

# 鹏华环球发现证券投资基金 2016 年半年度 报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	32
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	32
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.....	33
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	35
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细.....	37
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.....	37

7.11 投资组合报告附注.....	38
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
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.....	39
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>39</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华环球发现证券投资基金
基金简称	鹏华环球发现(QDII-FOF)
场内简称	-
基金主代码	206006
交易代码	206006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年10月12日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
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	55,094,187.55份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	积极地环球寻找并发现投资机会，通过积极的战略战术资产配置来进行资产在基金、股票、货币市场工具及现金中的分配，在分散风险的前提下，最大化地实现资本的长期增值。
投资策略	<p>本基金采用多重投资策略，包括自上而下和自下而上方法来增强基金选择流程并提升其效率。衍生品策略将不作为本基金的主要投资策略，且仅用于在适当时候力争规避外汇风险及其他相关风险之目的。</p> <p><b>1. 战略资产配置</b></p> <p>战略资产配置的目标在于通过资产的灵活配置获得最佳的风险回报。首先通过深入研究，建立基于全球主要市场增长、通货膨胀及货币政策的分析框架，再以宏观经济分析及对全球经济趋势的研究为基础，来决定重点投资区域（地域选择）及资产类别和权重，其后定期进行审核调整。资产类别和地区的适度分散可以有效降低组合的相关性及由此可能产生的单一市场的系统性风险和其他相关风险。此外本基金还将使用适当的风险控制措施来监控管理与战略资产配置相关的风险。</p> <p><b>2. 战术资产配置</b></p> <p>本基金在战略资产配置的基础上将根据短期内资本市场对不同区域内的不同资产类别的定价判断其与内涵价值的关系，同时考虑投资环境、资金流动、市场预期等因素的变化情况进行适当的战术资产配置及调整。同时，在对微观及宏观经济判断的基础上，本基</p>

	金还将使用适当的风险控制措施来监控管理与战术资产配置相关的风险。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界指数 (MSCI World Index RMB) × 50% + 摩根斯坦利新兴市场指数 (MSCI Emerging Markets Index RMB) × 50%
风险收益特征	本基金属于投资全球市场的基金中基金 (主要投资股票型公募基金), 为证券投资基金中的中高风险品种。长期平均的风险和预期收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金, 长期平均的风险低于投资单一市场的股票型基金。

### 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		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区金融街25号
办公地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	王洪章

### 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	Eurizon Capital SGR S. p. A.	State Street Bank and Trust Company
	中文	欧利盛资本资产管理股份有限公司	道富银行
注册地址		意大利米兰嘉多纳 (Cadorna) 广场三号	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 0211, United States
办公地址		意大利米兰嘉多纳 (Cadorna) 广场三号	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 0211, United States
邮政编码		20123	0211

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行股份有限公司

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,990,560.59
本期利润	-5,676,734.87
加权平均基金份额本期利润	-0.1091
本期加权平均净值利润率	-12.25%
本期基金份额净值增长率	-13.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-5,252,015.17
期末可供分配基金份额利润	-0.0953
期末基金资产净值	49,842,172.38
期末基金份额净值	0.905
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-9.50%

注：(1) 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。

(2) 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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放

