

华夏全球精选股票型证券投资基金 2016年第3季度报告

2016年9月30日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	6,434,658,243.96 份
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。
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
境外资产托管人英文名称	JPMorgan Chase Bank, National Association
境外资产托管人中文名称	摩根大通银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2016年7月1日-2016年9月30日)
1.本期已实现收益	-63,698,885.70
2.本期利润	365,998,244.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0562
4.期末基金资产净值	5,057,696,053.25
5.期末基金份额净值	0.786

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。

3.2 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	净值增长率①	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	7.67%	0.75%	4.79%	0.55%	2.88%	0.20%

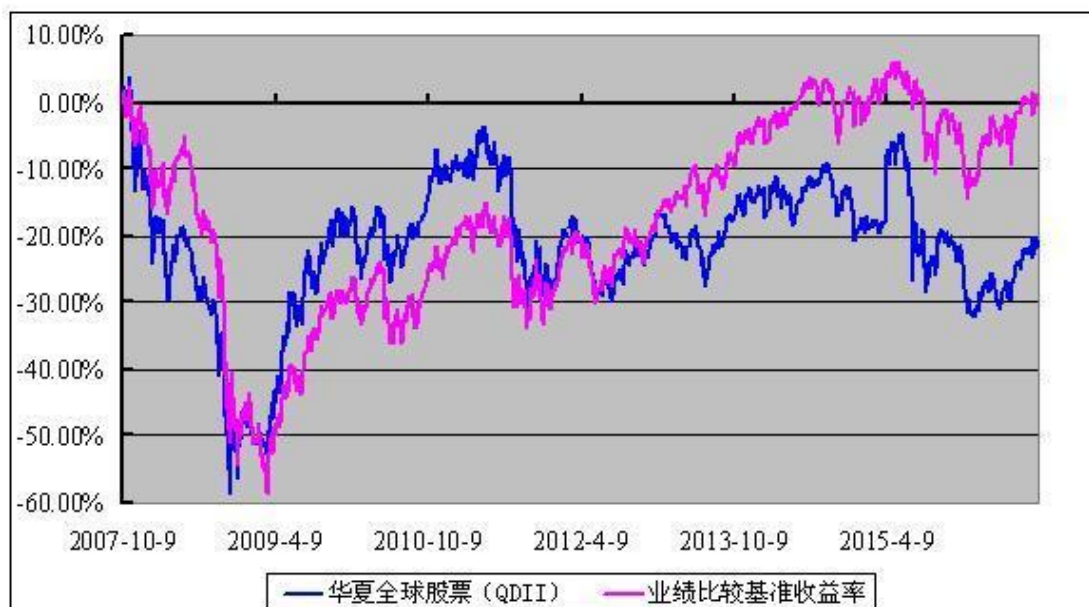
注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏全球精选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2007年10月9日至2016年9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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李湘杰	本基金的基金经理、国际投资部董事总经理	2016-05-25	-	14 年	国立台湾大学商学硕士。曾任台湾 ING 投信基金经理、台湾元大投信基金经理、华润元大基金投资管理部总经理、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2013 年 9 月 11 日至 2014 年 9 月 18 日期间）、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理（2014 年 8 月 18 日至 2015 年 9 月 23 日期间）等。2015 年 9 月加入华夏基金管理有限公司。
陈永强	本基金的基金经理、国际投资部高	2015-04-01	2016-07-25	10 年	荷兰代尔夫特工业大学工学硕士。曾任中邮基金研究员、嘉实基金研究员、华安资

	级副总裁				产管理（香港）有限公司投资经理、中信证券国际资产管理公司投资经理等。2013 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任基金经理助理等。
--	------	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3 季度，全球资本市场经历普遍上涨。7 月，英国脱欧对市场的短期冲击逐渐淡去，美国经济数据好于市场预期，三大股指创新高。8 月，全球风险偏好继续回升，资金流入新兴市场，投资新兴市场的回报好于欧洲、日本，更好于美国。8 月中旬中国政府公布年内开通深港通，并放开沪港通总额度，港股通流入资金

大幅上升，香港股市强劲上涨，成为当月全球涨幅最大的市场。9 月全球股市呈 V 形反弹，中上旬投资者担心美联储加息，美元走强股市走弱，加息预期减弱并消除后全球股指反弹。

报告期内，本基金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，主要投资于业绩增长确定性强的优质白马股、受益于港股通扩容的高股息银行、公用事业板块以及两地估值差异较大的科技资讯股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 0.786 元，本报告期份额净值增长率为 7.67%，同期业绩比较基准增长率以美元计为 4.79%（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 4 季度，中国经济下行压力下政府的不定期刺激，叠加美国大选等国际重大政治事件扰动，均为影响市场的波动因素。本基金将在以下几方面做好投资：

国家配置方面，本基金相对看好新兴市场及美国市场，看淡欧洲和日本市场。

中资股方面，本基金保持积极投资策略，通过精选个股战胜基准，核心配置教育、游戏、消费、信息技术等子板块中经营趋势向好、业绩增长确定的龙头公司；布局深港通开通后内地资金可能追捧的高股息及两地估值差异较大板块。同时，密切关注人民币贬值、外部政治事件带来的冲击性风险，适当配置黄金等避险品种及稳健的出口型公司对冲负面事件风险、人民币贬值风险。

