

华夏全球精选股票型证券投资基金 2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月二十八日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	12
§6 审计报告.....	13
§7 年度财务报表.....	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§8 投资组合报告.....	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	38
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	38
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	50
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	52
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	53
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	53
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	53
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	54
8.11 投资组合报告附注.....	54
§9 基金份额持有人信息.....	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	55
§10 开放式基金份额变动.....	55
§11 重大事件揭示.....	56
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§13 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	21,472,103,738.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	主要通过在全球范围内进行积极的股票投资，追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	一般情况下，本基金主要在全球范围内进行积极的股票投资。但在特殊情况下（如基金遭遇巨额赎回、基金主要投资市场临时发生重大变故、不可抗力等），基金可将部分资产临时性地投资于低风险资产，如债券、债券基金、货币市场基金、银行存款等。基金临时性投资的主要目标是保持基金资产的安全性和流动性。
业绩比较基准	摩根士丹利资本国际全球指数（MSCI All Country World Index）。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时，本基金为全球证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	010-67595096
传真	010-63136700	010-66275853

注册地址	北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 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	范勇宏	郭树清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	T. Rowe Price Group.Inc	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	普信集团	摩根大通银行
注册地址		100 East Pratt Street , Baltimore , Maryland 21202 United States	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		100 East Pratt Street , Baltimore , Maryland 21202 United States	270 Park Avenue, New York, New York 10017
邮政编码		21202	10017

注：根据本基金管理人 2010 年 6 月 26 日《关于华夏全球精选股票型证券投资基金的公告》，自 2010 年 6 月 24 日起，不再聘请普信集团担任本基金的境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	1,850,727,730.38	-491,448,454.92	-7,166,707,482.35

本期利润	1,628,749,023.63	7,754,120,610.47	-10,378,920,880.98
加权平均基金份额本期利润	0.0699	0.2998	-0.3703
本期加权平均净值利润率	8.54%	44.40%	-53.28%
本期基金份额净值增长率	8.86%	56.65%	-41.10%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	-4,826,969,087.54	-7,489,713,429.25	-12,494,786,452.67
期末可供分配基金份额利润	-0.2248	-0.3047	-0.4744
期末基金资产净值	19,268,351,182.98	20,267,275,138.17	13,845,666,158.54
期末基金份额净值	0.897	0.824	0.526
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	-10.30%	-17.60%	-47.40%

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

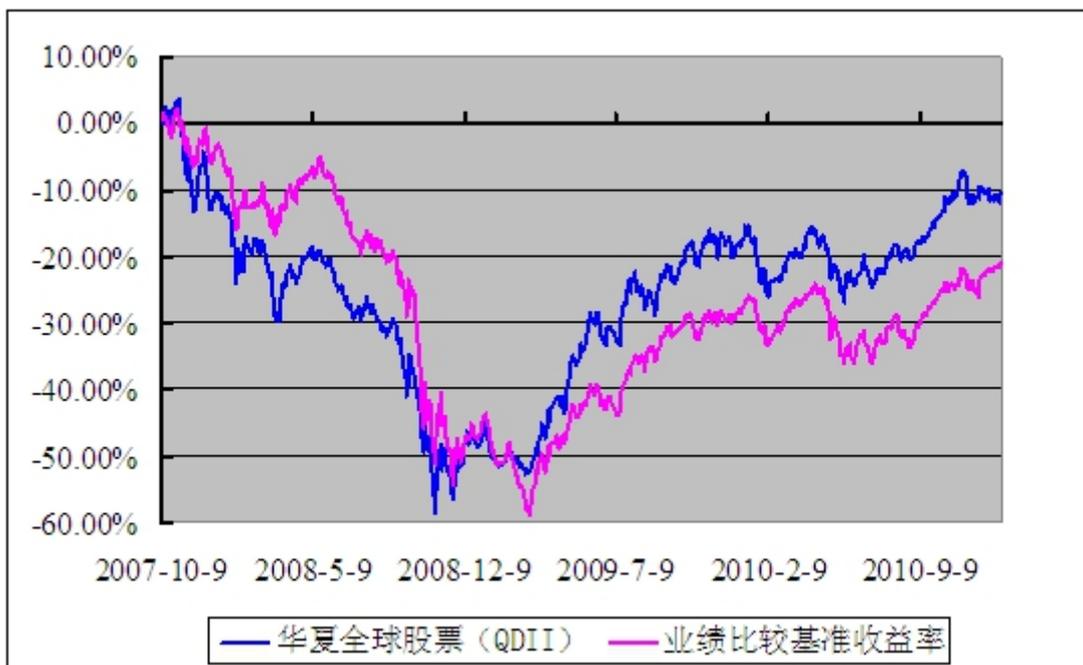
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.41%	0.79%	8.35%	0.85%	-2.94%	-0.06%
过去六个月	17.41%	0.71%	23.26%	0.90%	-5.85%	-0.19%
过去一年	8.86%	0.97%	10.42%	1.10%	-1.56%	-0.13%
过去三年	0.45%	1.66%	-18.01%	1.65%	18.46%	0.01%
自基金合同生效起至今	-10.30%	1.66%	-20.97%	1.61%	10.67%	0.05%

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

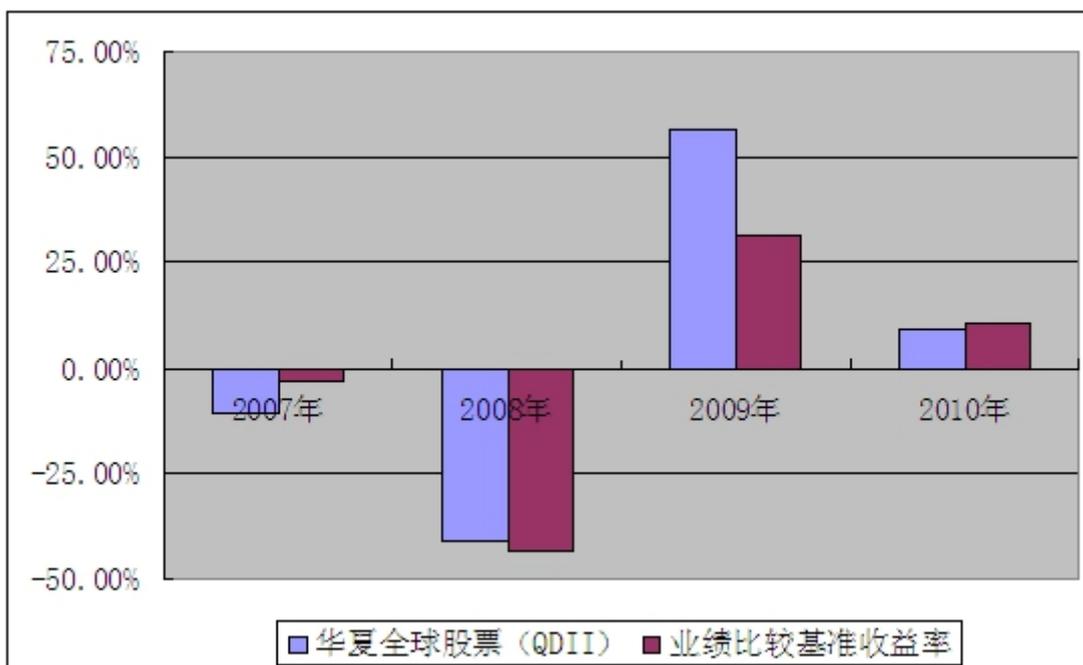
（2007 年 10 月 9 日至 2010 年 12 月 31 日）



注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏全球精选股票型证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图



注：本基金合同于 2007 年 10 月 9 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京和杭州设有分公司，在香港设有子公司。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内唯一的亚债中国基金投资管理人以及特定客户资产管理人，是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2010 年，在市场大幅震荡的情况下，华夏基金加强风险控制，坚持稳健的投资风格，主动管理的股票型基金与混合型基金根据自身投资目标及投资策略，谨慎运作，整体业绩表现良好；固定收益类基金持续创造正回报；指数型基金继续紧密跟踪标的指数。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在 2010 年基金分类排名中，华夏优势增长股票在 166 只标准股票型基金中排名第 3；华夏大盘精选混合在 43 只偏股型基金（股票上限 95%）中排名第 1；华夏策略混合在 40 只灵活配置型基金（股票上限 80%）中排名第 1。2010 年华夏基金为投资人实现分红逾 275 亿元，累计分红已超过 700 亿元。

为引导投资者树立正确的基金投资理念，增进与投资者之间的交流，2010 年，华夏基金继续加强投资者教育与服务工作。公司广泛收集 800 多个基金投资常见问题，编著出版了《做一个理性的投资者——中国基金投资指南》一书，分发给投资者。公司继续举办各类巡回报告会以及理财讲座，在媒体开设投资者教育专栏，参展北京、上海等地金融博览会，向投资者提供理财咨询服务。

2010 年，华夏基金凭借规范的经营管理及良好的品牌声誉，荣获多家机构评选的多个奖项，主要奖项有：2010 年 5 月，在《中国证券报》主办的“中国基金业金牛奖”评选活动中，华夏基金荣获“2009 年年度金牛基金公司奖”；2010 年 6 月，在《上海证券报》主办的“第七届中国金基金奖”评选活动中，华夏基金荣

