	统一超商股份有限公司	2912	台湾	中国台湾	235,000	7,886,500.80	0.06
172	POU SHENG INTL HOLDING S LTD	宝胜国际(控股)有限公司	03813	香港	中国香港	15,172,000	7,793,945.13	0.06
173	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L	上海电气集团股份有限公司	02727	香港	中国香港	3,000,000	7,656,663.35	0.06
174	ORIENTAL UNION CHEMICAL	东联化学股份有限公司	1710	台湾	中国台湾	1,000,000	7,601,191.45	0.06
175	MSTAR SEMICONDUCTOR INC	开曼晨星半导体公司	3697	台湾	中国台湾	180,000	7,584,252.86	0.06
176	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	-	ICBP	印度尼西亚	印度尼西亚	1,934,500	7,458,322.76	0.05
177	E INK HOLDING S INC	元太科技工业股份有限公司	8069	台湾	中国台湾	1,010,000	7,003,576.89	0.05
178	CHINA ZHENGTONG AUTO SERVICE	中国正通汽车服务控股有限公司	01728	香港	中国香港	2,077,500	6,911,545.25	0.05
179	WT MICROELECTRONICS CO LTD	文晔科技股份有限公司	3036	台湾	中国台湾	800,000	6,817,781.75	0.05
180	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	-	KMB	印度	印度	100,000	6,731,990.17	0.05

181	ITC LTD	-	ITC	印度	印度	228,000	6,709,167.55	0.05
182	ADVANCE D INFO SERVICE PCL	-	ADVAN C	泰国	泰国	180,000	6,653,541.55	0.05
183	KOREA KUMHO PETROCH EMICAL CO	-	011780	韩国	韩国	10,000	6,626,724.23	0.05
184	DONGFAN G ELECTRIC CORP LTD	东方电气 股份有限 公司	01072	香港	中国 香港	500,000	6,392,783.89	0.05
185	DLF LTD	-	DLFU	印度	印度	280,000	6,318,728.04	0.05
186	SANDS CHINA LTD	金沙中国 有限公司	01928	香港	中国 香港	300,000	5,993,234.89	0.04
187	SHANDON G WEIGAO GP MEDICAL	山东威高 集团医用 高分子制 品股份有 限公司	01066	香港	中国 香港	860,000	5,988,668.62	0.04
188	WEICHAI POWER CO LTD	潍柴动力 股份有限 公司	02338	香港	中国香 港	236,000	5,878,914.96	0.04
189	CHINA SHIPPING DEVELOP MENT	中海发展 股份有限 公司	01138	香港	中国香 港	2,000,000	5,870,923.98	0.04
190	WEI CHUAN FOODS	味全食品 工业股份 有限公司	1201	台湾	中国 台湾	920,000	5,863,292.30	0.04
191	APOLLO TYRES LTD	-	APTY	印度	印度	651,900	5,853,421.69	0.04
192	GOODBA BY INTERNA TIONAL HOLDI	好孩子国 际控股有 限公司	01086	香港	中国 香港	3,175,000	5,825,057.38	0.04
193	TAIWAN SURFACE	台湾表面 黏着科技	6278	台湾	中国 台湾	450,000	5,726,301.47	0.04