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

4.6 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 投资组合报告

5.1 报告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	4,260,429,006.91	83.41
	其中：普通股	3,538,463,309.68	69.28
	存托凭证	721,965,697.23	14.14
2	基金投资	441,841,572.92	8.65
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	324,840,005.14	6.36
8	其他各项资产	80,530,753.53	1.58
9	合计	5,107,641,338.50	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	1,563,837,417.76	30.92
美国	1,326,572,390.50	26.23
韩国	308,835,024.91	6.11
中国台湾	288,935,486.51	5.71
泰国	244,863,014.69	4.84
印度	233,800,058.86	4.62
印度尼西亚	194,239,897.33	3.84
新加坡	63,526,733.19	1.26
澳大利亚	35,818,983.16	0.71
合计	4,260,429,006.91	84.24

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	1,877,055,483.81	37.11

金融	794,467,544.72	15.71
非必需消费品	699,676,130.04	13.83
必需消费品	241,730,302.77	4.78
电信服务	199,578,947.25	3.95
材料	156,490,772.60	3.09
能源	105,830,703.86	2.09
房地产	91,155,575.88	1.80
工业	51,296,212.88	1.01
保健	24,612,079.78	0.49
公用事业	18,535,253.32	0.37
合计	4,260,429,006.91	84.24

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	TENCENT HOLDING S LTD	腾讯控 股有 限公 司	00700	香港	中国香 港	1,780,200	326,489,691.80	6.46
2	SAMSUNG ELECTRO NICS CO LTD	-	005930	韩国	韩国	26,057	252,698,645.60	5.00
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	-	BABA	纽约	美国	318,000	224,649,338.97	4.44
4	INDUSTRI AL & COMMER CIAL BANK OF CHINA LTD	中国工 商银 行股 份有 限公 司	01398	香港	中国香 港	42,003,000	175,405,465.98	3.47
5	TAIWAN SEMICON DUCTOR	-	TSM	纽约	美国	711,800	145,402,163.48	2.87

	MANUFACTURING CO LTD							
6	CHINA MOBILE LTD	中国移动有限公司	00941	香港	中国香港	1,383,500	111,798,123.53	2.21
7	AMAZON.COM INC	-	AMZN	纳斯达克	美国	19,200	107,354,663.41	2.12
8	BANK OF CHINA LTD	中国银行股份有限公司	03988	香港	中国香港	30,052,000	91,600,472.94	1.81
9	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	吉利汽车控股有限公司	00175	香港	中国香港	14,530,000	86,575,056.28	1.71
10	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	台湾积体电路制造股份有限公司	2330	台湾	中国台湾	2,086,000	81,101,426.20	1.60

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.5 报告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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净
----	------	------	------	-----	------	--------

						值比例 (%)
1	DIREXION ETFS/USA	指数型	ETF 基金	Rafferty Asset Management LLC	210,462,359.5 5	4.16
2	HANG SENG INVESTME NT MANAGEM ENT	指数型	ETF 基金	Hang Seng Investment Management Ltd	84,164,199.84	1.66
3	ISHARES ETFS/USA	指数型	ETF 基金	BlackRock Fund Advisors	83,016,399.61	1.64
4	VANECK VECTORS ETFS/USA	指数型	ETF 基金	Van Eck Associates Corp	25,092,688.26	0.50
5	FUBON SECURITIE S INVESTME NT TR	指数型	ETF 基金	Fubon Securities Investment Trust Co Ltd/Taiwan	23,210,344.29	0.46
6	WISDOMTR EE ETFS/USA	指数型	ETF 基金	WisdomTree Asset Management Inc	15,895,581.37	0.31
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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	42,921,341.18

3	应收股利	4,552,674.55
4	应收利息	20,203.00
5	应收申购款	945,962.95
6	其他应收款	32,090,571.85
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,530,753.53

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	6,571,279,432.30
本报告期基金总申购份额	36,131,464.21
减：本报告期基金总赎回份额	172,752,652.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,434,658,243.96

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内披露的主要事项

2016 年 7 月 2 日发布华夏基金管理有限公司公告。

2016 年 7 月 2 日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

2016 年 7 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增

珠海盈米财富管理有限公司为代销机构的公告。

2016 年 7 月 27 日发布华夏基金管理有限公司关于调整华夏全球精选股票型证券投资基金基金经理的公告。

2016 年 8 月 17 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增深圳富济财富管理有限公司为代销机构的公告。

2016 年 8 月 18 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增乾道金融信息服务（北京）有限公司为代销机构的公告。

2016 年 8 月 19 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构的公告。

2016 年 8 月 31 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增大泰金石投资管理有限公司为代销机构的公告。

2016 年 8 月 31 日发布关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告。

2016 年 9 月 20 日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

2016 年 9 月 28 日发布关于华夏全球精选股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告。

8.2 其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至 2016 年 9 月 30 日数据），华夏策略混合在 75 只灵活配置混合型基金（股票

上限 80%) 中排名第 6, 华夏医疗健康混合 A 在 58 只偏股型基金(股票上限 95%) 中排名第 5, 华夏沪深 300 指数增强 A 在 39 只增强指数股票型基金中排名第 10; 固定收益类产品中, 华夏理财 30 天债券在 39 只短期理财债券型基金中排名第 11, 华夏薪金宝货币在 194 只货币型基金中排名第 7。

在客户服务方面, 3 季度, 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) 网上交易上线通联兴业快捷支付方式、定投通业务, 进一步升级华夏基金管家客户端, 为客户提供更多便捷的理财方式; (2) 网上查询系统优化了数据更新时间, 提高客户自助查询的及时性; (3) 开展“体验定投通, 红包大放送”、“数说华夏基金‘投友’十件事儿”、2016 北京马拉松系列宣传等活动, 为客户提供多样化的关怀服务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 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。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后, 投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一六年十月二十五日