

华夏全球精选股票型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	31
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	32
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	55
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	58
7.7 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.....	58
7.8 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.....	58
7.9 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.....	58
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	58
7.11 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	61
§11 备查文件目录.....	66

§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	6,571,279,432.30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	张静
	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 8 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-275,360,116.94
本期利润	-337,425,342.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0508
本期加权平均净值利润率	-7.12%
本期基金份额净值增长率	-6.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-1,774,239,627.96
期末可供分配基金份额利润	-0.2700
期末基金资产净值	4,797,039,804.34
期末基金份额净值	0.730
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-27.00%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.53%	1.15%	-0.81%	1.69%	2.34%	-0.54%
过去三个月	-0.14%	0.89%	0.26%	1.09%	-0.40%	-0.20%
过去六个月	-6.41%	0.96%	-0.02%	1.07%	-6.39%	-0.11%
过去一年	-16.67%	1.35%	-5.72%	1.07%	-10.95%	0.28%
过去三年	-2.67%	0.99%	12.22%	0.79%	-14.89%	0.20%
自基金合同生效起至今	-27.00%	1.29%	-4.56%	1.23%	-22.44%	0.06%

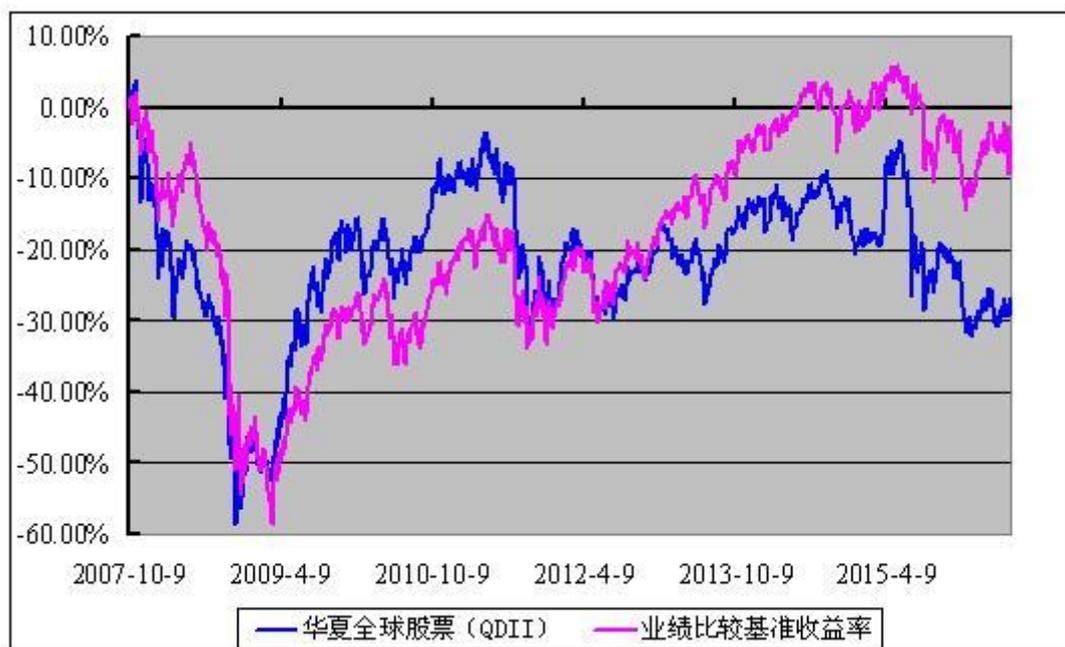
注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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2016年6月30日）



注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。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、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人，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，尽力捕捉市场机会，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 2016 年 6 月 30 日数据），华夏策略混合在 75 只灵活配置混合型基金（股票上限 80%）中排名第 8，华夏沪深 300 指数增强 A 在 39 只增强指数股票型基金中排名第 11；固定收益类产品中，华夏理财 30 天债券在 41 只短期理财债券型基金中排名第 9，华夏薪金宝货币在 194 只货币型基金中排名第 13。

在《中国证券报》主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2015 年度被动投资金牛基金公司”奖。在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中，华夏基金获得“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”奖。

在客户服务方面，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）实现资产证明和对账单自动获取，客户可以自助提交申请并查询办理进度，业务处理更加高效；（2）网上交易平台上线交通银行、招商银行、民生银行、邮政储蓄银行等快捷支付方式和华夏财富系统，并与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财，拓宽客户交易通道，增加交易便利性；（3）开展“130 万人定投的华夏红利”、“客户个性化白皮书”、“你定，我投”、“书写华夏印象，见证一个行业”等活动，为客户提供多样化的关怀服务。

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		
李湘杰	本基金的基金经理、国际投资部董事总经理	2016-05-25	-	14 年	国立台湾大学商学硕士。曾任台湾 ING 投信基金经理、台湾元大投信基金经理、华润元大基金投资管理部总经理、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2013 年 9 月 11 日至 2014 年 9 月 18 日期间）、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理（2014 年 8 月 18 日至 2015 年 9 月 23 日期间）等。2015 年 9 月加入华夏基金管理有限公司。
杨昌桁	本基金的基金经理、国际投资部总监、国际投资首席	2007-10-09	2016-06-01	26 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

	策略顾问				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。
陈永强	本基金的基金经理、国际投资部高级副总裁	2015-04-01	-	10 年	荷兰代尔夫特工业大学工学硕士。曾任中邮基金研究员、嘉实基金研究员、华安资产管理（香港）有限公司投资经理、中信证券国际资产管理公司投资经理等。2013 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任基金经理助理等。

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根据本基金管理人发布的《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》，自 2016 年 7 月 25 日起，陈永强先生不再担任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告

期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，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

上半年,全球各大类资本市场均经历了大幅波动。1 月,中国股市的短期快速下跌以及人民币贬值导致了全球市场动荡。油价、港币等资产类别持续下跌继而引发市场恐慌情绪的蔓延和升级。2 月,春节期间欧洲的银行危机再次引发全球市场新一轮快速下跌。进入 2 月下旬,随着中国财政政策的积极指引以及货币政策的清晰导向,全球市场信心得到逐步恢复。美联储对加息的鸽派表态进一步提升了全球的市场偏好。新兴市场国家受惠于中国经济企稳预期以及弱势美元,更是取得了大幅反弹。4 月,美元走弱,全球主要股市普遍上涨,巴西涨幅领先。5 月,市场呈现阶段性特征,前半段全球主要股市普遍下跌,中国香港、中国台湾领跌,日元欧元走强;后半段出现翻转,除巴西、中国外主要市场普遍上涨;美国多项经济数据超预期令市场对美联储加息预期大增,美元强势回归,日元欧元走软,原油突破 50 美元大关。6 月,美国未加息,月末英国公投退欧成为“黑天鹅”事件,超出市场预期,英镑、欧元大幅贬值,日元大幅升值,除中国外的全球股市急挫。

报告期内,本基金持续跟踪分析全球宏观政策和经济态势,采取中性仓位策略,主要投资于业绩确定性强、跨越周期保持成长的优质白马股,以及在全球宽松货币环境下受益的上游周期类公司(如黄金)。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 0.730 元,本报告期份额净值增长率为-6.41%,同期业绩比较基准增长率以美元计为-0.02%(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

展望下半年，在中国经济下行压力下政府的不定期刺激，叠加众多国际政治事件扰动，将成为影响市场的波动因素。人民币贬值压力较大，带来持续资金外流压力。本基金将在以下几方面做好投资：

国家及行业配置方面，相对看好美国及新兴市场，以及受益于本轮全球科技浪潮以及中国消费升级需求的行业。

中资股方面，本基金将在不明确的市场趋势中保持中性仓位，通过精选个股战胜基准，核心配置教育、游戏、消费、信息技术等子板块中经营趋势向好、业绩增长确定的龙头公司。同时，密切关注人民币贬值、外部政治事件带来的冲击性风险，适当配置黄金等避险品种及稳健的出口型公司对冲负面事件风险、人民币贬值风险。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括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、合规负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏全球精选股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	705,730,428.37	960,791,900.49
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,076,605,320.27	4,633,394,332.97
其中：股票投资		3,646,329,284.27	4,257,276,309.93