日或交易所的交易日。

### 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

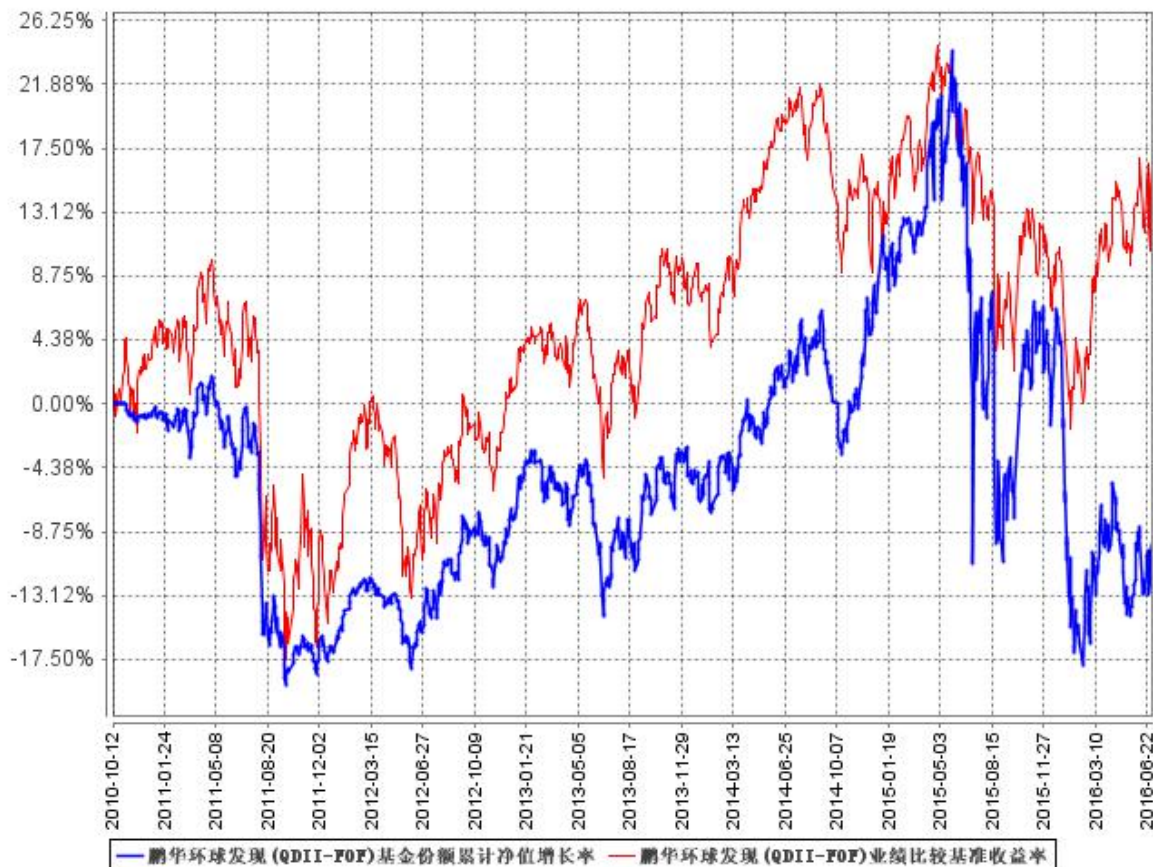
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.00%	1.46%	2.32%	1.51%	-2.32%	-0.05%
过去三个月	-0.88%	1.23%	3.61%	1.01%	-4.49%	0.22%
过去六个月	-13.15%	1.66%	5.99%	1.06%	-19.14%	0.60%
过去一年	-18.17%	2.03%	-0.72%	1.08%	-17.45%	0.95%
过去三年	3.19%	1.35%	17.50%	0.79%	-14.31%	0.56%
自基金合同生效起至今	-9.50%	1.05%	16.32%	0.88%	-25.82%	0.17%

注：本基金业绩比较基准=摩根斯坦利世界指数（MSCI World Index RMB）×50%+摩根斯坦利新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index RMB）×50%。



### 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

鹏华环球发现(QDII-FOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、鹏华环球发现证券投资基金基金合同于 2010 年 10 月 12 日生效。  
2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

## § 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

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止 2016 年 6 月，公司管理资产总规模达到 3609.67 亿元，管理 99 只公募基金、10 只全国社保投资组合。经过近 18 年投资管理基金，在基金投资、风

险控制等方面积累了丰富经验。

#### 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尤柏年	本基金基金经理	2014年9月13日	-	12	尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，12年证券从业经验。历任澳大利亚BConnect公司Apex投资咨询团队分析师，华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理、华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职；2014年7月加盟鹏华基金管理有限公司，任职于国际业务部，2014年8月起担任鹏华全球高收益债（QDII）基金基金经理，2014年9月起兼任鹏华环球发现（QDII-FOF）基金基金经理，2015年7月起兼任鹏华前海万科REITs基金基金经理，现同时担任国际业务部副总经理。尤柏年先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，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关于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位	证券从业年限	说明
Domenico Mignacca	风险管理负责人	19	-
Oreste Auleta	基金甄选部负责人	16	-

Alessandro Solina	首席投资官	24	-
Andrea Conti	策略负责人	13	-

### 4.3 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《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与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的 5% 的情况。