	MOUNTING TECH	股份有限公司						
194	NINTENDO CO LTD	-	7974	大阪	日本	7,500	5,499,354.29	0.04
195	ACC LTD	-	ACC	印度	印度	38,000	5,476,734.85	0.04
196	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	-	MAJOR	泰国	泰国	1,557,100	5,428,123.88	0.04
197	WISTRON CORP	纬创资通股份有限公司	3231	台湾	中国台湾	700,000	5,409,761.60	0.04
198	HANGLUNG PROPERTIES LTD	恒隆地产有限公司	00101	香港	中国香港	250,000	5,340,910.01	0.04
199	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	-	086280	韩国	韩国	4,300	5,164,703.19	0.04
200	EVERGREEN MARINE	长荣海运股份有限公司	2603	台湾	中国台湾	1,500,000	5,113,336.31	0.04
201	GENTING BHD	-	GENT	马来西亚	马来西亚	272,000	5,105,414.45	0.04
202	VIVOTEK INC	晶睿通讯股份有限公司	3454	台湾	中国台湾	270,000	4,973,592.96	0.04
203	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一重装国际控股有限公司	00631	香港	中国香港	1,453,000	4,905,010.21	0.04
204	TONGHSING ELECTRONIC INDUST	同欣电子工业股份有限公司	6271	台湾	中国台湾	240,000	4,888,476.55	0.04
205	EPISTAR CORP	晶元光电股份有限公司	2448	台湾	中国台湾	350,000	4,853,964.18	0.04
206	CHINA MOBILE LTD	中国移动有限公司	00941	香港	中国香港	69,700	4,816,665.04	0.04
207	EVERLIGHT	亿光电子工业股份	2393	台湾	中国台湾	430,000	4,615,977.01	0.03

	ELECTRONICS CO LTD	有限公司						
208	BEC WORLD PUBLIC CO LTD	-	BEC	泰国	泰国	427,800	4,328,288.05	0.03
209	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	-	016360	韩国	韩国	16,000	4,325,042.01	0.03
210	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	中国铝业股份有限公司	02600	香港	中国香港	1,500,000	4,036,260.23	0.03
211	ACER INC	宏碁股份有限公司	2353	台湾	中国台湾	600,000	3,912,813.87	0.03
212	ACCTON TECHNOLOGY CORP	智邦科技股份有限公司	2345	台湾	中国台湾	1,060,000	3,792,973.36	0.03
213	HONAM PETROCHEMICAL CORP	-	011170	韩国	韩国	2,800	3,656,847.32	0.03
214	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	富邦金融控股股份有限公司	2881	台湾	中国台湾	500,828	3,160,036.42	0.02
215	KINSUS INTERCONNECT TECH	景硕科技股份有限公司	3189	台湾	中国台湾	180,000	3,102,302.43	0.02
216	CHINA UNICOM (HONG KONG) LIMITED	中国联合网络通信(香港)股份有限公司	00762	香港	中国香港	380,000	3,024,178.17	0.02
217	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	彰化商业银行股份有限公司	2801	台湾	中国台湾	900,000	2,991,778.14	0.02

218	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	-	PRE	多伦多	加拿大	21,000	2,809,252.15	0.02
219	CHINA NATIONAL BUILDING MA	中国建材股份有限公司	03323	香港	中国香港	414,000	2,798,522.69	0.02
220	TAIFLEX SCIENTIFIC CO LTD	台虹科技股份有限公司	8039	台湾	中国台湾	300,000	2,782,163.11	0.02
221	UNITED SPIRITS LTD	-	UNSP	印度	印度	35,400	2,761,535.56	0.02
222	CHINA OILFIELD SERVICES	中海油田服务股份有限公司	02883	香港	中国香港	300,000	2,710,409.90	0.02
223	LENOVO GROUP LTD	联想集团有限公司	00992	香港	中国香港	500,000	2,666,377.97	0.02
224	MASTERS KILL EDUCATION GROUP	-	MASEG	马来西亚	马来西亚	1,482,100	2,640,285.85	0.02
225	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	中国农业银行股份有限公司	01288	香港	中国香港	1,000,000	2,519,604.87	0.02
226	YULON MOTOR COMPANY	裕隆汽车制造股份有限公司	2201	台湾	中国台湾	200,000	2,218,955.05	0.02
227	TAISUN ENTERPRISE CO LTD	泰山企业股份有限公司	1218	台湾	中国台湾	520,500	1,658,610.68	0.01
228	XINJIANG TIANYE WATER SAVING	新疆天业节水灌溉股份有限公司	00840	香港	中国香港	2,172,000	1,469,981.52	0.01
229	TAIWAN FERTILIZ	台湾肥料股份有限公司	1722	台湾	中国台湾	100,000	1,446,131.97	0.01

