

## 鹏华环球发现证券投资基金更新的招募说明书(摘要)

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

二零一六年十一月

### 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2010年4月13日证监许可[2010]470号文核准募集。并经中国证监会基金部2010年10月10日基金部函[2010]605号文件《关于鹏华环球发现证券投资基金备案确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规，本基金基金合同已于2010年10月12日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人在认购或申购本基金份额时应认真阅读本基金招募说明书及基金合同。本基金投资于全球证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括合格境内机构投资者基金产品及本基金特有风险、一般风险及其他风险等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资人保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金

份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书与基金托管人相关信息更新部分已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年10月11日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日(未经审计)。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

- 1、名称：鹏华基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
- 3、成立日期：1998年12月22日
- 4、法定代表人：何如
- 5、办公地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
- 6、电话：(0755) 82021233 传真：(0755) 82021155
- 7、联系人：吕奇志
- 8、注册资本：人民币1.5亿元
- 9、股权结构：

出资人名称	出资额(万元)	出资比例
-------	---------	------

国信证券股份有限公司	7,500	50%
------------	-------	-----

意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)	7,350	49%
---	-------	-----

深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
----------------	-----	----

总计	15,000	100%
----	--------	------

### (二) 主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记，深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生，董事，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与

经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁、国信证券股份有限公司副总裁、国信证券股份有限公司公司顾问。

周中国先生，董事，会计学硕士研究生，国籍：中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理；2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理、国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理；2015年6月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。

Massimo Mazzini 先生，董事，经济和商学学士。国籍：意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理工作，历任 CA AIPG SGR 投资总监、CAAM AI SGR 及 CA AIPG SGR 首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官，欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）市场及业务发展总监。

Andrea Vismara 先生，董事，法学学士，律师，国籍：意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）法务部、产品开发部，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）治理与股权部工作，现在担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）董事会秘书兼任企业事务部总经理，欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）企业服务部总经理。

史际春先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授，现任中国人民大学法学院教授、博士生导师，国务院特殊津贴专家，兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员。

张元先生，独立董事，大学本科，国籍：中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑，

甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任，中央金融工作委员会研究室主任，中国银监会政策法规部（研究局）主任（局长）等职务；2005年6月至2007年12月，任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记；2007年12月至2010年12月，任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。

高臻女士，独立董事，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中国进出口银行副处长，负责贷款管理和运营，项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购；2007年加入曼达林投资顾问有限公司，现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

## 2、基金管理人监事会成员

黄俞先生，监事会主席，研究生学历，国籍：中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作，曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

陈冰女士，监事，本科学历，国籍：中国。曾任国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务部财务科副经理、资金财务部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资金财务部总部副总经理等，现任国信证券资金财务部总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。

SANDRO VESPRINI 先生，监事，工商管理学士，国籍：意大利。先后在米兰军医院出纳部、税务师事务所、菲亚特汽车发动机和变速器平台管控管理团队工作、圣保罗 IMI 资产管理 SGR 企业经管部、圣保罗财富管理企业管控部工作、曾任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务管理和投资经理，现任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务负责人。

于丹女士，职工监事，法学硕士，国籍：中国。历任北京市金杜（深圳）律师事务所律师；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部法务主管，现任监察稽核部总经理助理。

郝文高先生，职工监事，大专学历，国籍：中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，现任登记结算部总经理。

刘焱先生，职工监事，管理学硕士，国籍：中国。历任毕马威（中国）管理顾问公司咨询顾问，南方基金管理有限公司北京分公司副总经理；2014年10月加入鹏华基金管理有限公司，现任首席市场官兼市场发展部、北京分公司总经理。

## 3、高级管理人员情况

何如先生，董事长，简历同前。

邓召明先生，董事，总裁，简历同前。

高阳先生，副总裁，特许金融分析师（CFA），经济学硕士，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司经理，博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生，副总裁，工商管理硕士、法学硕士，国籍：中国。历任中国人民大学校办科员，中国证监会办公厅副处级秘书，全国社保基金理事会证券投资处处长、股权资产部（实业投资部）副主任，并于2014年至2015年期间担任中国证监会第16届主板发审委专职委员，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。历任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理，鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理、职工监事、督察长，现任鹏华基金管理有限公司副总裁、电子商务部总经理。

