

# 华夏全球精选股票型证券投资基金 2012 年年度报告

2012 年 12 月 31 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：二〇一三年三月二十八日

## §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 2013 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	12
§6 审计报告.....	13
§7 年度财务报表.....	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§8 投资组合报告.....	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	38
8.4 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.....	39
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	54
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	56
8.7 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.....	56
8.8 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.....	57
8.9 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.....	57
8.10 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.....	57
8.11 投资组合报告附注.....	57
§9 基金份额持有人信息.....	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
§10 开放式基金份额变动.....	59
§11 重大事件揭示.....	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§13 备查文件目录.....	65

## §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	17,925,165,790.70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	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.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	北京市西城区闹市口大街 1 号院

	号通泰大厦 B 座 12 层	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
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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-782,434,630.12	1,064,307,534.34	1,850,727,730.38
本期利润	1,555,902,349.64	-3,378,497,832.15	1,628,749,023.63
加权平均基金份额本期利润	0.0836	-0.1690	0.0699
本期加权平均净值利润率	10.92%	-19.91%	8.54%
本期基金份额净值增长率	11.50%	-19.51%	8.86%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-3,844,053,327.25	-5,341,651,828.04	-4,826,969,087.54
期末可供分配基金份额利润	-0.2145	-0.2784	-0.2248
期末基金资产净值	14,433,826,481.75	13,845,709,239.45	19,268,351,182.98
期末基金份额净值	0.805	0.722	0.897
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	-19.50%	-27.80%	-10.30%

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
过去三个月	4.95%	0.54%	2.46%	0.68%	2.49%	-0.14%
过去六个月	9.82%	0.70%	8.86%	0.75%	0.96%	-0.05%
过去一年	11.50%	0.81%	13.44%	0.84%	-1.94%	-0.03%
过去三年	-2.31%	1.03%	13.46%	1.13%	-15.77%	-0.10%
过去五年	-9.85%	1.45%	-15.75%	1.47%	5.90%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-19.50%	1.46%	-18.79%	1.45%	-0.71%	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12月31日)

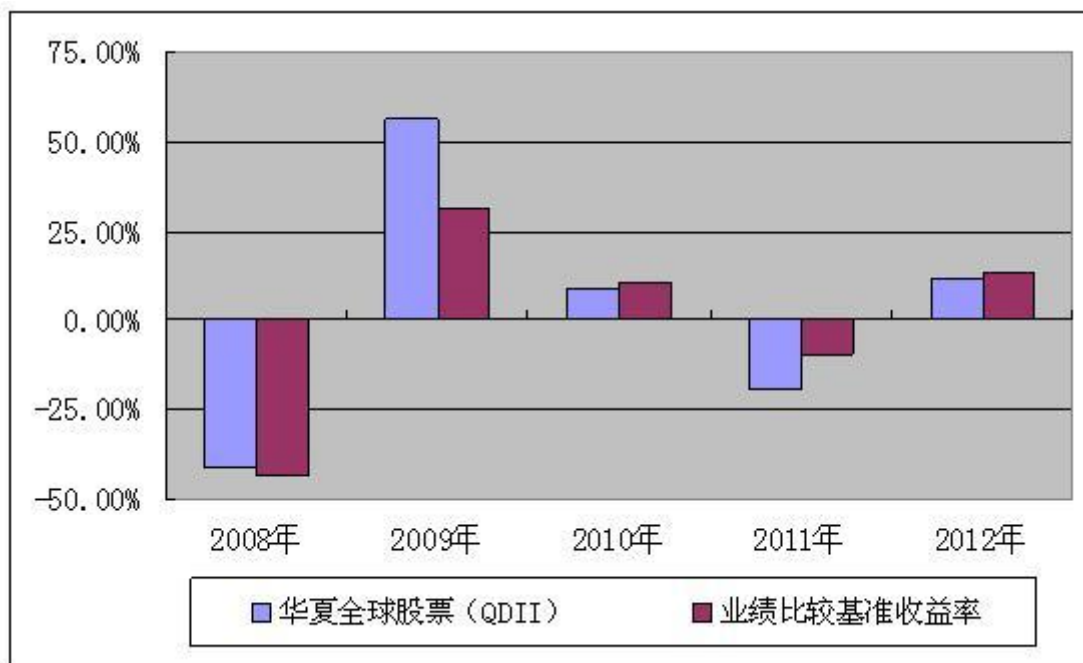


注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

### 3.2.3 过去五年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

华夏全球精选股票型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## §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、广州和青岛设有分公司，在香港及深圳设有子公司。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、保险资金投资管理人，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，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，旗下主动管理的股票型、混合型基金表现稳健，部分基金业绩表现良好；固定收益类基金均实现了正收益，总体表现优于行业平均水平。凭借规范的经营管理及良好的品牌声誉，华夏基金荣获多家机构评选的多个奖项，主要奖项包括：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。

在客户服务方面，2012 年，华夏基金继续以客户需求为导向，持续提高服务质量：推出华夏基金活期通账户服务，客户可通过活期通账户办理华夏现金增利证券投资基金的快速取现、余额理财、信用卡还款等业务，客户资金使用效率大幅提高；推出移动客户端基金交易功能，客户可通过 iPhone、iPad 以及 Android 版移动客户端办理基金开户、申购、赎回、转换、定期定额投资等业务；推出关联账户查询服务，客户可通过网上查询系统一站式查询指定关联人的基金投资情况。

#### 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		
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。
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。
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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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，本基金管理人严格执行了《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。

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（1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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5% 的情况。

#### 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，全球经济运行基本平稳，市场流动性依旧宽裕，股票、债券均小幅上涨。资本市场波动的主要原因是：欧债危机的恶化与缓解、主要央行宽松政策的扩大与猜测、中国经济增速的下滑与回升、美国财政悬崖的隐忧与妥协。

1 季度，发达国家经济状况分化：美国经济持续好转，欧洲经济缓步衰退，日本经济相对平稳。新兴市场通胀明显降低，宏观政策不再收紧，其内需是推动全球经济的主要动力。该季度，欧洲央行的数量宽松政策缓解了危机，投资者信心显著回升，全球股市普遍上涨。

2 季度，发达国家复苏放缓：美国就业率、消费信心、制造业景气度回落；欧洲银行问题严重，阻碍了资金流向实体经济，同时财政开支大幅消减。新兴市场通胀继续回落，经济增速放缓也较为明显。该季度，欧洲主权债务及银行问题发酵，中国、美国经济数据放缓，全球资本市场下跌明显。

3 季度，发达经济总体稳定：美国房地产市场转好、消费信心回升、企业资本开支意愿增强；欧洲重债国继续财政紧缩，德国制造业订单大幅消减，信心指数大幅降低。新兴市场经济继续放缓，主要是中国仍在消化 08 年金融危机后的过度刺激。该季度，欧洲央行、美联储都推出了新一轮数量宽松政策，引发了全球证券市场反弹。

4 季度，全球经济重归平稳：美国失业率下降，产能利用率回升；欧洲经济仍无起色，但也没有恶化；日本持续货币宽松政策，出口得到一定支持；新兴市场延续稳增长政策，经济下滑势头被遏制，宏观指标开始反弹。该季度，欧洲、新兴市场不确定性消除，资金明显涌入高风险资产。