获“2009 年度金基金·TOP 公司奖”。

在客户服务方面，2010 年，华夏基金继续以客户需求为导向，持续提高服务质量：举办多场客户见面会，加强与客户的沟通；根据客户建议，不断改进服务系统及业务规则。

在践行企业社会责任方面，青海省玉树县发生地震灾害后，华夏基金及全体员工通过华夏人慈善基金会向灾区捐款 100 余万元，华夏基金香港公司向中联办捐款专户捐赠港币 10 万元整，并于 10 月采购优质燃煤 200 吨捐赠给玉树灾区，用于保障 9 所学校、总计 11239 名学生和教职工的冬季取暖。2010 年 8 月，甘肃舟曲地区发生特大山洪泥石流灾害，华夏基金员工通过华夏人慈善基金会踊跃捐款，并组织志愿者亲赴甘肃舟曲灾区，为 8 个村、402 户、总计 1061 位灾民送上援助物资。此外，华夏人慈善基金会还组织实施了山西天镇唐八里村机井援建项目、贵州新塘小学助学项目等由华夏基金公司及其员工个人捐助的指定项目。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨昌桁	本基金的基金经理	2007-10-09	-	20 年	中国台湾籍，美国田纳西州立大学财务金融专业硕士。自 1990 年开始从事台湾证券市场的投资管理工作，曾在国票投信投资本部、荷银投信、怡富证券投研部、京华证券研究部、元富证券等任职，具有 10 年以上的台湾证券市场投资管理经验。2005 年 1 月加入华夏基金管理有限公司，历任公司研究主管。
周全	本基金的基金经理、国际投资部副总经理	2007-10-09	-	10 年	中国人民银行研究生部金融专业硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，历任交易主管、行业研究员。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Robert N. Gensler	普信全球股票投资决策委员会成员，普信全球股票基金基金经理	27 年	美国沃顿商学院学士，斯坦福大学 MBA。1986—1991 年曾在所罗门兄弟工作。1993 年加入普信集团，曾任普信媒体—电信基金分析员、基金经理，普信全球科技基金基金经理。

注：根据本基金管理人 2010 年 6 月 26 日《关于华夏全球精选股票型证券投资基金的公告》，自 2010 年 6 月 24 日起，不再聘请普信集团担任本基金的境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年，在新兴市场需求的拉动下，全球经济持续复苏。但欧洲主权债务危机、大宗商品价格上涨、新兴市场资产价格泡沫、各国摇摆的宏观经济政策等因素，也持续影响着全球股市的表现。

1 季度初，美联储宣布退出危机救助政策、中国提高存款准备金率、希腊债

务危机显现，全球股市出现小幅下跌。之后，美联储强调维持长期低利率、中国政府表示保持宽松政策的连续性，投资人的风险偏好上升，以能源原材料为代表的周期性股票又带领全球股指反弹。

2 季度，发达国家经济数据未能继续改善，消费者信心指数出现下滑；欧盟迟迟没有明确救助措施，希腊主权债务危机恶化，欧洲高赤字国家债券遭到抛售，资金大量撤出欧元及高风险资产，全球金融市场出现明显动荡。此外，新兴市场经济快速增长，部分新兴市场的宏观政策转向紧缩。

3 季度，流动性持续注入新兴经济体，其货币不断升值，股票、房地产等资产价格继续攀升；宽松的宏观政策未能改善欧美的就业情况，但相关企业出口订单状况较好，盈利屡超预期；此外，以美元标价的农产品、有色金属、原油价格出现了大幅上涨。

4 季度，新兴市场通胀压力显现，美国经济持续复苏，日本、欧洲增长乏力。各国经济政策也因此出现不同取向，新兴市场持续收紧货币，美欧日则继续保持宽松的基调。受上述因素影响，美欧股市小幅上涨，新兴市场振荡下跌。

2010 年初，我们明确了“2010 年全球股市单边上涨或下跌概率不大”的判断，认为围绕经济复苏的大趋势，投资人对各国宏观经济、政策预期的变化，可能导致证券市场或相关行业出现较大幅度的波动。因此，本基金避免了对股票仓位的过多调整，致力于研究和发掘具有成长性的行业和公司，以期在市场悲观时加大投资，努力为投资人获取长期良好的回报。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.897 元，本报告期份额净值增长率为 8.86%，同期业绩比较基准增长率以美元计为 10.42%（不包含人民币汇率变动等因素产生的效应）。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年，我们对投资机会谨慎乐观。

从宏观经济的角度看，我们认为全球经济将持续复苏，但可能出现波折。其中，新兴市场的通货膨胀、发达国家的财政政策退出、美国的货币政策选择是最大的不确定因素。（1）受超发货币、不希望汇率快速升值、推进国内价格体系改革等因素影响，新兴经济体通胀压力仍然较大，短期内难以根本抑制。（2）

2011 年，不少欧洲国家主权债务集中到期，再融资压力较大；同时，美国的巨大赤字也难以以为继。这些都不利于社会总需求的增长。（3）美国经济复苏的趋势已较明显，各国要求美国采取负责任货币政策的呼声也越来越高。美联储货币政策的变化，可能导致全球资金的大规模波动，影响不同区域的经济的发展。

从证券市场的角度看，我们认为 2011 年全球股市仍将以振荡为主，新兴市场的波动可能更为明显。新兴市场通胀、宏观政策变动、欧洲主权债务、大宗商品价格高企等，可能给投资人信心带来负面影响；但宽松的欧美货币政策、新兴市场的良好发展前景、美国经济的复苏等，也会对全球股市提供支持。因此，2011 年全球股市的结构性机会可能更为重要，配置需求稳定增长的行业、区域，把握需求快速增长的新产品、新商业模式，是我们的主要投资策略。

2011 年，本基金将继续跟踪各国政策动向，解读主要经济体宏观数据，同时，关注新兴市场的内需及发达市场的进口，通过深入分析研究上市公司，把握好结构性投资机会，努力为投资人争取长期良好的回报。

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。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，重点加强了对基金投资交易的风险控制及合规检查。在监察稽核工作中加大了投资研究、销售等业务的合规培训和考试力度，针对投研人员多次开展合规培训，强化合规考试内容及频率，增强员工合规意识；同时加大了日常业务检查的范围及频率，及时开展了员工行为合规检查及对公司投研、营销、运作等业务的专项检查，促进了公司业务的合规运作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种

进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、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，负责估值工作决策和执行的机构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。

4.9 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。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20302 号

华夏全球精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏全球精选股票型证券投资基金(以下简称“华夏全球精选基金”)的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是华夏全球精选基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2)选择和运用恰当的会计政策；
- (3)作出合理的会计估计。

6.2 注册会计师的责任

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

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

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示

的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了华夏全球精选基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 汪棣 单峰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2011-03-07

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏全球精选股票型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,482,039,110.40	2,318,836,272.10
结算备付金		1,363,636.36	-
存出保证金		62,750,000.00	-
交易性金融资产	7.4.7.2	17,694,103,787.04	16,911,754,878.35
其中：股票投资		16,353,011,131.72	15,437,364,834.89
基金投资		173,196,850.42	981,765,802.43
债券投资		1,167,895,804.90	492,624,241.03
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	29,514.06
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		98,519,928.44	1,116,311,670.96
应收利息	7.4.7.5	19,587,279.53	4,843,188.44
应收股利		6,736,149.82	5,436,967.15
应收申购款		3,724,386.48	1,814,697.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	98,542.60	162,278,963.71
资产总计		19,368,922,820.67	20,521,306,151.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		7,278,400.00	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		56,818,925.53	54,875,026.23
应付管理人报酬		30,331,101.75	31,793,391.79
应付托管费		5,738,316.54	6,014,966.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	404,893.87	161,347,629.69
负债合计		100,571,637.69	254,031,013.75
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	21,472,103,738.79	24,583,057,572.03
未分配利润	7.4.7.10	-2,203,752,555.81	-4,315,782,433.86
所有者权益合计		19,268,351,182.98	20,267,275,138.17
负债和所有者权益总计		19,368,922,820.67	20,521,306,151.92

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.897 元，基金份额总额 21,472,103,738.79 份。

7.2 利润表

会计主体：华夏全球精选股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		2,092,524,969.39	8,179,104,785.69
1.利息收入		54,960,799.90	10,285,694.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,106,364.71	3,431,166.76
债券利息收入		48,977,939.68	6,854,527.28

资产支持证券利息收入		50,980.07	-
买入返售金融资产收入		2,825,515.44	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,303,201,623.40	-72,448,138.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,936,663,557.89	-201,424,829.73
基金投资收益	7.4.7.13	-17,004,557.07	-220,387,024.82
债券投资收益	7.4.7.14	64,289,579.78	5,339,464.45
资产支持证券投资收益		236,815.49	-
衍生工具收益	7.4.7.15	61,983,294.45	60,887,821.81
股利收益	7.4.7.16	257,032,932.86	283,136,429.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-221,978,706.75	8,245,569,065.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-48,557,118.82	-7,763,223.38
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	4,898,371.66	3,461,388.38
减：二、费用		463,775,945.76	424,984,175.22
1.管理人报酬		352,784,561.61	321,515,871.64
2.托管费		66,743,025.14	60,827,327.14
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	42,436,354.68	42,118,386.00
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	1,812,004.33	522,590.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,628,749,023.63	7,754,120,610.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,628,749,023.63	7,754,120,610.47

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏全球精选股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	24,583,057,572.03	-4,315,782,433.86	20,267,275,138.17
二、本期经营活动产生的基金	-	1,628,749,023.63	1,628,749,023.63

净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,110,953,833.24	483,280,854.42	-2,627,672,978.82
其中：1.基金申购款	594,870,429.17	-99,706,204.85	495,164,224.32
2.基金赎回款	-3,705,824,262.41	582,987,059.27	-3,122,837,203.14
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）	21,472,103,738.79	-2,203,752,555.81	19,268,351,182.98
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	26,340,452,611.21	-12,494,786,452.67	13,845,666,158.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,754,120,610.47	7,754,120,610.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,757,395,039.18	424,883,408.34	-1,332,511,630.84
其中：1.基金申购款	2,163,982,918.16	-727,561,376.15	1,436,421,542.01
2.基金赎回款	-3,921,377,957.34	1,152,444,784.49	-2,768,933,172.85
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）	24,583,057,572.03	-4,315,782,433.86	20,267,275,138.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

