

# 华夏全球精选股票型证券投资基金

## 2019 年半年度报告

2019 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：二〇一九年八月二十九日

## §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 2019 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 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.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表 11	
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	28
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	28
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.....	29
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	43
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	45
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.....	45
7.11 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	51

## §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	4,088,363,130.07 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	李彬	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区A区	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区金融大街33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	田国立

## 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	《证券时报》
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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-93,674,769.79
本期利润	295,983,150.26
加权平均基金份额本期利润	0.0702
本期加权平均净值利润率	7.26%
本期基金份额净值增长率	7.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-126,070,918.42
期末可供分配基金份额利润	-0.0308
期末基金资产净值	3,992,222,932.07
期末基金份额净值	0.976
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-2.40%

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	3.50%	1.14%	6.36%	0.59%	-2.86%	0.55%
过去三个月	-1.21%	0.95%	2.93%	0.61%	-4.14%	0.34%
过去六个月	7.49%	0.97%	14.88%	0.66%	-7.39%	0.31%
过去一年	-4.50%	1.31%	3.61%	0.79%	-8.11%	0.52%
过去三年	33.70%	1.09%	31.09%	0.62%	2.61%	0.47%
自基金合同生效起至今	-2.40%	1.24%	25.11%	1.11%	-27.51%	0.13%

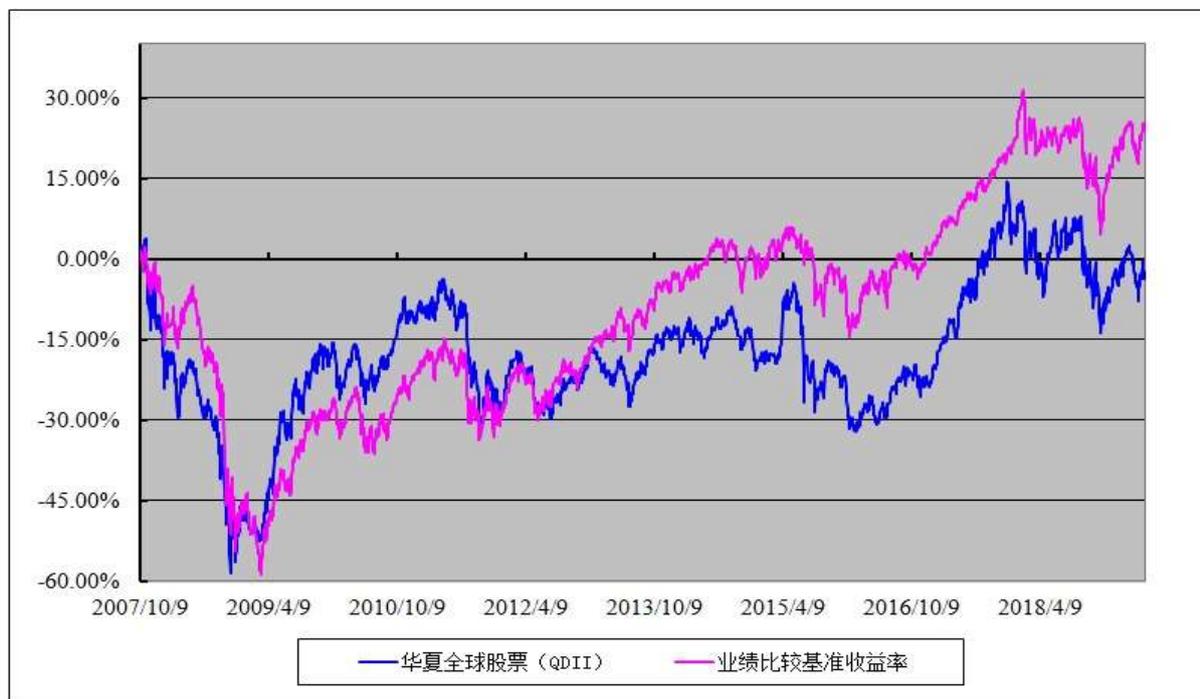
注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

#### 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 2019 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、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 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。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF 及华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、A 股市场指数、海外市场指数及信用债指数等较为完整的产品线。

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 2019 年 6 月 30 日数据），华夏移动互联混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中排序 9/34；华夏稳增混合在“混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金（A 类）”中排序 8/27；华夏回报混合(H 类)在“混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金（非 A 类）”中排序 8/89；华夏鼎沛债券(A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 1/228；华夏理财 30 天债券(A 类)在“债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金（摊余成本法）（A 类）”中排序 10/40；华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 7/19；华夏上证 50AH 优选指数（LOF）（A 类）在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（A 类）”中排序 8/29；华夏上证 50AH 优选指数（LOF）（C 类)在“标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非 A 类）”中排序 4/11；华夏上证 50ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 6/61；华夏消费 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF

基金”中排序 3/31；华夏沪深 300ETF 联接(C 类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 9/34。

上半年，公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上，华夏安康债券、华夏收益债券（QDII）和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报 QDII 明星基金和 2018 年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏鼎茂债券（004042）荣获“2018 年度开放式债券型金牛基金”奖，华夏中小板 ETF（159902）荣获“2018 年度开放式指数型金牛基金”奖。

在客户服务方面，2019 年上半年度，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）华夏基金客服电话系统上线智能语音功能，客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金信息，同时系统还可以进行身份信息认证，主动告知业务办理进度，为客户提供全面、准确、便捷的服务，提升客户体验；（2）直销电子交易平台开通华夏惠利货币 A 的快速赎回业务，为广大投资者的资金使用提供便利；（3）与微众银行、华融湘江银行、紫金农商银行等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“你的今年收益知否？知否？”、“你的户口本更新了”、“户龄”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李湘杰	本基金的基金经理、董事总经理	2016-05-25	-	17 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。
--	--	--	--	--	---

