

# 华夏全球精选股票型证券投资基金

## 2022 年第 3 季度报告

2022 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：二〇二二年十月二十五日

## §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 2022 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 2022 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	2,157,286,399.74 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	主要投资策略包括资产配置策略、股票精选策略、债券投资策略、衍生品投资策略等。在股票精选策略上，本基金主要采取“自下而上”的个股精选策略，以国际化视野精选具有良好成长潜能、价值被相对低估的行业和公司进行投资。
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 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-45,228,602.39
2.本期利润	-105,692,964.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0488
4.期末基金资产净值	1,851,478,365.61
5.期末基金份额净值	0.858

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 本报告期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	-5.40%	1.16%	-7.27%	1.01%	1.87%	0.15%
过去六个月	-17.97%	1.38%	-22.23%	1.19%	4.26%	0.19%
过去一年	-24.87%	1.44%	-22.01%	1.10%	-2.86%	0.34%
过去三年	-12.89%	1.70%	6.28%	1.28%	-19.17%	0.42%
过去五年	-16.37%	1.52%	13.66%	1.09%	-30.03%	0.43%
自基金合同生效起至今	-14.20%	1.34%	32.27%	1.14%	-46.47%	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累计份额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

##### 累计份额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 2022 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、投委会成员	2016-05-25	-	20 年	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”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内，李湘杰已于 2022 年 7 月 17 日离任其原管理的 1 个私募资产管理计划。

### 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 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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共有 25 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 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，恒生指数下跌 21.21% 左右，标普 500 下跌 5.28% 左右。

港股在 7 至 9 月连续下跌。美股市场在 7 月大幅反弹，但在 8 至 9 月又下跌探底。

美国通胀在 3 季度仍然高企，美联储持续加息，市场流动性和风险偏好受到很大负面影响。美国科技股在 7 月反弹后，在 8、9 月回撤探底。美国科技股的涨跌与加息预期大体相关联，所以呈现出先反弹后下跌的走势。

港股市场受到美国联储连续加息和中国国内经济疲弱的双重影响，表现较差。

报告期内，本基金持仓配置更加均衡，对美股配置更加行业均衡。本基金持续优化持仓结构，降低了整体持仓的 beta，对基本面转差的股票进行卖出。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 0.858 元，本报告期份额净值增长率为-5.40%，同期业绩比较基准增长率以美元计为-7.27%（不包含人民币汇率变动等因素产生的效应）。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,655,386,995.05	83.81
	其中：普通股	1,545,291,031.25	78.24
	存托凭证	110,095,963.80	5.57
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	29,112,726.44	1.47
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	242,706,670.30	12.29
8	其他各项资产	47,980,516.08	2.43
9	合计	1,975,186,907.87	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

国家（地区）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
美国	1,141,474,494.52	61.65
中国香港	476,215,602.06	25.72
中国台湾	32,686,949.05	1.77
法国	5,009,949.42	0.27
合计	1,655,386,995.05	89.41

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	542,400,431.95	29.30
非必需消费品	341,094,873.54	18.42
材料	144,240,886.37	7.79
能源	141,421,367.24	7.64
保健	122,565,797.87	6.62
通信服务	79,957,340.17	4.32
必需消费品	77,302,066.69	4.18
工业	75,287,424.08	4.07
房地产	65,199,696.85	3.52
金融	61,496,366.79	3.32
公用事业	4,420,743.50	0.24
合计	1,655,386,995.05	89.41

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	-	AAPL	纳斯达克	美国	122,369.00	120,067,527.90	6.48

				达克				
2	YANCOAL AUSTRALIA LTD	兖煤澳大利亚有限公司	03668	香港	中国香港	4,126,700.00	108,424,841.52	5.86
3	TIANQI LITHIUM CORP	天齐锂业股份有限公司	09696	香港	中国香港	1,574,400.00	97,540,598.02	5.27
4	MICROSOFT CORP	-	MSFT	纳斯达克	美国	57,687.00	95,387,959.27	5.15
5	PINDUODUO INC	-	PDD	纳斯达克	美国	153,166.00	68,052,493.76	3.68
6	KE HOLDINGS INC	贝壳控股有限公司	BEKE	纽约	美国	215,034.00	26,747,755.85	1.44
			02423	香港	中国香港	979,600.00	38,451,941.00	2.08
7	TESLA INC	-	TSLA	纳斯达克	美国	33,096.00	62,327,113.66	3.37
8	AMAZON.COM INC	-	AMZN	纳斯达克	美国	77,664.00	62,308,071.99	3.37
9	KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	新东方在线科技控股有限公司	01797	香港	中国香港	2,157,000.00	57,453,330.01	3.10
10	SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	上海复旦微电子集团股	01385	香港	中国香港	1,736,500.00	56,383,106.15	3.05



		份有 限公 司					
--	--	---------------	--	--	--	--	--

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名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名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。

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	iShares ETFs/USA	权益类	ETF	BlackRock Fund Advisors	16,431,056.70	0.89
2	Global X ETFs/USA	权益类	ETF	Global X Managemen t Co LLC	9,417,830.67	0.51
3	Mirae Asset Global Investments	权益类	ETF	Mirae Asset Global Investments Hong Kong Ltd/HK	3,263,839.07	0.18
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	636,888.83
4	应收利息	-
5	应收申购款	616,300.95
6	其他应收款	46,727,326.30
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,980,516.08

#### 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

报告期期初基金份额总额	2,173,681,453.92
报告期期间基金总申购份额	28,513,917.22
减：报告期期间基金总赎回份额	44,908,971.40
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,157,286,399.74

## §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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

#### 1、报告期内披露的主要事项

2022 年 8 月 24 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

#### 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、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、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题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，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

二〇二二年十月二十五日