范勇宏 崔雁巍 崔雁巍
 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏全球精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2007]258号《关于同意华夏全球精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证

券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 30,048,564,114.29 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2007）第 131 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏全球精选股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 10 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 30,055,638,128.26 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行（JPMorgan&Chase Bank），境外投资顾问为普信集团（T. Rowe Price Group.Inc）（2010 年 6 月 24 日前）。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的股票投资(包括股票、存托凭证及信托凭证投资)、债券投资、基金投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资(包括股票、存托凭证及信托凭证投资)、债券投资、基金投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的

折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、基金买卖股票的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- 3、基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	1,482,039,110.40	2,318,836,272.10
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	1,482,039,110.40	2,318,836,272.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	13,731,487,134.73	16,353,011,131.72	2,621,523,996.99	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	OTC 市场	1,166,730,974.72	1,167,895,804.90	1,164,830.18
	合计	1,166,730,974.72	1,167,895,804.90	1,164,830.18
资产支持证券	-	-	-	
基金	213,898,307.89	173,196,850.42	-40,701,457.47	
其他	-	-	-	
合计	15,112,116,417.34	17,694,103,787.04	2,581,987,369.70	
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日			

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		12,656,466,036.39	15,437,364,834.89	2,780,898,798.50
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	OTC 市场	475,982,432.24	492,624,241.03	16,641,808.79
	合计	475,982,432.24	492,624,241.03	16,641,808.79
资产支持证券		-	-	-
基金		982,648,247.33	981,765,802.43	-882,444.90
其他		-	-	-
合计		14,115,096,715.96	16,911,754,878.35	2,796,658,162.39

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	1,953,866,000.00	-	7,278,400.00	-
其中：外汇远期	1,953,866,000.00	-	7,278,400.00	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其中：权证	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,953,866,000.00	-	7,278,400.00	-
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
其中：外汇远期	-	-	-	-
权益衍生工具	-	29,514.06	-	-
其中：权证	-	29,514.06	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	29,514.06	-	-

注：权证投资成本在备注栏中列示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	82,041.27	107,127.45
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	525.03	-
应收债券利息	19,498,128.33	4,736,060.99
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	6,584.90	-
合计	19,587,279.53	4,843,188.44

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
其他应收款	98,542.60	98,542.60
待摊费用	-	-
应收换汇款	-	162,180,421.11
合计	98,542.60	162,278,963.71

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末均无应付交易费用余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	214,137.87	206,811.56
预提费用	190,000.00	190,000.00
应付换汇款	-	160,950,818.13
其他	756.00	-

合计	404,893.87	161,347,629.69
----	------------	----------------

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,583,057,572.03	24,583,057,572.03
本期申购	594,870,429.17	594,870,429.17
本期赎回（以“-”号填列）	-3,705,824,262.41	-3,705,824,262.41
本期末	21,472,103,738.79	21,472,103,738.79

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,489,713,429.25	3,173,930,995.39	-4,315,782,433.86
本期利润	1,850,727,730.38	-221,978,706.75	1,628,749,023.63
本期基金份额交易产生的变动数	812,016,611.33	-328,735,756.91	483,280,854.42
其中：基金申购款	-158,516,200.92	58,809,996.07	-99,706,204.85
基金赎回款	970,532,812.25	-387,545,752.98	582,987,059.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,826,969,087.54	2,623,216,531.73	-2,203,752,555.81

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
活期存款利息收入	3,061,216.34	3,426,365.23
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	34,344.44	-
其他	10,803.93	4,801.53
合计	3,106,364.71	3,431,166.76

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至	上年度可比期间 2009年1月1日至
----	------------------	-----------------------

	2010 年 12 月 31 日	2009 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	12,587,879,706.18	13,504,623,416.60
减：卖出股票成本总额	10,651,216,148.29	13,706,048,246.33
买卖股票差价收入	1,936,663,557.89	-201,424,829.73

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	1,402,064,737.92	3,576,488,210.61
减：卖出/赎回基金成本总额	1,419,069,294.99	3,796,875,235.43
基金投资收益	-17,004,557.07	-220,387,024.82

7.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	2,765,774,869.60	248,665,436.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,678,645,577.59	241,309,835.25
减：应收利息总额	22,839,712.23	2,016,137.03
债券投资收益	64,289,579.78	5,339,464.45

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
卖出权证成交金额	61,983,294.45	60,887,821.81
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	61,983,294.45	60,887,821.81

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

股票投资产生的股利收益	257,032,930.47	266,860,832.10
基金投资产生的股利收益	2.39	16,275,597.45
合计	257,032,932.86	283,136,429.55

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
1.交易性金融资产	-214,670,792.69	8,245,539,551.33
——股票投资	-159,374,801.51	7,804,157,764.29
——债券投资	-15,476,978.61	16,641,808.79
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-39,819,012.57	424,739,978.25
2.衍生工具	-7,307,914.06	29,514.06
——权证投资	-29,514.06	29,514.06
——远期投资	-7,278,400.00	-
3.其他	-	-
合计	-221,978,706.75	8,245,569,065.39

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
基金赎回费收入	3,903,808.94	3,461,388.38
其他	994,562.72	-
合计	4,898,371.66	3,461,388.38

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
交易所市场交易费用	42,436,354.68	42,118,386.00
银行间市场交易费用	-	-
合计	42,436,354.68	42,118,386.00

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
审计费用	190,000.00	190,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
银行费用	55,806.62	52,044.91
税务顾问费	39,361.00	106,954.00
其他	1,446,836.71	93,591.53
合计	1,812,004.33	522,590.44

注：“其他”主要包含支付给存托凭证托管机构的存托服务费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行	境外资产托管人
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中信万通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信金通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信建投证券有限责任公司	基金管理人股东原控股的公司、基金销售机构

注：①中信证券股份有限公司分别于 2010 年 11 月 17 日和 2010 年 12 月 24 日发布公告，经中国证监会批准，已转让其持有的 53% 中信建投证券有限责任公司股权。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例
中信证券	5,832,000,000.00	90.67%	-	-

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	352,784,561.61	321,515,871.64
其中：支付销售机构的客户维护费	59,603,760.91	46,270,986.23

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

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

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2010年1月1日至 2010年12月31日	2009年1月1日至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	66,743,025.14	60,827,327.14

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
期初持有的基金份额	2,354,528.21	2,354,528.21
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	2,354,528.21	2,354,528.21
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	0.01%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	512,895,169.33	2,965,324.68	638,566,690.96	3,405,374.51
摩根大通银行	969,143,941.07	95,891.66	1,680,269,581.14	20,990.72

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

保管，按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有需披露的暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、监察稽核部、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、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，

将风险控制预期可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在境外证券交易所上市，除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,482,039,110.40	-	-	1,482,039,110.40
结算备付金	1,363,636.36	-	-	1,363,636.36
存出保证金	62,750,000.00	-	-	62,750,000.00
债券投资	-	877,367,499.17	290,528,305.73	1,167,895,804.90
应收直销申购款	87,210.73	-	-	87,210.73

上年度末 2009年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	2,318,836,272.10	-	-	2,318,836,272.10
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
债券投资	79,379,532.05	220,471,325.06	192,773,383.92	492,624,241.03
应收直销申购款	131,936.95	-	-	131,936.95

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
	利率下降 25 个基点	16,440,542.24	3,411,607.60
	利率上升 25 个基点	-16,435,724.67	-3,411,238.14

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2010 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	598,053,681.12	286,126,763.39	89,301,948.25	973,482,392.76
交易性金融资产	6,426,552,263.03	8,713,581,700.08	2,508,997,023.93	17,649,130,987.04
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	79,597,952.02	17,644,838.24	1,277,138.18	98,519,928.44
应收利息	19,139,917.39	2,949.85	-	19,142,867.24
应收股利	6,026,723.69	-	709,426.13	6,736,149.82
其他资产	-	-	-	-
资产合计	7,129,370,537.25	9,017,356,251.56	2,600,285,536.49	18,747,012,325.30
以外币计价的负债				
应付换汇款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2009 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	1,102,836,822.42	681,618,305.41	10,014,084.38	1,794,469,212.21
交易性金融资产	4,949,338,065.03	10,583,417,713.15	1,296,743,100.17	16,829,498,878.35
衍生金融资产	-	-	29,514.06	29,514.06
应收证券清算款	901,120,028.08	19,928,027.47	195,263,615.41	1,116,311,670.96
应收利息	4,025,001.57	6,150.63	242.73	4,031,394.93
应收股利	5,112,494.71	-	324,472.44	5,436,967.15
其他资产	162,180,421.11	-	-	162,180,421.11
资产合计	7,124,612,832.92	11,284,970,196.66	1,502,375,029.19	19,911,958,058.77
以外币计价的负债				
应付换汇款	-	-	160,950,818.13	160,950,818.13
负债合计	-	-	160,950,818.13	160,950,818.13

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日

	所有外币相对人民币升值 5%	937,350,616.27	987,550,362.03
	所有外币相对人民币贬值 5%	-937,350,616.27	-987,550,362.03

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 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	16,353,011,131.72	84.87	15,437,364,834.89	76.17
交易性金融资产-基金投资	173,196,850.42	0.90	981,765,802.43	4.84
衍生金融资产-权证投资	-	-	29,514.06	0.00
合计	16,526,207,982.14	85.77	16,419,160,151.38	81.01

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为摩根士丹利资本国际全球指数 (MSCIAllCountryWorldIndex) 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 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	+5%	973,004,162.34	841,336,383.50
	-5%	-973,004,162.34	-841,336,383.50