	ER CO LTD	公司						
230	XINGDA INTL HOLDINGS	兴达国际控股有限公司	01899	香港	中国香港	697,000	1,432,211.90	0.01
231	SINGAPORE AIRLINES LTD	-	SIA	新加坡	新加坡	22,000	1,139,219.04	0.01
232	MOBILE TELESYSTEMS	-	MBT	纽约	美国	8,000	870,306.24	0.01
233	MEGASTUDY CO LTD	-	072870	韩国	韩国	1,840	792,556.22	0.01
234	HENGDELI HOLDINGS LTD	亨得利控股有限公司	03389	香港	中国香港	392,000	779,919.63	0.01
235	K-GREEN TRUST	-	KGT	新加坡	新加坡	156,800	779,067.23	0.01
236	BREADTALK GROUP LTD	-	BREAD	新加坡	新加坡	298,800	746,030.18	0.01
237	FIBRIACELULOSE SA	-	FBR	纽约	美国	3,000	142,120.50	0.00
238	HOLCIM PHILIPPINES INC	-	HLCM	菲律宾	菲律宾	55,000	98,225.55	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

## 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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CHINA LIFE INSURANCE CO	02628	387,311,044.24	2.80
2	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	322,342,032.40	2.33

3	HAITONG SECURITIES CO LTD	06837	313,918,453.37	2.27
4	SOHU.COM INC	SOHU	309,337,033.72	2.23
5	BANK OF AMERICA CORP	BAC	262,291,421.09	1.89
6	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO	02601	257,972,074.00	1.86
7	CHINA SHENHUA ENERGY CO	01088	254,017,719.50	1.83
8	SINA CORP	SINA	253,464,723.10	1.83
9	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	00914	203,127,070.90	1.47
10	CTRP.COM INTERNATIONAL	CTRP	167,876,536.03	1.21
11	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	03333	164,641,881.48	1.19
12	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	01068	161,673,624.06	1.17
13	CHINA NATIONAL BUILDING MA	03323	153,057,786.83	1.11
14	PING AN INSURANCE GROUP CO	02318	144,832,797.58	1.05
15	CHINA COAL ENERGY CO	01898	126,594,848.70	0.91
16	FOCUS MEDIA HOLDING	FMCN	114,954,851.04	0.83
17	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY	01157	101,015,398.12	0.73
18	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	01880	93,069,205.27	0.67
19	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	00388	89,149,143.90	0.64
20	NETEASE.COM INC	NTES	83,047,015.15	0.60

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	BANK OF CHINA LTD	03988	746,311,308.58	5.39
2	IND & COMM BK OF CHINA	01398	488,039,822.03	3.52

3	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	360,931,261.95	2.61
4	HAITONG SECURITIES CO LTD	06837	318,546,875.18	2.30
5	CHINA LIFE INSURANCE CO	02628	315,881,799.49	2.28
6	PETROLEO BRASILEIRO	PBR/A	296,089,554.12	2.14
7	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO	02601	221,447,971.34	1.60
8	CHINA MERCHANTS BANK	03968	180,045,804.01	1.30
9	CHINA NATIONAL BUILDING MA	03323	140,880,746.61	1.02
10	PETROCHINA CO LTD	00857	139,040,759.43	1.00
		PTR	815,199.90	0.01
11	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO	01336	134,576,229.58	0.97
12	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	01169	124,182,104.12	0.90
13	PING AN INSURANCE GROUP CO	02318	117,693,173.60	0.85
14	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	00914	88,495,443.90	0.64
15	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY	01157	87,095,174.06	0.63
16	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	01728	81,346,132.97	0.59
17	NOMURA HOLDINGS INC	8604	68,536,633.76	0.50
18	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	01880	65,633,543.95	0.47
19	CHINA SHENHUA ENERGY CO	01088	65,383,874.98	0.47
20	GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	02777	64,518,424.99	0.47

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	6,242,531,198.65
卖出收入（成交）总额	6,023,472,272.87