### 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

经历过一季度的大起大落后，第二季度港股波动幅度相对有所减弱。4 月份港股延续第一季度上扬走势，随后 5 月份随着美元重新走强以及偏弱的外围经济数据导致的全球避险情绪回升，资金再次流出导致港股下挫。进入 6 月后影响港股因素增多，美国 5 月份非农数据严重不符合预期、A 股未被纳入 MSCI、美国 6 月加息再次落空、深港通预期扰动等事件推动港股围绕 20500 点附近来回震荡。临近 6 月底，英国脱欧公投后，港股应声急跌，虽随后几日跟随欧美股市出现了一小波反弹，但仍难摆脱英国脱欧后遗症，该黑天鹅事件对英国以及欧洲经济的负面影响近几个月内将逐渐显现，短期内港股表现料将受到一定压制。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

在 2016 年上半年，基金份额净值增长率为-13.15%，领先于沪深 300 指数，但是落后于 MSCI 世界指数和恒生指数。

#### 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 2016 年下半年，全球经济仍充满挑战和不确定性。需密切注意意大利宪法改革公投、美国大选等重大事件对全球经济产生的影响，同时需警惕欧洲银行业危机等潜伏的黑天鹅事件。

另一方面，由于港股仍是估值洼地，伴随人民币资产荒及深港通预期升温等因素近期内地资金加速南下，国内机构已开始预热深港通，截止二季度末港股通 2500 亿元额度已剩余不足四分之一。本基金继续在港股中精选并增加了对绩优海外中国股票的持仓，以及减少业绩增长低于预期的公司股票。考虑到深港通大概率在下半年落地，本基金将继续持有相关的香港金融类股票。

#### 4.7 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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本公司成立投资品种估值小组，组成人员包括基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员。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，基金经理不参与或决定基金日常估值。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为-5,252,015.17 元，期末基金份额净值 0.905 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

#### 4.9 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

本报告期内，本基金出现过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形；截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

### § 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

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：鹏华环球发现证券投资基金  
报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,311,096.17	10,692,780.93
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	44,422,100.95	46,342,747.14
其中：股票投资		13,184,647.17	16,389,130.16
基金投资		31,237,453.78	29,953,616.98
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	2,114,048.20
应收利息	6.4.7.5	14.21	731.09
应收股利		110,176.73	27,663.50
应收申购款		65,028.30	21,792.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	7,874,405.00
资产总计		51,908,416.36	67,074,167.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2016年6月30日	2015年12月31日
<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		1,552,213.46	-
应付赎回款		60,409.53	10,890,697.54
应付管理人报酬		60,249.47	71,145.81
应付托管费		14,058.23	16,600.70
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	379,313.29	8,171,984.12
负债合计		2,066,243.98	19,150,428.17
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	55,094,187.55	46,001,267.86
未分配利润	6.4.7.10	-5,252,015.17	1,922,471.83
所有者权益合计		49,842,172.38	47,923,739.69
负债和所有者权益总计		51,908,416.36	67,074,167.86

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值0.905元，基金份额总额55,904,187.55份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华环球发现证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
<b>一、收入</b>		-5,005,556.76	974,713.21
1.利息收入		4,006.84	22,708.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,006.84	22,007.07
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		-	701.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,451,848.13	6,624,727.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,115,166.09	-136,681.86
基金投资收益	6.4.7.13	-1,617,621.41	6,387,876.02
债券投资收益	6.4.7.14	-	-

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	280,939.37	373,533.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,686,174.28	-5,700,678.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		120,954.08	-32,228.13
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	7,504.73	60,184.25
<b>减：二、费用</b>		671,178.11	856,765.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	344,244.06	392,777.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	80,323.65	91,647.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	56,188.91	186,180.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
<b>6. 其他费用</b>	6.4.7.21	190,421.49	186,159.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,676,734.87	117,947.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,676,734.87	117,947.77

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华环球发现证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	46,001,267.86	1,922,471.83	47,923,739.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,676,734.87	-5,676,734.87
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）	9,092,919.69	-1,497,752.13	7,595,167.56
其中：1.基金申购款	15,892,233.41	-2,032,835.65	13,859,397.76