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》等法律法规和基金合同，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，全球主要股票市场呈现鲜明的分阶走势：第一阶段为年初以来在中美贸易谈判积极进展推动外加美联储鸽派转向的推动下，刺激全球风险偏好大幅改善，带动以股票为代表的风险资产自 18 年末低点显著修复估值反弹。A/H 市场在流动性释放以及风险偏好提升的背景下一季度领涨全球，美股市场也显著反弹，一度创出新高；但进入第二阶段，随着国内金融去杠杆再度显现，外加 5 月之后贸易摩擦重新爆发超市场预期，避险情绪叠加对增长的担忧使得全球风险偏好因此急转直下，资金再度避险，估值大幅回撤、盈利前景趋于谨慎对全球股市造成双杀。但临近季末，随着美联储在 6 月 FOMC 会议上进一步强化降息预期释放宽松信号，以及市场逐渐预期 G20 谈判取得阶段性进展，全球股票市场风险偏好部分恢复，推动美股部分指数再创新高。

考虑到贸易战重燃对于中美市场的不确定性加剧，我们对美国为首的发达国家市场股票进行了超配，对新兴市场股票进行了低配。重点配置长期趋势向好、业绩增长确定性强的科技、互联网及移动支付等板块。我们坚持“自下而上”研究，选择具有成长性、国际竞争力、性价比高的平台型领导厂商进行中长期投资。报告期内，本基金着重在云计算、互联网、教育、医疗健康、智能硬件创新等领域进行投资，精选细分板块里全球领先的优质龙头公司，对公司盈利能力、现金流质量、负债情况等严格筛选，以确保能在流动性趋紧的情况下，企业具备内生自我造血的能力。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.976 元，本报告期份额净值增长率为 7.49%，同期业绩比较基准增长率以美元计为 14.88%（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，影响全球经济体的主要宏观因素变化在于美联储宽松转向和全球利率大幅下行，尽管贸易摩擦格局预计仍将维持目前局面，加大增长下行风险，但美联储预防式降息或将起到一定支撑效果，基准情形下不至于衰退。当前估值处于合理位置，不算泡沫，基本面走向和外部冲击是关键。欧洲市场增长在外需拖累以及政局混乱的背景下仍将面临压力；新兴市场经济增长压力较大，整体宏观不确定性仍旧严峻。考虑到美国的宽松信号，预计美股市场仍将维持相对强劲的优势，从行业来看，以科技、消费、医药行业为代表的新经济板块与整体宏观周期相关度较弱，可能会有较明显的超额收益；而传统周期、金融等行业与整体宏观周期相关度较强，下行压力较大。

本基金将继续跟踪分析全球宏观政策和经济态势，采取积极的仓位策略，持续跟踪新经济板块，聚焦优质个股，寻找确定性的投资机会，以期获得超额收益。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务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技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	484,127,698.98	605,077,647.35
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	3,483,075,695.47	3,315,946,616.52
其中：股票投资		3,365,311,122.12	3,163,726,599.50
基金投资		117,764,573.35	152,220,017.02
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		61,528,146.49	19,053,521.43
应收利息	6.4.7.5	16,616.32	24,912.77
应收股利		4,643,540.40	569,161.72
应收申购款		850,002.03	1,139,601.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	5,170,849.00	5,999,448.93
资产总计		4,039,412,548.69	3,947,810,910.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		26,701,621.64	3,722,548.42
应付赎回款		7,994,187.15	6,744,298.75
应付管理人报酬		6,014,917.90	6,276,378.43
应付托管费		1,137,957.42	1,187,422.96
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	5,340,932.51	6,188,165.43
负债合计		47,189,616.62	24,118,813.99
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	4,088,363,130.07	4,319,161,751.99
未分配利润	6.4.7.10	-96,140,198.00	-395,469,655.45
所有者权益合计		3,992,222,932.07	3,923,692,096.54
负债和所有者权益总计		4,039,412,548.69	3,947,810,910.53

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.976 元，基金份额总额 4,088,363,130.07 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019 年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年6月30日
<b>一、收入</b>		358,965,594.00	-61,438,107.62
1.利息收入		1,300,220.96	757,967.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,300,220.96	757,967.90
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）		-24,613,558.99	258,813,745.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-47,792,234.40	286,647,294.23
基金投资收益	6.4.7.13	5,713,811.75	-42,621,227.87
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	-	-
股利收益	6.4.7.17	17,464,863.66	14,787,678.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	389,657,920.05	-320,530,555.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-7,873,412.58	-1,720,348.15
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	494,424.56	1,241,083.59
<b>减：二、费用</b>		62,982,443.74	80,622,781.75
1.管理人报酬		37,434,642.39	45,593,821.66
2.托管费		7,082,229.65	8,625,858.13
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	18,299,925.52	25,440,414.58
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		23,727.56	-
7.其他费用	6.4.7.21	141,918.62	962,687.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		295,983,150.26	-142,060,889.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		295,983,150.26	-142,060,889.37

## 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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	4,319,161,751.99	-395,469,655.45	3,923,692,096.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	295,983,150.26	295,983,150.26
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）	-230,798,621.92	3,346,307.19	-227,452,314.73
其中：1.基金申购款	130,175,401.71	-4,116,009.22	126,059,392.49
2.基金赎回款	-360,974,023.63	7,462,316.41	-353,511,707.22
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）	4,088,363,130.07	-96,140,198.00	3,992,222,932.07
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	5,169,806,144.57	259,074,754.84	5,428,880,899.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-142,060,889.37	-142,060,889.37
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）	-606,698,634.50	-16,620,765.88	-623,319,400.38
其中：1.基金申购款	348,150,198.13	14,045,011.53	362,195,209.66
2.基金赎回款	-954,848,832.63	-30,665,777.41	-985,514,610.04
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）	4,563,107,510.07	100,393,099.59	4,663,500,609.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

## 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》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》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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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

根据财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关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增值税征收范围，不征收增值税。
- 2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。
- 3、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- 4、存款利息收入不征收增值税。
- 5、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- 6、对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 7、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。
- 8、本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	484,127,698.98
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	484,127,698.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,077,231,381.25	3,365,311,122.12	288,079,740.87
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	115,427,069.00	117,764,573.35	2,337,504.35
其他	-	-	-
合计	3,192,658,450.25	3,483,075,695.47	290,417,245.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	16,616.32
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	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	16,616.32