基金投资		430,276,036.00	376,118,023.04
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	86,816.89
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		30,428,457.69	8,541,688.05
应收利息	6.4.7.5	15,387.21	28,889.19
应收股利		30,482,505.17	354,678.70
应收申购款		847,029.94	236,072.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	64,767,476.27	46,350,071.77
资产总计		4,908,876,604.92	5,649,784,450.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		55,837,005.20	350,750,746.53
应付赎回款		5,768,021.25	6,404,893.82
应付管理人报酬		7,154,141.57	8,234,446.03
应付托管费		1,353,486.23	1,557,868.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	41,724,146.33	46,843,088.98
负债合计		111,836,800.58	413,791,043.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,571,279,432.30	6,712,477,058.84
未分配利润	6.4.7.10	-1,774,239,627.96	-1,476,483,651.60
所有者权益合计		4,797,039,804.34	5,235,993,407.24
负债和所有者权益总计		4,908,876,604.92	5,649,784,450.74

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.730 元，基金份额总额 6,571,279,432.30

份。

6.2 利润表

会计主体：华夏全球精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-273,066,285.73	869,531,061.82
1.利息收入		396,869.08	976,195.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	396,869.08	976,195.49
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-219,593,793.87	398,225,411.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-250,446,322.93	350,184,296.76
基金投资收益	6.4.7.13	-18,213,782.42	-217,501.12
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	56,222.17	-
股利收益	6.4.7.17	49,010,089.31	48,258,616.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-62,065,225.63	414,829,494.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		8,018,709.85	50,502,289.59
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	177,154.84	4,997,670.28
减：二、费用		64,359,056.84	130,986,344.32
1.管理人报酬		43,537,040.16	77,432,284.68
2.托管费		8,236,737.30	14,649,351.17
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	10,959,532.11	36,817,442.49
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.21	1,625,747.27	2,087,265.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-337,425,342.57	738,544,717.50
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-337,425,342.57	738,544,717.50
-------------------	--	-----------------	----------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏全球精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,712,477,058.84	-1,476,483,651.60	5,235,993,407.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-337,425,342.57	-337,425,342.57
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）	-141,197,626.54	39,669,366.21	-101,528,260.33
其中：1.基金申购款	56,519,602.94	-16,338,600.70	40,181,002.24
2.基金赎回款	-197,717,229.48	56,007,966.91	-141,709,262.57
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）	6,571,279,432.30	-1,774,239,627.96	4,797,039,804.34
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,584,766,523.94	-2,128,571,836.91	9,456,194,687.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	738,544,717.50	738,544,717.50
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）	-4,453,407,411.49	502,398,853.80	-3,951,008,557.69
其中：1.基金申购款	56,141,839.86	-9,108,938.99	47,032,900.87
2.基金赎回款	-4,509,549,251.35	511,507,792.79	-3,998,041,458.56
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）	7,131,359,112.45	-887,628,265.61	6,243,730,846.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
杨明辉	汪贵华	汪贵华
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏全球精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2007]258号《关于同意华夏全球精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 30,048,564,114.29 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2007）第 131 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 10 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 30,055,638,128.26 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行（JPMorgan Chase Bank, National Association）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括银行存款、短期政府债券等货币市场工具，政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等固定收益类证券，在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证等权益类证券，以及基金、结构性投资产品、金融衍生产品和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》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或增值税征收范围,不征收营业

税或增值税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3、存款利息收入不征收增值税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	705,730,428.37
定期存款	-
其他存款	-
合计	705,730,428.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,869,011,293.23	3,646,329,284.27	-222,682,008.96
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	409,840,804.58	430,276,036.00	20,435,231.42
其他	-	-	-
合计	4,278,852,097.81	4,076,605,320.27	-202,246,777.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	15,387.21
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	15,387.21

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	64,767,476.27
待摊费用	-
合计	64,767,476.27

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21,738.01
预提费用	119,344.68
其他应付款	41,575,755.64
其他	7,308.00
合计	41,724,146.33

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,712,477,058.84	6,712,477,058.84
本期申购	56,519,602.94	56,519,602.94
本期赎回（以“-”号填列）	-197,717,229.48	-197,717,229.48
本期末	6,571,279,432.30	6,571,279,432.30

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,209,182,909.16	-267,300,742.44	-1,476,483,651.60
本期利润	-275,360,116.94	-62,065,225.63	-337,425,342.57
本期基金份额交易产生的变动数	29,774,675.02	9,894,691.19	39,669,366.21
其中：基金申购款	-11,826,749.20	-4,511,851.50	-16,338,600.70
基金赎回款	41,601,424.22	14,406,542.69	56,007,966.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,454,768,351.08	-319,471,276.88	-1,774,239,627.96

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	396,834.06
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	-	
其他	35.02	
合计	396,869.08	

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	卖出股票成交总额	3,582,595,204.53
减：卖出股票成本总额	3,833,041,527.46	
买卖股票差价收入	-250,446,322.93	

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	248,327,853.13
减：卖出/赎回基金成本总额	266,541,635.55
基金投资收益	-18,213,782.42

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日
卖出权证成交总额	56,222.17
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	56,222.17

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本报告期无其他衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	45,419,290.04
基金投资产生的股利收益	3,590,799.27
合计	49,010,089.31

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

1.交易性金融资产	-61,978,408.74
——股票投资	-91,730,087.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	29,751,678.75
2.衍生工具	-86,816.89
——权证投资	-86,816.89
——远期投资	-
3.其他	-
合计	-62,065,225.63

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	177,154.84
合计	177,154.84

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	10,959,532.11
银行间市场交易费用	-
合计	10,959,532.11

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	79,563.12
信息披露费	39,781.56
银行费用	4,000.29
税务顾问费	7,000.00
其他	1,495,402.30
合计	1,625,747.27

注：“其他”主要包含支付给存托凭证托管机构的存托服务费用。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行	基金境外资产托管人
中信证券国际有限公司	基金管理人股东控股的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	464,629,873.96	6.74%	85,558,164.55	0.49%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30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	371,703.88	5.80%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	102,669.79	0.49%	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	43,537,040.16	77,432,284.68
其中：支付销售机构的客户维护费	6,328,817.57	11,268,918.71

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，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	8,236,737.30	14,649,351.17
----------------	--------------	---------------

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	72,547,035.54	396,721.08	280,486,559.37	935,157.99
摩根大通银行活期存款	633,183,392.83	112.98	1,185,684,273.19	40,974.49

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资产托管人摩根大通银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有需披露的暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、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之内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行

人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或 OTC 市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	705,730,428.37	-	-	705,730,428.37
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	185,504.29	-	-	185,504.29
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计

银行存款	960,791,900.49	-	-	960,791,900.49
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	16,513.17	-	-	16,513.17
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控，并通过外汇远期投资交易对上述外汇风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	344,930,899.02	255,891,792.17	32,362,101.53	633,184,792.72
交易性金融资产	1,484,141,280.67	1,752,574,966.91	839,889,072.69	4,076,605,320.27
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	26,819,507.22	-	3,608,950.47	30,428,457.69
应收利息	-	-	-	-
应收股利	1,375,822.54	7,642,973.67	2,224,631.53	11,243,427.74
应收在途资金	32,205,131.27	-	32,562,345.00	64,767,476.27
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,889,472,640.72	2,016,109,732.75	910,647,101.22	4,816,229,474.69
以外币计价的负债	-	-	-	-
应付在途资金	32,548,253.03	-	9,027,502.61	41,575,755.64
应付证券清算款	7,748,893.92	11,773,152.15	36,314,959.13	55,837,005.20
负债合计	40,297,146.95	11,773,152.15	45,342,461.74	97,412,760.84

