

华夏全球精选股票型证券投资基金 2014 年年度报告

2014 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：二〇一五年三月三十一日

§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 2015 年 3 月 27 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（特殊普通合伙）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 2014 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.....	18
§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.....	39
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.....	51
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	53
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	53
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细.....	53
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.....	53
8.11 投资组合报告附注.....	53
§9 基金份额持有人信息.....	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	54
§10 开放式基金份额变动.....	55
§11 重大事件揭示.....	55
§12 备查文件目录.....	60

§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	11,584,766,523.94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
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.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	杨明辉	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(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 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	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	733,935,021.11	598,164,305.60	-782,434,630.12
本期利润	-719,570,331.39	1,069,685,581.29	1,555,902,349.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0527	0.0640	0.0836
本期加权平均净值利润率	-6.11%	7.93%	10.92%
本期基金份额净值增长率	-6.64%	8.57%	11.50%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	-2,128,571,836.91	-2,723,725,050.74	-3,844,053,327.25
期末可供分配基金份额利润	-0.1837	-0.1790	-0.2145
期末基金资产净值	9,456,194,687.03	13,292,514,724.06	14,433,826,481.75
期末基金份额净值	0.816	0.874	0.805
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末

基金份额累计净值增长率	-18.40%	-12.60%	-19.50%
-------------	---------	---------	---------

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	-4.90%	0.71%	0.06%	0.72%	-4.96%	-0.01%
过去六个月	-7.17%	0.62%	-2.71%	0.61%	-4.46%	0.01%
过去一年	-6.64%	0.68%	2.10%	0.56%	-8.74%	0.12%
过去三年	13.02%	0.75%	39.27%	0.69%	-26.25%	0.06%
过去五年	-0.97%	0.91%	39.30%	0.95%	-40.27%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-18.40%	1.30%	-0.30%	1.28%	-18.10%	0.02%

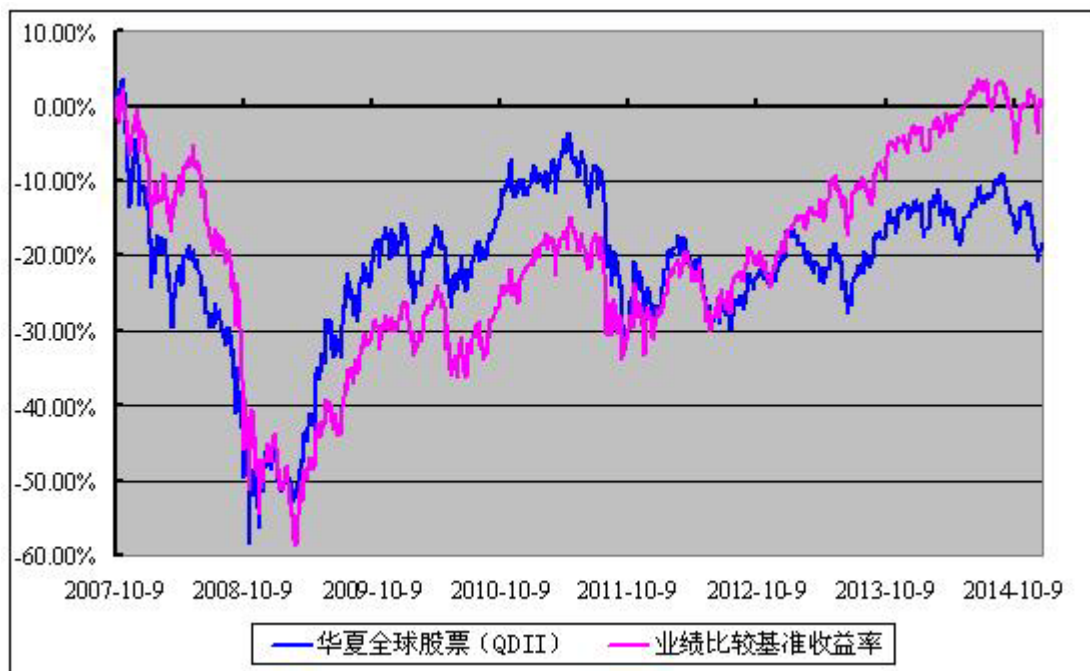
注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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2014年12月31日)

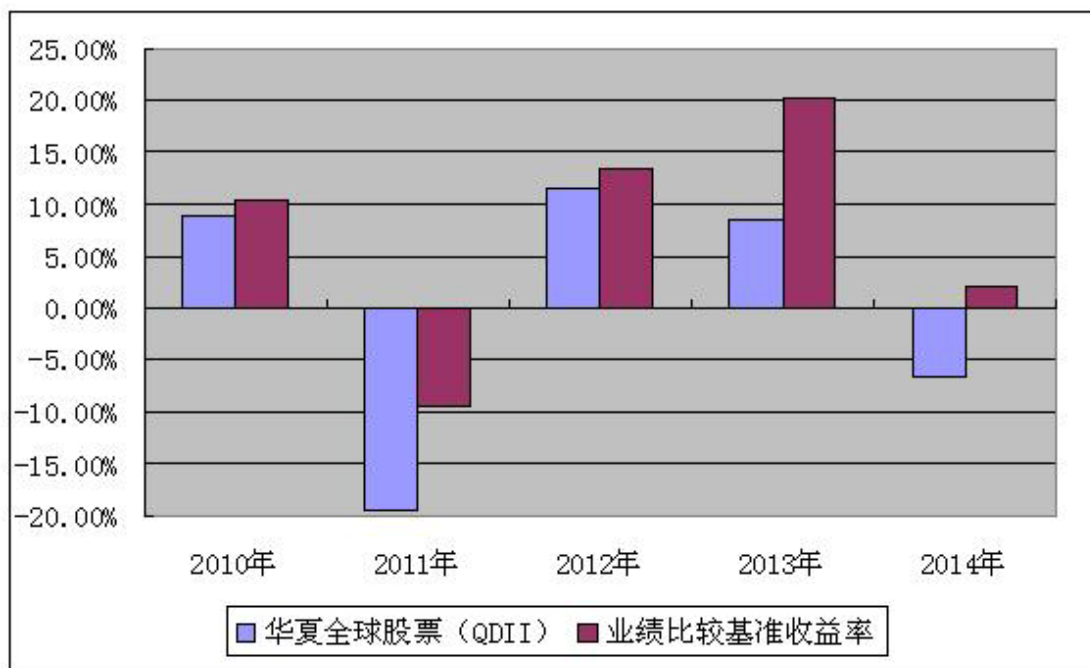


注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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

过去五年基金每年净值增长率及其与同期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。

华夏基金以深入的投资研究为基础，积极把握市场机会，尽力为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至 2014 年 12 月 31 日数据），华夏基金旗下 7 只主动管理的股票及混合基金今年以来净值增长率超过 20%，华夏蓝筹混合（LOF）在 43 只偏股型基金（股票上限 95%）中排名第 7，华夏永福养老理财混合在 10 只偏债型基金中排名第 3。固定收益类产品中，华夏基金旗下 6 只债券型基金今年以来净值增长率超过 10%，华夏亚债中国指数在 16 只指数债券型基金中排名第 4。

2014 年，在《中国证券报》主办的“第十一届中国基金业金牛奖”评选中，华夏基金荣获年度“金牛基金管理公司奖”，所管理的基金荣获 6 个单项奖；在《上海证券报》主办的“第十一届中国金基金奖”评选中，华夏基金荣获“金基金·TOP 公司大奖”，所管理的基金荣获 5 个单项奖，为获奖最多的基金公司；在《证券时报》主办的“2013 年度中国基金业明星基金奖”评选中，华夏基金荣获“五年持续回报明星基金公司奖”和“2013 年度十大明星基金公司奖”，所管理的基金荣获 3 个单项奖。