## 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
其他应收款	5,170,849.00
待摊费用	-
合计	5,170,849.00

## 6.4.7.7 应付交易费用

无。

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	30,086.87
预提费用	136,157.10
其他应付款	5,174,688.54
合计	5,340,932.51

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,319,161,751.99	4,319,161,751.99
本期申购	130,175,401.71	130,175,401.71
本期赎回（以“-”号填列）	-360,974,023.63	-360,974,023.63
本期末	4,088,363,130.07	4,088,363,130.07

## 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	-35,985,423.57	-359,484,231.88	-395,469,655.45
本期利润	-93,674,769.79	389,657,920.05	295,983,150.26
本期基金份额交易产生的变动数	3,589,274.94	-242,967.75	3,346,307.19
其中：基金申购款	-2,514,679.20	-1,601,330.02	-4,116,009.22
基金赎回款	6,103,954.14	1,358,362.27	7,462,316.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-126,070,918.42	29,930,720.42	-96,140,198.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,300,171.00
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	49.96
合计	1,300,220.96

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,169,807,637.07
减：卖出股票成本总额	9,217,599,871.47
买卖股票差价收入	-47,792,234.40

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	853,063,653.57
减：卖出/赎回基金成本总额	847,349,841.82
基金投资收益	5,713,811.75

6.4.7.14 债券投资收益

无。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,432,166.74
基金投资产生的股利收益	3,032,696.92

合计	17,464,863.66
----	---------------

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	389,657,920.05
——股票投资	376,355,038.46
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	13,302,881.59
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	389,657,920.05

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	481,663.48
其他	12,761.08
合计	494,424.56

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	18,299,925.52
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	18,299,925.52

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	79,343.16

信息披露费	56,813.94
银行费用	5,761.52
合计	141,918.62

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
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
中信里昂证券有限公司（CLSA）	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	138,220,496.39	0.76%	247,956,739.20	1.30%
中信里昂证券有限公司（CLSA）	66,834,956.02	0.37%	-	-

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	159,195.83	1.58%	-	-
中信里昂证券有限公司 (CLSA)	20,050.53	0.20%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	198,365.38	1.67%	-	-
中信里昂证券有限公司 (CLSA)	-	-	-	-

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	37,434,642.39	45,593,821.66
其中：支付销售机构的客户维护费	5,726,460.35	6,647,308.91

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,082,229.65	8,625,858.13

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

无。

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

无。

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

无。

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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	100,143,218.21	410,440.42	138,423,196.25	588,385.84
摩根大通银行活期存款	383,984,480.77	889,730.58	737,752,373.03	168,383.67

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

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

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（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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，参考压力测试结果，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。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，本基金所投资的证券均能及时变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的全球证券市场中具有良好流动性的金融工具。本基金投资海外国家/地区的资本市场规模较大、金融市场发展程度高，投资的证券品种成交活跃。本基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 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敏感性指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

##### 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。

## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	343,956,131.90	1,297.20	40,030,252.13	383,987,681.23
交易性金融资产	2,710,948,368.40	82,272,489.27	689,854,837.80	3,483,075,695.47
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	61,528,146.49	61,528,146.49
应收利息	47.71	-	-	47.71
应收股利	757,753.70	76,764.72	3,446,395.63	4,280,914.05
应收申购款	-	-	-	-
应收在途资金	1,292,914.04	3,877,934.96	-	5,170,849.00
其他资产	-	-	-	-
资产合计	3,056,955,215.75	86,228,486.15	794,859,632.05	3,938,043,333.95
以外币计价的负债				
应付证券清算款	6,457,554.00	2,584,054.31	17,660,013.33	26,701,621.64
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
应付在途资金	3,880,807.89	1,293,880.65	-	5,174,688.54
其他负债	-	-	-	-
负债合计	10,338,361.89	3,877,934.96	17,660,013.33	31,876,310.18
项目	上年度末 2018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	427,391,193.37	1,291.82	66,540,468.58	493,932,953.77
交易性金融资产	2,492,207,865.88	166,836,077.82	656,902,672.82	3,315,946,616.52
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	19,053,521.43	19,053,521.43
应收利息	-	-	-	-

应收股利	558,281.51	10,880.21	-	569,161.72
应收申购款	-	-	-	-
应收在途资金	1,138,922.03	4,860,526.90	-	5,999,448.93
其他资产	-	-	-	-
资产合计	2,921,296,262.79	171,708,776.75	742,496,662.83	3,835,501,702.37
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	-	3,722,548.42	-	3,722,548.42
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
应付在途资金	4,864,826.48	1,137,978.48	-	6,002,804.96
其他负债	-	-	-	-
负债合计	4,864,826.48	4,860,526.90	-	9,725,353.38

## 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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	195,308,351.19	191,288,817.45
	所有外币相对人民币贬值 5%	-195,308,351.19	-191,288,817.45

## 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（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

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证券价格实施监控，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 2019年6月30日		上年度末 2018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	3,365,311,122.12	84.30	3,163,726,599.50	80.63
交易性金融资产—基金投资	117,764,573.35	2.95	152,220,017.02	3.88
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,483,075,695.47	87.25	3,315,946,616.52	84.51

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除摩根士丹利资本国际全球指数(MSCI All Country World Index)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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	+5%	163,426,478.51	216,810,183.86
	-5%	-163,426,478.51	-216,810,183.86

#### 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 2019 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 3,483,075,695.47 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2018 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 3,315,946,616.52 元，第二层次的余额为 0 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	3,365,311,122.12	83.31
	其中：普通股	3,107,410,161.39	76.93
	存托凭证	131,608,005.65	3.26
	优先股	-	-
	房地产信托	126,292,955.08	3.13
2	基金投资	117,764,573.35	2.92
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	484,127,698.98	11.99
8	其他各项资产	72,209,154.24	1.79
9	合计	4,039,412,548.69	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 (%)
美国	2,603,050,020.62	65.20
中国台湾	658,253,809.96	16.49
中国香港	72,406,263.70	1.81
法国	31,113,398.36	0.78
瑞士	487,629.48	0.01
合计	3,365,311,122.12	84.30