项目	上年度末 2015 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	462,534,810.63	303,420,645.84	71,366,060.34	837,321,516.81
交易性金融资产	1,462,144,203.58	2,196,977,974.22	974,272,155.17	4,633,394,332.97
衍生金融资产	-	-	86,816.89	86,816.89
应收证券清算款	-	-	8,541,688.05	8,541,688.05
应收利息	-	13.77	-	13.77
应收股利	237,612.19	-	9,016.51	246,628.70
应收在途资金	8,509,232.01	-	37,840,839.76	46,350,071.77
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,933,425,858.41	2,500,398,633.83	1,092,116,576.72	5,525,941,068.96
以外币计价的负债	-	-	-	-
应付在途资金	38,031,970.52	-	8,541,688.05	46,573,658.57
应付证券清算款	259,178,774.71	34,150,762.90	57,421,208.92	350,750,746.53
负债合计	297,210,745.23	34,150,762.90	65,962,896.97	397,324,405.10

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	235,940,835.69	256,430,833.19
	所有外币相对人民币贬值 5%	-235,940,835.69	-256,430,833.19

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	3,646,329,284.27	76.01	4,257,276,309.93	81.31
交易性金融资产-基金投资	430,276,036.00	8.97	376,118,023.04	7.18
衍生金融资产—权证投资	-	-	86,816.89	0.00
合计	4,076,605,320.27	84.98	4,633,481,149.86	88.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为摩根士丹利资本国际全球指数（MSCI All Country World Index）变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定摩根士丹利资本国际全球指数（MSCI All Country World Index）变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、Beta 系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	+5%	162,845,065.84	145,620,136.18
	-5%	-162,845,065.84	-145,620,136.18

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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。

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2016 年 6 月 30 日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 4,076,605,320.27 元,第二层次的余额为 0 元,第三层次的余额为 0 元。(截至 2015 年 12 月 31 日止:第一层次的余额为 4,633,394,332.97 元,第二层次的余额为 86,816.89 元,第三层次的余额为 0 元。)

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,646,329,284.27	74.28
	其中:普通股	3,265,120,093.97	66.51
	存托凭证	378,536,221.75	7.71
2	基金投资	430,276,036.00	8.77
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	705,730,428.37	14.38

8	其他各项资产	126,540,856.28	2.58
9	合计	4,908,876,604.92	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	1,637,248,792.74	34.13
美国	1,197,061,100.44	24.95
中国台湾	196,756,542.43	4.10
泰国	124,967,043.75	2.61
韩国	101,245,083.12	2.11
印度尼西亚	95,344,520.63	1.99
新加坡	89,163,322.75	1.86
印度	81,630,400.45	1.70
丹麦	33,992,754.08	0.71
日本	25,340,477.02	0.53
德国	22,830,308.87	0.48
澳大利亚	14,064,259.91	0.29
墨西哥	7,260,376.12	0.15
巴西	5,546,075.18	0.12
英国	3,528,188.31	0.07
菲律宾	3,406,918.64	0.07
土耳其	3,012,602.44	0.06
南非	2,118,105.39	0.04
马来西亚	1,812,412.00	0.04
总计	3,646,329,284.27	76.01

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	1,009,217,278.75	21.04
非必需消费品	919,776,193.05	19.17
金融	697,774,816.51	14.55
工业	285,356,703.60	5.95
能源	177,419,695.61	3.70
必需消费品	152,539,612.99	3.18
电信服务	133,712,422.02	2.79

保健	133,183,336.54	2.78
材料	131,401,298.19	2.74
公用事业	5,947,927.01	0.12
合计	3,646,329,284.27	76.01

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	TENCENT HOLDING S LTD	腾讯控 股有 限公 司	00700	香港	中国香 港	1,171,900	176,384,842.02	3.68
2	INDUSTRI AL & COMMER CIAL BANK OF CHINA LTD	中国工 商银 行股 份有 限公 司	01398	香港	中国香 港	32,119,000	117,768,910.62	2.46
3	CHINA MOBILE LTD	中国移 动有 限公 司	00941	香港	中国香 港	1,383,500	104,826,057.82	2.19
4	NATIONA L AGRICUL TURAL HOLDING S LTD	国农控 股有 限公 司	01236	香港	中国香 港	70,706,000	100,921,591.43	2.10
5	TAL EDUCATI ON GROUP	-	XRS	纽约	美国	199,400	82,059,535.02	1.71
6	BANYAN TREE HOLDING S LTD	-	BTH	新加坡	新加坡	30,157,500	73,520,099.45	1.53
7	BANK OF CHINA LTD	中国银 行股 份有 限公 司	03988	香港	中国香 港	27,702,000	73,161,222.63	1.53

8	APPLE INC	-	AAPL	纳斯达克	美国	114,200	72,396,258.61	1.51
9	ALPHABE T INC	-	GOOG	纳斯达克	美国	14,750	67,694,439.40	1.41
10	MICROSO FT CORP	-	MSFT	纳斯达克	美国	169,200	57,412,690.86	1.20
11	TAIWAN SEMICON DUCTOR MANUFA CTURING CO LTD	台湾积体 电路制造 股份有限 公司	2330	台湾	中国台 湾	1,654,000	55,228,154.26	1.15
12	CHINA HIGH SPEED TRANSMI SSION EQUIPME NT GROUP CO LTD	中国高速 传动设备 集团有限 公司	00658	香港	中国香 港	8,946,000	47,482,310.56	0.99
13	CHINA OVERSEA S LAND & INVESTM ENT LTD	中国海外 发展有限 公司	00688	香港	中国香 港	2,231,000	46,717,221.46	0.97
14	GUANGZ HOU AUTOMO BILE GROUP CO LTD	广州汽车 集团股份 有限公司	02238	香港	中国香 港	5,694,000	45,016,377.67	0.94
15	HONG KONG EXCHANG ES AND CLEARIN G LTD	香港交易 及结算所 有限公司	00388	香港	中国香 港	277,800	44,542,688.41	0.93
16	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	-	BABA	纽约	美国	83,000	43,772,484.88	0.91
17	NETFLIX INC	-	NFLX	纳斯达克	美国	71,100	43,130,836.70	0.90

18	JD.COM INC	-	JD	纳斯达克	美国	303,700	42,755,000.18	0.89
19	PING AN INSURAN CE GROUP CO OF CHINA LTD	中国平安 保险(集团) 股份有限 公司	02318	香港	中国香 港	1,457,000	42,526,692.80	0.89
20	AMAZON. COM INC	-	AMZN	纳斯达克	美国	8,800	41,759,690.22	0.87
21	CNOOC LTD	中国海洋 石油有限 公司	00883	香港	中国香 港	5,030,000	41,357,512.27	0.86
22	TAIWAN SEMICON DUCTOR MANUFA CTURING CO LTD	-	TSM	纽约	美国	217,100	37,761,587.22	0.79
23	SAMSUNG ELECTRO NICS CO LTD	-	5930	韩国	韩国	4,352	35,708,012.54	0.74
24	FACEBOO K INC	-	FB	纳斯达克	美国	45,300	34,328,953.17	0.72
25	PANDORA A/S	-	PNDORA	丹麦	丹麦	37,830	33,992,754.08	0.71
26	CRCC HIGH-TEC H EQUIPME NT CORP LTD	中国铁建 高新装备 股份有限 公司	01786	香港	中国香 港	11,120,500	32,030,636.25	0.67
27	PETROCHI NA CO LTD	中国石油 天然气股 份有限公 司	00857	香港	中国香 港	7,018,000	31,730,753.56	0.66
28	CHINA CHUANGL IAN EDUCATI ON GROUP LTD	中国创联 教育集团 有限公司	02371	香港	中国香 港	165,928,000	31,058,118.56	0.65