在客户服务方面，2014 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户的使用便利性和服务体验：（1）改版月度电子账单，对投资者账户持有结构的合理性给予星级评分，便于客户对账户资产进行合理配置；（2）华夏现金增利货币基金在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额变化实时可见，且可见即可用，提高投资者的交易效率；（3）与腾讯财付通合作推出微信理财

通服务，支持资金随时购买财富宝货币基金，赎回快速到账，方便投资者进行现金管理。

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、国际投资部总监、国际投资首席策略顾问	2007-10-09	-	24 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、怡富证券投资部、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、董事总经理	2007-10-09	-	14 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、国际投资部总监等。
崔强	本基金的基金经理、国际投资部副总监	2012-02-29	2014-08-05	13 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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公

开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格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

2014 年，全球经济趋势在各区域间出现分化，全球货币、财政政策宽松，股票、债券市场小幅上涨，汇率市场出现较大波动。

美国经济增长趋势保持良好，居民消费受益于低利率和低通胀，整体温和增

长，企业盈利受益于市场出清和创新，总体稳健增长。美国失业率降低至 6% 以下，劳动参与率持续回升，制造业、服务业采购经理人指数维持高位。为了保持经济回升态势，美联储没有急于表明加息倾向。

欧洲经济增长乏力，处于结构调整的阵痛中。希腊、西班牙等国家一定程度实施了财政紧缩，改革僵化的劳动力市场，法国、意大利等国则没有任何改进。欧洲央行最终被迫推出量化宽松政策，期望为结构性改革赢得一些时间，防止经济过度下滑。

日本经济复苏低于预期。以前年度的日元贬值未能明显提升日本经济，居民收入改善不多，企业投资也未大幅增加。政府因负债太高，已无法再大规模赤字。9 月日本央行加大宽松力度，推动日元再度贬值。

中国经济增速保持在“合理区间”。政府通过针对性宏观政策，刺激交通、环保、民生等领域的投资，放松对房地产的消费限制，在保持经济稳定的同时力图实现结构的逐步转型。货币政策实际上进入偏松状态。

2014 年，全球股市整体小幅上涨。美国股市在科技、医药等板块的带领下表现较好。如以美元计价，欧洲、日本股市则为负收益。中国股市在蓝筹股带领下，4 季度明显上涨。此外，全球债市也小幅上涨。受各国央行宽松政策支持，主要发达国家的国债收益率均创出历史新低。2014 年美元相对绝大多数货币升值，其中对欧元升值约 13%，对日元升值约 15%。

报告期内，本基金股票仓位保持在 75%-85% 的水平，全球投资以结构性选择为主，对美国以创新科技类、对欧洲以价值低估类、对新兴市场以稳定增长类为主要投资标的，维持了美国互联网、技术创新类企业，新兴市场医疗、新能源、消费升级等产业的投资。总体配置方向正确，但个股选择并不理想，导致组合收益率落后于业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.816 元，本报告期份额净值增长率为-6.64%，同期业绩比较基准增长率以美元计为 2.10%（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

展望 2015 年，全球经济在宽松货币政策的支持下将能稳定运行。鉴于全球

经济增长动力不强，物价压力也不大，预计全球货币政策仍将以宽松为主。考虑到美元相对大多数货币明显升值，相当于对美国实施了一定程度的紧缩政策，预计美联储加息的时点将后移。日本、欧洲央行为了缓和主权债务压力，促进经济复苏，为结构性改革赢得时间，仍将维持量化宽松政策。中国为了保持经济在合理区间运行，也必然进一步实施宽松货币政策。

全球经济区域间增长趋势将存在显著差异。美元升值会减缓美国经济增长步伐，原油价格大跌也会影响美国就业。而欧元、日元的大幅贬值，对该区域的竞争力将有所帮助。汇率变动将促进国际经济实现再平衡。

资本市场的流动性已非常宽裕，日本、欧洲的主权债务利率已经反映了通缩预期。资本市场如果看到欧洲、日本的结构性改革取得明显突破，中国的体制改革、结构调整取得实质性进展，才能形成全球经济再次健康持续增长的预期，否则，全球股市难以出现整体持续的上涨。

基于上述分析，我们一方面将关注欧洲、日本、中国的改革突破，另一方面仍将重点关注增长持续性好，估值不贵的子行业和公司。挖掘符合社会发展趋势的行业、公司，在合理估值水平下进行投资，仍是我们的主要投资策略。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司修订法律监察工作管理制度、通信工具管理制度、员工投资行为管理制度、权限管理制度等多项制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，定期进行合规考试，不断提升员工的合规守法意识；积极参与各项业务的合规性管理，对信息披露文件、各类宣传推介材料进行合规性审查，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司实行全员风险管理，制定出台了风险管理制度、风险管理委员会管理办法、基金流动性风险管理制度等各项风险管理制度，加强风险控制制度建设，特别是投资风险控制，完善控制机制，提高员工的风险管理意识。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究等关键业务和重点岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健

经营。

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，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、法律监察工作负责人及基金会计工作负责人等。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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有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(2015)第 20244 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 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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（特殊普通合伙） 注册会计师 许康玮 洪磊
上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
2015 年 3 月 6 日

§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：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,532,070,552.18	1,681,526,228.83
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	7,908,133,378.61	11,635,452,202.21
其中：股票投资		7,856,445,169.85	11,254,361,254.78
基金投资		51,688,208.76	381,090,947.43
债券投资		-	-
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		70,574,835.64	21,780,717.92

应收利息	7.4.7.5	55,870.12	58,340.92
应收股利		3,315,963.79	3,436,885.20
应收申购款		1,120,443.77	544,658.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,515,271,044.11	13,342,799,033.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	-
应付赎回款		40,643,387.62	25,260,301.91
应付管理人报酬		15,208,269.62	20,733,061.70
应付托管费		2,877,240.19	3,922,471.14
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	347,459.65	368,475.11
负债合计		59,076,357.08	50,284,309.86
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	11,584,766,523.94	15,213,410,467.95
未分配利润	7.4.7.10	-2,128,571,836.91	-1,920,895,743.89
所有者权益合计		9,456,194,687.03	13,292,514,724.06
负债和所有者权益总计		9,515,271,044.11	13,342,799,033.92

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.816 元，基金份额总额 11,584,766,523.94 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
一、收入		-416,477,923.63	1,406,609,067.99
1.利息收入		1,733,138.71	6,077,234.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,594,058.99	1,881,436.43
债券利息收入		139,079.72	3,527,656.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	668,142.05
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,030,109,414.70	1,003,816,894.69
其中：股票投资收益	7.4.7.12	780,736,826.85	714,959,706.61
基金投资收益	7.4.7.13	96,925,263.45	2,100,687.04
债券投资收益	7.4.7.14	5,840,846.85	28,263,543.18
资产支持证券投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	1,235,944.78	4,450,545.11
股利收益	7.4.7.17	145,370,532.77	254,042,412.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-1,453,505,352.50	471,521,275.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,160,872.07	-77,728,276.60
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	4,024,003.39	2,921,939.55
减：二、费用		303,092,407.76	336,923,486.70
1.管理人报酬		217,740,030.23	250,061,678.65
2.托管费		41,194,059.82	47,308,966.33
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	42,986,766.87	37,601,675.38
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.21	1,171,550.84	1,951,166.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-719,570,331.39	1,069,685,581.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-719,570,331.39	1,069,685,581.29

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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	15,213,410,467.95	-1,920,895,743.89	13,292,514,724.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-719,570,331.39	-719,570,331.39
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）	-3,628,643,944.01	511,894,238.37	-3,116,749,705.64
其中：1.基金申购款	119,371,430.68	-17,143,300.37	102,228,130.31
2.基金赎回款	-3,748,015,374.69	529,037,538.74	-3,218,977,835.95
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）	11,584,766,523.94	-2,128,571,836.91	9,456,194,687.03
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	17,925,165,790.70	-3,491,339,308.95	14,433,826,481.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,069,685,581.29	1,069,685,581.29
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）	-2,711,755,322.75	500,757,983.77	-2,210,997,338.98
其中：1.基金申购款	156,337,851.54	-30,093,160.61	126,244,690.93
2.基金赎回款	-2,868,093,174.29	530,851,144.38	-2,337,242,029.91
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）	15,213,410,467.95	-1,920,895,743.89	13,292,514,724.06