苏波先生，副总裁，管理学博士，国籍：中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理，南方基金管理有限公司渠道服务二部总监助理，易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理，鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构理财部总经理、职工监事，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生，督察长，法学硕士，国籍：中国。历任中共中央办公厅秘书局干部，中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长，鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理，现任鹏华基金管理有限公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

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。

本基金基金经理管理其他基金情况：

2014年8月起担任鹏华全球高收益债（QDII）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。

本基金历任的基金经理：

本基金合同生效日至 2011 年 12 月 李海涛、裘韬

2011 年 12 月至 2012 年 4 月 裘韬

2012 年 4 月至 2014 年 1 月 裘韬、张珂

2014 年 1 月至 2014 年 9 月 裘韬

2014 年 9 月至 2015 年 9 月 裘韬、尤柏年

2015 年 9 月至今 尤柏年

#### 5、投资决策委员会成员情况

邓召明先生，鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党总支书记。

邢彪先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

尤柏年先生，鹏华基金管理有限公司国际业务部副总经理，鹏华全球高收益债、鹏华环球发现、鹏华前海万科 REITs 基金基金经理。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加

权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人

存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## 三、基金境外托管人

### （一）境外托管人的基本情况

名称：道富银行 State Street Bank and Trust Company

注册地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

办公地址：One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States

法定代表人：Joseph L. Hooley

成立时间：1891 年 4 月 13 日

最近一个会计年度（截止到 2015 年 12 月 31 日）所有者权益（Shareholders' Equity）：211.03 亿美元

### （二）托管资产规模、国际信用评级和托管业务

道富银行的全球托管业务由美国道富集团全资拥有。道富银行始创于 1891 年，自 1924 年成为美国第一个共同基金的托管人后，道富银行已成为一家具有领导地位的国际托管银行。截至 2015 年 12 月 31 日，托管和行政管理资产总额已达

到 27.51 万亿美元，一级资本比率为 15.4%。道富银行长期存款信用评级为 AA-（标准普尔）及 Aa2（穆迪投资）。道富银行在全球 30 个国家或地区设有办事处，2015 年 12 月 31 日道富拥有超过 3 万 2 千多名富有经验的员工为客户提供全方位的托管服务。在亚洲开设了四个全方位的营运中心：香港、新加坡、东京及悉尼，提供全球托管、基金会计、绩效评估、投资纲领监察报告、外汇交易、证券出借、基金转换管理、受托人和注册登记等服务。

### （三）境外托管人的职责

- 1、安全保管受托财产；
- 2、计算境外受托资产的资产净值；
- 3、按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；
- 4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；
- 5、按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；
- 6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；
- 7、其他由基金托管人委托其履行的职责。

## 四、境外投资顾问

### （一）基本情况

1. 投资顾问名称：欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）
2. 注册地址：意大利米兰嘉多纳（Cadorna）广场三号
3. 成立时间：1983 年
4. 资产管理规模：截至 2012 年 12 月 31 日，欧利盛资本资产管理股份公司管理的资产达到 1636 亿欧元。
5. 主要联系人：Andrea Vismara
6. 联系电话：(0039) 02 88102047
7. 传真：(0039) 02 88107057
8. 电子邮箱：Andrea.Vismara@eurizoncapital.com

### （二）公司简介

欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）是联合圣保罗股份公司（Intesa Sanpaolo S.p.A.）的成员，联合圣保罗股份公司（Intesa Sanpaolo S.p.A.）由联合银行（Intesa Bank）和圣保罗银行（Sanpaolo Bank）于

2006年8月26日合并组成，目前是意大利最大的银行。

欧利盛资本资产管理股份公司成立于1983年，在意大利中央银行（Bank of Italy）的监管下从事综合资产管理业务。公司位于意大利米兰，主营业务为公募基金和专户理财的管理，并提供全面的投资产品和服务，客户包括意大利的机构和个人投资者。

欧利盛资本资产管理股份公司直接管理并协调旗下三家公司的经营活动：

1. 欧利盛 AI 资产管理股份公司 (Eurizon A. I. SGR S.p.A) 位于意大利米兰，主营业务为组合对冲基金（fund of hedge funds）的管理。
2. 欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）是卢森堡主要的基金服务商，接受卢森堡金融业监管委员会（CSSF, Commission de Surveillance du Secteur Financier）的监管，主营业务包括基金产品的管理和对国际个人客户和机构客户的分销。
3. Epsilon 资产管理股份公司 (Epsilon SGR S.p.A.) 位于意大利米兰，专注于数量型公募基金的管理。