29	SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	深圳国际控股有限公司	00152	香港	中国香港	3,193,500	30,570,060.16	0.64
30	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	新华人寿保险股份有限公司	01336	香港	中国香港	1,249,000	29,410,024.87	0.61
31	BERKSHIRE HATHAWAY INC	-	BRK/B	纽约	美国	30,400	29,187,996.01	0.61
32	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	-	MAJOR	泰国	泰国	4,517,600	28,145,992.17	0.59
33	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	-	ASII	印度尼西亚	印度尼西亚	7,535,700	27,992,605.68	0.58
34	MCDONALD'S CORP	-	MCD	纽约	美国	34,900	27,850,151.41	0.58
35	STARBUCKS CORP	-	SBUX	纳斯达克	美国	70,800	26,817,209.39	0.56
36	TESLA MOTORS INC	-	TSLA	纳斯达克	美国	18,800	26,464,217.35	0.55
37	HOME DEPOT INC/THE	-	HD	纽约	美国	30,900	26,164,201.97	0.55
38	VISA INC	-	V	纽约	美国	53,100	26,116,497.12	0.54
39	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	中国人寿保险股份有限公司	02628	香港	中国香港	1,837,000	26,094,652.99	0.54
40	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地有限公司	01109	香港	中国香港	1,618,800	25,042,813.59	0.52

41	CHINA INTERNA TIONAL CAPITAL CORP LTD	中国国际 金融股份 有限公司	03908	香港	中国香 港	2,458,800	24,755,964.15	0.52
42	BAIDU INC	-	BIDU	纳斯达克	美国	22,600	24,750,224.56	0.52
43	CTRIPO M INTERNA TIONAL LTD	-	CTRP	纳斯达克	美国	86,100	23,522,988.38	0.49
44	WYNN RESORTS LTD	-	WYNN	纳斯达克	美国	35,700	21,457,555.25	0.45
45	SUNFOND A GROUP HOLDING S LTD	新丰泰集 团控股有 限公司	01771	香港	中国香 港	10,273,000	21,423,896.65	0.45
46	SUNNY OPTICAL TECHNOL OGY GROUP CO LTD	舜宇光学 科技(集团) 有限公司	02382	香港	中国香 港	898,000	20,838,071.35	0.43
47	CIA BRASILEI RA DE DISTRIBU ICAO	-	CBD	纽约	美国	214,800	20,724,754.60	0.43
48	HUATAI SECURITI ES CO LTD	华泰证券 股份有限 公司	06886	香港	中国香 港	1,469,800	20,702,691.03	0.43
49	CHINA PETROLE UM & CHEMICA L CORP	中国石油 化工股份 有限公司	00386	香港	中国香 港	4,322,000	20,686,362.93	0.43
50	HYUNDAI HEAVY INDUSTRI ES CO LTD	-	9540	韩国	韩国	33,900	20,592,737.59	0.43

51	NIKE INC	-	NKE	纽约	美国	55,000	20,132,323.20	0.42
52	AAC TECHNOL OGIES HOLDING S INC	瑞声科技 控股有限 公司	02018	香港	中国香 港	347,000	19,529,746.42	0.41
53	EXXON MOBIL CORP	-	XOM	纽约	美国	30,000	18,648,260.64	0.39
54	GEELY AUTOMO BILE HOLDING S LTD	吉利汽车 控股有限 公司	00175	香港	中国香 港	5,130,000	18,371,420.52	0.38
55	CHAROEN POKPHAN D FOODS PCL	-	CPF	泰国	泰国	3,253,800	17,661,335.95	0.37
56	YES BANK LTD	-	YES	印度	印度	154,800	16,835,354.82	0.35
57	BYD CO LTD	比亚迪股 份有限公 司	01211	香港	中国香 港	418,500	16,614,701.03	0.35
58	TELEKOM UNIKASI INDONESI A PERSERO TBK PT	-	TLKM	印度尼西 亚	印度尼 西亚	8,041,000	16,065,015.18	0.33
59	ADIDAS AG	-	ADS	德国	德国	16,700	15,848,896.63	0.33
60	SILICON MOTION TECHNOL OGY CORP	-	SIMO	纳斯达克	美国	49,800	15,785,173.72	0.33
61	EQUIFAX INC	-	EFX	纽约	美国	18,400	15,666,607.87	0.33
62	INDUSIND BANK LTD	-	IIB	印度	印度	140,600	15,353,179.44	0.32
63	JOHNSON &	-	JNJ	纽约	美国	19,000	15,282,926.64	0.32

	JOHNSON							
64	BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK PT	-	BBRI	印度尼西亚	印度尼西亚	2,818,600	15,280,768.95	0.32
65	PETROLEO BRASILEIRO SA	-	PBR	纽约	美国	321,400	15,259,876.59	0.32
66	VIBHAVADI MEDICAL CENTER PCL	-	VIBHA	泰国	泰国	26,560,600	15,043,676.44	0.31
67	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	-	KMB	印度	印度	199,825	14,984,353.10	0.31
68	WAL-MART STORES INC	-	WMT	纽约	美国	30,600	14,816,832.85	0.31
69	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	招金矿业股份有限公司	01818	香港	中国香港	2,109,000	14,762,905.23	0.31
70	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	-	JCNC	新加坡	新加坡	80,600	14,488,834.67	0.30
71	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	银河娱乐集团有限公司	00027	香港	中国香港	731,000	14,369,993.22	0.30
72	BROADCOM LTD	-	AVGO	纳斯达克	美国	13,900	14,323,789.87	0.30
73	FOSUN INTERNATIONAL LTD	复星国际有限公司	00656	香港	中国香港	1,671,000	14,281,959.60	0.30
74	CHINA PACIFIC	中国太平洋保险(集	02601	香港	中国香港	637,300	14,216,601.04	0.30

	INSURANCE GROUP CO LTD	团)股份有限公司						
75	ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	-	ACES	印度尼西亚	印度尼西亚	30,567,600	14,193,551.58	0.30
76	BHP BILLITON LTD	-	BHP	澳大利亚	澳大利亚	152,750	14,064,259.91	0.29
77	CONCORD NEW ENERGY GROUP LTD	协合新能源集团有限公司	00182	香港	中国香港	37,650,000	13,837,090.66	0.29
78	COSTCO WHOLESALE CORP	-	COST	纳斯达克	美国	13,200	13,746,000.15	0.29
79	VALE SA	-	VALE	纽约	美国	397,100	13,324,242.57	0.28
80	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	中国农业银行股份有限公司	01288	香港	中国香港	5,503,000	13,310,589.76	0.28
81	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	申洲国际集团控股有限公司	02313	香港	中国香港	409,000	13,091,411.68	0.27
82	SKYWORKS SOLUTIONS INC	-	SWKS	纳斯达克	美国	31,100	13,050,254.65	0.27
83	WALT DISNEY CO/THE	-	DIS	纽约	美国	20,000	12,973,279.68	0.27
84	HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	鸿海精密工业股份有限公司	2317	台湾	中国台湾	760,698	12,895,490.97	0.27

85	POSCO	-	5490	韩国	韩国	11,000	12,762,320.98	0.27
86	IMAX CHINA HOLDING INC	-	01970	香港	中国香港	391,700	12,755,277.09	0.27
87	AVICHIN A INDUSTR Y & TECHNOL OGY CO LTD	中国航空 科技工业 股份有限 公司	02357	香港	中国香港	2,765,000	12,690,559.56	0.26
88	CENTRAL PATTANA PCL	-	CPN	泰国	泰国	1,103,500	12,448,158.08	0.26
89	CHINA TAIPING INSURAN CE HOLDING S CO LTD	中国太平 保险控股 有限公司	00966	香港	中国香港	1,000,000	12,341,801.11	0.26
90	W-SCOPE CORP	-	6619	东京	日本	79,400	12,296,269.29	0.26
91	ZHONG AO HOME GROUP LTD	中奥到家 集团有限 公司	01538	香港	中国香港	11,312,000	12,278,758.78	0.26
92	BYD ELECTRO NIC INTERNA TIONAL CO LTD	比亚迪电 子(国际)有 限公司	00285	香港	中国香港	3,229,000	12,032,777.45	0.25
93	HYUNDAI ENGINEE RING & CONSTRU CTION CO LTD	-	720	韩国	韩国	61,900	11,886,347.28	0.25
94	REGINA MIRACLE INTERNA TIONAL HOLDING	维珍妮国 际(控股)有 限公司	02199	香港	中国香港	1,272,000	11,132,646.48	0.23