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>杨明辉</u>	<u>汪贵华</u>	<u>汪贵华</u>
基金管理人负责人	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 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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收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 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
活期存款	1,532,070,552.18	1,681,526,228.83
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	1,532,070,552.18	1,681,526,228.83

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,366,445,324.44	7,856,445,169.85	-510,000,154.59
债券			
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	OTC 市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		53,431,548.01	51,688,208.76	-1,743,339.25
其他		-	-	-
合计		8,419,876,872.45	7,908,133,378.61	-511,743,493.84
项目		上年度末 2013年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		10,386,946,827.86	11,254,361,254.78	867,414,426.92
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	OTC 市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		306,743,515.69	381,090,947.43	74,347,431.74
其他		-	-	-
合计		10,693,690,343.55	11,635,452,202.21	941,761,858.66

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	55,870.12	58,340.92
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	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	55,870.12	58,340.92

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	153,175.65	95,199.11
预提费用	190,000.00	270,000.00
其他	4,284.00	3,276.00
合计	347,459.65	368,475.11

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,213,410,467.95	15,213,410,467.95
本期申购	119,371,430.68	119,371,430.68
本期赎回（以“-”号填列）	-3,748,015,374.69	-3,748,015,374.69
本期末	11,584,766,523.94	11,584,766,523.94

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	-2,723,725,050.74	802,829,306.85	-1,920,895,743.89
本期利润	733,935,021.11	-1,453,505,352.50	-719,570,331.39
本期基金份额交易产生的变动数	535,627,863.46	-23,733,625.09	511,894,238.37

其中：基金申购款	-18,025,413.46	882,113.09	-17,143,300.37
基金赎回款	553,653,276.92	-24,615,738.18	529,037,538.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,454,162,166.17	-674,409,670.74	-2,128,571,836.91

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,593,948.47	1,877,321.57
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	0.32	3,990.78
其他	110.20	124.08
合计	1,594,058.99	1,881,436.43

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	10,153,481,574.93	8,993,520,118.62
减：卖出股票成本总额	9,372,744,748.08	8,278,560,412.01
买卖股票差价收入	780,736,826.85	714,959,706.61

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	633,360,697.52	76,638,139.12
减：卖出/赎回基金成本总额	536,435,434.07	74,537,452.08
基金投资收益	96,925,263.45	2,100,687.04

7.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券	468,797,755.05	641,868,311.91

到期兑付)成交总额		
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	462,818,232.45	606,927,586.81
减: 应收利息总额	138,675.75	6,677,181.92
买卖债券差价收入	5,840,846.85	28,263,543.18

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
卖出权证成交总额	1,235,944.78	4,450,545.11
减: 卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	1,235,944.78	4,450,545.11

注: 本项包含权证行权产生的差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	144,624,961.04	253,366,686.77
基金投资产生的股利收益	745,571.73	675,725.98
合计	145,370,532.77	254,042,412.75

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
1.交易性金融资产	-1,453,505,352.50	471,521,275.69
——股票投资	-1,377,414,581.51	438,456,796.83
——债券投资	-	-27,618,726.88
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	-76,090,770.99	60,683,205.74
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——远期投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-1,453,505,352.50	471,521,275.69

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
基金赎回费收入	4,024,003.39	2,921,785.87
其他	-	153.68
合计	4,024,003.39	2,921,939.55

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。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
交易所市场交易费用	42,986,766.87	37,601,675.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	42,986,766.87	37,601,675.38

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013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	24,816.27	84,047.21
银行费用	48,836.33	56,510.80
其他	827,898.24	1,540,608.33
合计	1,171,550.84	1,951,166.34

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	基金境外托管人
中信证券股份有限公司	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
中信证券国际有限公司	基金管理人股东控股的公司

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2014 年 2 月 12 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、山东省农村经济开发投资公司（比例 10%）、POWER CORPORATION OF CANADA（出资比例 10%）、青岛海鹏科技投资有限公司（出资比例 10%）、南方工业资产管理有限责任公司（出资比例 7.8%）。

②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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券国际有限公司	53,958,900.29	0.31%	51,683,670.78	0.31%

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

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回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券国际有限公司	64,748.84	0.24%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券国际有限公司	62,020.40	0.29%	-	-

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	217,740,030.23	250,061,678.65
其中：支付销售机构的客户维护费	28,608,471.99	36,367,577.09

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的托管费	41,194,059.82		47,308,966.33

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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
中国建设银行活期存款	359,095,323.53	1,528,031.61	271,258,580.21	1,822,537.53
摩根大通银行活期存款	1,172,975,228.65	65,916.86	1,410,267,648.62	54,784.04

注：本基金的活期银行存款分别由基金托管人中国建设银行和基金境外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（2014 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
02222	雷士照明控股有限公司	2014-08-11	待向市场通报所有相关信息	1.39	-	-	49,791,000	72,607,893.68	69,140,359.86	-

注：期末估值单价为外币价格按照期末估值汇率折算为人民币的价格。

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 2014 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 2014 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。截止本期末，本基金未持有债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,532,070,552.18	-	-	1,532,070,552.18
结算备付金	-	-	-	-

结算保证金	-	-	-	-
债券投资	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	122,334.75	-	-	122,334.75
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,681,526,228.83	-	-	1,681,526,228.83
结算备付金	-	-	-	-
结算保证金	-	-	-	-
债券投资	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	37,179.88	-	-	37,179.88
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 (2014 年 12 月 31 日)	上年度末 (2013 年 12 月 31 日)
	利率下降 25 个基点	-	-
	利率上升 25 个基点	-	-

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 2014 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	617,483,924.80	367,933,357.40	187,562,565.39	1,172,979,847.59
交易性金融资产	3,063,110,646.36	3,801,145,149.16	1,043,877,583.09	7,908,133,378.61
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	464,605.08	68,776,419.81	1,333,810.75	70,574,835.64
应收利息	339.97	3,705.92	-	4,045.89
应收股利	2,625,467.15	-	690,496.64	3,315,963.79
其他资产	-	-	-	-
资产合计	3,683,684,983.36	4,237,858,632.29	1,233,464,455.87	9,155,008,071.52
以外币计价的负债	-	-	-	-
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2013 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	429,027,254.15	868,506,596.79	173,704,188.89	1,471,238,039.83
交易性金融资产	4,628,632,938.84	5,374,452,961.03	1,632,366,302.34	11,635,452,202.21
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	814,007.59	20,966,710.33	21,780,717.92
应收利息	84.69	4,826.72	-	4,911.41
应收股利	1,264,042.84	180,058.77	1,738,713.59	3,182,815.20
其他资产	-	-	-	-
资产合计	5,058,924,320.52	6,243,958,450.90	1,828,775,915.15	13,131,658,686.57
以外币计价的负债	-	-	-	-
应付在途资金	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付换汇款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	457,750,403.58	656,582,934.33
所有外币相对人民币贬值 5%	-457,750,403.58	-656,582,934.33	

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 2014 年 12 月 31 日		上年度末 2013 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	7,856,445,169.85	83.08	11,254,361,254.78	84.67
交易性金融资产-基金投资	51,688,208.76	0.55	381,090,947.43	2.87
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	7,908,133,378.61	83.63	11,635,452,202.21	87.53

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 (2014 年 12 月 31 日)	上年度末 (2013 年 12 月 31 日)