2012 年，本基金依据对各国宏观政策、经济发展趋势、估值水平的分析，总体上维持了偏高的股票投资比例。具体操作上，1 季度初，鉴于市场过度悲观，组合提高了股票配置，把握住了市场反弹的机会；但由于未能预判欧债问题的再次发酵，2 季度风险资产比例没有明显降低；不过，在市场急跌中，我们坚定增持了成长股、被严重低估的周期股、中小市值股，在下半年取得了较好的效果；之后组合在 4 季度市场反弹的过程中，减持了部分周期股和中小市值股票。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.805 元，本报告期份额净值增长率为 11.50%，同期业绩比较基准增长率以美元计为 13.44%（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

我们判断，2013 年全球经济将平稳增长。美国高科技产业的优势将继续，

制造业因为能源价格低廉、劳动生产率较高，也将创造更多就业，这些都将支持其经济的增长。欧洲经济金融机构还将去杠杆，重债国财政紧缩还将持续，需求不足仍会拖累经济。日元贬值导致日本出口竞争力上升，但不利于国内消费，总体效果还有待观察。中国政府重点在于改变经济结构，改善社会分配，改革经济体制，总体将维持平稳增长的状态。

目前，股票、债券市场的投资者都不悲观，一方面是全球经济、政治中的重大不确定性消除，政策制定者的关注点都在如何促进、保持增长；另一方面是全球极其宽松的货币政策，支持了资产价格，全球股票估值已经回到十年平均水平之上。但全球经济快速增长的动力尚未形成，结构性问题并无改善，经济、政治周期性波动还将存在。因此，我们对全球证券市场谨慎乐观。从估值角度，我们看好稳定增长类的股票，不看好低收益率的高等级债券。从行业配置角度，我们倾向受益于新兴市场内需的成长股，受益于需求升级的跨国企业，具备竞争优势的高科技公司，拥有资源、技术优势的大宗商品企业。

2013 年，我们将重点关注以下问题的发展变化：（1）美联储货币政策的动向，这对全球流动性、资金价格都将产生巨大影响；（2）欧洲财政、金融一体化进程，这可能引发欧债危机的反复；（3）日元大幅贬值对全球金融市场的滞后性影响；（4）新兴市场的通货膨胀会不会与经济增长同时发生。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在监察稽核工作中加大了对日常业务的检查范围及频率，及时对公司投研、营销等业务开展合规检查，重点开展了对分公司、理财中心业务的专项检查和员工行为合规的专项检查；加大了对各项业务的合规培训和考试力度，针对公司员工尤其是投研人员组织了多次合规培训和合规考试，提高了员工的风险意识与合规意识；进一步完善内部相关规章制度，促进了公司业务的合规运作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工

作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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

普华永道中天审字(2013)第 20642 号

华夏全球精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏全球精选股票型证券投资基金(以下简称“华夏全球精选基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华夏全球精选基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基

础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述华夏全球精选基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了华夏全球精选基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 许康玮 洪磊

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2013-03-26

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,947,265,337.75	1,679,175,511.71
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	12,473,280,272.26	12,064,492,468.52
其中：股票投资		11,539,641,076.22	10,144,988,293.78
基金投资		299,092,882.35	968,171,828.61
债券投资		634,546,313.69	951,332,346.13
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		104,021,420.37	119,270,926.71
应收利息	7.4.7.5	7,635,736.03	16,123,883.19
应收股利		2,826,040.63	1,993,923.43
应收申购款		1,494,060.09	1,230,752.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		14,536,522,867.13	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 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		59,590,061.26	4,669,464.68
应付赎回款		16,344,542.80	5,338,813.68
应付管理人报酬		22,223,685.98	22,163,040.03
应付托管费		4,204,481.13	4,193,007.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	333,614.21	213,900.30
负债合计		102,696,385.38	36,578,226.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	17,925,165,790.70	19,187,361,067.49
未分配利润	7.4.7.10	-3,491,339,308.95	-5,341,651,828.04
所有者权益合计		14,433,826,481.75	13,845,709,239.45
负债和所有者权益总计		14,536,522,867.13	13,882,287,465.71

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.805 元，基金份额总额 17,925,165,790.70 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		1,921,291,683.55	-2,948,416,958.23
1.利息收入		41,725,392.10	76,110,945.88



其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,796,649.07	3,735,235.99
债券利息收入		39,928,743.03	67,448,420.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	4,927,289.40
其他利息收入		-	-
<b>2.投资收益（损失以“-”填列）</b>		<b>-457,201,026.23</b>	<b>1,505,046,254.35</b>
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-426,435,568.76	1,206,210,170.09
基金投资收益	7.4.7.13	-240,791,774.47	-953,886.18
债券投资收益	7.4.7.14	-24,031,192.79	-16,164,650.52
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	423,671.97	64,636,146.11
股利收益	7.4.7.16	233,633,837.82	251,318,474.85
<b>3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）</b>	7.4.7.17	<b>2,338,336,979.76</b>	<b>-4,442,805,366.49</b>
<b>4.汇兑收益（损失以“-”号填列）</b>		<b>-3,228,657.03</b>	<b>-90,081,985.25</b>
<b>5.其他收入（损失以“-”号填列）</b>	7.4.7.18	<b>1,658,994.95</b>	<b>3,313,193.28</b>
<b>减：二、费用</b>		<b>365,389,333.91</b>	<b>430,080,873.92</b>
1.管理人报酬		263,895,325.26	314,601,001.77
2.托管费		49,926,142.59	59,519,108.45
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	49,948,269.17	53,652,781.60
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	1,619,596.89	2,307,982.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,555,902,349.64</b>	<b>-3,378,497,832.15</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,555,902,349.64</b>	<b>-3,378,497,832.15</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	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）	-	1,555,902,349.64	1,555,902,349.64
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）	-1,262,195,276.79	294,410,169.45	-967,785,107.34
其中：1.基金申购款	270,084,429.34	-61,770,971.48	208,313,457.86
2.基金赎回款	-1,532,279,706.13	356,181,140.93	-1,176,098,565.20
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）	17,925,165,790.70	-3,491,339,308.95	14,433,826,481.75
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	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）	-	-3,378,497,832.15	-3,378,497,832.15
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）	-2,284,742,671.30	240,598,559.92	-2,044,144,111.38
其中：1.基金申购款	482,562,904.19	-69,317,869.98	413,245,034.21
2.基金赎回款	-2,767,305,575.49	309,916,429.90	-2,457,389,145.59
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）	19,187,361,067.49	-5,341,651,828.04	13,845,709,239.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的股票投资(包括股票、存托凭证及信托凭证投资)、债券投资、基金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公允价值变动计入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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

##### 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

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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资(包括股票、存托凭证及信托凭证投资)、债券投资、基金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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 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。当本基金依法有权抵销债权债务且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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票(含股票、存托凭证及信托凭证)投资和基金投资在持有期间应取得的现金股利和基金分红收益扣除股票和基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为利息收入。

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；处置时其公允价值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按直线法近似计算。

#### 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按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 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分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。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。

#### 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，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

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。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

本基金作为境外投资者在各个国家和地区证券市场的投资所得的相关税负是基于其现行的税法法规。各个国家和地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致本基金在正常的经营活动中，部分交易和事项的最终税务处理存在不确定性。在计提和处理税收费用时，本基金需要作出相关会计估计。

### 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[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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
活期存款	1,947,265,337.75	1,679,175,511.71
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	1,947,265,337.75	1,679,175,511.71