### （三）主要负责人员情况介绍

#### 1、Alessandro Solina - 投资总监

2010年，Alessandro Solina 先生加入意大利欧利盛资本资产管理公司，担任投资总监，负责管理投资研究部。2009年，Alessandro Solina 先生成为 Zenit 公司的合伙人，投资总监以及董事会成员，负责公司开放式基金与机构客户的所有投资业务。之前，Alessandro Solina 先生在 Capitalia 资产管理公司担任投资总监，是该公司另类投资和产品开发委员会成员，在 Capitalia 公司时，Alessandro Solina 先生领导管理一支由 70 多名投资人员组成的投研队伍，并负责筛选外部基金经理以及投资研究开发。2001年至2004年，他在 Fineco 资产管理公司担任权益部负责人，协助权益投资委员会做投资决定，并管理该公司的权益投资组合。1996年至2001年，Alessandro Solina 先生在 Romagest/Gestifondi 公司担任意大利的权益部负责人。1992年至1996年，Alessandro Solina 先生在 Gestifondi 公司担任意大利基金组合投资经理。Alessandro Solina 先生毕业于 La Sapienza 意大利大学，主修经济。

#### 2、Oreste Auleta - 基金经理筛选总管，投资组合管理人

2010年，Oreste Auleta 先生加入欧利盛资本资产管理公司，担任资产配置及基金经理筛选的负责人。2000年至2008年，Oreste Auleta 先生在 Capitalia 资产管理公司担任全球产品的负责人，负责管理开放式基金，基金中的基金以及独立账户等。之前，Oreste Auleta 先生在 Pioneer Investments 资

产管理公司担任多种资产组合管理的总监。

Oreste Auleta 先生之前曾经在位于伦敦的 Economic Consultant 顾问公司工作，专注于发展中国家的金融体系改革等国际项目。Oreste Auleta 先生拥有数量经济以及金融经济的硕士学位。

### 3、Andrea Conti - 首席策略师

1996 年至 2003 年，Andrea Conti 先生在 IMI Sigeco，德意志银行以及巴黎的 CAI Cheuvreux 担任经济师和策略师。2003 年，Andrea Conti 先生加入 Sanpaolo 资产管理公司（欧利盛资本资产管理公司的前身），并于 2005 年 7 月成为公司的投资策略负责人。Andrea Conti 先生毕业于 Bocconi 大学获得经济学位。

### 4、Domenico Mignacca - 风险管理主管

1989 年，Domenico Mignacca 先生在 Ancona 大学获得商业与经济学位后，在英国南安普顿大学进修经济与数量经济学的硕士学位。1994 年，Domenico Mignacca 先生在美国的威斯康星大学的经济系被评选为优秀副研究员，并取得数量经济学的博士学位。同年，Domenico Mignacca 先生加入德意志银行的风险管理部，负责计算风险价值 VAR。1997 年至 2001 年，Domenico Mignacca 先生被 BNL Gestioni 评为高级数量分析师。2001 年，Domenico Mignacca 先生加入 Sanpaolo 资产管理公司（欧利盛资本资产管理公司的前身），担任风险管理总监。2005 年，Domenico Mignacca 先生在 LUIC 大学成为兼职教授，并在金融和经济的学术刊物上发表多篇文章。

## 五、相关服务机构

### （一）基金销售机构

#### 1. 直销机构

##### （1）鹏华基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

电话：（0755）82021233

传真：（0755）82021155

联系人：吕奇志

##### （2）鹏华基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区金融大街甲 9 号金融街中心南楼 502 房

联系电话：（010）88082426

传真：（010）88082018

联系人：李筠

(3) 鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 801B 室

电话：(021) 68876878

传真：(021) 68876821

联系人：李化怡

(4) 鹏华基金管理有限公司武汉分公司

办公地址：武汉市江汉区建设大道 568 号新世界国贸大厦 I 座 1001 室

联系电话：(027) 85557881

传真：(027) 85557973

联系人：祁明兵

(5) 鹏华基金管理有限公司广州分公司

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路 10 号富力中心 24 楼 07 单元

电话：(020) 38927993

传真：(020) 38927990

联系人：周樱

## 2. 销售机构

(1) 销售银行

1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：王未雨

客户服务电话：95533

传真：(010)66275654

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

2) 中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588（全国）

传真：(010)66107913

联系人：刘秀宇

联系电话：(010)66105799

网址: [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

3) 中国农业银行股份有限公司

注册(办公)地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 蒋超良

客户服务电话: 95599

联系人: 邱泽滨

网址: [www.abcchina.cn](http://www.abcchina.cn)