### 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	2,482,728,049.38	62.19
非必需消费品	217,915,004.56	5.46
保健	179,466,251.86	4.50
房地产	130,753,390.45	3.28
金融	115,465,788.24	2.89
工业	102,290,939.60	2.56
通信服务	65,170,485.55	1.63
必需消费品	53,565,223.74	1.34
材料	14,599,116.61	0.37
能源	3,356,872.13	0.08
公用事业	-	-
合计	3,365,311,122.12	84.30

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	MICROS OFT CORP	-	MSFT	纳斯达 克	美国	306,800.00	282,542,800.40	7.08
2	PAYPAL HOLDIN GS INC	-	PYPL	纳斯达 克	美国	241,000.00	189,637,637.09	4.75
3	TAIWAN SEMICO DUCTO R MANUFA CTURIN G CO LTD	台湾积体 电路制造 股份有限 公司	2330	台湾	中国台湾	2,826,000.0 0	149,842,921.86	3.75
4	MASTER CARD INC	-	MA	纽约	美国	60,900.00	110,750,571.44	2.77
5	VISA INC	-	V	纽约	美国	91,300.00	108,930,412.12	2.73
6	ADOBE INC	-	ADBE	纳斯达 克	美国	49,700.00	100,673,828.67	2.52
7	GLOBAL PAYMEN	-	GPN	纽约	美国	82,200.00	90,489,517.47	2.27

	TS INC							
8	VEEVA SYSTEMS INC	-	VEEV	纽约	美国	75,100.00	83,695,767.06	2.10
9	GENIUS ELECTR ONIC OPTICAL CO LTD	玉晶光电 股份有限 公司	3406	台湾	中国台湾	707,000.00	63,838,106.59	1.60
10	WASTE MANAG EMENT INC	-	WM	纽约	美国	78,300.00	62,102,403.10	1.56
11	SHOIFY INC	-	SHOP	纽约	美国	29,400.00	60,665,171.44	1.52
12	MERCA DOLIBR E INC	-	MELI	纳斯达 克	美国	14,000.00	58,880,293.08	1.47
13	AMERIC AN TOWER CORP	-	AMT	纽约	美国	41,700.00	58,610,701.72	1.47
14	BROADC OM INC	-	AVGO	纳斯达 克	美国	24,800.00	49,077,988.33	1.23
15	WORLDP AY INC	-	WP	纽约	美国	56,300.00	47,432,439.52	1.19
16	EURONE T WORLD WIDE INC	-	EEFT	纳斯达 克	美国	40,700.00	47,073,600.80	1.18
17	LARGAN PRECISI ON CO LTD	大立光电 股份有限 公司	3008	台湾	中国台湾	55,000.00	47,038,476.41	1.18
18	ALTERY X INC	-	AYX	纽约	美国	62,000.00	46,510,370.38	1.17
19	XILINX INC	-	XLNX	纳斯达 克	美国	55,600.00	45,072,953.11	1.13
20	ALIBAB A GROUP HOLDIN G LTD	-	BABA	纽约	美国	35,600.00	41,471,077.79	1.04

21	EVERBR IDGE INC	-	EVBG	纳斯达 克	美国	62,800.00	38,605,400.34	0.97
22	SALESF ORCE.C OM INC	-	CRM	纽约	美国	36,300.00	37,864,465.80	0.95
23	MONGO DB INC	-	MDB	纳斯达 克	美国	36,100.00	37,745,189.75	0.95
24	SERVICE NOW INC	-	NOW	纽约	美国	19,300.00	36,430,417.12	0.91
25	ANAPLA N INC	-	PLAN	纽约	美国	101,900.00	35,355,846.52	0.89
26	COUPA SOFTWA RE INC	-	COUP	纳斯达 克	美国	40,600.00	35,338,474.15	0.89
27	SEA LTD	-	SE	纽约	美国	147,400.00	33,662,848.52	0.84
28	AUTOMA TIC DATA PROCES SING INC	-	ADP	纳斯达 克	美国	29,000.00	32,961,230.39	0.83
29	WORKD AY INC	-	WDAY	纳斯达 克	美国	23,100.00	32,647,249.09	0.82
30	ASMEDI A TECHNO LOGY INC	祥硕科技 股份有限 公司	5269	台湾	中国台湾	304,000.00	32,642,628.30	0.82
31	VERISIG N INC	-	VRSN	纳斯达 克	美国	22,600.00	32,496,816.90	0.81
32	WORKIV A INC	-	WK	纽约	美国	80,600.00	32,187,716.64	0.81
33	IHS MARKIT LTD	-	INFO	纽约	美国	73,000.00	31,978,079.54	0.80
34	IDEXX LABORA TORIES INC	-	IDXX	纳斯达 克	美国	16,600.00	31,420,665.12	0.79
35	AMERIC AN EXPRES	-	AXP	纽约	美国	36,800.00	31,228,957.23	0.78

	S CO							
36	LVMH MOET HENNES SY LOUIS VUITTO N SE	-	MC	法国	法国	10,619.00	31,113,398.36	0.78
37	ZENDES K INC	-	ZEN	纽约	美国	50,800.00	31,092,370.69	0.78
38	FIDELIT Y NATION AL INFORM ATION SERVICE S INC	-	FIS	纽约	美国	36,700.00	30,952,346.80	0.78
39	OKTA INC	-	OKTA	纳斯达 克	美国	36,000.00	30,567,391.10	0.77
40	SAP SE	-	SAP	纽约	美国	32,500.00	30,564,916.21	0.77
41	PROCTE R & GAMBLE CO/THE	-	PG	纽约	美国	40,500.00	30,529,339.64	0.76
42	EQUINIX INC	-	EQIX	纳斯达 克	美国	8,800.00	30,508,213.68	0.76
43	ZSCALE R INC	-	ZS	纳斯达 克	美国	57,500.00	30,295,427.97	0.76
44	TRAVEL ERS COS INC/THE	-	TRV	纽约	美国	29,300.00	30,117,620.73	0.75
45	TWILIO INC	-	TWLO	纽约	美国	32,100.00	30,089,427.58	0.75
46	WIX.CO M LTD	-	WIX	纳斯达 克	美国	30,600.00	29,892,983.03	0.75
47	ELITE MATERI AL CO LTD	台光电子 材料股份 有限公司	2383	台湾	中国台湾	1,281,000.0 0	26,629,002.30	0.67
48	SBA COMMU NICATIO NS CORP	-	SBAC	纳斯达 克	美国	14,600.00	22,567,330.21	0.57