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	16,353,011,131.72	84.43
	其中：普通股	13,895,261,121.37	71.74
	存托凭证	2,456,882,773.29	12.68
2	基金投资	173,196,850.42	0.89
3	固定收益投资	1,167,895,804.90	6.03
	其中：债券	1,167,895,804.90	6.03
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,483,402,746.76	7.66
8	其他各项资产	191,416,286.87	0.99
9	合计	19,368,922,820.67	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	8,713,581,700.08	45.22
美国	4,256,637,273.72	22.09
英国	999,118,632.81	5.19
中国台湾	552,488,618.04	2.87
新加坡	487,137,102.01	2.53

韩国	418,452,842.13	2.17
印度尼西亚	264,752,773.15	1.37
日本	201,370,399.19	1.05
法国	139,987,870.95	0.73
加拿大	119,288,154.27	0.62
印度	112,321,289.67	0.58
马来西亚	39,541,243.14	0.21
澳大利亚	25,588,219.64	0.13
泰国	22,614,207.85	0.12
菲律宾	128,900.44	0.00
墨西哥	1,904.63	0.00
合计	16,353,011,131.72	84.87

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
金融	4,047,425,535.20	21.01
能源	3,448,495,893.68	17.90
信息技术	2,688,266,290.21	13.95
非必需消费品	2,500,347,282.88	12.98
材料	1,616,255,550.50	8.39
工业	827,481,886.29	4.29
必需消费品	681,004,946.54	3.53
保健	337,481,411.38	1.75
电信服务	177,950,751.11	0.92
公用事业	28,301,583.93	0.15
合计	16,353,011,131.72	84.87

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券 市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例 (%)
----	--------------	--------------	------	------------	--------------	--------	------	----------------------------------

1	IND & COMM BANK OF CHINA	中国工商银行 股份有限公司	01398	香港	中国香港	202,315,000	997,970,631.63	5.18
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有 限公司	00700	香港	中国香港	6,300,000	906,528,188.38	4.70
3	BANK OF CHINA LTD	中国银行股份 有限公司	03988	香港	中国香港	252,100,000	880,577,970.23	4.57
4	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL	中国石油化工 股份有限公司	00386	香港	中国香港	124,700,000	790,406,499.83	4.10
5	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	百丽国际控股 有限公司	01880	香港	中国香港	50,000,000	559,727,292.15	2.90
6	CHINA LIFE INSURANCE CO	中国人寿保险 股份有限公司	02628	香港	中国香港	18,000,000	486,886,069.20	2.53
7	GAZPROM OAO	—	OGZD	伦敦国际 金融期货 期权	英国	2,893,500	483,860,256.91	2.51
8	IMAX CORP	—	IMAX	纳斯达克	美国	2,590,300	481,534,669.32	2.50
9	SHANDA INTERACTIVE ENTERTAINMENT LTD	盛大互动娱乐 有限公司	SNDA	纳斯达克	美国	1,820,000	477,793,367.01	2.48
10	PETROLEO BRASILEIRO	—	PBR/A	纽约	美国	2,018,565	456,796,534.09	2.37
11	MONSANTO CO	—	MON	纽约	美国	979,340	451,676,336.30	2.34
12	INTIME DEPARTMENT STORE	银泰百货（集 团）有限公司	01833	香港	中国香港	41,775,000	404,302,013.20	2.10
13	PETRO CHINA CO LTD	中国石油天然 气股份有限公 司	00857	香港	中国香港	44,000,000	380,853,103.02	1.98
			PTR	新加坡	新加坡	1,000	863,732.53	0.00
14	CHINA RESOURCES ENTERPRISE	华润创业有限 公司	00291	香港	中国香港	13,000,000	352,747,466.24	1.83
15	PING AN INSURANCE GROUP CO	中国平安保险 (集团)股份有 限公司	02318	香港	中国香港	4,500,000	333,152,751.29	1.73
16	CHINA SHENHUA ENERGY CO	中国神华能源 股份有限公司	01088	香港	中国香港	9,400,000	261,069,758.61	1.35
17	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气公司	GE	纽约	美国	1,800,000	218,032,529.42	1.13
18	BANK OF	交通银行股份	03328	香港	中国香港	32,000,000	213,463,120.73	1.11

	COMMUNICATIO NSCO	有限公司						
19	BANYAN TREE HOLDINGS LTD	—	BTH	新加坡	新加坡	32,800,000	201,757,085.23	1.05
20	NEW ORIENTAL EDUCATIO	新东方教育科 技(集团)有 限公司	EDU	纽约	美国	262,800	183,147,086.30	0.95
21	ROSNEFT OJSC	—	ROSN	伦敦国际 金融期货 期权	英国	3,421,300	162,233,023.55	0.84
22	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	海尔电器集团 有限公司	01169	香港	中国香港	20,781,000	160,046,428.37	0.83
23	CORNINGINC	—	GLW	纽约	美国	1,190,500	152,325,146.46	0.79
24	CHINA MERCHANTS BANK	招商银行股份 有限公司	03968	香港	中国香港	9,040,000	151,104,899.89	0.78
25	NETEASE.COM INC	网易公司	NTES	纳斯达克	美国	600,000	143,646,363.02	0.75
26	CHINA MERCHANTS CHINA DIRECT	招商局中国基 金有限公司	00133	香港	中国香港	9,682,000	141,049,744.12	0.73
27	MINDRAY MEDICAL INTL LTD	—	MR	纽约	美国	792,314	138,527,609.31	0.72
28	AREVA	—	CEI	法国	法国	400,000	129,711,539.94	0.67
29	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	—	POT	纽约	美国	125,032	128,206,892.70	0.67
30	SEMBCORP MARINE LTD	—	SMM	新加坡	新加坡	4,518,000	125,408,941.49	0.65
31	FREEMPORT MCMORAN COPPER AND GOLD CL B	—	FCX	纽约	美国	145,501	115,719,861.59	0.60
32	CHINA FOODS LTD	中国食品有限 公司	00506	香港	中国香港	26,748,000	113,027,495.63	0.59
33	ICICI BANK LTD	—	IBN	纽约	美国	323,400	108,459,798.97	0.56
34	NOMURA HOLDINGS INC	野村控股公司	8604	东京	日本	2,500,000	105,126,007.95	0.55
35	CHINA UNICOM (HONGKONG) LIMITED	中国联合网络 通信(香港) 股份有限公司	00762	香港	中国香港	11,000,000	104,209,805.75	0.54

36	LUKOIL	—	LKOD	伦敦国际 金融期货 期权	英国	276,000	103,274,383.81	0.54
37	APPLEINC	—	AAPL	纳斯达克	美国	42,578	90,955,894.78	0.47
38	LOCK&LOCK CO LTD	—	115390	韩国	韩国	423,130	89,966,136.84	0.47
39	WILMAR INTERNATIONAL LTD	—	WIL	新加坡	新加坡	2,946,000	85,733,218.40	0.44
40	NHN CORP	—	035420	韩国	韩国	64,100	85,581,686.25	0.44
41	VISA INC	—	V	纽约	美国	180,600	84,178,676.06	0.44
42	HOLCIM INDONESIA TBK PT	—	SMCB	印度尼西亚	印度尼西亚	50,530,000	83,735,716.28	0.43
43	CHINA COAL ENERGY CO	中国中煤能源 股份有限公司	01898	香港	中国香港	8,000,000	82,740,813.72	0.43
44	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	大冢制药株式 会社	4578	东京	日本	500,000	81,651,268.31	0.42
45	HENGXIN CHINA HOLDINGS LTD	恒芯中国控股 有限公司	08046	香港	中国香港	61,917,333	79,125,162.41	0.41
46	BEIJING CAPITAL LAND LTD	首创置业股份 有限公司	02868	香港	中国香港	34,628,000	76,702,915.30	0.40
47	ADARO ENERGY PT	—	ADRO	印度 尼西亚	印度 尼西亚	40,193,000	75,486,541.27	0.39
48	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	—	034020	韩国	韩国	147,500	74,434,840.27	0.39
49	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国控股 有限公司	03900	香港	中国香港	9,992,000	73,208,581.26	0.38
50	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	—	OXY	纽约	美国	106,958	69,489,208.25	0.36
51	HYUNDAI MOTOR CO	—	005380	韩国	韩国	64,100	65,411,553.15	0.34
52	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	—	INTP	印度 尼西亚	印度 尼西亚	5,500,000	64,610,380.72	0.34
53	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	华宝国际控股 有限公司	00336	香港	中国香港	6,000,000	64,304,742.79	0.33
54	GUANGZHOU R	广州富力地产	02777	香港	中国香港	6,742,800	63,878,716.20	0.33

	AND F PROPERTIES CO.LTD.	股份有限公司						
55	LITTLE SHEEP GROUP LTD	小肥羊集团有限公司	00968	香港	中国香港	14,654,000	61,298,351.23	0.32
56	SOTHEBY'S	—	BID	纽约	美国	204,000	60,796,386.01	0.32
57	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	—	MSIL	印度	印度	287,598	60,570,944.11	0.31
58	MAOYE INTERNATIONAL HLDGS	茂业国际控股有限公司	00848	香港	中国香港	19,688,000	58,873,496.74	0.31
59	SOHU.COM INC	搜狐公司	SOHU	纳斯达克	美国	140,000	58,866,531.23	0.31
60	APACHE CORP	—	APA	纽约	美国	73,892	58,346,935.11	0.30
61	KINGSOFT CORP LTD	金山软件有限公司	03888	香港	中国香港	17,469,000	57,595,708.34	0.30
62	NEO-CHINA LAND GROUP HLDGS	中新地产集团(控股)有限公司	00563	香港	中国香港	23,000,000	57,216,567.64	0.30
63	WALTER ENERGY INC	—	WLT	纽约	美国	65,790	55,700,838.24	0.29
64	ANADARKO PETROLEUM CORP	—	APC	纽约	美国	103,384	52,145,321.48	0.27
65	TECK RESOURCES LTD	—	TCK/B	多伦多	加拿大	78,800	32,446,197.56	0.17
			TCK	纽约	美国	44,915	18,391,863.42	0.10
66	X5 RETAIL GROUP NV	—	FIVE	伦敦国际金融期货期权	英国	160,350	49,115,184.96	0.25
67	CHEVRON CORP	—	CVX	纽约	美国	79,124	47,816,324.48	0.25
68	CNOOC LTD	中国海洋石油有限公司	00883	香港	中国香港	3,000,000	47,129,549.17	0.24
69	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD.	远洋地产控股有限公司	03377	香港	中国香港	10,627,000	46,082,876.17	0.24
70	KEPPEL CORP LTD	—	KEP	新加坡	新加坡	784,000	45,874,408.70	0.24
71	SINA CORP	新浪公司	SINA	纳斯达克	美国	100,000	45,577,421.40	0.24
72	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	—	055550	韩国	韩国	144,300	44,897,168.83	0.23
73	HISENSE KELON	海信科龙电器	00921	香港	中国香港	10,000,000	43,875,122.60	0.23