2. 基金赎回款	-6,799,313.72	535,083.52	-6,264,230.20
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）	55,094,187.55	-5,252,015.17	49,842,172.38
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	40,162,308.87	3,762,668.41	43,924,977.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	117,947.77	117,947.77
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）	10,810,376.50	1,537,740.98	12,348,117.48
其中：1.基金申购款	64,482,700.09	10,528,430.12	75,011,130.21
2.基金赎回款	-53,672,323.59	-8,990,689.14	-62,663,012.73
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）	50,972,685.37	5,418,357.16	56,391,042.53

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：

\_\_\_\_\_  
邓召明  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
高鹏  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
郝文高  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华环球发现证券投资基金（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”）证监许可[2010]第470号《关于核准鹏华环球发现证券投资基金募集的批复》核



准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》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人民币 534,126,065.21 元，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2010)第 258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》于 2010 年 10 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 534,464,662.52 份基金份额，其中认购资金利息折合 338,597.31 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行，境外投资顾问为欧利盛资本资产管理股份公司。

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《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为公募基金(含交易型开放式指数基金(ETF))、股票、货币市场工具，及相关法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金基金投资部分的比例为基金资产的 60%-95%；股票、现金、货币市场工具以及相关法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具合计不高于本基金基金资产的 40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利世界指数(MSCI World Index RMB)×50%+摩根斯坦利新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index RMB)×50%。

#### 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》和中国证监会允许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

本基金 2016 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年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。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/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》[适用于 OEF]、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	7,311,096.17
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计：	7,311,096.17

注：于本期末，银行存款中包含的外币余额为：美元 785,164.72 元(折合人民币 5,206,584.29 元)，欧元 0.12 元(折合人民币 0.89 元)，英镑 0.22 元(折合人民币 1.96 元)和港币 2,334,624.96 元(折合人民币 1,995,333.92 元)。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,840,339.39	13,184,647.17	-655,692.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	34,719,338.55	31,237,453.78	-3,481,884.77
其他	-	-	-
合计	48,559,677.94	44,422,100.95	-4,137,576.99

#### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	14.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	14.21

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 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 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	298.09
预提费用	379,015.20
合计	379,313.29

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,001,267.86	46,001,267.86
本期申购	15,892,233.41	15,892,233.41
本期赎回(以“-”号填列)	-6,799,313.72	-6,799,313.72
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	55,094,187.55	55,094,187.55

注：申购含红利再投份额。

#### 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	5,475,832.96	-3,553,361.13	1,922,471.83
本期利润	-2,990,560.59	-2,686,174.28	-5,676,734.87
本期基金份额交易产生的变动数	777,837.74	-2,275,589.87	-1,497,752.13
其中：基金申购款	1,342,560.30	-3,375,395.95	-2,032,835.65
基金赎回款	-564,722.56	1,099,806.08	535,083.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,263,110.11	-8,515,125.28	-5,252,015.17

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	3,343.49
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	663.35
合计	4,006.84

注：其他为申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	9,374,371.61
减：卖出股票成本总额	10,489,537.70
买卖股票差价收入	-1,115,166.09

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	10,247,034.84
减：卖出/赎回基金成本总额	11,864,656.25
基金投资收益	-1,617,621.41

**6.4.7.14 债券投资收益**

无。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	90,992.96
基金投资产生的股利收益	189,946.41
合计	280,939.37

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,686,174.28
——股票投资	-773,416.97
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-1,912,757.31
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-2,686,174.28

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	7,504.73
合计	7,504.73

**6.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	56,188.91
银行间市场交易费用	-
合计	56,188.91

**6.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	1,840.66
其他	9,565.63
合计	190,421.49

注：其他为道富银行证券登记费。

**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**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**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**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

**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
鹏华基金管理有限公司	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、基金代销机构
道富银行（State Street Bank and Trust Company）	境外资产托管人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东，基金代销机构

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**

注：无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无。

**6.4.10.1.4 基金交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

注：无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	344,244.06	392,777.16
其中：支付销售机构的客户维护费	94,746.68	111,455.34

注：(1)支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

(2)根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，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，客户维护费从基金管理费中列支。



**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
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	80,323.65	91,647.97

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为0.35%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.35%÷当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**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自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
基金合同生效日（2010年10月12日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	20,020,333.33	20,020,333.33
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	20,020,333.33	20,020,333.33
期末持有的基金份额占基金总份额比例	36.3384%	39.2766%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