4) 中国银行股份有限公司

注册(办公)地址: 北京市复兴门内大街 1 号

办公地址: 北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人: 田国立

统一客户服务电话: 95566

联系人: 陈洪源

公司网站: [www.boc.cn](http://www.boc.cn)

5) 交通银行股份有限公司

注册(办公)地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 牛锡明

电话: (021)58781234

传真: (021)58408483

联系人: 张宏革

客户服务电话: 95559

网址: [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

6) 招商银行股份有限公司

注册(办公)地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人: 李建红

电话: (0755)83198888

传真: (0755)83195049

联系人: 邓炯鹏

客服电话: 95555

网址: [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

7) 平安银行股份有限公司

注册(办公)地址: 深圳市深南东路 5047 号

法定代表人: 孙建一

联系人：张莉

电话：(021)38637673

客服电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

8) 上海银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

客户服务电话：95594

联系人：汤征程

网址：www.bankofshanghai.com

9) 中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：穆婷

传真：(010)58560666

网址：www.cmbc.com.cn

10) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

联系人：唐苑

电话：(021)61618888

传真：(021)63604199

公司网站：www.spdb.com.cn

11) 中国光大银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

联系人：穆欣欣

电话：(010)68098778

传真：(010)68560661

客服电话：95595（全国）

网址：www.cebbank.com

12) 中信银行股份有限公司

地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

联系人：迟卓

客服电话：95558

网站： [bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

13) 华夏银行股份有限公司

办公地点：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

联系人：董金

网站： [www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

14) 杭州银行股份有限公司

地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

客户服务电话：（0571）96523，4008888508

网址： [www.hzbank.com.cn](http://www.hzbank.com.cn)

15) 渤海银行股份有限公司

注册（办公）地址：天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦

法定代表人：刘宝凤

联系人：王宏

联系电话：（022）58316666

传真：（022）58316569

客户服务热线：400-888-8811

网址： [www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

16) 东莞银行股份有限公司

注册（办公）地址：东莞市莞城区体育路 21 号

法定代表人：廖玉林

联系人：陈幸

客户服务电话：96228

网址： [www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

17) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市城区南城路 2 号

法定代表人：何沛良

联系人：杨亢

客户服务电话：961122

网址：[www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

18) 大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼

办公地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 9 楼

法定代表人：陈占维

联系人：朱珠

客户服务电话：4006640099

网址：[www.bankofd1.com](http://www.bankofd1.com)

19) 温州银行股份有限公司

注册（办公）地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

客户服务电话：96699（浙江），962699（上海），（0577）96699（其他地区）

网站：[www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn)

20) 宁波银行股份有限公司

注册（办公）地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：（0574）89068340

传真：（0574）87050024

联系人：胡技勋

客户服务电话：96528（上海、北京地区 962528）

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

21) 浙商银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

联系人：唐燕

客户服务热线：95527

传真：（0571）87659188

公司网站：[www.czbank.com](http://www.czbank.com)

22) 浙江民泰商业银行股份有限公司

办公地址：温岭市三星大道 168 号

法定代表人：江建法

客户服务电话：4008896521

联系人：刘兴龙

网址：www.mintaibank.com

23) 徽商银行股份有限公司

注册（办公）地址：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

法定代表人：李宏鸣

联系人：叶卓伟

联系电话：（0551）62667635

客户服务电话：4008896588

网址：www.hsbank.com.cn

24) 佛山顺德农村商业银行股份有限公司

注册（办公）地址：佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路 2 号

法定代表人：吴海恒

客户服务电话：（0757）22223388

网址：www.sdebank.com

25) 洛阳银行股份有限公司

注册地址：河南洛阳洛龙区开元大道 256 号

法定代表人：王建甫

联系人：李亚洁

客户服务电话：96699

网址：www.bankofluoyang.com.cn

26) 包商银行股份有限公司

注册（办公）地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号

法定代表人：李镇西

联系人：刘芳

联系电话：（0472）5189051

传真：（0472）5189057

客服电话：

内蒙古地区（0472）96016；北京地区（010）96016；宁波地区（0574）

967210；

深圳地区（0755）967210；成都地区（028）65558555

公司网站：www.bsb.com.cn

27) 珠海华润银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国广东珠海市吉大九洲大道东 1346 号