	S LTD							
95	BANK OF AMERICA CORP	-	BAC	纽约	美国	124,400	10,946,705.38	0.23
96	SINOPHARM GROUP CO LTD	国药控股股份有限公司	01099	香港	中国香港	345,600	10,914,391.47	0.23
97	BEAUTY COMMUNITY PCL	-	BEAUTY	泰国	泰国	6,974,000	10,862,523.76	0.23
98	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃控股有限公司	00868	香港	中国香港	2,198,000	10,708,136.39	0.22
99	OURGAME INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	联众国际控股有限公司	06899	香港	中国香港	3,595,000	10,662,025.57	0.22
100	DELTA ELECTRONICS INC	台达电子工业股份有限公司	2308	台湾	中国台湾	325,000	10,417,886.41	0.22
101	CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE CO LTD	中国中药有限公司	00570	香港	中国香港	3,947,000	10,322,856.81	0.22
102	CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	中国交通建设股份有限公司	01800	香港	中国香港	1,452,000	10,300,446.69	0.21
103	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	02039	香港	中国香港	1,249,000	10,184,088.47	0.21

104	CELGENE CORP	-	CELG	纳斯达克	美国	15,500	10,137,546.47	0.21
105	CHINA ELECTRO NICS CORP HOLDING S CO LTD	中国电子 集团控股 有限公司	00085	香港	中国香 港	6,362,000	10,113,883.79	0.21
106	ORANGE SKY GOLDEN HARVEST ENTERTAI NMENT HOLDING S LTD	橙天嘉禾 娱乐(集团) 有限公司	01132	香港	中国香 港	25,950,000	9,980,705.16	0.21
107	ILLUMIN A INC	-	ILMN	纳斯达克	美国	10,700	9,960,500.06	0.21
108	PIONEER NATURAL RESOURC ES CO	-	PXD	纽约	美国	9,900	9,926,767.14	0.21
109	NETEASE INC	-	NTES	纳斯达克	美国	7,600	9,737,731.52	0.20
110	BHP BILLITON LTD	-	BHP	纽约	美国	51,400	9,734,495.50	0.20
111	APOLLO TYRES LTD	-	APTY	印度	印度	651,900	9,701,928.75	0.20
112	FORMOSA CHEMICA LS & FIBRE CORP	台湾化学 纤维股份 有限公司	1326	台湾	中国台 湾	580,000	9,653,497.11	0.20
113	PERUSAH AAN PERKEBU NAN LONDON SUMATRA INDONESI A TBK PT	-	LSIP	印度尼西 亚	印度尼 西亚	13,708,000	9,496,010.54	0.20
114	WELLS	-	WFC	纽约	美国	30,000	9,415,640.88	0.20

	FARGO & CO							
115	JIANGNAN GROUP LTD	江南集团有限公司	01366	香港	中国香港	8,862,000	9,392,144.83	0.20
116	CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD	中国蒙牛乳业有限公司	02319	香港	中国香港	798,000	9,193,992.26	0.19
117	CHINA RAILWAY GROUP LTD	中国中铁股份有限公司	00390	香港	中国香港	1,815,000	8,935,327.25	0.19
118	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	-	GLOBAL	泰国	泰国	3,456,000	8,873,756.15	0.18
119	GILEAD SCIENCES INC	-	GILD	纳斯达克	美国	15,800	8,740,160.32	0.18
120	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	安徽海螺水泥股份有限公司	00914	香港	中国香港	536,000	8,530,133.27	0.18
121	UNITEDHEALTH GROUP INC	-	UNH	纽约	美国	9,000	8,426,928.96	0.18
122	CVS HEALTH CORP	-	CVS	纽约	美国	13,000	8,253,324.14	0.17
123	CARABAO GROUP PCL	-	CBG	泰国	泰国	809,000	8,056,860.30	0.17
124	MINOR INTERNATIONAL PCL	-	MINT	泰国	泰国	1,031,000	7,834,646.36	0.16
125	ELDORADO RESORTS INC	-	ERI	纳斯达克	美国	76,000	7,657,842.38	0.16
126	MERCK & CO INC	-	MRK	纽约	美国	20,000	7,640,468.64	0.16

127	KRAFT HEINZ CO/THE	-	KHC	纳斯达克	美国	13,000	7,627,471.49	0.16
128	FORMOSA PLASTICS CORP	台湾塑料 工业股份 有限公司	1301	台湾	中国台 湾	470,000	7,513,618.04	0.16
129	COMPEQ MANUFA CTURING CO LTD	华通电脑 股份有限 公司	2313	台湾	中国台 湾	2,135,000	7,501,802.88	0.16
130	FISERV INC	-	FISV	纳斯达克	美国	10,400	7,498,507.91	0.16
131	NEW ORIENTA L EDUCATI ON & TECHNOL OGY GROUP INC	-	EDU	纽约	美国	27,000	7,498,295.71	0.16
132	THAI UNION GROUP PCL	-	TU	泰国	泰国	1,793,000	7,447,282.33	0.16
133	GUDANG GARAM TBK PT	-	GGRM	印度尼西 亚	印度尼 西亚	212,200	7,349,917.70	0.15
134	SOUFUN HOLDING S LTD	-	SFUN	纽约	美国	220,300	7,348,092.40	0.15
135	ALSEA SAB DE CV	-	ALSEA*	墨西哥	墨西哥	290,200	7,260,376.12	0.15
136	NUTRIBIO TECH CO LTD	-	222040	韩国	韩国	17,030	7,216,961.52	0.15
137	EOG RESOURC ES INC	-	EOG	纽约	美国	13,000	7,191,271.15	0.15
138	SINO BIOPHAR MACEUTI CAL LTD	中国生物 制药有限 公司	01177	香港	中国香 港	1,651,000	7,126,065.36	0.15

139	PICC PROPERTY & CASUALTY CO LTD	中国人民 财产保险 股份有限 公司	02328	香港	中国香 港	678,000	7,023,339.53	0.15
140	QUANTA COMPUTE R INC	广达电脑 股份有限 公司	2382	台湾	中国台 湾	560,000	7,019,230.77	0.15
141	REYNOLD S AMERICA N INC	-	RAI	纽约	美国	19,600	7,009,364.07	0.15
142	NORDEX SE	-	NDX1	德国	德国	37,000	6,981,412.24	0.15
143	CHEVRON CORP	-	CVX	纽约	美国	10,000	6,951,486.96	0.14
144	ONO PHARMA CEUTICA L CO LTD	-	4528	东京	日本	23,700	6,786,298.01	0.14
145	CRRC CORP LTD	中国中车 股份有限 公司	01766	香港	中国香 港	1,145,000	6,762,307.02	0.14
146	AMERICA MOVIL SAB DE CV	-	AMX	纽约	美国	83,000	6,747,776.49	0.14
147	LINCOLN NATIONA L CORP	-	LNC	纽约	美国	26,000	6,684,382.22	0.14
148	ADVANCE D SEMICON DUCTOR ENGINEE RING INC	日月光半 导体制造 股份有限 公司	2311	台湾	中国台 湾	835,000	6,288,283.50	0.13
149	CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	中国神华 能源股份 有限公司	01088	香港	中国香 港	514,000	6,264,609.36	0.13
150	GMO PAYMENT GATEWA Y INC	-	3769	东京	日本	16,700	6,257,909.72	0.13