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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（%）
AA+至 AA-	63,457,020.07	0.46
A+至 A-	25,803,062.04	0.19
BBB+至 BBB-	270,421,984.97	1.98
BB+至 BB-	87,837,466.51	0.64
B+至 B-	81,558,320.52	0.60

注：上述债券投资组合主要适用标准普尔、穆迪等国际权威机构评级，采用发行主体评级的为远洋地产控股有限公司（联合资信主体评级 AA，公允价值为 44,497,885.21 元）。

### 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	USG82281AA73	SMFG PREFERRED 3 SUMIBK Var	37,949,400	47,433,714.04	0.35
2	XS0347451022	COUNTRY GARDEN COGARD	40,000,000	47,138,000.00	0.35
3	XS0526823041	SINO-OCEAN LAND SINOCE	44,274,300	44,497,885.21	0.33
4	XS0460546442	PETROLEOS DE VEN PDVSA	50,599,200	43,376,670.19	0.32
5	XS0191754729	GAZPROM	31,624,500	40,027,129.65	0.29

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。

### 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

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	MERRILL LYNCH INVESTMENT SOLUTIONS	股票型	开放式基金	York Capital Management	319,016,978.74	2.34
2	POLARIS TAIWAN TOP50 TRACKER	指数型	ETF 基金	Polaris Securities Investment Trust	5,952,219.89	0.04
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	597,354.67
3	应收股利	70,022,980.92
4	应收利息	10,946,078.70
5	应收申购款	1,279,536.92
6	其他应收款	-



7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	82,845,951.21

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	XS0347451022	COUNTRY GARDEN COGARD	47,138,000.00	0.35
2	XS0526823041	SINO-OCEAN LAND SINOCE	44,497,885.21	0.33

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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

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
1,242,963	14,992.52	120,527,283.34	0.65%	18,514,618,600.08	99.35%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	2,910,994.53	0.02%

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年10月9日）基金份额总额	30,055,638,128.26
本报告期期初基金份额总额	19,187,361,067.49
本报告期基金总申购份额	160,819,923.50
减：本报告期基金总赎回份额	713,035,107.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	18,635,145,883.42

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

本基金管理人于 2012 年 4 月 21 日发布公告，聘任林浩先生为华夏基金管理有限公司（以下简称“本公司”）副总经理；于 2012 年 5 月 7 日发布公告，王亚伟先生不再担任本公司副总经理。本基金管理人于 2012 年 5 月 11 日发布公告，经本公司股东会 2012 年第一次临时会议审议通过，选举组成本公司第四届董事会；经本公司第四届董事会 2012 年第一次临时会议审议通过，选举王东明先生为本公司董事长，范勇宏先生为本公司副董事长，同意滕天鸣先生任本公司总经理，范勇宏先生不再担任本公司总经理。根据中国证监会证监许可[2012]877 号批复，滕天鸣先生任华夏基金管理有限公司总经理已获得中国证监会核准。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

### 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	
MORGAN STANLEY	-	2,523,339,251.24	20.57%	2,629,983.41	13.01%	-
NOMURA	-	1,919,898,973.30	15.65%	3,330,122.83	16.48%	-
MERRILL LYNCH	-	1,639,912,738.53	13.37%	2,675,249.87	13.24%	-
CLSA	-	1,080,525,060.45	8.81%	1,850,603.32	9.16%	-
DEUTSCHE BANK	-	941,041,825.73	7.67%	970,842.65	4.80%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	801,120,687.13	6.53%	1,704,898.63	8.44%	-
CAPITAL SECURITIES CORP	-	539,981,000.92	4.40%	788,584.24	3.90%	-
SCOTIA CAPITAL	-	502,615,720.15	4.10%	724,531.43	3.59%	-
MASTERLINK	-	427,540,552.38	3.49%	356,499.48	1.76%	-
HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES	-	313,918,453.37	2.56%	3,139,184.53	15.53%	-
UBS SECURITIES	-	291,382,586.79	2.38%	365,058.14	1.81%	-
KGI	-	249,619,026.77	2.04%	306,697.98	1.52%	-
GOLDMAN SACHS	-	231,722,747.96	1.89%	347,584.12	1.72%	-
CREDIT SUISSE	-	224,624,143.22	1.83%	269,548.97	1.33%	-