法定代表人：蒋伟

客服电话：：400-880-0338 或 96588（广东省外请加拨 0756）

联系人：李阳

网址：www.crbank.com.cn

28) 吉林银行股份有限公司

注册地址：吉林省长春市经济技术开发区东南湖大路 1817 号

法定代表人：唐国兴

客服电话：400-889-6666

联系人：孟明

网址：www.jlbank.com.cn

29) 江苏张家港农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省张家港市人民中路 66 号

法定代表人：王自忠

客服电话：（0512）96065

联系人：朱芳

网址：www.zrcbank.com

30) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册（办公）地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

客户服务电话：（0519）96005

联系人：蒋娇

网址：www.jnbank.com.cn

31) 天津银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区友谊路 25 号

法定代表人：王金龙

联系电话：022-28405330

传真：022-28405631

客服电话：4006960296

公司网站：www.bank-of-tianjin.com.cn

32) 福建海峡银行股份有限公司

办公地址：福建省福州市晋安区六一北路 158 号

法定代表人：苏素华

客户服务电话：400-893-9999

联系人：黄钰雯

网址：www.fjhxbank.com

(2) 销售券商

1) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客户服务电话：400-8888-888

联系电话：010-66568430

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

2) 中信证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：张于爱

联系电话：010-60833799

传真：010-60833739

网址：www.citics.com

3) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海广东路 689 号

办公地址：上海广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系电话：021-23219275

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553

网址：www.htsec.com

4) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客服电话：400-8888-666 / 95521

网址：www.gtja.com

联系人：朱雅崑

联系电话：021-38676666

5) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 6 6 号 6 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 1 8 8 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

传真：010-65182261

客服电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

6) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16—26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16—26 层

法定代表人：何如

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

7) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址：上海市长柳路 36 号丁香国际商业中心东塔

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

联系电话：0591-38281888

客户服务电话：95562

传真：0591-38507538

网址：www.xyzq.com.cn

8) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系电话：0755-82492193

联系人：庞晓芸

网址：www.htsc.com.cn

9) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

10) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系电话：0755-82943666

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

11) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

法定代表人：林俊波

联系电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：李欣

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

12) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888

传真：020-87553600

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

13) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系电话：021-33389888

联系人：曹晔

客户服务电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

网址：www.swhysc.com

14) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系电话：0755-83516289

联系人：胡永君

网址：www.cc168.com.cn

15) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 2316 室

法定代表人：李玮

联系电话：021-20315290

联系人：许曼华

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

16) 财通证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：夏吉慧

联系电话：0571-87925129

客户服务电话：40086-96336（上海地区：962336）

网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

17) 东莞证券股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 22 楼

法定代表人：张运勇

联系人：李荣

联系电话：0769-22115712

客户服务电话：95328

传真：0769-22115712

网址：<http://www.dgzq.com.cn/>

18) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：杨树财

联系电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

19) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

业务联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686262

20) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系电话：021-22169081

传真：021-68817271

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

21) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

22) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

网址：www.bhzq.com

23) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：蔡一兵

联系电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

联系人：郭磊

客户服务热线：4008835316

网址：www.cfzq.com

24) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：邱三发

联系人：梁薇

联系电话：020-88836999

传真号码：020-88836654

客服热线：021-961303

网址：www.gzs.com.cn

25) 国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街八号国联金融大厦702

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82832919

传真：0510-82833124

联系人：沈刚

联系电话：0510-82831662

网址：www.glsc.com.cn

26) 华林证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋一层3号

办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼

法定代表人：林立

联系人：郑琢

联系电话：18627985979

客户服务电话：400-188-3888

传真：0755-82707700

网址: [www.chinalions.com](http://www.chinalions.com)