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	11,110,683,446.13	11,539,641,076.22	428,957,630.09	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	OTC 市场	606,927,586.81	634,546,313.69	27,618,726.88
	合计	606,927,586.81	634,546,313.69	27,618,726.88



资产支持证券	-	-	-	
基金	285,428,656.35	299,092,882.35	13,664,226.00	
其他	-	-	-	
合计	12,003,039,689.29	12,473,280,272.26	470,240,582.97	
项目	上年度末 2011年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	11,804,551,502.94	10,144,988,293.78	-1,659,563,209.16	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	OTC 市场	1,031,497,165.37	951,332,346.13	-80,164,819.24
	合计	1,031,497,165.37	951,332,346.13	-80,164,819.24
资产支持证券	-	-	-	
基金	1,096,540,197.00	968,171,828.61	-128,368,368.39	
其他	-	-	-	
合计	13,932,588,865.31	12,064,492,468.52	-1,868,096,396.79	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	54,231.20	68,016.49
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	7,581,504.83	16,055,865.82
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	0.88

合计	7,635,736.03	16,123,883.19
----	--------------	---------------

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末均无应付交易费用余额。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	61,598.21	20,120.30
预提费用	270,000.00	190,000.00
其他	2,016.00	3,780.00
合计	333,614.21	213,900.30

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	270,084,429.34	270,084,429.34
本期赎回（以“-”号填列）	-1,532,279,706.13	-1,532,279,706.13
本期末	17,925,165,790.70	17,925,165,790.70

#### 7.4.7.10 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	-782,434,630.12	2,338,336,979.76	1,555,902,349.64
本期基金份额交易产生的变动数	254,481,079.91	39,929,089.54	294,410,169.45
其中：基金申购款	-52,976,782.95	-8,794,188.53	-61,770,971.48
基金赎回款	307,457,862.86	48,723,278.07	356,181,140.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,844,053,327.25	352,714,018.30	-3,491,339,308.95

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
活期存款利息收入	1,796,455.87	3,419,467.73
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	-	36,772.94
其他	193.20	278,995.32
合计	1,796,649.07	3,735,235.99

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
卖出股票成交总额	10,356,506,326.15	12,636,442,712.27
减：卖出股票成本总额	10,782,941,894.91	11,430,232,542.18
买卖股票差价收入	-426,435,568.76	1,206,210,170.09

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	678,582,266.37	340,488,879.14
减：卖出/赎回基金成本总额	919,374,040.84	341,442,765.32
基金投资收益	-240,791,774.47	-953,886.18

7.4.7.14 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,353,164,695.75	1,833,983,641.11
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,358,006,056.32	1,827,664,603.47
减：应收利息总额	19,189,832.22	22,483,688.16

债券投资收益	-24,031,192.79	-16,164,650.52
--------	----------------	----------------

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
卖出权证成交总额	423,671.97	1,842,271.85
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	423,671.97	1,842,271.85

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
外汇远期投资收益	-	62,793,874.26
合计	-	62,793,874.26

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	232,354,981.69	250,027,720.71
基金投资产生的股利收益	1,278,856.13	1,290,754.14
合计	233,633,837.82	251,318,474.85

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
1.交易性金融资产	2,338,336,979.76	-4,450,083,766.49
——股票投资	2,088,520,839.25	-4,281,087,206.15
——债券投资	107,783,546.12	-81,329,649.42
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	142,032,594.39	-87,666,910.92

2.衍生工具	-	7,278,400.00
——权证投资	-	-
——远期投资	-	7,278,400.00
3.其他	-	-
合计	2,338,336,979.76	-4,442,805,366.49

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
基金赎回费收入	1,470,261.95	3,071,959.14
其他	188,733.00	241,234.14
合计	1,658,994.95	3,313,193.28

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。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
交易所市场交易费用	49,948,269.17	53,652,781.60
银行间市场交易费用	-	-
合计	49,948,269.17	53,652,781.60

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
审计费用	190,000.00	190,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
税务顾问费	36,619.53	74,337.31
银行费用	34,343.98	48,441.20
其他	1,278,633.38	1,915,203.59
合计	1,619,596.89	2,307,982.10

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。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

#### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
青岛海鹏科技投资有限公司	基金管理人的股东
无锡市国联发展（集团）有限公司	基金管理人的股东

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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。

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 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。

##### 7.4.10.1.4 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12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31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	-	-	5,520,000,000.00	100.00%

##### 7.4.10.1.5 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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	263,895,325.26	314,601,001.77
其中：支付销售机构的客户维护费	38,445,999.58	46,717,084.67

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	49,926,142.59	59,519,108.45

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。

### 7.4.10.3 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。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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%。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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	198,429,880.50	1,706,570.28	251,193,787.56	3,365,955.07
摩根大通银行	1,748,835,457.25	89,885.59	1,427,981,724.15	53,512.66

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。



### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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“7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,947,265,337.75	-	-	1,947,265,337.75
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
债券投资	-	634,546,313.69	-	634,546,313.69
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	48,966.68	-	-	48,966.68
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。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末 （2011 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	3,173,088.50	8,110,792.02
	利率上升 25 个基点	-3,172,374.64	-8,109,424.48

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012 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	700,554,085.18	883,004,958.11	165,278,231.92	1,748,837,275.21
交易性金融资产	5,247,306,714.10	4,890,207,449.39	2,335,766,108.77	12,473,280,272.26
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	94,483,092.95	-	9,538,327.42	104,021,420.37
应收利息	7,603,254.83	6,741.74	-	7,609,996.57
应收股利	778,214.17	544,507.77	1,503,318.69	2,826,040.63
其他资产	-	-	-	-
资产合计	6,050,725,361.23	5,773,763,657.01	2,512,085,986.80	14,336,575,005.04
以外币计价的负债				
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	59,590,061.26	-	59,590,061.26

应付换汇款	-	-	-	-
负债合计	-	59,590,061.26	-	59,590,061.26
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

#### 7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	713,849,247.19	679,102,199.43
	所有外币相对人民币贬值 5%	-713,849,247.19	-679,102,199.43

#### 7.4.13.4.3 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等损失的可能性。

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 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	11,539,641,076.22	79.95	10,144,988,293.78	73.27
交易性金融资产-基金投资	299,092,882.35	2.07	968,171,828.61	6.99
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	11,838,733,958.57	82.02	11,113,160,122.39	80.26

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	+5%	571,212,233.27	542,756,873.72
	-5%	-571,212,233.27	-542,756,873.72

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 各层级金融工具公允价值

截至 2012 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 11,838,733,958.57 元，第二层级的余额为 634,546,313.69 元，第三层级的余额为 0 元。（截至 2011 年 12 月 31 日止：第一层级的余额为 11,113,160,122.39 元，第二层级的余额为 951,332,346.13 元，第三层级的余额为 0 元。）

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

## §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	11,539,641,076.22	79.38
	其中：普通股	9,497,017,334.60	65.33
	存托凭证	2,041,792,651.91	14.05
2	基金投资	299,092,882.35	2.06
3	固定收益投资	634,546,313.69	4.37
	其中：债券	634,546,313.69	4.37
	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	1,947,265,337.75	13.40
8	其他各项资产	115,977,257.12	0.80
9	合计	14,536,522,867.13	100.00