	+5%	236,439,717.39	497,836,670.11
	-5%	-236,439,717.39	-497,836,670.11

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次：

第一层次：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。

第二层次：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。

第三层次：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 各层次金融工具公允价值

截至 2014 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次的余额为 7,908,133,378.61 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2013 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 11,635,452,202.21 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。）

7.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

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次未发生重大变动。

7.4.14.4 第三层次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次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	7,856,445,169.85	82.57
	其中：普通股	6,267,913,929.50	65.87
	存托凭证	1,587,760,069.74	16.69
2	基金投资	51,688,208.76	0.54
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,532,070,552.18	16.10
8	其他各项资产	75,067,113.32	0.79
9	合计	9,515,271,044.11	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	3,801,145,149.16	40.20
美国	2,796,185,131.19	29.57
中国台湾	386,979,671.02	4.09
英国	280,100,142.75	2.96
韩国	163,983,916.23	1.73
新加坡	107,718,791.87	1.14
马来西亚	86,237,167.44	0.91
德国	84,457,914.66	0.89
印度尼西亚	55,411,895.31	0.59
泰国	47,759,362.21	0.51
加拿大	32,229,841.34	0.34
印度	14,123,454.94	0.15
菲律宾	112,731.73	0.00
合计	7,856,445,169.85	83.08

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	1,854,838,167.07	19.62
信息技术	1,545,311,900.54	16.34
工业	1,024,075,277.07	10.83
公用事业	790,831,754.91	8.36
能源	751,569,516.93	7.95
金融	742,562,316.13	7.85
保健	456,764,054.84	4.83
材料	344,610,907.77	3.64
必需消费品	304,661,905.80	3.22
电信服务	41,219,368.79	0.44
合计	7,856,445,169.85	83.08

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	IMAX CORP	-	IMAX	纽约	美国	3,045,896	575,909,182.60	6.09
2	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	北京控股有限 公司	00392	香港	中国 香港	5,995,500	287,605,446.16	3.04
3	GREAT WALL MOTOR COMPANY	长城汽车股份 有限公司	02333	香港	中国 香港	7,135,000	248,256,533.00	2.63
4	CGN POWER CO LTD	中国广核电力 股份有限公司	01816	香港	中国 香港	83,415,000	221,790,108.87	2.35
5	ICICI BANK LTD	-	IBN	纽约	美国	3,054,000	215,839,770.31	2.28
6	YY INC	-	YY	纳斯达克	美国	529,800	202,096,692.12	2.14
7	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO	-	QIHU	纽约	美国	480,438	168,332,954.99	1.78
8	CHINA LONGYUAN POWER GROUP	龙源电力集团 股份有限公司	00916	香港	中国 香港	26,149,000	166,493,291.37	1.76
9	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	2,572,000	160,514,979.20	1.70

10	CHINA FOODS LTD	中国食品有限公司	00506	香港	中国香港	70,598,000	148,720,822.41	1.57
11	PHOENIX HEALTHCARE GROUP CO	凤凰医疗集团有限公司	01515	香港	中国香港	12,567,000	141,786,790.42	1.50
12	YOUKU TUDOU INC	-	YOKU	纽约	美国	1,285,000	140,038,516.16	1.48
13	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC	株洲南车时代电气股份有限公司	03898	香港	中国香港	3,100,000	110,674,710.97	1.17
14	ROSNEFT OJSC	-	ROSN	伦敦国际金融期货期权	英国	5,000,300	107,394,893.31	1.14
15	YANDEX NV	-	YNDX	纳斯达克	美国	919,700	101,072,491.63	1.07
16	NEW ORIENTAL EDUCATION	-	EDU	纽约	美国	800,600	99,985,965.28	1.06
17	CHINA MACHINERY ENGINEERIN	中国机械设备工程股份有限公司	01829	香港	中国香港	21,267,000	99,669,159.32	1.05
18	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD	中国民航信息网络股份有限公司	00696	香港	中国香港	14,660,000	96,927,298.39	1.03
19	BEIJING JINGNENG CLEAN ENE	北京京能清洁能源电力股份有限公司	00579	香港	中国香港	36,008,000	95,740,792.90	1.01
20	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	石药集团有限公司	01093	香港	中国香港	17,080,000	92,174,775.21	0.97
21	BANYAN TREE HOLDINGS LTD	-	BTH	新加坡	新加坡	32,783,000	88,564,436.35	0.94
22	AIRASIA BHD	-	AIRA	马来西亚	马来西亚	18,116,700	86,237,167.44	0.91
23	AIXTRON SE	-	AIXA	德国	德国	1,217,304	84,457,914.66	0.89
24	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	银泰商业(集团)有限公司	01833	香港	中国香港	18,698,500	82,910,818.65	0.88
25	BAIDU INC	-	BIDU	纳斯达克	美国	58,600	81,743,978.00	0.86
26	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP	华电福新新能源股份有限公司	00816	香港	中国香港	26,582,000	76,550,606.73	0.81
27	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速传动设备集团有限公司	00658	香港	中国香港	18,893,000	71,997,294.09	0.76
28	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG	上海实业控股有限公司	00363	香港	中国香港	3,884,000	71,247,609.51	0.75

	LTD							
29	NVC LIGHTING HOLDINGS LTD	雷士照明控股有限公司	02222	香港	中国香港	49,791,000	69,140,359.86	0.73
30	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	华润电力控股有限公司	00836	香港	中国香港	4,184,000	66,022,169.41	0.70
31	ALIBABA GROUP HOLDING	-	BABA	纽约	美国	101,200	64,364,096.63	0.68
32	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易及结算有限公司	00388	香港	中国香港	467,500	63,331,537.20	0.67
33	TAL EDUCATION GROUP	-	XRS	纽约	美国	351,200	60,365,207.75	0.64
34	SINA CORP	-	SINA	纳斯达克	美国	261,300	59,814,650.73	0.63
35	CHINA MERCHANTS CHINA DIRECT	招商局中国基金有限公司	00133	香港	中国香港	5,249,475	57,570,339.58	0.61
36	BBMG CORP	北京金隅股份有限公司	02009	香港	中国香港	11,000,000	56,325,557.77	0.60
37	AVICHINA INDUSTRY & TECH	中国航空科技工业股份有限公司	02357	香港	中国香港	14,872,000	56,204,748.56	0.59
38	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	华润燃气控股有限公司	01193	香港	中国香港	3,500,000	55,643,086.73	0.59
39	SOTHEBY'S	-	BID	纽约	美国	204,000	53,900,557.68	0.57
40	CHINA CINDA ASSET MANAGEME	中国信达资产管理股份有限公司	01359	香港	中国香港	18,000,000	53,682,461.84	0.57
41	MONSANTO CO	-	MON	纽约	美国	71,000	51,903,622.03	0.55
42	LUKOIL OAO	-	LKOD	伦敦国际金 融期货期 权	英国	196,100	47,757,448.82	0.51
43	HYUNDAI MOTOR CO	-	005380	韩国	韩国	49,900	47,298,520.52	0.50
44	CTRIIP.COM INTERNATIONAL	-	CTRP	纳斯达克	美国	165,800	46,161,124.10	0.49
45	EXXON MOBIL CORP	-	XOM	纽约	美国	80,000	45,256,124.00	0.48
46	ANADARKO PETROLEUM CORP	-	APC	纽约	美国	88,000	44,423,940.00	0.47
47	CHEVRON CORP	-	CVX	纽约	美国	64,000	43,931,482.88	0.46
48	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	-	OXY	纽约	美国	88,958	43,878,763.90	0.46
49	MAIL.RU GROUP	-	MAIL	伦敦国际金	英国	433,677	43,254,813.88	0.46