**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**

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	109,059.84	2,890.19	372,613.69	20,540.50
道富银行	7,202,036.33	453.30	7,908,729.30	106.92

注：本基金的银行存款主要由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人道富银行保管，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

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限债券及权证等其他证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金没有持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为基金中的基金，主要投资于全球市场中依法可投资的公募基金及股票。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金

管理人致力于全面内部控制体系的建设,建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会,主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项;督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查,组织、指导基金管理人内部监察稽核工作,并可向董事会和中国证监会直接报告;在公司内部设立独立的监察稽核部,专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查,并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而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,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算,在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险发生的可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。于2016年6月30日,本基金未持有信用类债券(2015年12月31日:未持有)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带

来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%，本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，或通过场外的交易方式变现，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，所有已售出而未回购证券总市值不得超过本基金总资产的 50%。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,311,096.17	-	-	-	7,311,096.17
交易性金融资产	-	-	-	44,422,100.95	44,422,100.95
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	14.21	14.21
应收股利	-	-	-	110,176.73	110,176.73

应收申购款	-	-	-	65,028.30	65,028.30
资产总计	7,311,096.17	-	-	44,597,320.19	51,908,416.36
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	60,409.53	60,409.53
应付管理人报酬	-	-	-	60,249.47	60,249.47
应付托管费	-	-	-	14,058.23	14,058.23
应付证券清算款	-	-	-	1,552,213.46	1,552,213.46
其他负债	-	-	-	379,313.29	379,313.29
负债总计	-	-	-	2,066,243.98	2,066,243.98
利率敏感度缺口	7,311,096.17	-	-	42,531,076.21	49,842,172.38
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	10,692,780.93	-	-	-	10,692,780.93
交易性金融资产	-	-	-	46,342,747.14	46,342,747.14
应收证券清算款	-	-	-	2,114,048.20	2,114,048.20
应收利息	-	-	-	731.09	731.09
应收股利	-	-	-	27,663.50	27,663.50
应收申购款	-	-	-	21,792.00	21,792.00
其他资产	-	-	-	7,874,405.00	7,874,405.00
资产总计	10,692,780.93	-	-	56,381,386.93	67,074,167.86
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	10,890,697.54	10,890,697.54
应付管理人报酬	-	-	-	71,145.81	71,145.81
应付托管费	-	-	-	16,600.70	16,600.70
其他负债	-	-	-	8,171,984.12	8,171,984.12
负债总计	-	-	-	19,150,428.17	19,150,428.17
利率敏感度缺口	10,692,780.93	-	-	37,230,958.76	47,923,739.69

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。

（2015 年 12 月 31 日：未持有）因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	5,206,584.29	1,995,333.92	2.85	7,201,921.06
交易性金融资产	20,777,916.93	23,644,184.02	-	44,422,100.95
应收股利	-	88,126.73	-	88,126.73
应收利息	1.46	-	-	1.46
资产合计	25,984,502.68	25,727,644.67	2.85	51,712,150.20
以外币计价的负债				
应付证券清算款	839,266.22	712,947.24	-	1,552,213.46
负债合计	839,266.22	712,947.24	-	1,552,213.46
资产负债表外汇风险敞口净额	25,145,236.46	25,014,697.43	2.85	50,159,936.74
项目	上年度末 2015年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	6,267,249.66	809,054.33	2.97	7,076,306.96
交易性金融资产	17,755,842.05	28,586,905.09	-	46,342,747.14
应收股利	-	27,663.50	-	27,663.50
应收利息	1.75	-	-	1.75
应收证券清算款	-	2,114,048.20	-	2,114,048.20
资产合计	24,023,093.46	31,537,671.12	2.97	55,560,767.55
以外币计价的负债				
其它负债	5,844,240.00	1,926,894.00	-	7,771,134.00
负债合计	5,844,240.00	1,926,894.00	-	7,771,134.00
资产负债表外汇风险敞口净额	18,178,853.46	29,610,777.12	2.97	47,789,633.55

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于全球市场中依法可投资的公募基金及股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类与权重，并定期进行回顾和动态调整。由于短期

市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金基金投资部分的比例为基金资产的 60%-95%；股票、现金、货币市场工具以及相关法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具合计不高于本基金基金资产的 40%。此外，本基金的基金管理人每日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对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	13,184,647.17	26.45	16,389,130.16	34.20
交易性金融资产-基金投资	31,237,453.78	62.67	29,953,616.98	62.50
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	44,422,100.95	89.13	46,342,747.14	96.70