### 8.2 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	4,890,207,449.39	33.88
美国	3,695,332,353.02	25.60
英国	866,023,197.84	6.00
中国台湾	422,161,002.89	2.92
韩国	421,462,525.09	2.92
新加坡	311,513,633.64	2.16
印度尼西亚	248,676,272.59	1.72
马来西亚	173,628,873.69	1.20
印度	166,071,347.88	1.15
加拿大	117,904,507.72	0.82
泰国	112,640,568.69	0.78
日本	103,599,653.32	0.72
澳大利亚	10,301,661.40	0.07
菲律宾	118,029.06	0.00
合计	11,539,641,076.22	79.95

### 8.3 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（%）
非必需消费品	2,582,671,422.06	17.89
金融	2,365,010,580.45	16.39
信息技术	2,199,363,666.16	15.24
能源	1,976,356,231.68	13.69
材料	737,477,245.02	5.11
电信服务	591,019,573.35	4.09
必需消费品	514,285,071.34	3.56
工业	420,399,325.96	2.91
保健	142,045,204.67	0.98
公用事业	11,012,755.53	0.08

合计	11,539,641,076.22	79.95
----	-------------------	-------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

#### 8.4 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	CHINA MOBILE LTD	中国移动 有限公司	00941	香港	中国 香港	7,969,700	583,292,043.88	4.04
2	IMAX CORP	-	IMAX	纽约	美国	3,178,800	449,158,209.64	3.11
3	INTIME DEPARTME NT STORE	银泰百货 (集团)有 限公司	01833	香港	中国 香港	56,239,500	416,854,520.05	2.89
4	IND & COMM BK OF CHINA	中国工商 银行股份 有限公司	01398	香港	中国 香港	80,658,000	359,755,139.37	2.49
5	CHINA LIFE INSURANC E CO	中国人寿 保险股份 有限公司	02628	香港	中国 香港	16,689,000	342,410,997.01	2.37
6	CHINA PACIFIC INSURANC E GROUP CO	中国太平 洋保险(集 团)股份有 限公司	02601	香港	中国 香港	14,518,800	337,327,864.87	2.34
7	CNOOC LTD	中国海洋 石油有限 公司	00883	香港	中国 香港	24,220,000	329,581,604.49	2.28
8	SINA CORP	-	SINA	纳斯达克	美国	889,254	280,699,970.23	1.94
9	CHINA FOODS LTD	中国食品 有限公司	00506	香港	中国 香港	45,708,000	265,400,727.74	1.84
10	BAIDU INC	-	BIDU	纳斯达克	美国	383,745	241,902,408.26	1.68
11	NEW ORIENTAL EDUCATIO	-	EDU	纽约	美国	1,883,200	229,990,065.49	1.59
12	QIHOO 360 TECHNOLO GY CO	-	QIHU	纽约	美国	1,199,138	223,778,930.62	1.55
13	BANK OF AMERICA CORP	-	BAC	纽约	美国	3,000,000	218,923,965.04	1.52



14	ROSNEFT OJSC	-	ROSN	伦敦国际 金融期货 期权	英国	3,421,300	191,605,818.08	1.33
15	SOHU.COM INC	-	SOHU	纳斯达克	美国	600,000	178,533,342.03	1.24
16	FOCUS MEDIA HOLDING	-	FMCN	纳斯达克	美国	1,101,900	177,790,226.22	1.23
17	GAZPROM OAO	-	OGZD	伦敦国际 金融期货 期权	英国	2,800,000	166,490,324.03	1.15
18	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL	中国石油 化工股份 有限公司	00386	香港	中国香 港	22,750,000	161,984,248.45	1.12
19	CHINA SHENHUA ENERGY CO	中国神华 能源股份 有限公司	01088	香港	中国香 港	5,842,000	160,841,531.46	1.11
20	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	恒大地产 集团有限 公司	03333	香港	中国香 港	45,496,000	156,804,677.52	1.09
21	CTRP.COM INTERNATIONAL	-	CTRP	纳斯达克	美国	1,089,300	155,148,378.13	1.07
22	WHITBREAD PLC	-	WTB	伦敦	英国	591,026	147,736,293.95	1.02
23	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控 股有限 公司	00700	香港	中国 香港	642,000	129,637,677.98	0.90
24	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	百丽国际 控股有 限公司	01880	香港	中国 香港	9,265,000	126,377,070.37	0.88
25	CHINA MERCHANTS BANK	招商银 行股份 有限公 司	03968	香港	中国 香港	8,536,500	118,378,497.49	0.82
26	LUKOIL OAO	-	LKOD	伦敦国际 金融期货 期权	英国	276,000	114,756,887.72	0.80
27	NHN CORP	-	035420	韩国	韩国	82,900	111,126,337.98	0.77
28	CHINA COAL	中国中 煤能 源股份	01898	香港	中国 香港	16,244,000	110,917,977.17	0.77

	ENERGY CO	有限公司						
29	BANYAN TREE HOLDINGS LTD	-	BTH	新加坡	新加坡	32,800,000	107,179,614.39	0.74
30	SENBCORP MARINE LTD	-	SMM	新加坡	新加坡	4,518,000	106,947,017.95	0.74
31	YANDEX NV-A	-	YNDX	纳斯达克	美国	756,200	102,381,668.47	0.71
32	BANK OF COMMUNI CATIONS CO	交通银行 股份有限 公司	03328	香港	中国 香港	21,175,000	100,284,343.20	0.69
33	AIRASIA BHD	-	AIRA	马来西亚	马来 西亚	17,594,900	99,088,886.74	0.69
34	PIGEON CORP	-	7956	东京	日本	328,400	98,599,841.97	0.68
35	TAIWAN SEMICON DUCTOR MANUFAC	台湾积体 电路制造 股份有限 公司	2330	台湾	中国 台湾	4,500,000	94,501,273.13	0.65
36	CORNING INC	-	GLW	纽约	美国	1,190,500	94,434,043.42	0.65
37	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	94,062,986.77	0.65
38	MAIL.RU GROUP	-	MAIL	伦敦国际 金融期货 期权	英国	433,677	94,042,749.05	0.65
39	ICICI BANK LTD	-	IBN	纽约	美国	323,400	88,647,385.84	0.61
40	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂房地 产控股有 限公司	00813	香港	中国 香港	7,369,000	87,368,081.16	0.61
41	POTASH CORP OF SASKATCH EWAN	-	POT	纽约	美国	312,046	79,807,947.28	0.55
42	LOCK&LOC K CO LTD	-	115390	韩国	韩国	552,292	75,501,636.15	0.52

43	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	-	INTP	印度尼西亚	印度尼西亚	5,028,000	72,456,818.73	0.50
44	BANK OF AYUDHYA PCL	-	BAY	泰国	泰国	10,826,400	72,275,201.05	0.50
45	TOP GLOVE CORP BHD	-	TOPG	马来西亚	马来西亚	5,841,800	67,599,372.21	0.47
46	NETEASE.COM INC	-	NTES	纳斯达克	美国	252,000	67,365,223.39	0.47
47	TRAVELSKY TECHNOLOGY 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	66,448,761.65	0.46
48	AUTONAVI HOLDINGS LTD	-	AMAP	纳斯达克	美国	925,200	65,946,007.78	0.46
49	HYUNDAI MOTOR CO	-	005380	韩国	韩国	49,900	64,385,578.50	0.45
50	HDFC BANK LTD	-	HDFCB	印度	印度	822,475	63,791,940.73	0.44
51	HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGY	-	HOLI	纳斯达克	美国	842,042	62,880,975.43	0.44
52	EXXON MOBIL CORP	-	XOM	纽约	美国	110,879	60,319,287.57	0.42
53	CHANGYU.COM LTD	-	CYOU	纳斯达克	美国	349,000	57,780,464.44	0.40
54	URALKALI	-	URKA	伦敦国际金融期货期权	英国	236,000	56,679,873.39	0.39
55	MAOYE INTERNATIONAL HLDGS	茂业国际控股有限公司	00848	香港	中国香港	43,689,000	55,979,119.04	0.39
56	BEIJING CAPITAL LAND LTD	首创置业股份有限公司	02868	香港	中国香港	21,162,000	55,259,817.99	0.38
57	CHEVRON CORP	-	CVX	纽约	美国	79,124	53,781,688.17	0.37