				融期货期 权				
50	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾积体电路 制造股份有限 公司	2330	台湾	中国 台湾	1,580,000	43,063,198.01	0.46
51	SYNUTRA INTERNATIONAL INC	-	SYUT	纳斯达克	美国	1,152,674	42,883,530.21	0.45
52	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗科学 有限公司	00853	香港	中国 香港	16,494,000	42,554,144.30	0.45
53	CHINA MING YANG WIND POW	-	MY	纽约	美国	3,136,300	42,028,333.14	0.44
54	NCISOFT CORP	-	036570	韩国	韩国	41,085	41,938,702.04	0.44
55	MINDRAY MEDICAL INTL LTD	-	MR	纽约	美国	256,200	41,386,957.92	0.44
56	GAZPROM OAO	-	OGZD	伦敦国际金 融期货期 权	英国	1,344,000	38,241,302.40	0.40
57	SCHLUMBERGER LTD	-	SLB	纽约	美国	73,000	38,151,536.67	0.40
58	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	-	005930	韩国	韩国	5,076	37,779,207.41	0.40
59	XIABUXIABU CATERING MANAGEME	呷哺呷哺餐饮 管理(中国)控股 有限公司	00520	香港	中国 香港	10,000,000	37,634,530.12	0.40
60	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安国际 控股有限公司	01788	香港	中国 香港	7,806,600	36,339,760.27	0.38
61	GOODBABY INTERNATIONAL HOLDI	好孩子国际控 股有限公司	01086	香港	中国 香港	16,810,000	35,809,610.46	0.38
62	SINO BIOPHARMACEUTI CAL	中国生物制药 有限公司	01177	香港	中国 香港	6,428,000	35,653,265.41	0.38
63	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	-	MAJOR	泰国	泰国	6,845,100	35,306,431.28	0.37
64	SINOPEC ENGINEERING GROUP	中石化炼化工 程(集团)股份有 限公司	02386	香港	中国 香港	8,400,000	34,727,913.58	0.37
65	EOG RESOURCES INC	-	EOG	纽约	美国	61,000	34,365,956.13	0.36
66	GEELY	吉利汽车控股	00175	香港	中国	17,540,000	34,181,778.96	0.36

	AUTOMOBILE HOLDINGS LT	有限公司			香港			
67	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	中国联合网络通信(香港)股份有限公司	00762	香港	中国香港	4,000,000	32,821,728.58	0.35
68	COSCO INTERNATIONAL HOLDINGS	中远国际控股有限公司	00517	香港	中国香港	12,702,000	31,768,703.38	0.34
69	HALLIBURTON CO	-	HAL	纽约	美国	130,000	31,285,835.10	0.33
70	SUNCOR ENERGY INC	-	SU	纽约	美国	100,000	19,446,182.00	0.21
70	SUNCOR ENERGY INC	-	SU	多伦多	加拿大	60,000	11,695,527.40	0.12
71	HOLCIM INDONESIA TBK PT	-	SMCB	印度尼西亚	印度尼西亚	28,652,500	30,926,399.96	0.33
72	CANADIAN NATURAL RESOURCES	-	CNQ	纽约	美国	162,000	30,610,664.64	0.32
73	SUNFONDA GROUP HOLDINGS LTD	新丰泰集团控股有限公司	01771	香港	中国香港	10,730,000	30,476,868.55	0.32
74	NOBLE ENERGY INC	-	NBL	纽约	美国	104,000	30,183,313.68	0.32
75	CHINA SANJIANG FINE CHEMICAL	中国三江精细化工有限公司	02198	香港	中国香港	15,378,000	30,089,824.62	0.32
76	CHEIL WORLDWIDE INC	-	030000	韩国	韩国	310,330	29,937,292.08	0.32
77	CHINA PACIFIC INSURANCE GR	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	02601	香港	中国香港	930,600	28,928,598.18	0.31
78	HARBIN ELECTRIC CO LTD	哈尔滨电气股份有限公司	01133	香港	中国香港	7,476,000	28,607,450.19	0.30
79	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	-	DD	纽约	美国	63,000	28,503,648.18	0.30
80	APACHE CORP	-	APA	纽约	美国	73,892	28,335,936.43	0.30
81	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY	新天绿色能源股份有限公司	00956	香港	中国香港	21,700,000	27,735,938.62	0.29
82	HESS CORP	-	HES	纽约	美国	61,000	27,553,979.38	0.29
83	HUADIAN POWER INTL CORP	华电国际电力股份有限公司	01071	香港	中国香港	5,000,000	26,825,451.24	0.28
84	AIRMEDIA GROUP INC	-	AMCN	纳斯达克	美国	1,676,300	26,258,636.03	0.28
85	BYD ELECTRONIC	比亚迪电子(国	00285	香港	中国	4,278,500	25,317,505.84	0.27

	INTL CO LTD	际)有限公司			香港			
86	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气有限公司	01083	香港	中国香港	4,000,000	24,805,652.56	0.26
87	ACE HARDWARE INDONESIA	-	ACES	印度尼西亚	印度尼西亚	60,195,500	23,342,592.51	0.25
88	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	上银科技股份有限公司	2049	台湾	中国台湾	450,000	23,050,930.79	0.24
89	KINDER MORGAN INC	-	KMI	纽约	美国	89,000	23,041,645.21	0.24
90	SINOSOFT TECHNOLOGY GROUP LT	中国擎天软件科技集团有限公司	01297	香港	中国香港	9,248,000	22,692,185.71	0.24
91	BEIJING CAPITAL LAND LTD	首创置业股份有限公司	02868	香港	中国香港	9,000,000	20,876,512.94	0.22
92	WUXI PHARMATECH CAYMAN	-	WX	纽约	美国	100,000	20,602,673.00	0.22
93	SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DE	上海实业城市开发集团有限公司	00563	香港	中国香港	20,000,000	20,355,783.59	0.22
94	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	5,047,000	20,308,207.86	0.21
95	TECHNOVATOR INTERNATIONAL LT	同方泰德国际科技有限公司	01206	香港	中国香港	8,300,000	20,300,554.72	0.21
96	MAKEMYTRIP LTD	-	MMYT	纳斯达克	美国	126,500	20,117,650.47	0.21
97	HUANENG RENEWABLES CORP	华能新能源股份有限公司	00958	香港	中国香港	9,924,000	19,652,988.33	0.21
98	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力国际发展有限公司	02380	香港	中国香港	6,205,000	19,239,884.27	0.20
99	ANGANG STEEL CO LTD	鞍钢股份有限公司	00347	香港	中国香港	3,588,000	18,683,768.99	0.20
100	NETEASE INC	-	NTES	纳斯达克	美国	30,700	18,623,776.16	0.20
101	WISDOM HOLDINGS GROUP	智美控股集团	01661	香港	中国香港	5,237,000	18,593,588.14	0.20
102	LENOVO GROUP LTD	联想集团有限公司	00992	香港	中国香港	2,286,000	18,396,894.46	0.19
103	CHINA LILANG LTD	中国利郎有限公司	01234	香港	中国香港	4,751,000	18,292,496.12	0.19