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,956,028.87	1,258,006.42
业绩比较基准下降 5%	-1,956,028.87	-1,258,006.42	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	13,184,647.17	25.40
	其中:普通股	13,184,647.17	25.40
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	31,237,453.78	60.18
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	7,311,096.17	14.08
8	其他各项资产	175,219.24	0.34
9	合计	51,908,416.36	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	3,441,340.81	6.90
香港	9,743,306.36	19.55
合计	13,184,647.17	26.45

### 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 (%)
保健护理机构	219,889.50	0.44
电影与娱乐	923,043.60	1.85



多样化房地产活动	13,179.01	0.03
房地产开发	185,634.32	0.37
工业机械	326,142.07	0.65
广告	126,533.89	0.25
海港与服务	178,352.54	0.36
航空航天与国防	1,193,290.25	2.39
互联网软件与服务	1,667,746.80	3.35
技术产品经销商	189,993.14	0.38
家庭娱乐软件	1,078,815.75	2.16
汽车制造商	563,068.45	1.13
数据处理与外包服务	1,210,525.56	2.43
投资银行业与经纪业	4,091,083.08	8.21
消闲用品	166,831.58	0.33
应用软件	245,119.36	0.49
制药	440,796.05	0.88
资产管理与托管银行	364,602.22	0.73
合计	13,184,647.17	26.45

注：本基金对以上行业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	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	海通国际	665 HK	Hongkong Exchange	CH	500,000	1,987,107.75	3.99
2	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	搜房控股有限公司	SFUN US	US exchange	USA	50,000	1,667,746.80	3.35
3	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYPL US	US exchange	USA	5,000	1,210,525.56	2.43
4	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	中航科工	2357 HK	Hongkong Exchange	CH	260,000	1,193,290.25	2.39
5	ALIBABA PICTURES	阿里影业	1060 HK	Hongkong	CH	600,000	923,043.60	1.85

	GROUP LTD			Exchange				
6	SHENWAN HONGYUAN HK LTD	申万宏源	218 HK	Hongkong Exchange	CH	260,000	873,301.81	1.75
7	FIRST SHANGHAI INVESTMENTS	第一上海	227 HK	Hongkong Exchange	CH	696,000	731,665.89	1.47
8	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	Hongkong Exchange	CH	49,000	625,669.72	1.26
9	TESLA MOTORS INC	特斯拉汽 车公司	TSLA US	US exchange	USA	400	563,068.45	1.13
10	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安 国际	1788 HK	Hongkong Exchange	CH	222,000	499,007.63	1.00
11	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	网龙网络	777 HK	Hongkong Exchange	CH	22,000	453,146.03	0.91
12	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	Hongkong Exchange	CH	60,000	364,602.22	0.73
13	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	Hongkong Exchange	CH	40,000	326,142.07	0.65
14	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	Hongkong Exchange	CH	210,000	263,836.63	0.53
15	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	Hongkong Exchange	CH	120,000	245,119.36	0.49
16	PHOENIX HEALTHCARE GROUP CO	凤凰医疗	1515 HK	Hongkong Exchange	CH	24,000	219,889.50	0.44
17	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州控股	861 HK	Hongkong Exchange	CH	38,000	189,993.14	0.38
18	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	绿城中国	3900 HK	Hongkong Exchange	CH	40,000	185,634.32	0.37
19	TIANJIN PORT DVLP HLDS LTD	天津港发 展	3382 HK	Hongkong Exchange	CH	188,000	178,352.54	0.36
20	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物 制药	1177 HK	Hongkong Exchange	CH	41,000	176,959.42	0.36
21	HAIER HEALTHWISE HOLDINGS LT	海尔智能 健康	348 HK	Hongkong Exchange	CH	800,000	166,831.58	0.33
22	WISDOM SPORTS GROUP	智美体育	1661 HK	Hongkong Exchange	CH	63,000	126,533.89	0.25
23	OVERSEAS CHINESE TOWN ASIA	华侨城 (亚洲)	3366 HK	Hongkong Exchange	CH	6,000	13,179.01	0.03