49	TRADE DESK INC/THE	-	TTD	纳斯达 克	美国	13,900.00	21,766,276.41	0.55
50	TAIWAN UNION TECHNO LOGY CORP	台耀科技 股份有限 公司	6274	台湾	中国台湾	782,000.00	21,599,429.43	0.54
51	NOVATE K MICROE LECTRO NICS CORP	联咏科技 股份有限 公司	3034	台湾	中国台湾	462,000.00	17,731,858.35	0.44
52	ATLASSI AN CORP PLC	-	TEAM	纳斯达 克	美国	19,400.00	17,450,023.52	0.44
53	PAYSIGN INC	-	PAYS	纳斯达 克	美国	186,000.00	17,096,141.46	0.43
54	ZTE CORP	中兴通讯 股份有限 公司	00763	香港	中国香港	861,200.00	17,092,912.29	0.43
55	PAYCOM SOFTWA RE INC	-	PAYC	纽约	美国	10,600.00	16,521,499.03	0.41
56	COSTCO WHOLE SALE CORP	-	COST	纳斯达 克	美国	8,800.00	15,987,032.36	0.40
57	Q2 HOLDIN GS INC	-	QTWO	纽约	美国	30,200.00	15,853,553.18	0.40
58	REALTE K SEMICO DUCTO R CORP	瑞昱半导 体股份有 限公司	2379	台湾	中国台湾	306,000.00	15,512,214.64	0.39
59	DANAHE R CORP	-	DHR	纽约	美国	15,700.00	15,425,754.35	0.39
60	ITEQ CORP	联茂电子 股份有限 公司	6213	台湾	中国台湾	632,000.00	15,283,040.03	0.38
61	HUBSPO	-	HUBS	纽约	美国	13,000.00	15,239,559.98	0.38

	T INC							
62	QUALCOMM INC	-	QCOM	纳斯达克	美国	29,000.00	15,165,794.45	0.38
63	RINGCENTRAL INC	-	RNG	纽约	美国	19,000.00	15,010,769.96	0.38
64	AUTODESK INC	-	ADSK	纳斯达克	美国	13,400.00	15,006,507.65	0.38
65	NICE LTD	-	NICE	纳斯达克	美国	15,600.00	14,692,608.84	0.37
66	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	-	CCI	纽约	美国	16,300.00	14,606,709.47	0.37
67	FLEXIUM INTERCONNECT INC	台郡科技股份有限公司	6269	台湾	中国台湾	756,000.00	14,457,567.74	0.36
68	CYBERARK SOFTWARE LTD	-	CYBR	纳斯达克	美国	16,300.00	14,325,444.87	0.36
69	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	臻鼎科技控股股份有限公司	4958	台湾	中国台湾	637,000.00	14,047,271.98	0.35
70	TRIPOD TECHNOLOGY CORP	健鼎科技股份有限公司	3044	台湾	中国台湾	573,000.00	13,983,422.56	0.35
71	ETSY INC	-	ETSY	纳斯达克	美国	33,100.00	13,964,901.22	0.35
72	GIANT MANUFACTURING CO LTD	巨大机械工业股份有限公司	9921	台湾	中国台湾	254,000.00	13,693,238.26	0.34
73	MERRY ELECTRONICS	美律实业股份有限公司	2439	台湾	中国台湾	365,000.00	13,685,029.68	0.34

	CO LTD							
74	TAIWAN CEMENT CORP	台湾水泥 股份有限 公司	1101	台湾	中国台湾	1,332,000.0 0	13,608,179.65	0.34
75	E.SUN FINANCI AL HOLDIN G CO LTD	玉山金融 控股股份 有限公司	2884	台湾	中国台湾	2,339,000.0 0	13,491,795.33	0.34
76	MERIDA INDUST RY CO LTD	美利达工 业股份有 限公司	9914	台湾	中国台湾	326,000.00	13,271,494.86	0.33
77	HOTAI MOTOR CO LTD	和泰汽车 股份有限 公司	2207	台湾	中国台湾	112,000.00	12,622,573.54	0.32
78	UNIMIC RON TECHNO LOGY CORP	欣兴电子 股份有限 公司	3037	台湾	中国台湾	1,447,000.0 0	11,316,023.14	0.28
79	TENCEN T HOLDIN GS LTD	腾讯控股 有限公司	00700	香港	中国香港	34,600.00	10,738,012.46	0.27
80	HUA NAN FINANCI AL HOLDIN GS CO LTD	华南金融 控股股份 有限公司	2880	台湾	中国台湾	2,162,000.0 0	10,000,642.98	0.25
81	YULON NISSAN MOTOR CO LTD	裕隆日产 汽车股份 有限公司	2227	台湾	中国台湾	158,000.00	9,639,532.13	0.24
82	SYSTEX CORP	精诚资讯 股份有限 公司	6214	台湾	中国台湾	508,000.00	8,644,208.84	0.22
83	FACEBO OK INC	-	FB	纳斯达 克	美国	6,300.00	8,358,947.73	0.21
84	AMAZO N.COM	-	AMZN	纳斯达 克	美国	600.00	7,810,882.90	0.20