58	HOLCIM INDONESIA TBK PT	-	SMCB	印度尼西 亚	印度尼 西亚	28,652,500	53,336,948.69	0.37
59	FREEPOR T-MCMORAN COPPER & GOLD INC	-	FCX	纽约	美国	234,369	50,380,921.16	0.35
60	CHEIL WORLDWI DE INC	-	030000	韩国	韩国	390,340	49,673,750.03	0.34
61	MONSANT O CO	-	MON	纽约	美国	83,340	49,580,847.41	0.34
62	ANADARK O PETROLEU M CORP	-	APC	纽约	美国	103,384	48,288,134.02	0.33
63	TECK RESOURCE S LTD	-	TCK	纽约	美国	130,000	29,702,130.26	0.21
			TCK/B	多伦多	加拿大	78,800	17,981,992.52	0.12
64	WILMAR INTERNATI ONAL LTD	-	WIL	新加坡	新加坡	2,592,000	44,549,833.50	0.31
65	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY	中联重科 股份有限 公司	01157	香港	中国香 港	4,786,000	44,323,665.28	0.31
66	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	43,843,725.77	0.30
67	CHINA LILANG LTD	中国利郎 有限公司	01234	香港	中国 香港	11,692,000	43,520,949.38	0.30
68	SOTHEBY'S	-	BID	纽约	美国	204,000	43,108,976.05	0.30
69	OCCIDENT AL PETROLEU M CORP	-	OXY	纽约	美国	88,958	42,836,137.45	0.30
70	CHINA DONGXIAN G GROUP CO	中国动向 (集团)有限 公司	03818	香港	中国 香港	50,476,000	42,161,788.44	0.29
71	KANGWON LAND INC	-	035250	韩国	韩国	237,880	41,088,512.16	0.28

72	ADARO ENERGY TBK PT	-	ADRO	印度尼西亚	印度尼西亚	40,193,000	41,021,845.55	0.28
73	SYNUTRA INTERNATIONAL INC	-	SYUT	纳斯达克	美国	1,389,860	40,447,518.10	0.28
74	SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO L	上海电气集团股份有限公司	02727	香港	中国香港	15,000,000	40,263,926.18	0.28
75	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	中国永达汽车服务控股有限公司	03669	香港	中国香港	6,000,000	40,093,625.59	0.28
76	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	华晨中国汽车控股有限公司	01114	香港	中国香港	5,150,000	39,843,040.43	0.28
77	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	39,368,631.63	0.27
78	EXIDE INDUSTRIES LTD	-	EXID	印度	印度	2,350,502	38,793,330.98	0.27
79	NATIONAL OILWELL VARCO INC	-	NOV	纽约	美国	90,000	38,665,253.26	0.27
80	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源控股有限公司	03800	香港	中国香港	30,000,000	37,952,703.84	0.26
81	HON HAI PRECISION INDUSTRY	鸿海精密工业股份有限公司	2317	台湾	中国台湾	1,970,000	37,915,902.56	0.26
82	PETROLEO BRASILEIRO	-	PBR/A	纽约	美国	304,900	37,006,629.23	0.26
83	NC SOFT CORPORATION	-	036570	韩国	韩国	41,085	36,513,747.37	0.25
84	APACHE	-	APA	纽约	美国	73,892	36,459,181.04	0.25

	CORP							
85	ACE HARDWARE INDONESIA	-	ACES	印度尼西亚	印度尼西亚	68,365,000	35,984,487.21	0.25
86	NOBLE ENERGY INC	-	NBL	纽约	美国	52,000	33,253,312.05	0.23
87	SUNCOR ENERGY INC	-	SU	纽约	美国	100,000	20,729,579.00	0.14
			SU	多伦多	加拿大	60,000	12,388,966.77	0.09
88	HALLIBUR TON CO	-	HAL	纽约	美国	150,000	32,706,599.26	0.23
89	EOG RESOURCE S INC	-	EOG	纽约	美国	43,000	32,646,698.44	0.23
90	HISENSE KELON ELEC HLD	海信科龙 电器股份 有限公司	00921	香港	中国 香港	11,501,000	31,058,230.25	0.22
91	BG GROUP PLC	-	BG/	伦敦	英国	300,000	31,028,653.60	0.21
92	SKYWORT H DIGITAL HLDGS LTD	创维数码 控股有限 公司	00751	香港	中国 香港	9,592,000	30,881,369.03	0.21
93	ZHONGSHE NG GROUP HOLDINGS	中升集团 控股有限 公司	00881	香港	中国 香港	3,219,000	30,594,647.71	0.21
94	CANADIAN NATURAL RESOURCE S	-	CNQ	纽约	美国	162,000	29,396,906.38	0.20
95	BARRICK GOLD CORP	-	ABX	多伦多	加拿大	130,000	28,574,287.67	0.20
96	BIOSENSO RS INTERNATI ONAL GROUP LTD	-	BIG	新加坡	新加坡	4,605,000	28,554,943.33	0.20
97	HESS CORP	-	HES	纽约	美国	84,294	28,059,793.47	0.19
98	BHP BILLITON	-	BLT	伦敦	英国	128,577	27,969,685.13	0.19

	PLC							
99	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	-	JSMR	印度尼西亚	印度尼西亚	7,556,000	26,433,586.94	0.18
100	CHINDEX INTERNATIONAL INC	-	CHDX	纳斯达克	美国	400,000	26,399,100.00	0.18
101	MEDIATEK INC	联发科技股份有限公司	2454	台湾	中国台湾	374,000	26,193,847.73	0.18
102	PEGATRON CORP	和硕联合科技股份有限公司	4938	台湾	中国台湾	3,100,000	25,201,421.99	0.17
103	LONGFOR PROPERTIES	龙湖地产有限公司	00960	香港	中国香港	2,000,000	24,620,600.18	0.17
104	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	-	MAJOR	泰国	泰国	6,257,100	24,420,163.96	0.17
105	AXIS BANK LTD	-	AXSB	印度	印度	155,000	24,032,378.61	0.17
106	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽(香港)有限公司	03808	香港	中国香港	5,000,000	24,004,274.22	0.17
107	TAOMEE HOLDINGS LTD	-	TAOM	纽约	美国	1,068,495	23,976,210.41	0.17
108	NOBLE CORP	-	NE	纽约	美国	105,000	22,980,416.55	0.16
109	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	416,500	21,920,808.64	0.15
110	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	中国人寿保险股份有限公司	2823	台湾	中国台湾	3,820,989	21,673,571.86	0.15
111	BAYTEX ENERGY CORP	-	BTE	多伦多	加拿大	79,000	21,378,826.77	0.15
112	DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	东方电气股份有限公司	01072	香港	中国香港	1,667,600	21,150,736.93	0.15