151	MASTERCARD INC	-	MA	纽约	美国	10,600	6,189,800.80	0.13
152	SSY GROUP LTD	石四药集团有限公司	02005	香港	中国香港	2,856,000	6,102,524.93	0.13
153	LARGAN PRECISION CO LTD	大立光电股份有限公司	3008	台湾	中国台湾	10,000	6,051,415.28	0.13
154	SYNAPTICS INC	-	SYNA	纳斯达克	美国	16,100	5,738,474.70	0.12
155	NXP SEMICONDUCTORS NV	-	NXPI	纳斯达克	美国	11,000	5,714,370.29	0.12
156	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	玉山金融控股股份有限公司	2884	台湾	中国台湾	1,445,000	5,641,480.70	0.12
157	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD	中海发展股份有限公司	01138	香港	中国香港	1,504,000	5,617,468.21	0.12
158	SYNCHRONY FINANCIAL	-	SYF	纽约	美国	33,000	5,532,012.29	0.12
159	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	-	OXY	纽约	美国	11,000	5,511,588.19	0.11
160	POLY PROPERTY GROUP CO LTD	保利置业集团有限公司	00119	香港	中国香港	3,223,000	5,454,272.68	0.11
161	XINGDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	兴达国际控股有限公司	01899	香港	中国香港	3,569,000	5,429,725.83	0.11
162	GOODBABY INTERNATIONAL	好孩子国际控股有限公司	01086	香港	中国香港	1,774,000	5,412,939.61	0.11

	TIONAL HOLDING S LTD							
163	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	可成科技股份有限公司	2474	台湾	中国台湾	105,000	5,124,182.30	0.11
164	PCHOME ONLINE INC	网络家庭国际信息股份有限公司	8044	台湾	中国台湾	70,000	5,091,819.04	0.11
165	HOTA INDUSTRIAL MANUFACTURING CO LTD	和大工业股份有限公司	1536	台湾	中国台湾	164,000	5,054,832.46	0.11
166	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	台塑石化股份有限公司	6505	台湾	中国台湾	280,000	5,034,284.36	0.10
167	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	-	SQM	纽约	美国	30,200	4,950,482.57	0.10
168	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	中国信托金融控股股份有限公司	2891	台湾	中国台湾	1,420,400	4,917,928.69	0.10
169	LG ELECTRONICS INC	-	66570	韩国	韩国	15,672	4,863,793.36	0.10
170	CP ALL PCL	-	CPALL	泰国	泰国	510,500	4,843,135.95	0.10
171	ITC LTD	-	ITC	印度	印度	131,518	4,759,587.16	0.10
172	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	臻鼎科技控股股份有限公司	4958	台湾	中国台湾	400,000	4,742,501.35	0.10

173	FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	富邦金融 控股股份 有限公司	2881	台湾	中国台 湾	600,000	4,641,815.66	0.10
174	WAN HAI LINES LTD	万海航运 股份有限 公司	2615	台湾	中国台 湾	1,255,000	4,590,239.93	0.10
175	CATHAY FINANCIA L HOLDING CO LTD	国泰金融 控股股份 有限公司	2882	台湾	中国台 湾	630,000	4,530,855.93	0.09
176	WENZHO U KANGNIN G HOSPITAL CO LTD	温州康宁 医院股份 有限公司	02120	香港	中国香 港	128,000	4,518,261.59	0.09
177	CHINA HARMON Y NEW ENERGY AUTO HOLDING LTD	中国和谐 新能源汽车 控股有限 公司	03836	香港	中国香 港	1,225,500	4,336,356.78	0.09
178	MOBILEY ENV	-	MBLY	纽约	美国	14,000	4,283,489.95	0.09
179	TATA CONSULT ANCY SERVICES LTD	-	TCS	印度	印度	16,977	4,257,878.27	0.09
180	CHINA NATIONA L BUILDING MATERIA L CO LTD	中国建材 股份有限 公司	03323	香港	中国香 港	1,470,000	4,246,639.40	0.09
181	SEMICON DUCTOR MANUFA CTURING INTERNA	中芯国际 集成电路 制造有限 公司	00981	香港	中国香 港	7,752,000	4,107,871.06	0.09

	TIONAL CORP							
182	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	中联重科 股份有限公司	01157	香港	中国香港	1,780,000	4,046,811.63	0.08
183	ADLINK TECHNOLOGY INC	凌华科技 股份有限公司	6166	台湾	中国台湾	290,133	3,964,518.35	0.08
184	BAJAJ FINANCE LTD	-	BAF	印度	印度	5,000	3,927,763.00	0.08
185	SANDS CHINA LTD	金沙中国 有限公司	01928	香港	中国香港	172,000	3,814,847.30	0.08
186	WELSPUN INDIA LTD	-	WLSI	印度	印度	356,000	3,808,398.14	0.08
187	SUN PHARMA CEUTICAL INDUSTRIES LTD	-	SUNP	印度	印度	50,116	3,756,836.73	0.08
188	CHIPBOND TECHNOLOGY CORP	颀邦科技 股份有限公司	6147	台湾	中国台湾	445,000	3,753,572.69	0.08
189	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	-	BDMS	泰国	泰国	831,000	3,749,676.26	0.08
190	EMBRAER SA	-	ERJ	纽约	美国	25,100	3,615,144.57	0.08
191	SINOPEC ENGINEERING RING	中石化炼化工程(集团)股份有	02386	香港	中国香港	600,000	3,589,720.54	0.07

	GROUP CO LTD	限公司						
192	NINE DRAGONS PAPER HOLDING S LTD	玖龙纸业 (控股)有限 公司	02689	香港	中国香 港	707,000	3,559,148.09	0.07
193	CHINA NT PHARMA GROUP CO LTD	中国泰凌 医药集团 有限公司	01011	香港	中国香 港	2,169,000	3,540,823.42	0.07
194	MAIL.RU GROUP LTD	-	MAIL	伦敦国际 金融期货 期权	英国	29,234	3,528,188.31	0.07
195	SAMSUNG HEAVY INDUSTRI ES CO LTD	-	10140	韩国	韩国	65,663	3,463,204.38	0.07
196	JOLLIBEE FOODS CORP	-	JFC	菲律宾	菲律宾	100,100	3,406,918.64	0.07
197	CHINA MERCHA NTS BANK CO LTD	招商银行 股份有限 公司	03968	香港	中国香 港	222,500	3,297,542.93	0.07
198	COWELL E HOLDING S INC	高伟电子 控股有限 公司	01415	香港	中国香 港	1,431,000	3,290,055.80	0.07
199	MEDIATE K INC	联发科技 股份有限 公司	2454	台湾	中国台 湾	65,000	3,258,928.57	0.07
200	TIMAH PERSERO TBK PT	-	TINS	印度尼西 亚	印度尼 西亚	9,115,300	3,203,000.55	0.07
201	CHINA GALAXY SECURITI ES CO LTD	中国银河 证券股份 有限公司	06881	香港	中国香 港	536,000	3,174,748.85	0.07
202	SUNAC CHINA	融创中国 控股有限	01918	香港	中国香 港	731,000	2,998,955.11	0.06

	HOLDING S LTD	公司						
203	COSMO LADY CHINA HOLDING S CO LTD	都市丽人 (中国)控股 有限公司	02298	香港	中国香 港	882,000	2,992,750.02	0.06
204	SCHLUMB ERGER LTD	-	SLB	纽约	美国	5,700	2,989,053.19	0.06
205	CHINA RESOURC ES GAS GROUP LTD	华润燃气 控股有限 公司	01193	香港	中国香 港	146,000	2,932,459.81	0.06
206	TIME WARNER INC	-	TWX	纽约	美国	6,000	2,925,950.69	0.06
207	SMILES SA	-	SMLE3	巴西	巴西	28,900	2,873,106.63	0.06
208	3D SYSTEMS CORP	-	DDD	纽约	美国	31,000	2,814,214.97	0.06
209	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	株洲中车 时代电气 股份有限 公司	03898	香港	中国香 港	74,000	2,694,341.68	0.06
210	SUL AMERICA SA	-	SULA11	巴西	巴西	82,500	2,672,968.55	0.06
211	HESS CORP	-	HES	纽约	美国	6,700	2,670,185.30	0.06
212	REALTEK SEMICON DUCTOR CORP	瑞昱半导 体股份有 限公司	2379	台湾	中国台 湾	130,000	2,668,581.67	0.06
213	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	紫金矿业 集团股份 有限公司	02899	香港	中国香 港	1,202,000	2,660,820.53	0.06
214	CASETEK HOLDING S LTD	铠胜控股 有限公司	5264	台湾	中国台 湾	115,000	2,658,410.36	0.06