	INC							
85	TAIFLEX SCIENTI FIC CO LTD	台虹科技 股份有限 公司	8039	台湾	中国台湾	787,000.00	7,542,662.12	0.19
86	MEDIAT EK INC	联发科技 股份有限 公司	2454	台湾	中国台湾	105,000.00	7,314,508.04	0.18
87	ASIA VITAL COMPO NENTS CO LTD	奇鋹科技 股份有限 公司	3017	台湾	中国台湾	841,000.00	7,173,952.79	0.18
88	TAIWAN SURFAC E MOUNTI NG TECHNO LOGY CORP	台湾表面 黏着科技 股份有限 公司	6278	台湾	中国台湾	554,000.00	7,165,466.90	0.18
89	INTERN ATIONA L GAMES SYSTEM CO LTD	鈹象电子 股份有限 公司	3293	台湾	中国台湾	107,000.00	7,097,757.23	0.18
90	ACCTON TECHNO LOGY CORP	智邦科技 股份有限 公司	2345	台湾	中国台湾	242,000.00	7,060,042.14	0.18
91	SINBON ELECTR ONICS CO LTD	信邦电子 股份有限 公司	3023	台湾	中国台湾	278,000.00	7,000,141.71	0.18
92	APEX INTERN ATIONA L CO LTD	泰鼎国际 股份有限 公司	4927	台湾	中国台湾	574,000.00	6,952,975.67	0.17
93	YUANTA FINANCI AL HOLDIN	元大金融 控股股份 有限公司	2885	台湾	中国台湾	1,644,000.0 0	6,802,159.70	0.17

	G CO LTD							
94	CHAILE ASE HOLDING CO LTD	中租控股股份有限公司	5871	台湾	中国台湾	234,000.00	6,670,911.20	0.17
95	VIVOTEK INC	晶睿通讯股份有限公司	3454	台湾	中国台湾	235,000.00	6,438,741.57	0.16
96	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	中国工商银行股份有限公司	01398	香港	中国香港	988,000.00	4,956,753.21	0.12
97	PING AN INSURANCE 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	54,000.00	4,458,226.15	0.11
98	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	-	TMO	纽约	美国	2,100.00	4,239,819.98	0.11
99	AURAS TECHNOLOGY CO LTD	双鸿科技股份有限公司	3324	台湾	中国台湾	123,000.00	3,984,044.14	0.10
100	COMPEQ MANUFACTURING CO LTD	华通电脑股份有限公司	2313	台湾	中国台湾	657,000.00	3,796,988.41	0.10
101	CHINA BIOLOGICAL PRODUCTS HOLDING	-	CBPO	纳斯达克	美国	5,500.00	3,603,374.01	0.09

	GS INC							
102	EXACT SCIENCE S CORP	-	EXAS	纳斯达克	美国	4,400.00	3,570,554.19	0.09
103	IOVANC E BIOTHE RAPEUTI CS INC	-	IOVA	纳斯达克	美国	21,100.00	3,556,777.29	0.09
104	SHIN ZU SHING CO LTD	新日兴股 份有限公 司	3376	台湾	中国台湾	136,000.00	3,515,045.96	0.09
105	TAIWAN PAIHO LTD	台湾百和 工业股份 有限公司	9938	台湾	中国台湾	176,000.00	3,502,444.69	0.09
106	STANDA RD FOODS CORP	佳格食品 股份有限 公司	1227	台湾	中国台湾	257,000.00	3,460,891.54	0.09
107	VOLTRO NIC POWER TECHNO LOGY CORP	旭隼科技 股份有限 公司	6409	台湾	中国台湾	23,000.00	3,454,479.97	0.09
108	COMPAL ELECTR ONICS INC	仁宝电脑 工业股份 有限公司	2324	台湾	中国台湾	759,000.00	3,426,670.64	0.09
109	CHIPBO ND TECHNO LOGY CORP	颀邦科技 股份有限 公司	6147	台湾	中国台湾	247,000.00	3,315,266.94	0.08
110	APPLE INC	-	AAPL	纳斯达克	美国	2,400.00	3,265,537.50	0.08
111	FIBROG EN INC	-	FGEN	纳斯达克	美国	10,200.00	3,168,109.25	0.08
112	ABBOTT LABORA TORIES	-	ABT	纽约	美国	5,000.00	2,890,811.35	0.07
113	VMWAR E INC	-	VMW	纽约	美国	2,500.00	2,873,796.47	0.07
114	CHINA	万科企业	02202	香港	中国香港	104,700.00	2,700,099.69	0.07

	VANKE CO LTD	股份有限 公司						
115	TAL EDUCAT ION GROUP	-	TAL	纽约	美国	10,100.00	2,645,453.31	0.07
116	JOHNSO N & JOHNSO N	-	JNJ	纽约	美国	2,700.00	2,585,272.18	0.06
117	BOSTON SCIENTI FIC CORP	-	BSX	纽约	美国	8,600.00	2,541,081.61	0.06
118	INTUITI VE SURGIC AL INC	-	ISRG	纳斯达 克	美国	700.00	2,524,286.72	0.06
119	LI NING CO LTD	李宁有限 公司	02331	香港	中国香港	147,000.00	2,383,265.67	0.06
120	SSY GROUP LTD	石四药集 团有限公 司	02005	香港	中国香港	370,000.00	2,299,174.43	0.06
121	NEW CHINA LIFE INSURA NCE CO LTD	新华人寿 保险股份 有限公司	01336	香港	中国香港	68,000.00	2,274,353.70	0.06
122	MERCK & CO INC	-	MRK	纽约	美国	3,800.00	2,190,485.66	0.05
123	NOVO NORDIS K A/S	-	NVO	纽约	美国	6,200.00	2,175,485.07	0.05
124	PFIZER INC	-	PFE	纽约	美国	7,200.00	2,144,246.43	0.05
125	GUARD ANT HEALTH INC	-	GH	纳斯达 克	美国	3,400.00	2,017,875.69	0.05
126	WH GROUP LTD	万洲国际 有限公司	00288	香港	中国香港	257,500.00	1,795,014.30	0.04