104	CHINA DATANG CORP RENEWABL	中国大唐集团 新能源股份有 限公司	01798	香港	中国 香港	22,233,000	18,067,722.50	0.19
105	REXLOT HOLDINGS LTD	御泰中彩控股 有限公司	00555	香港	中国 香港	35,975,000	17,881,727.45	0.19
106	FMC CORP	-	FMC	纽约	美国	50,000	17,448,328.50	0.18
107	AGRIUM INC	-	AGU	纽约	美国	30,000	17,387,750.40	0.18
108	HISENSE KELON ELEC HLD	海信科龙电器 股份有限公司	00921	香港	中国 香港	3,198,000	17,283,717.13	0.18
109	POLY CULTURE GROUP CORP	保利文化集团 股份有限公司	03636	香港	中国 香港	910,000	17,159,609.97	0.18
110	BHP BILLITON PLC	-	BLT	伦敦	英国	128,577	17,033,011.98	0.18
111	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限 公司	00700	香港	中国 香港	191,000	16,953,290.69	0.18
112	EPISTAR CORP	晶元光电股份 有限公司	2448	台湾	中国 台湾	1,388,000	16,876,026.19	0.18
113	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	中国正通汽车 服务控股有限 公司	01728	香港	中国 香港	6,136,000	16,702,157.13	0.18
114	QIWI PLC-SPONSORED	-	QIWI	纳斯达克	美国	132,000	16,307,624.52	0.17
115	TIANJIN ZHONG XIN PHARM CO	-	TIAN	新加坡	新加 坡	2,823,000	16,237,500.78	0.17
116	TAOMEI HOLDINGS LTD	-	TAOM	纽约	美国	768,495	16,223,352.12	0.17
117	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药有限 公司	00570	香港	中国 香港	4,546,000	16,068,508.41	0.17
118	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	雅居乐地产控 股有限公司	03383	香港	中国 香港	4,618,000	16,067,956.12	0.17
119	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	福寿园国际集 团有限公司	01448	香港	中国 香港	5,200,000	15,344,158.11	0.16
120	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力国际 有限公司	00819	香港	中国 香港	9,280,000	15,082,846.66	0.16
121	SINOTRANS LIMITED	中国外运股份 有限公司	00598	香港	中国 香港	3,690,000	15,051,681.79	0.16
122	PLAYMATES TOYS LTD	彩星玩具有限 公司	00869	香港	中国 香港	10,784,000	14,889,703.41	0.16
123	BAKER HUGHES INC	-	BHI	纽约	美国	43,000	14,752,970.19	0.16
124	WEI CHUAN FOODS	味全食品工业 股份有限公司	1201	台湾	中国 台湾	3,000,000	14,497,440.75	0.15
125	PETROLEO BRASIL	-	PBR/A	纽约	美国	304,900	14,141,877.90	0.15

126	APOLLO TYRES LTD	-	APTY	印度	印度	651,900	14,123,454.94	0.15
127	EURASIA DRILLIN	-	EDCL	伦敦国际金 融期货期 权	英国	128,900	14,039,555.98	0.15
128	AUSTAR LIFESCIENCES LTD	奥星生命科技 有限公司	06118	香港	中国 香港	8,000,000	13,128,691.43	0.14
129	DAQO NEW ENERGY CORP	-	DQ	纽约	美国	80,585	12,988,243.86	0.14
130	FMC TECHNOLOGIES INC	-	FTI	纽约	美国	45,000	12,897,628.20	0.14
131	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	海尔电器集团 有限公司	01169	香港	中国 香港	875,000	12,744,061.80	0.13
132	INNOLUX CORP	群创光电股份 有限公司	3481	台湾	中国 台湾	4,280,000	12,740,737.53	0.13
133	CHINA TIANYI HOLDINGS LTD	中国天溢控股 有限公司	00756	香港	中国 香港	18,164,000	12,611,370.49	0.13
134	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	-	FM	多伦多	加拿 大	143,000	12,471,689.93	0.13
135	BG GROUP PLC	-	BG/	伦敦	英国	150,000	12,379,116.38	0.13
136	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	中华开发金融 控股股份有限 公司	2883	台湾	中国 台湾	6,318,000	12,334,770.53	0.13
137	PW MEDTECH GROUP LTD	普华和顺集团 公司	01358	香港	中国 香港	4,500,000	12,319,982.97	0.13
138	LIANHUA SUPERMARKET HLDGS	联华超市股份 有限公司	00980	香港	中国 香港	3,999,000	12,273,519.71	0.13
139	TONG YANG INDUSTRY	东阳实业厂股 份有限公司	1319	台湾	中国 台湾	1,730,000	12,256,039.76	0.13
140	SOUFUN HOLDINGS LTD	-	SFUN	纽约	美国	264,500	11,960,533.95	0.13
141	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	永丰金融控股 股份有限公司	2890	台湾	中国 台湾	4,450,014	11,182,394.48	0.12
142	SERCOMM CORPORATION	中磊电子股份 有限公司	5388	台湾	中国 台湾	808,000	11,167,281.96	0.12
143	TECK RESOURCES LTD	-	TCK	纽约	美国	130,000	10,850,210.80	0.11
144	21VIANET GROUP INC	-	VNET	纳斯达克	美国	113,900	10,781,879.93	0.11

145	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD	东风汽车集团股份有限公司	00489	香港	中国香港	1,200,000	10,395,651.34	0.11
146	SHANDONG 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	2,072,000	10,233,688.73	0.11
147	FREEPORT-MCMORAN INC	-	FCX	纽约	美国	70,000	10,005,788.80	0.11
148	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	日月光半导体制造股份有限公司	2311	台湾	中国台湾	1,336,000	9,839,239.07	0.10
149	AU OPTRONICS CORP	友达光电股份有限公司	2409	台湾	中国台湾	3,080,000	9,644,857.38	0.10
150	PERFECT WORLD CO	-	PWRD	纳斯达克	美国	100,000	9,643,544.00	0.10
151	SHANGHAI JINJIANG INTL HO	上海锦江国际酒店(集团)股份有限公司	02006	香港	中国香港	4,912,000	9,611,212.03	0.10
152	NAN YA PLASTICS CORP	南亚塑料工业股份有限公司	1303	台湾	中国台湾	750,000	9,495,823.69	0.10
153	COSMO LADY CHINA HOLDINGS CO	都市丽人(中国)控股有限公司	02298	香港	中国香港	2,230,000	9,325,000.24	0.10
154	BIOTEQUE CORPORATION	邦特生物科技股份有限公司	4107	台湾	中国台湾	700,000	9,201,042.40	0.10
155	HON HAI PRECISION INDUSTRY	鸿海精密工业股份有限公司	2317	台湾	中国台湾	538,760	9,154,071.46	0.10
156	DONGJIANG ENVIRONMENTAL	东江环保股份有限公司	00895	香港	中国香港	424,200	9,086,750.79	0.10
157	UNITED MICROELECTRONICS CORP	联华电子股份有限公司	2303	台湾	中国台湾	3,180,000	9,066,699.45	0.10
158	FORMOSA PLASTICS CORP	台湾塑料工业股份有限公司	1301	台湾	中国台湾	648,000	9,056,145.31	0.10
159	TIANJIN DEVELOPMENT HLDGS LT	天津发展控股有限公司	00882	香港	中国香港	2,000,000	9,041,755.04	0.10
160	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	光宝科技股份有限公司	2301	台湾	中国台湾	1,275,000	8,971,016.34	0.09
161	CATHAY FINANCIAL	国泰金融控股股份有限公司	2882	台湾	中国台湾	960,000	8,712,381.99	0.09

	HOLDING CO							
162	ADVANCED INFO SERVICE PCL	-	ADVANC	泰国	泰国	180,000	8,397,640.21	0.09
163	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	中美矽晶制品股份有限公司	5483	台湾	中国台湾	780,000	8,337,768.12	0.09
164	PHOENIX NEW MEDIA LTD	-	FENG	纽约	美国	163,700	8,323,963.29	0.09
165	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	富邦金融控股股份有限公司	2881	台湾	中国台湾	845,000	8,281,228.11	0.09
166	TSUI WAH HOLDINGS LTD	翠华控股有限公司	01314	香港	中国香港	3,784,000	8,210,166.05	0.09
167	BAYTEX ENERGY CORP	-	BTE	多伦多	加拿大	79,000	8,062,624.01	0.09
168	INVENTEC CORP	英业达股份有限公司	2356	台湾	中国台湾	1,865,000	7,696,739.62	0.08
169	EVERGREEN MARINE CORP LTD	长荣海运股份有限公司	2603	台湾	中国台湾	1,775,000	7,685,576.59	0.08
170	TECO ELECTRIC & MACHINERY	东元电机股份有限公司	1504	台湾	中国台湾	1,300,000	7,576,362.54	0.08
171	GUANGZHOU R&F PROPERTIES	广州富力地产股份有限公司	02777	香港	中国香港	1,000,000	7,487,456.83	0.08
172	KINSUS INTERCONNECT TECH	景硕科技股份有限公司	3189	台湾	中国台湾	366,000	7,463,862.40	0.08
173	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	中国人寿保险股份有限公司	2823	台湾	中国台湾	1,400,500	7,119,818.80	0.08
174	YANG MING MARINE TRANSPORT	阳明海运股份有限公司	2609	台湾	中国台湾	2,165,000	7,051,603.51	0.07
175	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	-	086280	韩国	韩国	4,300	7,030,194.18	0.07
176	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团有限公司	00546	香港	中国香港	2,608,000	6,893,194.19	0.07
177	GREENLAND HONG KONG HOLDINGS	绿地香港控股有限公司	00337	香港	中国香港	2,811,000	6,830,927.58	0.07
178	TAIWAN CEMENT	台湾水泥股份有限公司	1101	台湾	中国台湾	805,000	6,753,294.50	0.07
179	SINOMEDIA HOLDING LTD	中视金桥国际传媒控股有限公司	00623	香港	中国香港	1,884,000	6,480,902.78	0.07
180	FUTURE BRIGHT	佳景集团有限	00703	香港	中国	3,252,000	6,234,834.50	0.07