27) 方正证券股份有限公司

注册地址: 湖南长沙市芙蓉中路二段 200 号华侨国际大厦 22-24 层

办公地址: 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 11 层

法定代表人: 雷杰

联系人: 郭军瑞

联系电话: 0731-85832503

客户服务电话: 95571

网址: [www.foundersec.com](http://www.foundersec.com)

28) 江海证券有限公司

注册地址: 哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址: 哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 孙名扬

联系人: 张背北

联系电话: 0451-82336863

客服热线: 4006662288

网址: [www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

29) 华西证券股份有限公司

注册地址: 四川省成都市陕西街 239 号

办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼

法定代表人: 杨炯洋

联系人: 谢国梅

联系电话: 010-68716150

传真: 028-86150615

客户服务咨询电话: 400-8888-818

网址: [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

30) 爱建证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人: 张建华

电话: (021) 32229888

传真: (021) 68728703

联系人: 戴莉丽

客户服务电话：（021）63340678

网址：[www.aizq.com](http://www.aizq.com)

31) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63080985

客服热线：95321

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

32) 华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦21楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦21楼

法定代表人：李晓安

联系人：邓鹏怡

联系电话：0931-4890208

客户服务电话：4006898888、95368

传真：0931-4890628

网址：[www.hlzq.com](http://www.hlzq.com)

33) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

邮政编码：350003

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）。

公司网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

34) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

服务热线：4008888993

公司网站：www.dxzq.net

35) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元

法定代表人：赵立功

联系电话：0755-83219494

传真：0755-82545500

联系人：王鹏宇

客户服务电话：4001840028

网址：www.wkzq.com.cn

36) 财达证券有限责任公司

注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层

办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层

法定代表人：翟建强

联系人：陈丽君

咨询电话：4006128888

公司网址 www.s10000.com

37) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：田德军

联系人：田芳芳

联系电话：010-83561146

客户服务电话：95399

传真：010-83561001

网址：<http://www.xsdzq.com.cn/>

38) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

联系人：崔成

电话：027-87610052

传真：027-87618863

客户服务电话：4008005000

网址：<http://www.tfzq.com>

39) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏

电话：021-64339000

传真：021-54668802

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

网址：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

40) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广电大楼三、四层

办公地址：北京市朝阳区红旗营南路天畅园 6 号楼二层

法定代表人：徐刚

联系人：张悦

电话：010-64408820

传真：010-64408834

客户服务电话：95564

网址：[www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

41) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

办公地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 6 楼

法定代表人：刘建武

联系人：刘莹

电话：029-87406649

传真：029-87406710

客户服务电话：95582

网址：[www.westsecu.com.cn](http://www.westsecu.com.cn)

42) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

电话：010-65051166

传真：010-85679203

联系人：杨涵宇

客户服务电话：400-910-1166

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

43) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

客户服务电话：400-860-8866

联系电话：029-63387256

联系人：黄芳

网址：[www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

44) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

联系电话：023-63786141

客户服务电话：4008096096

传真：023-63786212

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

45) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：赵大建

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

传真：010-56437013

网址：<http://www.e5618.com/>

46) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12-18 层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

联系电话：010-85556100

传真：010-85556088

网址：www.hrsec.com.cn

47) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：4008881888

联系电话：0755-23838751

联系人：吴军

网址：www.firstcapital.com.cn

(3) 期货公司销售机构

1) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

联系人：洪诚

联系电话：0755-23953913

公司网站：www.citicsf.com

(4) 第三方销售机构

(1) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室

办公地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室

法定代表人：黄永伟

联系人：侯仁凤

联系电话：010-57756068

客服电话：400-786-8868

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(2) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人：王昌庆

联系人：罗细安

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

网址：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

(3) 北京展恒基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

传真：010-62020355

客服电话：4008188000

网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(4) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：4000-766-123

传真：0571-26698533

联系人：周瑾旻

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(5) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：于扬

联系电话：021-20835888

客服电话：400-920-0022

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(6) 上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

传真：021-50325989

联系人：陶怡

网址：www.ehowbuy.com

(7) 上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：何雪

联系电话：021-20662010

客服电话：4008219031

网址：www.lu.com

(8) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

联系电话：020-87599527

客服电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

(9) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-1289

传真：021-58787698

联系人：刘琼

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站: [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(10) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人: 马令海