127	CANSINO BIOLOGICS INC	康希诺生物股份公司	06185	香港	中国香港	57,600.00	1,688,232.33	0.04
128	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	中国农业银行股份有限公司	01288	香港	中国香港	573,000.00	1,649,179.29	0.04
129	CHINA MOBILE LTD	中国移动有限公司	00941	香港	中国香港	25,500.00	1,596,910.52	0.04
130	ILLUMINA INC	-	ILMN	纳斯达克	美国	600.00	1,518,552.48	0.04
131	BILIBILI INC	-	BILI	纳斯达克	美国	13,100.00	1,465,252.93	0.04
132	DEXCOM INC	-	DXCM	纳斯达克	美国	1,400.00	1,442,147.07	0.04
133	BAIDU INC	-	BIDU	纳斯达克	美国	1,700.00	1,371,585.15	0.03
134	ANTHEM INC	-	ANTM	纽约	美国	700.00	1,358,076.36	0.03
135	UNITED HEALTH GROUP INC	-	UNH	纽约	美国	800.00	1,341,996.44	0.03
136	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	招商银行股份有限公司	03968	香港	中国香港	33,500.00	1,148,465.00	0.03
137	BAOZUN INC	-	BZUN	纳斯达克	美国	3,100.00	1,062,594.88	0.03
138	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	安徽海螺水泥股份有限公司	00914	香港	中国香港	23,000.00	990,936.96	0.02
139	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	中国石油化工股份有限公司	00386	香港	中国香港	208,000.00	972,127.78	0.02
140	CHINA	中国国际	03908	香港	中国香港	70,000.00	971,001.16	0.02

	INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	金融股份有限公司						
141	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	中升集团控股有限公司	00881	香港	中国香港	50,500.00	966,754.35	0.02
142	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	广州汽车集团股份有限公司	02238	香港	中国香港	130,000.00	954,277.97	0.02
143	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	石药集团有限公司	01093	香港	中国香港	84,000.00	931,569.64	0.02
144	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	申洲国际集团控股有限公司	02313	香港	中国香港	9,800.00	926,394.26	0.02
145	HUAZHU GROUP LTD	-	HTHT	纳斯达克	美国	3,700.00	922,069.14	0.02
146	BANK OF CHINA LTD	中国银行股份有限公司	03988	香港	中国香港	317,000.00	920,743.58	0.02
147	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	吉利汽车控股有限公司	00175	香港	中国香港	78,000.00	917,205.30	0.02
148	CHINA RESOUR	华润啤酒(控股)有限	00291	香港	中国香港	28,000.00	914,318.35	0.02

	CES BEER HOLDIN GS CO LTD	公司						
149	CHINA OVERSE AS LAND & INVEST MENT LTD	中国海外 发展有限 公司	00688	香港	中国香港	36,000.00	912,558.02	0.02
150	CNOOC LTD	中国海洋 石油有限 公司	00883	香港	中国香港	77,000.00	905,446.26	0.02
151	CHINA COMMU NICATIO NS SERVICE S CORP LTD	中国通信 服务股份 有限公司	00552	香港	中国香港	166,000.00	885,413.64	0.02
152	NETEAS E INC	-	NTES	纳斯达 克	美国	500.00	879,171.01	0.02
153	CHINA MENGNI U DAIRY CO LTD	中国蒙牛 乳业有限 公司	02319	香港	中国香港	33,000.00	878,627.55	0.02
154	CHINA SHENHU A ENERGY CO LTD	中国神华 能源股份 有限公司	01088	香港	中国香港	59,000.00	849,573.21	0.02
155	CHINA RESOUR CES LAND LTD	华润置地 有限公司	01109	香港	中国香港	28,000.00	847,777.66	0.02
156	VALUE PARTNE RS GROUP LTD	惠理集团 有限公司	00806	香港	中国香港	169,000.00	774,978.98	0.02
157	PINDUO	-	PDD	纳斯达	美国	4,900.00	694,942.80	0.02

	DUO INC			克				
158	CHINA ISOTOPE & RADIATION CORP	中国同辐股份有限公司	01763	香港	中国香港	40,000.00	648,507.67	0.02
159	PETROCHINA CO LTD	中国石油天然气股份有限公司	00857	香港	中国香港	166,000.00	629,724.88	0.02
160	LONZA GROUP AG	-	LONN	瑞士	瑞士	210.00	487,629.48	0.01
161	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育用品有限公司	02020	香港	中国香港	10,000.00	472,210.05	0.01
162	CHINA RAILWAY GROUP LTD	中国中铁股份有限公司	00390	香港	中国香港	68,000.00	355,517.39	0.01

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	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	279,089,234.18	7.11
2	XILINX INC	XLNX	244,045,446.60	6.22
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	2330	196,465,911.72	5.01
4	DELL TECHNOLOGIES INC	DELL	194,809,433.50	4.96
5	QUALCOMM INC	QCOM	162,786,041.09	4.15
6	APPLE INC	AAPL	147,343,571.85	3.76
7	ZTE CORP	00763	136,985,368.24	3.49

8	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL	133,686,602.65	3.41
9	GENIUS ELECTRONIC OPTICAL CO LTD	3406	116,440,100.71	2.97
10	MICROSOFT CORP	MSFT	111,442,412.02	2.84
11	VMWARE INC	VMW	107,770,705.12	2.75
12	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA	101,122,763.58	2.58
13	LARGAN PRECISION CO LTD	3008	96,535,990.24	2.46
14	STMICROELECTRONICS NV	STM	94,857,585.91	2.42
15	NVIDIA CORP	NVDA	92,321,201.52	2.35
16	WIRECARD AG	WDI	92,046,321.68	2.35
17	FACEBOOK INC	FB	90,913,483.71	2.32
18	SHOPIFY INC	SHOP	89,280,964.18	2.28
19	BROADCOM INC	AVGO	86,660,780.94	2.21
20	GLOBAL PAYMENTS INC	GPN	85,601,520.90	2.18
21	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	03968	83,938,042.23	2.14
22	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	LSCC	83,470,095.34	2.13
23	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	02018	82,836,394.59	2.11

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

#### 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	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	405,475,896.59	10.33
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	2330	319,338,978.96	8.14
3	ADOBE INC	ADBE	314,337,464.03	8.01
4	AMAZON.COM INC	AMZN	244,639,185.38	6.23
5	MICROSOFT CORP	MSFT	221,284,054.60	5.64
6	XILINX INC	XLNX	197,039,723.51	5.02
7	DELL TECHNOLOGIES INC	DELL	163,214,181.93	4.16
8	QUALCOMM INC	QCOM	161,834,675.74	4.12
9	APPLE INC	AAPL	153,241,448.77	3.91
10	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA	149,332,457.51	3.81