215	EVERGREEN MARINE CORP TAIWAN LTD	长荣海运股份有限公司	2603	台湾	中国台湾	999,000	2,453,042.38	0.05
216	SINO-AMERICAN SILICON PRODUCTS INC	中美矽晶制品股份有限公司	5483	台湾	中国台湾	328,000	2,429,689.47	0.05
217	KOREA ELECTRIC POWER CORP	-	15760	韩国	韩国	6,916	2,405,214.71	0.05
218	LUKOIL PJSC	-	LUKOY	美国OTC	美国	8,600	2,379,791.79	0.05
219	CHINA NATIONAL MATERIALS CO LTD	中国中材股份有限公司	01893	香港	中国香港	1,661,000	2,370,813.84	0.05
220	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	-	32830	韩国	韩国	4,055	2,346,490.76	0.05
221	ULTRATECH CEMENT LTD	-	UTCEM	印度	印度	6,801	2,278,866.90	0.05
222	GENERAL INTERFAC E SOLUTION HOLDING LTD	业成控股股份有限公司	6456	台湾	中国台湾	140,000	2,258,236.13	0.05
223	SQUARE INC	-	SQ	纽约	美国	35,700	2,142,441.25	0.04
224	BARCLAYS AFRICA GROUP	-	BGA	南非	南非	32,434	2,118,105.39	0.04

	LTD							
225	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	306,000	2,097,525.00	0.04
226	ESTEE LAUDER COS INC/THE	-	EL	纽约	美国	3,400	2,052,144.20	0.04
227	CHINA TELECOM CORP LTD	中国电信股份有限公司	00728	香港	中国香港	690,000	2,040,499.72	0.04
228	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	-	SAHOL	土耳其	土耳其	93,806	2,036,296.21	0.04
229	PVR LTD	-	PVRL	印度	印度	19,804	1,966,254.14	0.04
230	TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS	-	TKC	纽约	美国	31,900	1,935,547.81	0.04
231	CHINA MACHINERY ENGINEERING CORP	中国机械设备工程股份有限公司	01829	香港	中国香港	436,000	1,874,415.32	0.04
232	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	银泰商业(集团)有限公司	01833	香港	中国香港	339,000	1,860,141.90	0.04
233	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	中国铁建股份有限公司	01186	香港	中国香港	220,000	1,818,278.93	0.04
234	GENTING BHD	-	GENT	马来西亚	马来西亚	134,400	1,812,412.00	0.04
235	CHINA MINSHENG	中国民生银行股份有限公司	01988	香港	中国香港	280,000	1,790,073.98	0.04

	BANKING CORP LTD							
236	INDOCEM ENT TUNGGAL PRAKARS A TBK PT	-	INTP	印度尼西亚	印度尼西亚	208,200	1,763,650.45	0.04
237	MAN WAH HOLDING S LTD	敏华控 股有 限公 司	01999	香港	中国香 港	182,000	1,735,988.86	0.04
238	BBMG CORP	北京金隅 股份有 限公 司	02009	香港	中国香 港	687,000	1,356,375.91	0.03
239	FIBRIA CELULOS E SA	-	FBR	纽约	美国	30,000	1,344,807.36	0.03
240	GIGASOL AR MATERIA LS CORP	硕禾电 子材 料股 份有 限公 司	3691	台湾	中国台 湾	12,000	1,221,789.99	0.03
241	WILMAR INTERNA TIONAL LTD	-	WIL	新加坡	新加坡	71,900	1,154,388.63	0.02
242	DAWNRA YS PHARMA CEUTICA L HOLDING S LTD	东瑞制 药 (控 股) 有 限 公 司	02348	香港	中国香 港	224,000	1,133,394.43	0.02
243	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	-	GARAN	土耳其	土耳其	55,893	976,306.23	0.02
244	CHINA RESOURC ES BEER HOLDING S CO LTD	华润啤 酒 (控 股) 有 限 公 司	00291	香港	中国香 港	60,000	866,661.10	0.02
245	VALUE PARTNER S GROUP	惠理集 团有 限公 司	00806	香港	中国香 港	113,000	686,687.90	0.01

	LTD							
246	CGN NEW ENERGY HOLDING S CO LTD	中国广核新能源控股有限公司	01811	香港	中国香港	680,000	610,252.49	0.01
247	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	中国铝业股份有限公司	02600	香港	中国香港	252,000	523,381.26	0.01
248	JIANGXI COPPER CO LTD	江西铜业股份有限公司	00358	香港	中国香港	68,000	501,569.43	0.01
249	CHINA COAL ENERGY CO LTD	中国中煤能源股份有限公司	01898	香港	中国香港	138,000	475,330.28	0.01
250	YANZHOU COAL MINING CO LTD	兖州煤业股份有限公司	01171	香港	中国香港	80,000	342,561.90	0.01
251	CHINA FOODS LTD	中国食品有限公司	00506	香港	中国香港	120,000	263,588.05	0.01
252	EVERLIGHT ELECTRONICS CO LTD	亿光电子工业股份有限公司	2393	台湾	中国台湾	14,000	150,453.18	0.00
253	XINYI AUTOMOBILE GLASS HONG KONG ENTERPRISES LTD	信义汽车玻璃香港企业有限公司	08328	香港	中国香港	244,250	0.00	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	----------	------	----------	----------------

1	SYNAPTICS INC	SYNA	173,543,805.76	3.31
2	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	01398	58,602,382.96	1.12
3	APPLE INC	AAPL	54,197,180.69	1.04
4	CHINA MOBILE LTD	00941	53,759,741.22	1.03
5	HONG KONG EXCHANGES AND CLEARING LTD	00388	49,847,333.00	0.95
6	BANK OF CHINA LTD	03988	44,736,099.57	0.85
7	ANGANG STEEL CO LTD	00347	41,443,992.94	0.79
8	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TSM	35,687,123.66	0.68
9	CRCC HIGH-TECH EQUIPMENT CORP LTD	01786	35,588,079.47	0.68
10	CNOOC LTD	00883	33,464,083.62	0.64
11	LEXMARK INTERNATIONAL INC	LXK	32,648,077.99	0.62
12	JD.COM INC	JD	31,477,320.74	0.60
13	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930	31,303,580.70	0.60
14	CHINA EVERGRANDE GROUP	03333	29,814,295.47	0.57
15	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	02628	28,718,966.27	0.55
16	CATERPILLAR INC	CAT	28,497,511.57	0.54
17	BERKSHIRE HATHAWAY INC	BRK/B	28,058,724.40	0.54
18	CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	01800	28,020,005.46	0.54
19	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	28,019,478.09	0.54
20	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	ASII	26,788,899.68	0.51

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	SYNAPTICS INC	SYNA	147,664,654.04	2.82
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA	86,170,615.83	1.65
3	JD.COM INC	JD	75,282,652.13	1.44
4	BYD CO LTD	01211	48,027,197.57	0.92
5	AMAZON.COM INC	AMZN	43,187,095.00	0.82
6	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	2330	39,707,680.90	0.76
7	ANGANG STEEL CO LTD	00347	39,395,023.90	0.75
8	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	4528	38,296,056.87	0.73
9	LEXMARK INTERNATIONAL INC	LXK	36,647,814.85	0.70
10	BANK OF CHINA LTD	03988	36,152,207.93	0.69
11	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	01398	35,562,790.87	0.68
12	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	01833	34,729,492.63	0.66
13	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSION EQUIPMENT GROUP CO LTD	00658	33,673,991.31	0.64
14	TOYOTA MOTOR CORP	7203	33,590,150.21	0.64
15	KOSE CORP	4922	32,679,333.40	0.62
16	SINA CORP/CHINA	SINA	32,093,081.58	0.61
17	TEMP HOLDINGS CO LTD	2181	31,920,810.54	0.61
18	CNOOC LTD	00883	31,516,851.38	0.60
19	TAL EDUCATION GROUP	XRS	31,363,482.60	0.60
20	CTRP.COM INTERNATIONAL LTD	CTRP	30,421,485.66	0.58