CHINA INTERNATION AL CAPITAL CORPORATION	-	211,658,224.59	1.73%	264,572.81	1.31%	-
FUBON BANK	-	177,187,132.05	1.44%	213,457.78	1.06%	-
SAMSUNG SECURITIES	-	107,626,122.75	0.88%	161,438.91	0.80%	-
YUANTA SECURITIES (HONG KONG)	-	31,519,131.25	0.26%	37,823.14	0.19%	-
MACQUARIE SECURITIES	-	21,515,650.72	0.18%	32,273.44	0.16%	-
OKASAN	-	18,579,396.21	0.15%	27,869.09	0.14%	-
SINOPAC SECURITIES	-	10,121,391.59	0.08%	12,145.31	0.06%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

ii 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

iii 有良好的交易执行能力和交易执行系统。

iv 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

v 能够及时准确高效地提供结算等后台业务支持。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了中信证券、安信证券、中信建投证券、申银万国证券、

高华证券、国泰君安证券、广发证券、中金公司、中投证券、西南证券、中国银河证券、太平洋证券、国联证券、华鑫证券、方正证券、信达证券、渤海证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

⑤此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

### 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		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	占当期基金成交总额的比例
MORGAN STANLEY	130,847,215.23	10.42%	-	-	49,303,059.65	7.94%
NOMURA	128,306,164.09	10.22%	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	301,022,602.69	23.97%	-	-	171,136,477.76	27.56%
DEUTSCHE BANK	168,993,187.28	13.46%	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	335,478,319.86	54.03%
CAPITAL SECURITIES CORP	-	-	-	-	13,410,909.24	2.16%
SCOTIA CAPITAL	-	-	-	-	11,537,789.78	1.86%
MASTERLINK	-	-	-	-	32,710,266.03	5.27%
UBS SECURITIES	25,418,310.32	2.02%	-	-	-	-
KGI	-	-	-	-	5,968,175.50	0.96%
GOLDMAN SACHS	25,496,866.85	2.03%	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	29,265,458.50	2.33%	-	-	-	-
FUBON BANK	-	-	-	-	1,315,717.18	0.21%
BARCLAYS CAPITAL	40,388,464.57	3.22%	-	-	-	-
BNP PARIBAS	12,581,349.38	1.00%	-	-	-	-
CITIGROUP	193,674,554.17	15.42%	-	-	-	-

HSBC	46,790,714.04	3.73%	-	-	-	-
J.P.MORGAN	94,995,109.21	7.56%	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED BANK	39,040,422.82	3.11%	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE	12,613,993.77	1.00%	-	-	-	-
ING BANK	6,327,547.04	0.50%	-	-	-	-

## 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	关于在境外主要投资场所节假日暂停华夏全球精选股票型证券投资基金申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-01-06
2	关于在境外主要投资场所节假日暂停华夏全球精选股票型证券投资基金申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-02-10
3	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏全球精选股票型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-02
4	华夏基金管理有限公司关于调整基金对账单服务方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-10
5	关于在境外主要投资场所节假日暂停华夏全球精选股票型证券投资基金申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-30
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-31
7	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-04-21
8	关于在境外主要投资场所节假日暂停华夏全球精选股票型证券投资基金申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-04-27
9	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-05-07
10	华夏基金管理有限公司公告两则	中国证监会指定报刊及网站	2012-05-11
11	关于在境外主要投资场所节假日暂停华夏全球精选股票型证券投资基金申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-05-18
12	关于在境外主要投资场所节假日暂停华夏全球精选股票型证券投资基金申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-05-25

13	关于在境外主要投资场所节假日暂停华夏全球精选股票型证券投资基金申购、赎回、定期定额等业务的公告两则	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-21
14	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-29

### §11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

### §12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 12.1.2 《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《华夏全球精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 12.1.4 法律意见书；
- 12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

#### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

#### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司  
二〇一二年八月二十八日