## 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	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	SFUN US	1,784,938.39	3.72
2	CHANGYOU.COM LTD-ADR	CYOU US	990,275.93	2.07
3	TESLA MOTORS INC	TSLA US	683,350.96	1.43
4	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	644,625.87	1.35
5	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	532,573.94	1.11
6	WEIBO CORP-SPON ADR	WB US	500,920.57	1.05
7	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	777 HK	441,765.79	0.92
8	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	460 HK	355,667.71	0.74
9	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	269,742.15	0.56
10	PHOENIX HEALTHCARE GROUP CO	1515 HK	259,621.04	0.54
11	MOMO INC-SPON ADR	MOMO US	230,318.39	0.48
12	FIRST SHANGHAI INVESTMENTS	227 HK	188,386.92	0.39
13	HAIER HEALTHWISE HOLDINGS LT	348 HK	174,634.59	0.36
14	TIANJIN PORT DVLP HLDS LTD	3382 HK	173,315.19	0.36
15	GOME ELECTRICAL APPLIANCES	493 HK	172,401.76	0.36
16	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	861 HK	172,266.43	0.36
17	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	1788 HK	171,946.39	0.36
18	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	169,568.43	0.35
19	INTIME RETAIL GROUP CO LTD	1833 HK	97,112.09	0.20
20	WISDOM SPORTS GROUP	1661 HK	45,039.14	0.09

注：1，本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2，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	CHANGYOU.COM LTD-ADR	CYOU US	1,034,209.20	2.16
2	BBMG CORP-H	2009 HK	741,421.63	1.55
3	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	1448 HK	716,405.93	1.49
4	FIRST SHANGHAI INVESTMENTS	227 HK	596,385.61	1.24
5	WEIBO CORP-SPON ADR	WB US	578,584.72	1.21
6	MOMO INC-SPON ADR	MOMO US	454,919.73	0.95
7	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	377,311.71	0.79
8	BEIJING URBAN CONSTRUCTION-H	1599 HK	366,196.40	0.76
9	VALUE PARTNERS GROUP LTD	806 HK	349,738.13	0.73
10	CHINA VAST INDUSTRIAL URBAN	6166 HK	346,409.57	0.72
11	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	326,345.71	0.68
12	POLY PROPERTY GROUP CO LTD	119 HK	268,835.00	0.56
13	PW MEDTECH GROUP LTD	1358 HK	257,921.31	0.54
14	JOY CITY PROPERTY LTD	207 HK	252,340.90	0.53
15	PHOENIX HEALTHCARE GROUP CO	1515 HK	220,613.56	0.46
16	OVERSEAS CHINESE TOWN ASIA	3366 HK	220,058.01	0.46
17	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	218,356.18	0.46
18	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	2039 HK	208,236.38	0.43
19	CGN POWER CO LTD-H	1816 HK	198,742.85	0.41
20	SHANDONG XINHUA PHARMACEUT-H	719 HK	196,151.80	0.41

注：1，本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2，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	8,058,471.68
卖出收入（成交）总额	9,374,371.61

注：买入股票成本、卖出股票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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：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	GUGGENHEIM CHINA SMALL CAP E	股票型	ETF 基金	China Asset Management Hong Kong Ltd	5,883,200.64	11.80
2	HS H-SHARE ETF	股票型	ETF 基金	Guggenheim Funds Investment Advisors LLC	4,268,410.01	8.56
3	CHINAAMC CSI 300 IDX ETF-HKD	股票型	ETF 基金	CSOP Asset Management Ltd	3,690,678.73	7.40
4	CSOP SZSE CHINEXT ETF-HKD	股票型	ETF 基金	Krane Funds Advisors LLC	3,458,141.82	6.94
5	KRANESHARES CSI CHINA INTERN	股票型	ETF 基金	Rafferty Asset Management LLC	3,015,074.02	6.05
6	DIREXION DAILY CSI 300 CHINA	股票型	ETF 基金	DBX Advisors LLC	2,853,073.80	5.72
7	MARKET VECTORS CHINA AMC SME	股票型	ETF 基金	Van Eck Associates Corp	2,231,398.80	4.48
8	ISHARES CSI CONSUMER	股票型	ETF 基金	Hang Seng Investment	1,609,788.04	3.23