	ELEC HLD	股份有限公司						
74	SYNUTRA INTERNATIONAL INC	—	SYUT	纳斯达克	美国	492,560	43,874,937.16	0.23
75	CHINDEX INTERNATIONAL INC	—	CHDX	纳斯达克	美国	400,000	43,683,329.20	0.23
76	EXXON MOBIL CORP	—	XOM	纽约	美国	89,579	43,378,794.15	0.23
77	CHINA SOUTHERN AIRLINES COMPANY LIMITED	中国南方航空 股份有限公司	01055	香港	中国香港	10,000,000	40,552,540.50	0.21
78	HALLIBURTON CO	—	HAL	纽约	美国	149,569	40,444,181.67	0.21
79	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	005930	韩国	韩国	7,100	39,629,766.53	0.21
80	CHINA RESOURCES LAND LIMITED	华润置地有限 公司	01109	香港	中国香港	3,256,000	39,389,807.15	0.20
81	ZHUZHOU CSRTIMES ELECTRIC	株洲南车时代 电气股份有限 公司	03898	香港	中国香港	1,513,000	39,378,689.28	0.20
82	BHARTI AIRTEL LTD	—	BHARTI	印度	印度	707,950	37,631,894.90	0.20
83	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	紫金矿业集团 股份有限公司	02899	香港	中国香港	6,000,000	36,855,102.98	0.19
84	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY LIMITED	中国太平保险 控股有限公司	00966	香港	中国香港	1,770,000	36,039,792.45	0.19
85	XSTRATA PLC	—	XTA	伦敦	英国	226,885	35,418,501.13	0.18
86	EOG RESOURCES INC	—	EOG	纽约	美国	58,326	35,309,452.62	0.18
87	CHINATELECOM CORP LTD	中国电信股份 有限公司	00728	香港	中国香港	10,000,000	34,674,126.01	0.18
88	POU SHENG INTL HOLDINGS LTD	宝胜国际（控 股）有限公司	03813	香港	中国香港	30,000,000	34,503,737.19	0.18
89	BG GROUP PLC	—	BG/	伦敦	英国	255,818	34,377,930.95	0.18

90	BHP BILLITON PLC	—	BLT	伦敦	英国	128,577	34,010,841.79	0.18
91	NATIONAL OILWELL VARCO INC	—	NOV	纽约	美国	74,147	33,023,336.91	0.17
92	JIANGXI COPPER COMPANY LIMITED	江西铜业股份有限公司	00358	香港	中国香港	1,511,000	32,890,197.61	0.17
93	CHINA NATIONAL MATERIALS	中国中材股份有限公司	01893	香港	中国香港	5,996,000	32,028,771.34	0.17
94	THOMPSON CREEK METALS CO INC	—	TC	纽约	美国	200,000	19,497,228.80	0.10
			TCM	多伦多	加拿大	122,190	11,887,975.90	0.06
95	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	—	FM	多伦多	加拿大	43,000	30,946,504.88	0.16
96	TOP GLOVE CORP BHD	—	TOPG	马来西亚	马来西亚	2,841,800	30,592,015.12	0.16
97	SHIMAOPROPERTY HOLDINGSLTD	世茂房地产控股有限公司	00813	香港	中国香港	3,051,000	30,515,565.22	0.16
98	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	三一重装国际控股有限公司	00631	香港	中国香港	3,000,000	29,289,839.12	0.15
99	CHONGQING IRON&STEEL CO	重庆钢铁股份有限公司	01053	香港	中国香港	16,644,000	28,643,111.30	0.15
100	TIANNENG POWER INTL LTD	天能动力国际有限公司	00819	香港	中国香港	10,000,000	27,517,795.34	0.14
101	FMC TECHNOLOGIES INC	—	FTI	纽约	美国	46,418	27,332,044.36	0.14
102	SUNCOR ENERGY INC	—	SU	多伦多	加拿大	60,000	15,305,325.67	0.08
			SU	纽约	美国	46,097	11,689,423.99	0.06
103	MAIL.RU GROUP-GDR REGS W/I	—	MAIL	伦敦国际金融期货期权	英国	110,000	26,225,892.00	0.14
104	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L	上海电气集团股份有限公司	02727	香港	中国香港	6,000,000	26,222,840.26	0.14
105	LARGAN PRECISION CO LTD	大立光股份有限公司	3008	台湾	中国台湾	160,000	26,221,335.59	0.14
106	NALCO HOLDING CO	—	NLC	纽约	美国	123,305	26,082,588.03	0.14

107	ILUKA RESOURCES LTD	—	ILU	澳大利亚	澳大利亚	408,000	25,311,794.42	0.13
108	HELMERICH & PAYNE	—	HP	纽约	美国	78,782	25,294,418.25	0.13
109	AAC ACOUSTIC TECHNOLOGIES	瑞声声学科技控股有限公司	02018	香港	中国香港	1,400,000	24,748,976.92	0.13
110	HESS CORP	—	HES	纽约	美国	48,294	24,480,299.02	0.13
111	URALKALI	—	URKA	伦敦国际 金融期货 期权	英国	100,000	24,318,554.40	0.13
112	AIR MEDIA GROUP INC	—	AMCN	纳斯达克	美国	526,824	24,039,191.43	0.12
113	CANADIAN NATURAL RESOURCES	—	CNQ	纽约	美国	81,038	23,839,785.91	0.12
114	TIANJIN ZHONGXIN PHARM CO	天津中新药业集团股份有限公司	TIAN	新加坡	新加坡	4,000,000	23,576,812.00	0.12
115	ANGLO AMERICAN PLC	—	AAL	伦敦	英国	67,367	23,299,778.20	0.12
116	RIO TINTO PLC	—	RIO	伦敦	英国	49,406	22,984,285.11	0.12
117	CP ALL PCL	—	CPALL	泰国	泰国	2,613,400	22,614,207.85	0.12
118	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	—	PRE	多伦多	加拿大	100,000	22,490,192.50	0.12
119	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	欣兴电子股份有限公司	3037	台湾	中国台湾	1,750,000	22,468,972.04	0.12
120	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	国泰金融控股股份有限公司	2882	台湾	中国台湾	1,917,000	22,403,170.05	0.12
121	AMBASSADOR HOTEL/THE	国宾大饭店股份有限公司	2704	台湾	中国台湾	2,000,000	21,700,415.66	0.11
122	VALESA	—	VALE	纽约	美国	93,197	21,337,149.24	0.11
123	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	联强国际股份有限公司	2347	台湾	中国台湾	1,198,283	21,317,238.78	0.11
124	HON HAI PRECISION INDUSTRY	鸿海精密工业股份有限公司	2317	台湾	中国台湾	800,000	21,248,323.66	0.11
125	RALINK TECHNOLOGY	雷凌科技股份有限公司	3534	台湾	中国台湾	900,000	20,852,743.17	0.11

	CORP							
126	EPISTAR CORP	晶元光电股份有限公司	2448	台湾	中国台湾	830,000	19,981,335.85	0.10
127	AGILE PROPERTY HOLDINGS LIMITED	雅居乐地产控股有限公司	03383	香港	中国香港	2,000,000	19,492,481.65	0.10
128	ZTE CORP	中兴通讯股份有限公司	00763	香港	中国香港	733,800	19,317,338.98	0.10
129	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURER	台湾积体电路制造股份有限公司	2330	台湾	中国台湾	1,200,000	19,259,118.90	0.10
130	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	新普科技股份有限公司	6121	台湾	中国台湾	400,000	19,168,700.50	0.10
131	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	洛阳栾川钼业集团股份有限公司	03993	香港	中国香港	3,140,000	19,126,997.62	0.10
132	CHIPBOND TECHNOLOGY CORP	颀邦科技股份有限公司	6147	台湾	中国台湾	1,650,000	18,984,473.01	0.10
133	MASTERCARD INC	—	MA	纽约	美国	12,500	18,552,666.21	0.10
134	SUNTECH POWER HOLDINGS	—	STP	纽约	美国	341,040	18,091,430.92	0.09
135	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	富邦金融控股股份有限公司	2881	台湾	中国台湾	1,893,278	17,118,716.48	0.09
136	KOREA EXCHANGE BANK	—	004940	韩国	韩国	239,540	16,624,822.04	0.09
137	ACER INC	宏碁股份有限公司	2353	台湾	中国台湾	800,380	16,301,134.79	0.08
138	AU OPTRONICS CORP	友达光电股份有限公司	2409	台湾	中国台湾	2,380,000	16,301,080.99	0.08
139	CHINA TRUST FINANCIAL HOLDING	中国信托金融控股股份有限公司	2891	台湾	中国台湾	3,102,400	15,007,501.13	0.08
140	ACE HARDWARE INDONESIA	—	ACES	印度尼西亚	印度尼西亚	6,836,500	14,853,703.73	0.08
141	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	第一金融控股股份有限公司	2892	台湾	中国台湾	2,445,000	14,839,524.08	0.08