11	MASTERCARD INC	MA	136,863,720.33	3.49
12	SALESFORCE.COM INC	CRM	128,992,908.08	3.29
13	VISA INC	V	128,366,733.96	3.27
14	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH	125,725,642.58	3.20
15	VMWARE INC	VMW	115,469,541.18	2.94
16	ZTE CORP	00763	115,405,086.75	2.94
17	FISERV INC	FISV	101,362,233.54	2.58
18	CISCO SYSTEMS INC	CSCO	98,476,320.94	2.51
19	STMICROELECTRONICS NV	STM	97,103,774.98	2.47
20	NVIDIA CORP	NVDA	95,076,747.61	2.42
21	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	ERIC	89,296,913.76	2.28
22	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	LSCC	84,800,841.17	2.16
23	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	03968	80,420,368.49	2.05
24	FACEBOOK INC	FB	79,689,531.37	2.03
25	WALT DISNEY CO/THE	DIS	78,491,760.23	2.00

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	9,042,829,355.63
卖出收入（成交）总额	9,169,807,637.07

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名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名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	FIRST TRUST	指数型	ETF 基金	First Trust Advisors LP	38,276,060.96	0.96

	ETF/USA					
2	ISHARES ETF/USA	指数型	ETF 基金	BlackRock Fund Advisors	32,190,617.77	0.81
3	INVESCO ETF/USA	指数型	ETF 基金	Invesco Capital Management LLC	31,195,889.92	0.78
4	ISHARES ETF/HO NG KONG	指数型	ETF 基金	BlackRock Asset Management North Asia Ltd	9,866,225.57	0.25
5	GLOBAL X ETF/USA	指数型	ETF 基金	Global X Management Co LLC	3,123,705.56	0.08
6	KRANESH ARES ETF/USA	指数型	ETF 基金	Krane Funds Advisors LLC	3,112,073.57	0.08
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

#### 7.11 投资组合报告附注

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

7.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	61,528,146.49
3	应收股利	4,643,540.40
4	应收利息	16,616.32
5	应收申购款	850,002.03
6	其他应收款	5,170,849.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,209,154.24

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。

## §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
551,470	7,413.57	17,070,129.02	0.42%	4,071,293,001.05	99.58%

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	388,941.50	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	0~10
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	4,319,161,751.99
本报告期基金总申购份额	130,175,401.71
减：本报告期基金总赎回份额	360,974,023.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,088,363,130.07

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 3 月 2 日发布公告，李彬女士担任华夏基金管理有限公司督察长，周璇女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

本基金托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
BOCI SECURITIES	-	192,271,904.93	1.06%	273,713.62	2.71%	-
CATHAY SECURITIES	-	206,881,315.96	1.14%	336,350.23	3.33%	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES	-	72,200,438.51	0.40%	76,973.33	0.76%	-
CICC	-	487,529,283.88	2.68%	278,335.81	2.76%	-
CITIC SECURITIES INTERNATIONAL	-	138,220,496.39	0.76%	159,195.83	1.58%	-
CLSA	-	66,834,956.02	0.37%	20,050.53	0.20%	-
CREDIT SUISSE	-	3,973,764,518.90	21.82%	1,277,144.23	12.65%	-

FIRST SHANGHAI SECURITIES	-	75,954,561.15	0.42%	91,145.46	0.90%	-
GF SECURITIES	-	77,730,653.57	0.43%	77,730.65	0.77%	-
GOLDMAN SACHS	-	799,173,228.34	4.39%	257,238.57	2.55%	-
HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES	-	2,535,176,741.62	13.92%	516,780.97	5.12%	-
J.P.MORGAN	-	1,641,955,927.50	9.02%	566,424.92	5.61%	-
JEFFERIES	-	781,283,973.52	4.29%	239,725.14	2.37%	-
KGI	-	1,694,405,866.57	9.30%	2,632,352.81	26.07%	-
MASTERLINK	-	61,975,619.56	0.34%	82,053.71	0.81%	-
MERRILL LYNCH	-	3,536,933,438.48	19.42%	1,104,186.97	10.93%	-
MIZUHO	-	289,996,102.81	1.59%	132,450.74	1.31%	-
NOMURA	-	207,489,964.19	1.14%	71,656.96	0.71%	-
SINOPAC SECURITIES	-	1,372,869,185.41	7.54%	1,905,299.09	18.87%	-

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，本基金还选择了爱建证券、安信证券、财富里昂证券、东吴证券、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、国信证券、华宝证券、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、天风证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、中国银河证券、长城证券、中金公司、中投证券、中信建投证券、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，长城证券、安信证券、中信证券的部分交易单元为本基金本

期新增的券商交易单元。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
BOCI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CATHAY SECURITIES	-	-	-	-	65,835,890.43	3.98%
CCB INTERNATIONAL SECURITIES	-	-	-	-	5,583,638.64	0.34%
CICC	-	-	-	-	-	-
CITIC SECURITIES INTERNATIONAL	-	-	-	-	60,774,283.67	3.68%
CLSA	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	283,383,549.23	17.14%
FIRST SHANGHAI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
GF SECURITIES	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS	-	-	-	-	5,251,574.14	0.32%
HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES	-	-	-	-	56,938,574.48	3.44%
J.P.MORGAN	-	-	-	-	246,128,221.86	14.89%
JEFFERIES	-	-	-	-	7,733,936.75	0.47%
KGI	-	-	-	-	499,253,832.62	30.21%
MASTERLINK	-	-	-	-	6,742,862.25	0.41%
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	57,025,532.54	3.45%
MIZUHO	-	-	-	-	111,961,737.74	6.77%
NOMURA	-	-	-	-	31,366,558.68	1.90%
SINOPAC SECURITIES	-	-	-	-	214,901,068.42	13.00%

#### 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关于华夏全球精选股票型证券投资基金在境外主要投资场所 2019 年节假日暂停申购、赎回、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-07

2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-02
3	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增华融湘江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	2019-03-04
4	华夏基金管理有限公司关于提示投资者在中国结算办理场外账户对应关系维护业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增玄元保险代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	2019-05-09
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在嘉实财富管理有限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	2019-05-13
7	华夏基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善客户身份信息资料的特别提示公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-04

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

## §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

二〇一九年八月二十九日