113	GUANGZH OU R&F PROPERTIE S CO LTD	广州富力 地产股份 有限公司	02777	香港	中国 香港	1,959,600	20,500,007.00	0.14
114	QUIMICA Y MINERA CHIL	-	SQM	纽约	美国	56,000	20,288,588.32	0.14
115	MINTH GROUP LTD	敏实集团 有限公司	00425	香港	中国 香港	2,742,000	19,812,625.15	0.14
116	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	-	FM	多伦多	加拿大	143,000	19,777,969.76	0.14
117	KINDER MORGAN INC	-	KMI	纽约	美国	89,000	19,763,937.64	0.14
118	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	富邦金融 控股股份 有限公司	2881	台湾	中国 台湾	2,600,781	19,763,520.64	0.14
119	AGRIUM INC	-	AGU	纽约	美国	30,000	18,832,250.54	0.13
120	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	国泰金融 控股股份 有限公司	2882	台湾	中国 台湾	2,730,000	18,617,725.05	0.13
121	SCHLUMBE RGER LTD	-	SLB	纽约	美国	42,000	18,294,206.72	0.13
122	CHINA RESOURCE S LAND LTD	华润置地 有限公司	01109	香港	中国 香港	1,054,000	18,035,157.30	0.12
123	X5 RETAIL GROUP NV	-	FIVE	伦敦国际 金融期货 期权	英国	160,350	17,990,656.66	0.12
124	IMPERIAL OIL LTD	-	IMO	多伦多	加拿大	66,000	17,802,464.23	0.12
125	RIO TINTO PLC	-	RIO	伦敦	英国	49,406	17,722,256.23	0.12
126	CHINA NATIONAL MATERIAL S	中国中材 股份有限 公司	01893	香港	中国 香港	9,119,000	17,600,339.34	0.12



127	CHINA TAIPING INSURANC E HOLD	中国太平 保险控股 有限公司	00966	香港	中国 香港	1,189,000	15,138,344.19	0.10
128	COMBA TELECOM SYSTEMS HOLDIN	京信通信 系统控股 有限公司	02342	香港	中国 香港	6,634,000	15,009,856.45	0.10
129	POLY HONG KONG INVESTME NTS	保利(香港) 投资有限 公司	00119	香港	中国 香港	3,000,000	14,743,165.72	0.10
130	GOODBAB Y INTERNATI ONAL HOLDI	好孩子国 际控股有 限公司	01086	香港	中国 香港	6,445,000	14,634,497.72	0.10
131	EPISTAR CORP	晶元光电 股份有限 公司	2448	台湾	中国 台湾	1,245,000	14,204,742.91	0.10
132	SAMSUNG ELECTRON ICS CO LTD	-	005930	韩国	韩国	1,550	13,931,021.61	0.10
133	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIE S	-	010140	韩国	韩国	60,000	13,658,790.63	0.09
134	CHINA OILFIELD SERVICES	中海油田 服务股份 有限公司	02883	香港	中国 香港	1,032,000	13,373,754.31	0.09
135	SIMPL TECHNOLO GY CO LTD	新普科技 股份有限 公司	6121	台湾	中国 台湾	416,000	13,149,208.08	0.09
136	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	12,466,003.49	0.09
137	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	-	JCNC	新加坡	新加坡	50,000	12,388,847.78	0.09
138	FMC TECHNOLO	-	FTI	纽约	美国	45,000	12,114,358.43	0.08

	GIES INC							
139	WINTEK CORP	胜华科技股份有限公司	2384	台湾	中国台湾	3,581,000	11,939,288.68	0.08
140	CHINA STEEL CORP	中国钢铁股份有限公司	2002	台湾	中国台湾	2,000,000	11,842,427.58	0.08
141	TATA MOTORS LTD	-	TTMT	印度	印度	330,000	11,792,384.37	0.08
142	XINGDA INTL HOLDINGS	兴达国际控股有限公司	01899	香港	中国香港	3,536,000	11,470,150.49	0.08
143	AJISEN CHINA HOLDINGS LTD	味千(中国)控股有限公司	00538	香港	中国香港	1,894,000	11,366,023.84	0.08
144	CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	中国石油化学工业开发(股)公司	1314	台湾	中国台湾	2,900,750	11,304,105.90	0.08
145	BAKER HUGHES INC	-	BHI	纽约	美国	43,000	11,040,173.39	0.08
146	HUANENGP OOWERINTL INC	华能国际电力股份有限公司	00902	香港	中国香港	1,894,000	11,012,755.53	0.08
147	BUNGE LTD	-	BG	纽约	美国	23,400	10,691,296.08	0.07
148	AIRMEDIA GROUP INC	-	AMCN	纳斯达克	美国	878,827	10,605,824.85	0.07
149	YANZHOU COAL MINING CO	兖州煤业股份有限公司	01171	香港	中国香港	1,000,000	10,396,445.79	0.07
150	CHINA MENGNIU DAIRY CO	中国蒙牛乳业有限公司	02319	香港	中国香港	580,000	10,347,788.48	0.07
151	ILUKA RESOURCES LTD	-	ILU	澳大利亚	澳大利亚	175,000	10,301,661.40	0.07
152	UNITED MICROELECTRONICS CORP	联华电子股份有限公司	2303	台湾	中国台湾	4,000,000	10,132,095.26	0.07

153	MAKEMYT RIP LTD	-	MMYT	纳斯达克	美国	126,500	9,891,239.93	0.07
154	CORETRON IC CORPORAT ION	中强光电 股份有限 公司	5371	台湾	中国 台湾	2,020,000	9,839,823.28	0.07
155	ASTRA INTERNATI ONAL TBK PT	-	ASII	印度尼西 亚	印度尼 西亚	2,000,000	9,756,886.11	0.07
156	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	-	ICBP	印度尼西 亚	印度尼 西亚	1,934,500	9,685,699.36	0.07
157	CHINA ZHENGTON G AUTO SERVICE	中国正通 汽车服务 控股有限 公司	01728	香港	中国 香港	2,206,500	9,644,718.70	0.07
158	YULON MOTOR COMPANY	裕隆汽车 制造股份 有限公司	2201	台湾	中国 台湾	800,000	9,525,901.53	0.07
159	STANDARD FOODS CORP	佳格食品 股份有限 公司	1227	台湾	中国 台湾	550,000	9,466,364.65	0.07
160	PCHOME ONLINE INC	网路家庭 国际资讯 股份有限 公司	8044	台湾	中国 台湾	320,000	9,318,063.68	0.06
161	ORIENTAL UNION CHEMICAL	东联化学 股份有限 公司	1710	台湾	中国 台湾	1,180,000	8,890,264.10	0.06
162	TIANJIN ZHONG XIN PHARM CO	-	TIAN	新加坡	新加坡	2,000,000	8,799,700.00	0.06
163	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	-	DD	纽约	美国	28,000	7,915,946.13	0.05
164	WEICHA I POWER CO LTD	潍柴动力 股份有限 公司	02338	香港	中国 香港	283,200	7,900,390.53	0.05
165	ADVANCE D INFO SERVICE PCL	-	ADVAN C	泰国	泰国	180,000	7,727,529.47	0.05