142	GENESYS LOGIC INC	创惟科技股份有限公司	6104	台湾	中国台湾	1,149,000	14,700,539.70	0.08
143	NINTENDO CO LTD	任天堂株式会社	7974	日本大阪	日本	7,500	14,593,122.93	0.08
144	SHENZHEN EXPRESSWAY CO	深圳高速公路股份有限公司	00548	香港	中国香港	3,598,000	14,131,009.82	0.07
145	CHINACOSCOHOLDINGS	中国远洋控股股份有限公司	01919	香港	中国香港	2,000,000	14,040,039.23	0.07
146	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	—	JSMR	印度尼西亚	印度尼西亚	5,556,000	14,015,278.63	0.07
147	ASIA POLYMER	亚洲聚合股份有限公司	1308	台湾	中国台湾	1,300,000	13,870,182.34	0.07
148	ANGANGSTEELCO LTD	鞍钢股份有限公司	00347	香港	中国香港	1,368,000	13,868,968.85	0.07
149	DELTA ELECTRONICS INC	台达电子工业股份有限公司	2308	台湾	中国台湾	420,000	13,528,852.89	0.07
150	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	彰化商业银行股份有限公司	2801	台湾	中国台湾	2,300,000	13,465,560.01	0.07
151	ARCELORMITTA L-NY REGISTERED	—	MT	纽约	美国	51,241	12,939,559.28	0.07
152	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	台湾肥料股份有限公司	1722	台湾	中国台湾	500,000	12,319,506.81	0.06
153	CHINA KANGHUI HOLD	—	KH	纽约	美国	99,987	12,257,024.08	0.06
154	TSRC CORP	台橡股份有限公司	2103	台湾	中国台湾	800,000	12,206,483.81	0.06
155	BAKER HUGHES INC	—	BHI	纽约	美国	32,048	12,134,006.04	0.06
156	ALUMINUMCORP OFCHINALTD	中国铝业股份有限公司	02600	香港	中国香港	2,000,000	12,080,567.74	0.06
157	AGUNG PODOMORO LAND TBK PT	—	APLN	印度尼西亚	印度尼西亚	42,500,000	12,051,152.52	0.06
158	CHINARESOURCEPOWERHOLDING	华润电力控股有限公司	00836	香港	中国香港	1,000,000	11,995,373.32	0.06
159	CHIMEI INNOLUX CORP	奇美电子股份有限公司	3481	台湾	中国台湾	1,250,000	11,387,067.07	0.06

160	ORIENTAL UNION CHEMICAL	东联化学股份有限公司	1710	台湾	中国台湾	1,300,000	11,049,128.31	0.06
161	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	南亚电路板股份有限公司	8046	台湾	中国台湾	450,000	11,036,695.78	0.06
162	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	—	CLF	纽约	美国	21,142	10,922,735.80	0.06
163	KINSUS INTERCONNECT TECH	景硕科技股份有限公司	3189	台湾	中国台湾	480,000	10,741,705.75	0.06
164	CORETRONIC CORPORATION	中强光电股份有限公司	5371	台湾	中国台湾	990,000	10,674,570.09	0.06
165	SOUTHWESTERN ENERGY CO	—	SWN	纽约	美国	42,000	10,411,281.76	0.05
166	VALLOUREC	—	VK	法国	法国	14,716	10,276,331.01	0.05
167	NOBLE ENERGY INC	—	NBL	纽约	美国	18,000	10,261,476.29	0.05
168	YULON MOTOR COMPANY	裕隆汽车制造股份有限公司	2201	台湾	中国台湾	700,000	9,762,926.59	0.05
169	FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	晶华国际酒店股份有限公司	2707	台湾	中国台湾	80,000	9,331,178.73	0.05
170	DATANGINTLPO WERGENCO	大唐国际发电股份有限公司	00991	香港	中国香港	4,000,000	9,303,229.88	0.05
171	MASTERSKILL EDUCATION GROUP	—	MASEG	马来西亚	马来西亚	2,000,000	8,949,228.02	0.05
172	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	永丰金融控股股份有限公司	2890	台湾	中国台湾	2,700,000	8,208,860.36	0.04
173	MACROBLOCK INC	聚积科技股份有限公司	3527	台湾	中国台湾	250,000	7,770,331.13	0.04
174	UNITED SPIRITS LIMITED	—	UNSP	印度	印度	35,400	7,676,641.10	0.04
175	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	新光金融控股股份有限公司	2888	台湾	中国台湾	2,400,000	7,595,145.48	0.04
176	FENG HSIN IRON & STEEL CO	丰兴钢铁股份有限公司	2015	台湾	中国台湾	600,000	7,554,457.20	0.04
177	COMPAL ELECTRONICS	仁宝电脑工业股份有限公司	2324	台湾	中国台湾	851,703	7,441,054.66	0.04
178	HUANENGPOWE RINTLINC	华能国际电力股份有限公司	00902	香港	中国香港	2,000,000	7,002,980.73	0.04

179	WISTRON CORP	纬创资通股份有限公司	3231	台湾	中国台湾	500,000	6,713,566.09	0.03
180	FARADAY TECHNOLOGY CORP	智原科技股份有限公司	3035	台湾	中国台湾	500,000	6,442,310.90	0.03
181	APOLLO TYRES LTD	—	APTY	印度	印度	651,900	6,441,809.56	0.03
182	SILICONWARE PRECISION INDS	矽品精密工业股份有限公司	2325	台湾	中国台湾	800,000	6,329,287.90	0.03
183	BAYTEX ENERGY CORP	—	BTE	多伦多	加拿大	20,000	6,211,957.76	0.03
184	MAANSHAN IRON & STEEL	马鞍山钢铁股份有限公司	00323	香港	中国香港	1,688,000	5,953,658.19	0.03
185	CHANGYOU.COM LTD	畅游有限公司	CYOU	纳斯达克	美国	30,000	5,664,395.31	0.03
186	ALPHA NETWORKS INC	明泰科技股份有限公司	3380	台湾	中国台湾	1,000,000	5,651,149.91	0.03
187	SINOFERT HOLDINGS LTD	中化化肥控股有限公司	00297	香港	中国香港	1,576,000	5,397,509.06	0.03
188	TAISUN ENTERPRISE CO LTD	泰山企业股份有限公司	1218	台湾	中国台湾	1,250,000	5,227,313.67	0.03
189	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT	中海发展股份有限公司	01138	香港	中国香港	580,000	5,119,161.88	0.03
190	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	元大金融控股股份有限公司	2885	台湾	中国台湾	1,000,000	4,927,802.72	0.03
191	D-LINK CORP	友讯科技股份有限公司	2332	台湾	中国台湾	700,000	4,746,965.92	0.02
192	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国控股有限公司	01918	香港	中国香港	2,000,000	4,736,809.35	0.02
193	APEX BIOTECHNOLOGY CORP	五鼎生物技术股份有限公司	1733	台湾	中国台湾	300,000	4,652,026.61	0.02
194	XINJIANG TIANYE WATER SAVI	新疆天业节水灌溉股份有限公司	00840	香港	中国香港	4,392,000	4,377,834.17	0.02
195	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	合生创展集团有限公司	00754	香港	中国香港	378,000	2,692,211.60	0.01
196	SIMCERE PHARMACEUTICAL	—	SCR	纽约	美国	33,631	2,541,326.75	0.01

197	COUNTRYGARDE NHOLDINGSCO	碧桂园控股有 限公司	02007	香港	中国香港	1,000,000	2,538,793.50	0.01
198	YUNGTAY ENGINEERING CO LTD	永大机电工业 股份有限公司	1507	台湾	中国台湾	200,000	1,980,162.93	0.01
199	MEGASTUDY CO LTD	—	072870	韩国	韩国	1,840	1,906,868.22	0.01
200	SINGAPORE AIRLINES LTD	—	SIA	新加坡	新加坡	22,000	1,739,891.24	0.01
201	MOBILETELESYS TEMS	—	MBT	纽约	美国	8,000	1,105,725.99	0.01
202	BREADTALK GROUP LIMITED	—	BREAD	新加坡	新加坡	298,800	988,481.53	0.01
203	K-GREEN TRUST	—	KGT	新加坡	新加坡	156,800	867,237.06	0.00
204	CHINA MOBILE LTD	—	CHLX	新加坡	新加坡	1,000	327,293.83	0.00
205	FIBRIA CELULOSE SA	—	FBR	纽约	美国	3,000	317,889.60	0.00
206	BHP BILLITON LTD	—	BHP	澳大利亚	澳大利亚	900	276,425.22	0.00
207	HOLCIM PHILIPPINES INC	—	HLCM	菲律宾	菲律宾	55,000	128,900.44	0.00
208	AMERICA MOVIL SAB DE CV	—	AMXL	墨西哥	墨西哥	100	1,904.63	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值 比例（%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	937,140,185.36	4.62
2	SHANDA INTERACTIVE ENTERTAINMENT LTD	SNDA	496,687,969.67	2.45
3	CHINA LIFE INSURANCE CO	02628	455,617,018.10	2.25
4	PETROLEO BRASILEIRO	PBR/A	400,404,316.53	1.98
5	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	POT	392,538,924.04	1.94
6	CHINA SHENHUA ENERGY CO	01088	381,348,221.08	1.88
7	BANK OF CHINA LTD	03988	335,853,786.66	1.66