联系人: 邓洁

联系电话: 010-58321388-1105

客服电话: 010-58325327

网址: [jrj.xinlande.com.cn](http://jrj.xinlande.com.cn)

(11) 深圳腾元基金销售有限公司

住所: 深圳市福田区福华三路卓越世纪中心 1 号楼 1806-1810

办公地址: 深圳市福田区福华三路卓越世纪中心 1 号楼 1806-1810

法定代表人: 卓紘晶

联系人: 王妮萍

联系电话: 0755-33376853

客服电话: 4006-877-899

网址: [www.dowinfund.com](http://www.dowinfund.com)

(12) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人: 薛峰

客服电话: 4006-788-887

传真: 0755-82080798

联系人: 邓爱萍

网址: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)、[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(13) 天相投资顾问有限公司

办公地址: 北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人: 林义相

客服电话: 010-66045678

传真: 010-66045527

联系人: 林爽

网址: [www.txsec.com](http://www.txsec.com)

(14) 万银财富(北京)基金销售有限公司

住所: 北京朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201

办公地址：北京朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201

法定代表人：李招弟

联系人：毛怀营

联系电话：010-59393923

客服电话：400-808-0069

网址：www.wy-fund.com

(15) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人：唐宁

联系人：王巨明

联系电话：010-52855650

客服电话：400-6099-500

网址：www.yixinfund.com

(16) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

客服电话：(0571)56768888

传真：0571-88911818

联系人：蒋泽君

网址：www.10jqka.com.cn

(17) 中期时代基金销售（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 16 号 1 幢 11 层

法定代表人：路瑶

联系人：侯英建

联系电话：010-59539888

客服电话：400-8888-160

网址：www.cifcofund.com

(18) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

联系电话：020-89629099

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

19) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

联系人：曹怡晨

联系电话：021-50583533

客服电话：400-067-6266

网址：a.leadbank.com.cn

20) 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

联系电话：010-62676405

客服电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。

## (二) 注册登记机构

名称：鹏华基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

法定代表人：何如

联系人：吴群莉

联系电话：0755-82021106

传真：0755-82021165

## (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

联系电话：(021) 5115 0298

传真：(021) 5115 0398

经办律师：刘佳、梁丽金

#### (四) 会计师事务所及经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：陈熹

经办注册会计师：单峰、陈熹

#### 六、基金的名称及类型

本基金名称：鹏华环球发现证券投资基金。

本基金类型：契约型开放式，QDII 基金

#### 七、基金投资目标

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。本基金的投资目标是，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

#### 八、基金的投资范围

本基金的投资范围包括：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。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金基金投资部分的比例为基金资产的 60%-100%；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%，其中现金或货币市场工具不低于基金资产的 5%。

若法律法规或监管机构允许，本基金在履行适当程序后，可以调整上述投资比例。

## 九、基金的投资策略

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。

### 1. 资产配置

#### (1) 战略资产配置

资产配置方面，本基金主要投资公募基金及股票。

地域配置上，本基金将全球市场分为成熟市场和新兴市场两类，在基金和股票投资部分，根据国家或区域的宏观经济走势、市场风险等因素进行地域配置。成熟市场和新兴市场战略资产配置的基础比例为 50%、50%，并可在一定范围内浮动。

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。

#### (2) 战术资产配置

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。

### 2. 基金投资策略

本基金将在可投资范围内挑选出最优秀的基金管理人的基础上，通过基金选择模型，在综合进行定性与定量分析后，对该类优秀基金管理人管理的基金进行筛选，最后形成本基金可投资的基金产品并进行相应资产配置。面对数量庞大的基金品

种，首先必须应用数量模型进行初步过滤；其次进行定性阶段的深入基本面挖掘，综合考虑基金管理公司、基金经理人和基金投资风格评价选择投资品种；最后对拟投资基金组合进行风险收益模拟分析并定期监控。

### 3. 股票投资策略

在股票投资部分，本基金以自下而上的方法侧重于单个股票的投资价值评估和选择。在股票选择中遵循价值投资的理念，深入挖掘全球范围内经营业绩优秀而稳定，在行业内具有领先地位，或者具有垄断地位的优质企业，利用企业的优良业绩和持续分红派息为投资人取得稳定收益；并降低投资组合的市场价值波动风险。