	HOLDINGS LTD	公司			香港			
181	CHIPBOND TECHNOLOGY CORP	颀邦科技股份有限公司	6147	台湾	中国台湾	555,000	6,222,301.57	0.07
182	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	华虹半导体有限公司	01347	香港	中国香港	768,000	6,204,821.55	0.07
183	ASIA CEMENT CORP	亚洲水泥股份有限公司	1102	台湾	中国台湾	800,000	6,030,935.35	0.06
184	NEO SOLAR POWER CORP	新日光能源科技股份有限公司	3576	台湾	中国台湾	1,035,000	5,981,934.00	0.06
185	YULON NISSAN MOTOR CO LTD	裕隆日产汽车股份有限公司	2227	台湾	中国台湾	92,000	5,921,914.60	0.06
186	LEJU HOLDINGS LTD	-	LEJU	纽约	美国	87,800	5,780,790.63	0.06
187	CHINA SHIPPING CONTAINER	中海集装箱运输股份有限公司	02866	香港	中国香港	2,916,000	5,636,658.49	0.06
188	INOTERA MEMORIES INC	华亚科技股份有限公司	3474	台湾	中国台湾	500,000	4,851,810.17	0.05
189	CRYSTALWISE TECHNOLOGY INC	兆远科技股份有限公司	4944	台湾	中国台湾	900,000	4,671,075.41	0.05
190	TON YI INDUSTRIAL CORP	统一实业股份有限公司	9907	台湾	中国台湾	1,200,000	4,639,181.04	0.05
191	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	微星科技股份有限公司	2377	台湾	中国台湾	700,000	4,614,052.14	0.05
192	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	300,000	4,314,438.37	0.05
193	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY	中联重科股份有限公司	01157	香港	中国香港	883,000	4,117,335.94	0.04
194	BEC WORLD PUBLIC CO LTD	-	BEC	泰国	泰国	427,800	4,055,290.72	0.04
195	SHANGHAI FUDAN MICROELECT	上海复旦微电子集团股份有限公司	01385	香港	中国香港	724,000	3,930,023.28	0.04
196	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	兆丰金融控股股份有限公司	2886	台湾	中国台湾	830,000	3,922,717.52	0.04
197	WISTRON NEWEB CORP	启碁科技股份有限公司	6285	台湾	中国台湾	300,000	3,885,314.12	0.04
198	ACBEL POLYTECH	康舒科技股份	6282	台湾	中国	550,000	3,752,904.16	0.04

	INC	有限公司			台湾			
199	QUANTA COMPUTER INC	广达电脑股份 有限公司	2382	台湾	中国 台湾	240,000	3,674,231.38	0.04
200	CHINA DREDGING ENVIRONMENT P	中国疏浚环保 控股有限公司	00871	香港	中国 香港	3,019,000	3,453,816.30	0.04
201	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	中国信托金融 控股股份有限 公司	2891	台湾	中国 台湾	800,000	3,177,839.01	0.03
202	HTC CORP	宏达国际电子 股份有限公司	2498	台湾	中国 台湾	115,000	3,156,576.10	0.03
203	WISTRON CORP	纬创资通股份 有限公司	3231	台湾	中国 台湾	548,000	3,040,132.66	0.03
204	SHANGHAI FUDAN-ZHANGJIA NG	上海复旦张江 生物医药股份 有限公司	01349	香港	中国 香港	548,000	2,810,360.51	0.03
205	MOMO INC	-	MOMO	纳斯达克	美国	36,020	2,644,876.56	0.03
206	GINKO INTERNATIONAL CO LTD	-	8406	台湾	中国 台湾	40,000	2,605,673.35	0.03
207	CHLITINA HOLDING LTD	丽丰股份有限 公司	4137	台湾	中国 台湾	80,000	2,389,178.24	0.03
208	BREADTALK GROUP LTD	-	BREAD	新加坡	新加 坡	298,800	2,145,684.13	0.02
209	SPRINGLAND INTERNATIONAL HOL	华地国际控股 有限公司	01700	香港	中国 香港	970,000	2,066,348.73	0.02
210	UNIZYX HOLDING CORP	合勤投资控股 股份有限公司	3704	台湾	中国 台湾	538,000	1,851,110.55	0.02
211	CALIFORNIA RESOURCES CORP	-	CRC	纽约	美国	35,583	1,199,705.40	0.01
212	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	-	ASII	印度尼西亚	印度 尼西 亚	311,600	1,142,902.84	0.01
213	SPT ENERGY GROUP INC	华油能源集团 有限公司	01251	香港	中国 香港	714,000	805,568.30	0.01
214	KEPPEL INFRASTRUCTURE TRUST	-	KIT	新加坡	新加 坡	156,800	771,170.61	0.01
215	XUNLEI LTD	-	XNET	纳斯达克	美国	10,000	446,687.00	0.00
216	HOLCIM PHILIPPINES INC	-	HLCM	菲律宾	菲律 宾	55,000	112,731.73	0.00
217	CHINA MERCHANTS BANK	招商银行股份 有限公司	03968	香港	中国 香港	331	5,082.05	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	GREAT WALL MOTOR COMPANY	02333	274,773,462.43	2.07
2	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	01788	247,536,406.65	1.86
3	CGN POWER CO LTD	01816	214,097,449.09	1.61
4	YY INC	YY	194,196,926.44	1.46
5	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO	QIHU	185,846,976.00	1.40
6	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	00175	155,618,440.47	1.17
7	CHINA LONGYUAN POWER GROUP	00916	143,027,128.76	1.08
8	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	00658	138,935,381.61	1.05
9	PING AN INSURANCE GROUP CO	02318	132,775,082.38	1.00
10	AIXTRON SE	AIXA	124,117,897.22	0.93
11	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330	121,596,206.44	0.91
12	BANK OF CHINA LTD	03988	118,750,323.67	0.89
13	YOUKU TUDOU INC	YOKU	102,931,022.05	0.77
14	BEIJING JINGNENG CLEAN ENE	00579	96,331,352.08	0.72
15	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	91,293,699.90	0.69
16	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	01093	89,689,128.82	0.67
17	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC	03898	83,233,067.53	0.63
18	SINOPEC ENGINEERING GROUP	02386	81,830,065.99	0.62
19	HON HAI PRECISION INDUSTRY	2317	79,850,047.10	0.60
20	CHINA MING YANG WIND POW	MY	79,709,808.05	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。