8	MONSANTO CO	MON	323,958,190.03	1.60
9	BANK OF COMMUNICATIONSCO	03328	321,028,828.82	1.58
10	CHINA MERCHANTS BANK	03968	271,194,589.07	1.34
11	IMAX CORP	IMAX	233,596,677.66	1.15
12	SOHU.COM INC	SOHU	199,448,259.44	0.98
13	IND & COMM BANK OF CHINA	01398	198,641,297.86	0.98
14	NETEASE.COM INC	NTES	174,025,518.23	0.86
15	HONG KONG EXCHANGES AND CLEARING LIMITED	00388	168,510,517.14	0.83
16	CHINA RESOURCES LAND LIMITED	01109	149,564,829.44	0.74
17	BAIDU INC	BIDU	148,781,921.20	0.73
18	MINDRAY MEDICAL INTL LTD	MR	146,140,825.38	0.72
19	GUANGZHOU R AND F PROPERTIES CO.LTD.	02777	132,358,940.99	0.65
20	CHINA FOODS LTD	00506	127,734,371.64	0.63

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

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	VALESA	VALE	407,526,660.22	2.01
		VALE/P	178,168,116.59	0.88
2	BANK OF CHINA LTD	03988	558,926,544.86	2.76
3	BANK OF COMMUNICATIONSCO	03328	489,258,676.49	2.41
4	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	POT	400,723,966.21	1.98
5	PETROCHINA CO LTD	00857	398,713,871.68	1.97
6	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL	00386	355,075,532.64	1.75
7	IND & COMM BANK OF CHINA	01398	345,384,838.42	1.70
8	NETEASE.COM INC	NTES	262,604,137.08	1.30

9	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	03900	259,363,809.83	1.28
10	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	01880	247,118,622.82	1.22
11	BAIDU INC	BIDU	239,022,894.50	1.18
12	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD	00489	205,642,983.59	1.01
13	CHINA MERCHANTS BANK	03968	202,427,631.78	1.00
14	HONG KONG EXCHANGES AND CLEARING LIMITED	00388	201,992,359.96	1.00
15	SOHU.COM INC	SOHU	179,998,281.44	0.89
16	PING AN INSURANCE GROUP CO	02318	177,400,214.62	0.88
17	CHINA SHENHUA ENERGY CO	01088	168,997,323.04	0.83
18	SHIMAOPROPERTYHOLDINGSLTD	00813	165,246,938.22	0.82
19	CHINATELECOM CORP LTD	00728	164,633,369.03	0.81
20	MAANSHANIRON&STEEL	00323	160,079,589.54	0.79

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

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	11,726,237,246.63
卖出收入（成交）总额	12,587,879,706.18

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

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
AAA	169,905,368.52	0.88
A-	35,330,369.36	0.18
A3	32,892,401.16	0.17
BBB+	85,378,735.80	0.44
BBB	184,637,783.22	0.96
BBB-	105,271,790.13	0.55

Baa3	48,211,448.01	0.25
Ba2	35,205,180.46	0.18
BB-	97,463,949.33	0.51
B+	75,190,480.08	0.39
B2	37,545,212.16	0.19
B-	78,950,862.38	0.41

注：①上述债券投资组合优先适用标准普尔（STANDARD&POOR'S）评级，若其暂未参与标准普尔评级，则适用穆迪（MOODY'S）评级。上表所列债券信用等级中除 A3、Baa3、Ba2、B2 为穆迪评级外，其他均为标准普尔评级。

②除上表所示，公允价值为人民币 181,912,224.29 元的债券截止本报告期末暂未参与标准普尔及穆迪评级，其债券发行主体分别为长江基建集团有限公司（标准普尔评级 A-），远洋地产控股有限公司（联合资信评级 AA），PETROLEOS DE VENEZUELA S（标准普尔评级 B+）。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	US912828PV69	US TREASURY N/B	145,699,400	145,471,744.70	0.75
2	XS0543477821	PHBS HUWHY	99,340,500	91,555,483.05	0.48
3	USG6419EAB05	NEO-CHINA GROUP NECHIN	72,849,700	78,950,862.38	0.41
4	USG4672JAA81	HUTCH WHA INT 10 HUWHY	66,227,000	65,269,688.72	0.34
5	USY1004WAA46	BERAU CAP RESOUR BERAUC	52,981,600	61,540,247.67	0.32

注：①债券代码为 ISIN 码。

②数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	远期投资	外汇远期（港币兑人民币）	0.00	0.00

2	远期投资	外汇远期（美元兑人民币）	-65,400.00	0.00
3	远期投资	外汇远期（美元兑人民币）	-78,000.00	0.00
4	远期投资	外汇远期（港币兑人民币）	-96,000.00	0.00
5	远期投资	外汇远期（美元兑人民币）	-222,000.00	0.00

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	PROSHARES TRUST	指数	ETF 基金	ProShares Advisors LLC	173,196,850.42	0.90
2	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

8.11 投资组合报告附注

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

8.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 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	62,750,000.00
2	应收证券清算款	98,519,928.44
3	应收股利	6,736,149.82
4	应收利息	19,587,279.53
5	应收申购款	3,724,386.48
6	其他应收款	98,542.60

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	191,416,286.87

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	XS0347451022	COUNTRY GARDEN COGARD	44,972,800.00	0.23

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,400,251	15,334.47	135,384,058.65	0.63%	21,336,719,680.14	99.37%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,457,211.27	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年10月9日)基金份额总额	30,055,638,128.26
本报告期期初基金份额总额	24,583,057,572.03
本报告期基金总申购份额	594,870,429.17
减：本报告期基金总赎回份额	3,705,824,262.41

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,472,103,738.79

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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。

2011 年 2 月 9 日，本基金托管人发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可（2011）115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。2011 年 1 月 31 日，本基金托管人发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 190,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 4 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人收到中国证监会基金监管部《关于督促规范华夏基金管理公司股权的函》（基金部函[2010]17 号）、《关于进一步督促规范华夏基金管理公司股权的函》（基金部函[2010]166 号）、《关于进一步督促规范华夏基金管理公司股权的函》（基金部函[2010]448 号）及《关于进一步督促规范华夏基金管理公司股权的函》（基金部函[2010]600 号），督促本基金管理人股东所持华夏基金股权比例符合相关法律法规和监管要求。本基金管理人将按照中国证监会规定积极配合有关方面做好工作。本基金管理人已分别于 2010 年 1 月 16 日、2010 年 4 月 8 日、2010 年 7 月 20 日及 2010 年 10 月 13 日刊登有关临时公告。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员未受到任何处分。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
MORGAN STANLEY	-	6,050,200,052.57	24.95%	2,927,419.46	13.13%	-
NOMURA INTERNATIONAL	-	4,460,247,180.10	18.39%	5,850,035.70	26.24%	-
MERRILL LYNCH LTD	-	3,529,555,854.19	14.55%	2,943,679.42	13.20%	-
JP MORGAN (ASIA PACIFIC) SECURITIES LTD	-	2,176,583,737.37	8.98%	1,592,049.06	7.14%	-
DEUTSCHE BANK LONDON	-	1,830,457,892.69	7.55%	1,901,165.55	8.53%	-
CAPITAL SECURITIES CORP.	-	736,246,357.20	3.04%	1,072,821.75	4.81%	-
HONG KONG SHANGHAI BANKING CORPORATION LIMITED	-	725,481,991.10	2.99%	969,096.03	4.35%	-
YUANTA SECURITIES(HK) CO. LTD	-	651,137,371.82	2.69%	788,537.93	3.54%	-
SAMSAUNG SECURITIES CO.,LTD	-	472,171,035.16	1.95%	515,273.37	2.31%	-
MASTERLINK SECURITIES CORPORATION	-	453,936,975.08	1.87%	610,522.63	2.74%	-
BNP PARIBAS SECURITIES(ASIA) LIMITED	-	348,689,483.03	1.44%	556,113.33	2.49%	-
CS FIRST BOSTON - ADV EXEC SVCS	-	342,756,530.19	1.41%	478,093.57	2.14%	-

TAIFOOK SECURITIES COMPANY LIMITED	-	286,742,706.29	1.18%	286,742.72	1.29%	-
BOCI SECURITIES LTD	-	259,292,003.40	1.07%	-	-	-
PIPER JAFFRAY	-	257,135,121.39	1.06%	308,562.22	1.38%	-
YUANTA SECURITIES COMPANY LIMITED	-	254,922,105.44	1.05%	181,785.56	0.82%	-
CSC SECURITIES(HK) LIMITED	-	237,975,107.05	0.98%	237,975.11	1.07%	-
CREDIT SUISSE	-	213,626,998.21	0.88%	114,492.36	0.51%	-
FRIEDMANN PACIFIC SECURITIES LIMITED	-	157,465,193.94	0.65%	196,831.59	0.88%	-
CITIGROUP	-	154,442,467.54	0.64%	111,110.20	0.50%	-
BARCLAYS CAPITAL	-	128,722,553.38	0.53%	31,508.35	0.14%	-
KGI ASIA LIMITED - KGIHK	-	117,282,915.18	0.48%	117,282.92	0.53%	-
POLARIS SECURITIES (HK) LIMITED	-	108,580,914.29	0.45%	108,580.90	0.49%	-
UNITED BANK OF SWITZERLAND	-	78,241,900.63	0.32%	20,592.66	0.09%	-
GOLDMAN SACHS	-	37,418,201.46	0.15%	170,877.33	0.77%	-
MASTERLINK SECURITIES CORPORATION - MASLNKTW	-	32,174,813.82	0.13%	38,621.10	0.17%	-
CLSA LTD	-	18,392,310.62	0.08%	45,641.88	0.20%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	16,422,620.47	0.07%	7,291.52	0.03%	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	16,137,076.82	0.07%	24,205.62	0.11%	-
SG SECURITIES LIMITED	-	14,269,271.14	0.06%	21,000.01	0.09%	-
DEUTSCHE SECURITIES ASIA	-	11,938,262.29	0.05%	8,947.36	0.04%	-