166	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	-	KMB	印度	印度	100,000	7,429,781.06	0.05
167	DLF LTD	-	DLFU	印度	印度	280,000	7,379,833.91	0.05
168	PHISON ELECTRON ICS CORP	群联电子 股份有限 公司	8299	台湾	中国 台湾	165,000	6,876,510.17	0.05
169	FORMOSA PLASTICS CORP	台湾塑料 工业股份 有限公司	1301	台湾	中国 台湾	400,000	6,806,689.64	0.05
170	APOLLO TYRES LTD	-	APTY	印度	印度	651,900	6,631,323.90	0.05
171	LENOVO GROUP LTD	联想集团 有限公司	00992	香港	中国 香港	1,154,000	6,569,613.03	0.05
172	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO	中国南方 航空股份 有限公司	01055	香港	中国 香港	2,060,000	6,531,919.84	0.05
173	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	1,012,000	6,327,494.25	0.04
174	SYNNEX TECHNOLO GY INTL CORP	联强国际 股份有限 公司	2347	台湾	中国 台湾	540,000	6,254,620.35	0.04
175	BEC WORLD PUBLIC CO LTD	-	BEC	泰国	泰国	427,800	6,239,086.51	0.04
176	ACC LTD	-	ACC	印度	印度	38,000	6,220,374.32	0.04
177	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	彰化商业 银行股份 有限公司	2801	台湾	中国 台湾	1,800,400	6,217,032.00	0.04
178	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	统一超商 股份有限 公司	2912	台湾	中国 台湾	180,000	6,059,772.36	0.04
179	FOXCONN TECHNOLO	鸿准精密 工业股份	2354	台湾	中国 台湾	300,000	5,903,893.97	0.04

	GY CO LTD	有限公司						
180	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	-	086280	韩国	韩国	4,300	5,624,433.70	0.04
181	GENTING BHD	-	GENT	马来西亚	马来 西亚	272,000	5,143,329.11	0.04
182	ASUSTEK COMPUTER INC	华硕计算 机股份有 限公司	2357	台湾	中国 台湾	72,000	5,089,429.39	0.04
183	SAMSUNG SECURITIE S CO LTD	-	016360	韩国	韩国	16,000	5,045,426.16	0.03
184	NINTENDO CO LTD	-	7974	大阪	日本	7,500	4,999,811.35	0.03
185	TTY BIOPHARM CO LTD	台湾东洋 药品工业 股份有限 公司	4105	台湾	中国 台湾	180,000	4,364,594.88	0.03
186	EVERLIGH T ELECTRON ICS CO LTD	亿光电子 工业股份 有限公司	2393	台湾	中国 台湾	500,000	4,124,282.37	0.03
187	HENGDELI HOLDINGS LTD	亨得利控 股有限公 司	03389	香港	中国 香港	1,828,000	4,121,144.63	0.03
188	HONAM PETROCHE MICAL CORP	-	011170	韩国	韩国	2,800	4,059,253.21	0.03
189	CHINA NATIONAL BUILDING MA	中国建材 股份有限 公司	03323	香港	中国 香港	414,000	3,807,240.08	0.03
190	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	安徽海螺 水泥股份 有限公司	00914	香港	中国 香港	165,000	3,773,374.59	0.03
191	CHINA EASTERN AIRLINES CO	中国东方 航空股份 有限公司	00670	香港	中国 香港	1,250,000	3,132,314.50	0.02
192	GEELY AUTOMOBILE	吉利汽车 控股有限 公司	00175	香港	中国 香港	1,050,000	3,125,015.90	0.02

	HOLDINGS LT							
193	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	3,105,958.45	0.02
194	GLOBAL UNICHIP CORP	创意电子 股份有限 公司	3443	台湾	中国 台湾	100,000	2,175,802.51	0.02
195	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	新光金融 控股股份 有限公司	2888	台湾	中国 台湾	1,200,000	2,127,740.01	0.01
196	AMBASSA DOR HOTEL/THE	国宾大饭 店股份有 限公司	2704	台湾	中国 台湾	300,000	2,049,151.32	0.01
197	PTT EXPLOR & PROD PUBLIC CO	-	PTTEP	泰国	泰国	58,734	1,978,587.70	0.01
198	MASTERSK ILL EDUCATIO N GROUP	-	MASEG	马来西亚	马来 西亚	1,482,100	1,797,285.63	0.01
199	XINJIANG TIANYE WATER SAVI	新疆天业 节水灌溉 股份有限 公司	00840	香港	中国 香港	2,172,000	1,690,938.93	0.01
200	SINGAPOR E AIRLINES LTD	-	SIA	新加坡	新加坡	22,000	1,217,014.54	0.01
201	BREADTAL K GROUP LTD	-	BREAD	新加坡	新加坡	298,800	1,045,572.44	0.01
202	MEGASTU DY CO LTD	-	072870	韩国	韩国	1,840	854,037.59	0.01
203	K-GREEN TRUST	-	KGT	新加坡	新加坡	156,800	831,089.71	0.01
204	GINTECH ENERGY CORP	昱晶能源 科技股份 有限公司	3514	台湾	中国 台湾	64,000	376,879.30	0.00
205	SINO-AME RICAN SILICON PRODUC	中美硅晶 製品股份 有限公司	5483	台湾	中国 台湾	34,000	255,056.01	0.00

206	HOLCIM PHILIPPINE S INC	-	HLCM	菲律宾	菲律宾	55,000	118,029.06	0.00
-----	-------------------------------	---	------	-----	-----	--------	------------	------

注：所用证券代码采用当地市场代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 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	557,036,510.46	4.02
2	CHINA MOBILE LTD	00941	544,514,010.38	3.93
3	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO	02601	427,485,809.99	3.09
4	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	377,813,204.71	2.73
5	SINA CORP	SINA	339,764,529.11	2.45
6	HAITONG SECURITIES CO LTD	06837	313,918,453.37	2.27
7	SOHU.COM INC	SOHU	309,337,033.72	2.23
8	PING AN INSURANCE GROUP CO	02318	302,938,110.32	2.19
9	BANK OF AMERICA CORP	BAC	262,291,421.09	1.89
10	CHINA SHENHUA ENERGY CO	01088	254,017,719.50	1.83
11	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO	QIHU	253,585,029.18	1.83
12	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU	230,445,920.16	1.66
13	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP	01339	217,503,647.61	1.57
14	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	00914	203,127,070.90	1.47
15	FOCUS MEDIA HOLDING	FMCN	177,927,077.52	1.29
16	CTRIIP.COM INTERNATIONAL	CTRP	174,237,308.01	1.26
17	NEW ORIENTAL EDUCATIO	EDU	173,876,436.20	1.26
18	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	03333	164,641,881.48	1.19
19	CHINA YURUN FOOD	01068	161,673,624.06	1.17

	GROUP LTD			
20	CHINA NATIONAL BUILDING MA	03323	153,057,786.83	1.11

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。

### 8.5.2 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	898,995,707.88	6.49
2	CHINA LIFE INSURANCE CO	02628	660,499,310.14	4.77
3	IND & COMM BK OF CHINA	01398	495,416,888.85	3.58
4	PING AN INSURANCE GROUP CO	02318	425,937,504.98	3.08
5	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	369,291,504.90	2.67
6	HAITONG SECURITIES CO LTD	06837	318,546,875.18	2.30
7	PETROLEO BRASILEIRO	PBR/A	296,089,554.12	2.14
8	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY	01157	245,254,375.49	1.77
9	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO	02601	240,792,954.06	1.74
10	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP	01339	234,601,756.77	1.69
11	SINA CORP	SINA	200,880,098.11	1.45
12	CHINA MERCHANTS BANK	03968	197,777,990.27	1.43
13	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO	QIHU	185,572,196.12	1.34
14	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	00914	181,740,780.49	1.31
15	CHINA NATIONAL BUILDING MA	03323	140,880,746.61	1.02
16	PETROCHINA CO LTD	00857	139,040,759.43	1.00
		PTR	815,199.90	0.01
17	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	01336	134,576,229.58	0.97
18	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	01169	124,182,104.12	0.90