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	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	726,089,927.09	5.46
2	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	00392	411,169,327.67	3.09
3	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	01788	290,766,995.88	2.19
4	AUTONAVI HOLDINGS LTD	AMAP	224,410,729.64	1.69
5	IND & COMM BK OF CHINA	01398	218,379,865.96	1.64
6	BANK OF AMERICA CORP	BAC	212,174,751.43	1.60
7	BANK OF CHINA LTD	03988	196,282,588.06	1.48
8	CNOOC LTD	00883	187,254,110.16	1.41
9	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	01880	182,259,688.89	1.37
10	NEW ORIENTAL EDUCATION	EDU	178,379,686.75	1.34
11	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330	160,383,030.67	1.21
12	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	01833	157,433,929.73	1.18
13	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	BBCA	144,357,807.00	1.09
14	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	00658	134,472,471.15	1.01
15	GREAT WALL MOTOR COMPANY	02333	127,042,424.35	0.96
16	WHITBREAD PLC	WTB	126,101,258.78	0.95
17	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP	00816	122,930,999.40	0.92
18	NETEASE INC	NTES	121,423,181.52	0.91
19	HOLLYSYS AUTOMATION TECHNOLOGY	HOLI	115,777,436.23	0.87
20	CHINA LIFE INSURANCE CO	02628	105,796,324.08	0.80

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	7,352,243,244.66
卖出收入（成交）总额	10,153,481,574.93

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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序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	YUANTA/P-SH ARES TAIWAN TOP 50 ETF	指数型	ETF 基金	Yuanta Securities Investment Trust	51,688,208.76	0.55
2	-	-	-	-	-	-
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	70,574,835.64
3	应收股利	3,315,963.79
4	应收利息	55,870.12
5	应收申购款	1,120,443.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,067,113.32

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
840,299	13,786.48	44,033,238.50	0.38%	11,540,733,285.44	99.62%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,147,801.12	0.02%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§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	15,213,410,467.95
本报告期基金总申购份额	119,371,430.68
减：本报告期基金总赎回份额	3,748,015,374.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	11,584,766,523.94

§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 2014 年 8 月 21 日发布公告，杨明辉先生代任华夏基金管理有限公司总经理，滕天鸣先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于 2014 年 9 月 6 日发布公告，张霄岭先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人于 2014 年 9 月 13 日发布公告，汤晓东先生担任华夏基金管理有限公司督察长，方瑞枝女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

本基金托管人于 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务，于 2014 年 11 月 3 日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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（特殊普通合伙）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 8 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	-	3,900,914,261.20	22.32%	4,003,357.03	14.91%	-
CLSA	-	2,309,459,505.07	13.21%	5,089,588.46	18.95%	-
MERRILL LYNCH	-	2,175,532,209.28	12.45%	3,137,993.16	11.69%	-
CREDIT SUISSE	-	1,494,096,951.75	8.55%	2,279,376.89	8.49%	-
KGI	-	1,045,721,615.43	5.98%	1,424,901.68	5.31%	-
NOMURA	-	954,212,999.65	5.46%	1,908,426.07	7.11%	-
CAPITAL SECURITIES CORP	-	818,537,277.26	4.68%	1,109,065.40	4.13%	-
SINOPAC SECURITIES	-	751,093,521.25	4.30%	919,661.68	3.42%	-
CITIGROUP	-	652,845,024.57	3.74%	745,711.86	2.78%	-
MASTERLINK	-	589,147,472.20	3.37%	719,447.65	2.68%	-
DEUTSCHE BANK	-	285,729,481.39	1.63%	472,453.62	1.76%	-
SCOTIA CAPITAL	-	265,445,137.36	1.52%	495,869.02	1.85%	-
UBS	-	216,282,242.00	1.24%	324,423.35	1.21%	-
CICC	-	215,257,449.47	1.23%	378,084.73	1.41%	-
FIRST SECURITIES	-	215,111,231.17	1.23%	275,368.00	1.03%	-
GUOTAI JUNAN SECURITIES	-	180,498,034.49	1.03%	1,285,579.80	4.79%	-
SHENYIN WANGUO SECURITIES	-	177,169,709.11	1.01%	212,603.65	0.79%	-
BOCI SECURITIES	-	174,186,633.72	1.00%	428,777.15	1.60%	-
FUBON BANK	-	173,461,070.19	0.99%	207,493.68	0.77%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	157,902,491.64	0.90%	236,853.76	0.88%	-
CHINA MERCHANTS SECURITIES	-	133,491,615.22	0.76%	133,491.59	0.50%	-

MACQUARIE SECURITIES	-	105,599,704.13	0.60%	124,037.33	0.46%	-
BTIG HONG KONG LTD	-	85,622,021.72	0.49%	128,433.00	0.48%	-
BOCOM INTERNATIONAL HOLDINGS	-	69,775,464.79	0.40%	83,730.52	0.31%	-
GOLDMAN SACHS	-	65,284,506.07	0.37%	97,926.77	0.36%	-
CITIC SECURITIES INTERNATIONAL	-	53,958,900.29	0.31%	64,748.84	0.24%	-
ICBC INTERNATIONAL SECURITIES	-	51,923,165.20	0.30%	62,307.79	0.23%	-
FIRST SHANGHAI SECURITIES	-	47,566,986.49	0.27%	57,080.57	0.21%	-
J.P.MORGAN	-	34,466,210.12	0.20%	307,735.10	1.15%	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES	-	28,214,405.67	0.16%	28,214.40	0.11%	-
HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES	-	19,169,019.56	0.11%	19,169.02	0.07%	-
BNP PARIBAS	-	15,829,962.05	0.09%	18,995.95	0.07%	-
JEFFERIES	-	12,582,224.89	0.07%	72,820.53	0.27%	-

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，本基金还选择了安信证券、上海华信证券、方正证券、高华证券、广发证券、广州证券、国联证券、国泰君安证券、华融证券、华鑫证券、上海证券、申银万国证券、太平洋证券、信达证券、西南证券、西部证券、中信建投证券、中金公司、中投证券、中国银河证券、中信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，西部证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。原财富里昂证券的交易单元更名为上海华信证券的交易单元。

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	17,185,303.93	1.84%	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	229,691,918.38	41.25%
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	128,973,951.27	23.16%
KGI	-	-	-	-	29,703,969.84	5.33%
NOMURA	31,185,155.63	3.35%	-	-	-	-
CAPITAL SECURITIES CORP	-	-	-	-	34,606,947.02	6.22%
SINOPAC SECURITIES	-	-	-	-	14,726,973.50	2.65%
CITIGROUP	62,447,027.51	6.70%	-	-	92,866,769.65	16.68%
MASTERLINK	-	-	-	-	11,794,446.46	2.12%
DEUTSCHE BANK	95,274,390.42	10.23%	-	-	-	-
UBS	77,420,528.12	8.31%	-	-	-	-
FIRST SECURITIES	-	-	-	-	14,415,752.75	2.59%
GOLDMAN SACHS	62,446,357.99	6.70%	-	-	-	-
ICBC INTERNATIONAL SECURITIES	429,877,000.03	46.15%	-	-	-	-
J.P.MORGAN	155,641,548.13	16.71%	-	-	-	-

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	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-01-15
2	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增厦门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	2014-01-23
3	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-02-12
4	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-02-12
5	华夏基金管理有限公司关于暂停开放式基金网上下单转账支付业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-02-22
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	2014-04-01
7	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-15
8	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-29
9	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-16
10	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-21
11	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-23
12	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-29
13	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-06-26
14	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-07-01
15	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-07-19
16	华夏基金管理有限公司关于调整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	2014-08-06
17	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-08-21
18	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-08-27
19	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增吉林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	2014-08-28

20	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-09-03
21	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-09-06
22	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增包商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	2014-09-09
23	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-09-11
24	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-09-13
25	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-10-11
26	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增宏信证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-10-15
27	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-10-20
28	华夏基金管理有限公司关于广州分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-11-08
29	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-11-24
30	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-11-25
31	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-12-04
32	关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-12-22
33	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股份有限公司基金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	2014-12-31

§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

二〇一五年三月三十一日