LTD						
J P MORGAN CHASE HQ	-	9,947,463.61	0.04%	9,420.84	0.04%	-
USB ASIA SECURITIES LTD	-	7,674,597.78	0.03%	7,675.16	0.03%	-
ITG CANADA/TD SECURITIES	-	5,736,626.21	0.02%	919.96	0.00%	-
KEEFE BRUYETTE & WOOD	-	5,404,995.13	0.02%	1,611.60	0.01%	-
LEERINK SWANN AND COMPANY	-	5,345,001.17	0.02%	2,949.19	0.01%	-
MACQUARIE EQUITIES LIMITED	-	3,424,768.84	0.01%	3,114.60	0.01%	-
WEEDEN & CO	-	3,142,455.13	0.01%	4,813.04	0.02%	-
STIFEL NICOLAS & COMPANY	-	2,997,456.43	0.01%	4,838.60	0.02%	-
BEAR STEARNS	-	2,788,800.34	0.01%	4,041.48	0.02%	-
SOLEIL SECURITIES	-	2,512,025.05	0.01%	1,085.40	0.00%	-
LIQUIDNET INC	-	2,053,757.11	0.01%	1,325.99	0.01%	-
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED	-	1,858,637.75	0.01%	2,517.11	0.01%	-
BLAIR, WILLIAM & COMPANY	-	1,677,615.33	0.01%	1,065.09	0.00%	-
RAYMOND JAMES & ASSOCIATES	-	1,642,964.91	0.01%	546.12	0.00%	-
AMERICAN TECHNOLOGY RESEARCH	-	1,364,556.42	0.01%	1,331.30	0.01%	-
RBC CAPITAL MARKETS	-	1,065,441.59	0.00%	907.96	0.00%	-
BUCKINGHAM RESEARCH GROUP	-	902,229.52	0.00%	409.58	0.00%	-
ALLEN & COMPANY	-	780,851.24	0.00%	696.35	0.00%	-
SANTANDER	-	759,808.74	0.00%	937.79	0.00%	-
STEPHENS INC.	-	695,221.86	0.00%	389.13	0.00%	-
CREDIT LYONNAIS	-	657,004.40	0.00%	328.52	0.00%	-
CANACCORD ADAMS	-	621,704.86	0.00%	682.70	0.00%	-

PIPELINE TRADING SYSTEMS LLC	-	607,838.11	0.00%	273.05	0.00%	-
OTR GLOBAL TRADING	-	598,098.05	0.00%	491.55	0.00%	-
MEDIOBANCA	-	579,931.84	0.00%	869.92	0.00%	-
EXECUTION	-	443,066.40	0.00%	664.60	0.00%	-
KEPLER EQUITIES	-	429,776.78	0.00%	644.64	0.00%	-
ITAU SECURITIES INC	-	424,550.97	0.00%	914.92	0.00%	-
RENAISSANCE CAPITAL LTD	-	423,280.66	0.00%	846.56	0.00%	-
NESBITT BURNS SECURITIES	-	398,500.73	0.00%	300.39	0.00%	-
CREDIT AGRICOLE INDOSUEZ CHEUVREUX	-	340,355.65	0.00%	510.57	0.00%	-
SIMMONS & COMPANY INT'L	-	320,578.64	0.00%	218.49	0.00%	-
ROBERT W BAIRD & CO	-	307,636.55	0.00%	245.78	0.00%	-
ISI GROUP	-	304,908.10	0.00%	245.76	0.00%	-
B-TRADE SERVICES - TRADE BOOK	-	304,905.47	0.00%	66.56	0.00%	-
COLLINS STEWART INC	-	300,548.83	0.00%	307.25	0.00%	-
HOWARD WEIL DIVISION - LEGG MASON	-	287,280.99	0.00%	245.75	0.00%	-
LIBERUM CAPITAL	-	269,522.71	0.00%	539.03	0.00%	-
HOWARD WEIL INC	-	269,216.11	0.00%	191.18	0.00%	-
GARDNER RICH & COMPANY	-	256,445.94	0.00%	191.15	0.00%	-
HELVEA	-	220,174.78	0.00%	330.28	0.00%	-
SALMON BROTHERS - PROGRAM	-	150,730.10	0.00%	47.79	0.00%	-
ASK RAYMOND JAMES (INDIA)	-	145,825.93	0.00%	218.75	0.00%	-
ICAP SECURITIES	-	140,216.96	0.00%	109.92	0.00%	-

TRPIKA	-	136,556.95	0.00%	273.11	0.00%	-
WESTLB PANMURE	-	132,605.78	0.00%	198.92	0.00%	-
OPPENHEIMER & CO.	-	126,436.40	0.00%	109.22	0.00%	-
SIDOTI AND COMPANY	-	122,593.86	0.00%	136.53	0.00%	-
BNY BROKERAGE	-	46,071.37	0.00%	27.31	0.00%	-
OLIVETREE	-	42,964.51	0.00%	64.44	0.00%	-
HSBC SECURITIES (JAMES CAPEL)	-	41,728.84	0.00%	20.48	0.00%	-
FIRST UNION/WACHOVIA	-	36,653.63	0.00%	27.31	0.00%	-
EXANE SA	-	35,951.55	0.00%	53.91	0.00%	-
CLSA LTD - CLSAHK	-	31,622.82	0.00%	31.62	0.00%	-
JONES ASSOCIATES	-	23,039.04	0.00%	13.65	0.00%	-
NUMIS CORP	-	13,709.80	0.00%	20.57	0.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

iii 有良好的交易执行能力和交易执行系统。

iv 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

v 能够及时准确高效地提供结算等后台业务支持。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了中信证券、安信证券、中信建投证券、申银万国证券、高华证券、国泰君安证券、广发证券、中金公司、中投证券、西南证券、中国银河证券、太平洋证券、国联证券、华鑫证券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，华鑫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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
MORGAN STANLEY	510,496,290.30	8.35%	-	-	624,540,262.92	30.43%
NOMURA INTERNATIONAL	287,389,290.23	4.70%	-	-	517,334,804.18	25.21%
MERRILL LYNCH LTD	936,779,663.06	15.33%	-	-	467,929,242.97	22.80%
JP MORGAN (ASIA PACIFIC) SECURITIES LTD	458,730,998.51	7.51%	-	-	75,234,910.62	3.67%
DEUTSCHE BANK LONDON	-	-	-	-	57,189,550.78	2.79%
HONG KONG SHANGHAI BANKING CORPORATION LIMITED	184,479,575.14	3.02%	-	-	125,973,148.82	6.14%
BNP PARIBAS SECURITIES(ASIA) LIMITED	-	-	-	-	114,738,284.90	5.59%
CS FIRST BOSTON - ADV EXEC SVCS	-	-	-	-	69,443,888.24	3.38%
BOCI SECURITIES LTD	113,761,010.50	1.86%	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	655,788,458.73	10.73%	-	-	-	-

CITIGROUP	795,742,014.48	13.02%	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL	212,846,820.22	3.48%	-	-	-	-
UNITED BANK OF SWITZERLAND	143,316,852.88	2.34%	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS	370,348,042.33	6.06%	-	-	-	-
DEUTSCHE SECURITIES ASIA LTD	812,337,555.70	13.29%	-	-	-	-
BARCLAYS BANK	238,134,511.20	3.90%	-	-	-	-
BNP PARIBAS, LONDON	70,950,536.69	1.16%	-	-	-	-
BOCI FINANCIAL PRODUCTS LTD	58,755,729.38	0.96%	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED BANK	111,642,340.71	1.83%	-	-	-	-
UBS INVESTMENT BANK LTD UBSFIAG	150,829,587.42	2.47%	-	-	-	-
申银万国证券	-	-	600,000,000.00	9.33%	-	-
中信证券	-	-	5,832,000,000.00	90.67%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于调整信息披露负责人的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-01-04
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	2010-01-16
3	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	2010-01-21
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开办定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-01-27
5	华夏基金管理有限公司关于开通中国工商银行借记卡基金网上交易的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-02-09
6	华夏基金管理有限公司关于开通交通银行太平洋借记卡基金网上交易	中国证监会指定报刊及网站	2010-02-26

	的公告		
7	华夏基金管理有限公司关于开通中国工商银行借记卡基金网上交易定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-03-29
8	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-04-01
9	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-04-08
10	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳发展银行基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-05-04
11	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-05-08
12	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开办定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-05-27
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	2010-05-27
14	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-06-01
15	华夏基金管理有限公司关于开通开放式基金网上下单转账支付业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-06-12
16	华夏基金管理有限公司关于开通中国建设银行龙卡借记卡基金网上交易定期定额申购业务及调整旗下基金费率优惠事项的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-06-12
17	关于华夏全球精选股票型证券投资基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-06-26
18	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-07-20
19	华夏基金管理有限公司关于设立南京分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-08-12
20	华夏基金管理有限公司关于调整中国农业银行金穗借记卡基金网上交易优惠费率的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-08-23
21	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-09-30
22	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-10-13

23	华夏基金管理有限公司关于网上下单转账支付业务增加指定银行收款账户的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-10-22
24	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开办定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-10-22
25	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增华夏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	2010-11-04
26	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	2010-12-10
27	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳发展银行股份有限公司基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-12-31
28	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2010-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2010 年 1 月 29 日，中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任副行长。

2、2010 年 5 月 12 日，中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生辞去副行长的职务。

3、2010 年 6 月 21 日，中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

4、2010 年 7 月 1 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2009 年度 A 股分红派息实施公告，每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元(含税)。

5、2010 年 9 月 15 日，中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任监事长，谢渡扬先生辞去监事、监事长职务。

6、2010 年 11 月 2 日，中国建设银行股份有限公司发布 2010 年度 A 股配股发行公告。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。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

二〇一一年三月二十八日