	STAPLES			Management Ltd		
9	DIREXION DAILY FTSE CHINA BU	股票型	ETF 基金	BlackRock Asset Management North Asia Ltd	1,531,011.46	3.07
10	SPDR GOLD TRUST	股票型	ETF 基金	BlackRock Asset Management North Asia Ltd	838,647.86	1.68

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 7.11.2

本基金投资的前十名股票没有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	-
3	应收股利	110,176.73
4	应收利息	14.21
5	应收申购款	65,028.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	175,219.24

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 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，投资组合报告中数字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
791	69,651.31	29,225,166.47	53.05%	25,869,021.08	46.95%

### 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	53,450.36	0.0970%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

### 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

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人本报告期末未持有本基金份额。

（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年10月12日）基金份额总额	534,464,662.52
本报告期期初基金份额总额	46,001,267.86
本报告期基金总申购份额	15,892,233.41
减：本报告期基金总赎回份额	6,799,313.72
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	55,094,187.55

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动：

报告期内，因股东方更换董事代表，原董事 Alessandro Varaldo 先生不再担任公司董事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Andrea Vismara 先生担任本公司董事，Alessandro Varaldo 先生不再担任本公司董事职务。Andrea Vismara 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

报告期内，原监事 Andrea Vismara 先生辞去公司监事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Sandro Vesprini 先生担任本公司监事，Andrea Vismara 先生不再担任本公司监事职务。Sandro Vesprini 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

#### 10.2.2 基金托管人的重大人事变动：

基金托管人本报告期无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

### 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机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查



或处罚。

## 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	
DAIWA	-	12,707,686.71	72.90%	38,761.12	87.69%	-
BARCLAY	-	4,725,156.58	27.10%	5,440.18	12.31%	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际(香港)	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-
NOMURA	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
招商证券(香港)	-	-	-	-	-	-
Citibank	-	-	-	-	-	-
申银万国(香港)	-	-	-	-	-	-
元大证券(香港)	-	-	-	-	-	-
交银国际(香港)	-	-	-	-	-	-
国元证券(香港)	-	-	-	-	-	-
国泰君安(香港)	-	-	-	-	-	-
工银亚洲(香港)	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-
BMO	-	-	-	-	-	-
UBS	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	-	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

(1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- 1) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 2) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到监管机构处罚；
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件及较强的交易执行能力；
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

(2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定的证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本报告期内上述交易单元未发生变化。

(3) 当期基金成交总额包括场内交易和场外交易两部分，上述列示的成交金额未包含场外交易部分。

### 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
DAIWA	-	-	-	-	-	-	19,152,825.00	75.68%
BARCLAY	-	-	-	-	-	-	6,155,460.20	24.32%
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际(香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan	-	-	-	-	-	-	-	-

Stanley									
招商证券 (香港)									
Citibank									
申银万国 (香港)									
元大证券 (香港)									
交银国际 (香港)									
国元证券 (香港)									
国泰君安 (香港)									
工银亚洲 (香港)									
Merrill Lynch									
BMO									
UBS									
JP Morgan									

注：当期基金成交总额包括场内交易和场外交易两部分，上述列示的成交金额未包含场外交易部分。

## 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	鹏华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
2	2015年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月21日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤海银行基金定期定额申购及网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月22日
4	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购最低金额及赎回持有最低份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月24日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大证券网上交易和手机客户端申购及定期定额投	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月10日

	资费率优惠活动的公告		
6	2015 年年度度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 30 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 30 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与张家港农村商业银行基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 8 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海陆金所资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 18 日
10	2016 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
11	鹏华基金管理有限公司关于增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
12	鹏华基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为我司旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 3 日
13	鹏华基金管理有限公司关于增加天津银行为旗下部分开放式基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 11 日
14	鹏华基金关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行“基金通”申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 17 日
15	鹏华环球发现证券投资基金更新的招募说明书（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 20 日
16	鹏华基金管理有限公司关于增加中国民族证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 30 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国民生银行股份有限公司开通定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 31 日
18	鹏华基金管理有限公司关于调整	《中国证券报》、《上	2016 年 6 月 18 日

	个人投资者开立基金账户的证件类型类型的公告	海证券报》、《证券时报》	
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华环球发现证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华环球发现证券投资基金 2016 年半年度报告》(原文)。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行股份有限公司

### 11.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(<http://www.phfund.com>)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日