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	3,313,824,589.29
卖出收入（成交）总额	3,582,595,204.53

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	DIREXION ETFS/USA	指数型	ETF 基金	Rafferty Asset Management LLC	122,604,538.60	2.56
2	HANG SENG INVESTME NT MANAGEM ENT	指数型	ETF 基金	Hang Seng Investment Management Ltd	115,326,174.17	2.40
3	ISHARES ETFS/USA	指数型	ETF 基金	BlackRock Fund Advisors	89,541,033.92	1.87
4	YUANTA SECURITIE S INVESTME NT TRUST	指数型	ETF 基金	Yuanta Securities Investment Trust Co Ltd/Taiwan	31,397,869.91	0.65

5	VANECK VECTORS ETFS/USA	指数型	ETF 基金	Van Eck Associates Corp	23,137,755.45	0.48
6	WISDOMTR EE ETFS/USA	指数型	ETF 基金	WisdomTree Asset Management Inc	14,740,620.47	0.31
7	POWERSHA RES ETFS/USA	指数型	ETF 基金	Invesco PowerShares Capital Management LLC	10,696,788.72	0.22
8	VANGUAR D ETF/USA	指数型	ETF 基金	Wellington Management Group LLP	8,830,039.61	0.18
9	STATE STREET ETF/USA	指数型	ETF 基金	SSgA Funds Management Inc	7,208,167.45	0.15
10	STATE STREET ETF/USA	指数型	ETF 基金	World Gold Trust Services LLC/USA	6,793,047.70	0.14

7.11 投资组合报告附注

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

7.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	30,428,457.69
3	应收股利	30,482,505.17
4	应收利息	15,387.21
5	应收申购款	847,029.94
6	其他应收款	64,767,476.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	126,540,856.28

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
518,601	12,671.17	26,023,482.62	0.40%	6,545,255,949.68	99.60%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	901,854.08	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年10月9日）基金份额总额	30,055,638,128.26
本报告期期初基金份额总额	6,712,477,058.84
本报告期基金总申购份额	56,519,602.94
减：本报告期基金总赎回份额	197,717,229.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	6,571,279,432.30

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据本基金管理人发布的相关公告，孙毅先生自 2016 年 1 月 1 日起任华夏基金管理有限公司副总经理，自 2016 年 6 月 30 日起不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
MERRILL LYNCH	-	972,338,491.78	14.10%	829,152.08	12.93%	-
MORGAN STANLEY	-	872,586,483.42	12.65%	499,326.62	7.79%	-
CLSA	-	781,300,422.21	11.33%	681,143.63	10.62%	-
NOMURA	-	529,526,972.58	7.68%	280,442.26	4.37%	-
GOLDMAN	-	506,195,441.94	7.34%	292,942.92	4.57%	-

SACHS						
CITIC SECURITIES INTERNATIO NAL	-	464,629,873.96	6.74%	371,703.88	5.80%	-
CREDIT SUISSE	-	447,509,859.17	6.49%	358,072.06	5.59%	-
DEUTSCHE BANK	-	347,936,856.26	5.05%	325,937.65	5.08%	-
J.P.MORGAN	-	344,381,166.19	4.99%	206,942.26	3.23%	-
CICC	-	205,858,907.12	2.99%	306,021.66	4.77%	-
BOCI SECURITIES	-	173,328,531.95	2.51%	284,977.42	4.45%	-
MIZUHO	-	158,601,068.53	2.30%	247,753.50	3.86%	-
JEFFERIES	-	150,306,727.30	2.18%	252,916.21	3.95%	-
KGI	-	149,799,910.56	2.17%	251,009.04	3.92%	-
CAPITAL SECURITIES CORP	-	142,493,149.14	2.07%	250,147.13	3.90%	-
SHENYIN WANGUO SECURITIES	-	103,717,099.29	1.50%	124,460.51	1.94%	-
BOCOM INTERNATIO NAL HOLDINGS	-	78,181,738.31	1.13%	93,818.11	1.46%	-
FIRST SECURITIES	-	76,996,824.91	1.12%	99,501.37	1.55%	-
UBS	-	62,580,504.64	0.91%	135,296.08	2.11%	-

FIRST SHANGHAI SECURITIES	-	58,052,762.92	0.84%	69,663.55	1.09%	-
SINOPAC SECURITIES	-	53,574,088.83	0.78%	74,738.23	1.17%	-
MASTERLIN K	-	53,355,855.29	0.77%	71,160.44	1.11%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	45,668,247.06	0.66%	143,057.31	2.23%	-
HSBC	-	43,597,174.64	0.63%	53,246.87	0.83%	-
CATHAY SECURITIES	-	32,111,713.50	0.47%	45,484.51	0.71%	-
ICBC INTERNATIO NAL SECURITIES	-	20,775,306.98	0.30%	24,930.37	0.39%	-
MACQUARIE SECURITIES	-	18,096,597.24	0.26%	34,066.40	0.53%	-
CITIGROUP	-	1,207,415.02	0.02%	1,207.42	0.02%	-
SCOTIA CAPITAL	-	1,193,070.57	0.02%	1,789.62	0.03%	-

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，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 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。

v 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。

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、华福证券、华融证券、华鑫证券、上海证券、申万宏源证券、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，华福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。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	93,442,072.65	17.33%
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	35,652,478.15	6.61%
GOLDMAN SACHS	-	-	-	-	26,314,498.59	4.88%
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	90,051,497.95	16.70%
DEUTSCHE BANK	-	-	-	-	17,760,808.66	3.29%
CICC	-	-	-	-	8,040,691.26	1.49%
BOCI SECURITIES	-	-	-	-	16,656,344.32	3.09%
MIZUHO	-	-	-	-	13,676,537.61	2.54%
JEFFERIES	-	-	-	-	18,304,046.10	3.39%
KGI	-	-	-	-	39,647,793.98	7.35%

CAPITAL SECURITIES CORP	-	-	-	-	49,936,426.14	9.26%
FIRST SECURITIES	-	-	-	-	5,942,787.27	1.10%
UBS	-	-	-	-	27,616,875.71	5.12%
SINOPAC SECURITIES	-	-	-	-	8,710,723.61	1.62%
MASTERLINK	-	-	-	-	6,084,795.87	1.13%
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	49,703,255.63	9.22%
HSBC	-	-	-	-	27,119,805.24	5.03%
MACQUARIE SECURITIES	-	-	-	-	4,614,384.11	0.86%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
2	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	2016-01-13
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	2016-01-13
4	华夏基金管理有限公司关于调整中国建设银行储蓄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	2016-01-21
5	华夏基金管理有限公司关于设立上海华夏财富投资管理有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-30
6	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	2016-02-03
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增联讯证券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	2016-02-18
8	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增江苏江南农村商业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	2016-03-03
9	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	2016-03-04

10	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华夏财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-04
11	关于华夏基金管理有限公司旗下部分开放式基金在大同证券有限责任公司开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-08
12	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	2016-03-22
13	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	2016-04-15
14	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众禄金融控股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	2016-05-10
15	关于停止支付宝基金专户电子交易开户及认购、申购、定期定额申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-13
16	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中正达广投资管理有限公司、北京汇成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	2016-05-24
17	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	2016-05-25
18	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海天天基金销售有限公司调整申购、赎回数额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-26
19	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	2016-05-27
20	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	2016-06-03
21	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	2016-06-28

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

11.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

11.1.2 《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》；

11.1.3 《华夏全球精选股票型证券投资基金托管协议》；

11.1.4 法律意见书；

11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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
二〇一六年八月二十七日