19	BANK OF AMERICA CORP	BAC	117,447,094.27	0.85
20	SOHU.COM INC	SOHU	95,099,481.17	0.69

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。

### 8.5.3 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	10,089,073,838.10
卖出收入（成交）总额	10,356,506,326.15

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。

### 8.6 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-	333,167,839.68	2.31
BBB+至 BBB-	34,130,579.28	0.24
BB+至 BB-	59,731,797.91	0.41
B+至 B-	207,516,096.82	1.44

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。

### 8.7 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	US912828TZ38	US TREASURY N/B	314,275,000	314,299,554.36	2.18
2	USG6419EAB05	SHANGHAI INDL URBAN DEVP	56,569,500	60,639,675.54	0.42
3	XS0836493642	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	50,284,000	56,112,921.29	0.39
4	XS0460546442	PETROLEOS DE VENEZUELA S	50,284,000	47,784,885.21	0.33
5	USG9550BAA10	WEST CHINA CEMENT LTD	43,998,500	42,978,614.78	0.30

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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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	267,062,038.46	1.85
2	YUANTA/P-SHARES TAIWAN TOP 50 ETF	指数型	ETF 基金	Yuanta Securities Investment Trust	32,030,843.89	0.22
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	104,021,420.37
3	应收股利	2,826,040.63
4	应收利息	7,635,736.03
5	应收申购款	1,494,060.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	115,977,257.12

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

## §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

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
1,201,107	14,923.87	81,953,634.42	0.46%	17,843,212,156.28	99.54%

9.2 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	2,897,258.95	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。

## §10 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	270,084,429.34
减：本报告期基金总赎回份额	1,532,279,706.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	17,925,165,790.70

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

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。

2012年11月15日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可[2012]961号）；聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可[2012]1036号）。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为

190,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 6 年的审计服务。

### 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

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。

### 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
MORGAN STANLEY	-	3,744,273,842.51	18.33%	3,920,000.01	12.32%	-
MERRILL LYNCH	-	3,012,299,264.37	14.74%	3,882,429.79	12.20%	-
NOMURA	-	2,678,639,111.28	13.11%	4,847,603.08	15.23%	-
DEUTSCHE BANK	-	2,464,262,242.17	12.06%	2,359,371.57	7.41%	-
CLSA	-	1,150,336,655.81	5.63%	2,047,442.03	6.43%	-
CAPITAL SECURITIES CORP	-	1,146,452,764.06	5.61%	1,709,368.01	5.37%	-
MASTERLINK	-	872,342,214.09	4.27%	871,663.57	2.74%	-
SCOTIA CAPITAL	-	824,712,228.94	4.04%	771,553.39	2.42%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	801,120,687.13	3.92%	1,704,898.63	5.36%	-
KGI	-	732,503,433.74	3.59%	947,461.76	2.98%	-
CITIGROUP	-	447,765,655.25	2.19%	454,015.05	1.43%	-
HAITONG INTERNATION	-	349,823,229.61	1.71%	3,175,089.31	9.98%	-

AL SECURITIES						
CREDIT SUISSE	-	337,767,844.34	1.65%	405,321.41	1.27%	-
CICC	-	336,908,614.82	1.65%	421,135.81	1.32%	-
UBS	-	291,382,586.79	1.43%	365,058.14	1.15%	-
GOLDMAN SACHS	-	231,722,747.96	1.13%	347,584.12	1.09%	-
CCB INTERNATION AL SECURITIES	-	217,503,647.62	1.06%	2,175,036.48	6.83%	-
FUBON BANK	-	214,561,558.83	1.05%	258,140.97	0.81%	-
SAMSUNG SECURITIES	-	177,248,726.12	0.87%	265,872.72	0.84%	-
MACQUARIE SECURITIES	-	174,895,597.74	0.86%	262,343.40	0.82%	-
SINOPAC HOLDINGS	-	115,045,812.47	0.56%	138,122.78	0.43%	-
HSBC	-	40,378,256.48	0.20%	403,782.56	1.27%	-
YUANTA SECURITIES (HONG KONG)	-	31,519,131.25	0.15%	37,823.14	0.12%	-
OKASAN	-	18,579,396.21	0.09%	27,869.09	0.09%	-
BOCI SECURITIES	-	18,302,119.87	0.09%	27,453.18	0.09%	-

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、华融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在上述租用的券商交易单元中，华融证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。渤海证券的交易单元为本期剔除的交易单元。

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。

### 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		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	168,625,139.32	7.54%	-	-	49,303,059.65	6.82%
MERRILL LYNCH	460,288,570.49	20.58%	-	-	171,136,477.76	23.66%
NOMURA	172,392,762.17	7.71%	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK	617,144,296.38	27.59%	-	-	-	-
CAPITAL SECURITIES CORP	-	-	-	-	53,103,131.06	7.34%

MASTERLINK	-	-	-	-	44,405,419.85	6.14%
SCOTIA CAPITAL	-	-	-	-	11,537,789.78	1.60%
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	335,478,319.86	46.38%
KGI	-	-	-	-	57,063,447.66	7.89%
CITIGROUP	264,505,265.92	11.83%	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	42,595,880.50	1.90%	-	-	-	-
UBS	67,212,468.26	3.01%	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS	36,589,591.85	1.64%	-	-	-	-
FUBON BANK	-	-	-	-	1,315,717.18	0.18%
HSBC	53,117,114.04	2.37%	-	-	-	-
BOCI SECURITIES	6,255,653.52	0.28%	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL	80,150,293.97	3.58%	-	-	-	-
BNP PARIBAS	12,581,349.38	0.56%	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE CIB	12,613,993.77	0.56%	-	-	-	-
ING BANK	6,327,547.04	0.28%	-	-	-	-
J.P.MORGAN	159,174,752.85	7.12%	-	-	-	-
ROYAL BANK OF SCOTLAND	18,915,600.00	0.85%	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED BANK	58,103,138.87	2.60%	-	-	-	-

## 11.8 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
15	华夏基金管理有限公司关于设立上海联洋投资理财中心暨上海分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-07-17
16	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增河北银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-08-15
17	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	2012-08-17
18	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	2012-08-24

19	华夏基金管理有限公司关于调整中国农业银行金穗借记卡基金电子交易优惠费率的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-09-18
20	华夏基金管理有限公司关于设立北京朝外大街投资理财中心的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-09-25
21	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	2012-10-12
22	华夏基金管理有限公司关于设立青岛分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-11-08
23	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	2012-11-09
24	华夏基金管理有限公司关于设立北京东四环投资理财中心的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-11-22
25	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银行基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-11-30
26	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	2012-12-20
27	华夏基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-12-28
28	华夏基金管理有限公司关于设立华夏资本管理有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-12-31

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

1、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。

2、2012年11月15日，根据工作需要，中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

13.1.2 《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》；

13.1.3 《华夏全球精选股票型证券投资基金托管协议》；

13.1.4 法律意见书；

13.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

13.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 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。

### 13.3 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  
二〇一三年三月二十八日