### 4. 衍生品投资策略

本基金投资衍生品主要采取组合避险策略和有效管理策略。本基金在充分使用衍生品投资策略的基础上，可以通过使用衍生品投资来降低外汇风险及其他相关风险。基金管理人可以使用远期合约和其他工具来进行外汇风险的套期保值，从而尽可能减小对投资表现的负面影响。套期保值部分的比例应根据法律法规、本基金合同的规定，在充分考虑投资需要和境外投资仓位后予以确定。但是，本基金将不会对外汇的波动进行投机交易

## 十、基金的业绩比较基准

明晟 MSCI 世界指数 (MSCI World Index RMB) × 50% + 明晟 MSCI 新兴市场指数 (MSCI Emerging Markets Index RMB) × 50%

MSCI 明晟公司 (简称 MSCI)，是一家提供全球指数及相关衍生金融产品标的的国际公司，明晟 MSCI 指数是全球投资组合经理中最多采用的投资标的之一。明晟 MSCI 世界指数和明晟 MSCI 新兴市场指数涵盖地区广泛、可投资性强，目前被很多国际投资机构选择作为业绩比较基准。本基金主要通过公募基金投资于全球市场，且投资重点在成熟市场和新兴市场，因此基金管理人认为明晟 MSCI 世界指数和明晟 MSCI 新兴市场指数比较适合作为本基金的业绩比较基准。

MSCI 明晟公司通过多家金融信息平台公开发布指数信息。明晟 MSCI 世界指数和明晟 MSCI 新兴市场指数的国家构成及权重如下：

国家及地区 权重 国家及地区 权重

美国 59.20% 中国 26.96%

日本 8.86% 韩国 14.84%

英国 7.02% 台湾地区 12.14%

法国 3.62% 印度 8.48%

加拿大 3.57% 南非 7.13%  
德国 3.35% 巴西 7.37%  
瑞士 3.34% 墨西哥 3.67%  
澳大利亚 2.72% 俄罗斯 3.66%  
香港特别行政区 1.30% 马来西亚 2.66%  
西班牙 1.13% 印度尼西亚 2.72%  
荷兰 1.25% 泰国 2.20%  
瑞典 1.05% 土耳其 1.17%  
意大利 0.70% 菲律宾 1.33%  
丹麦 0.65% 波兰 1.06%  
比利时 0.51% 智利 1.13%  
新加坡 0.47% 卡塔尔 0.88%  
芬兰 0.37% 阿拉伯联合酋长国 0.85%  
以色列 0.26% 哥伦比亚 0.46%  
挪威 0.24% 希腊 0.31%  
爱尔兰 0.17% 秘鲁 0.37%  
奥地利 0.07% 匈牙利 0.28%  
新西兰 0.07% 捷克 0.15%  
葡萄牙 0.06% 埃及 0.18%

数据来源：MSCI 明晟公司，数据截至 2016 年 9 月 30 日。

今后如本基金投资范围变更或市场中出现其它代表性更强、投资者认同度更高的指数，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

## 十一、基金的风险收益特征

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。

## 十二、基金的投资

本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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于 2016 年 10 月 20 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。

本报告中所列财务数据截至 2016 年 9 月 30 日（未经审计）。

#### 1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（人民币元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 11,995,929.02 22.26

其中：普通股 11,995,929.02 22.26

优先股 - -

存托凭证 - -

房地产信托凭证 - -

2 基金投资 34,005,017.21 63.11

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 7,842,315.94 14.55

8 其他资产 40,517.72 0.08

9 合计 53,883,779.89 100.00

#### 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（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

香港 7,445,969.92 13.95

美国 4,549,959.10 8.52

合计 11,995,929.02 22.47

### 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（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

Financial Exchanges & Data 438,664.22 0.82

保健护理机构 665,073.50 1.25

电影与娱乐 836,862.84 1.57

多样化房地产活动 355,442.86 0.67

房地产开发 1,057,873.84 1.98

广告 117,952.89 0.22

互联网软件与服务 2,457,136.58 4.60

家庭娱乐软件 46,406.28 0.09

教育服务 800,271.62 1.50

数据处理与外包服务 1,094,357.86 2.05

特殊消费者服务 192,426.80 0.36

投资银行业与经纪业 973,102.73 1.82

系统软件 998,464.66 1.87

消闲用品 179,081.76 0.34

应用软件 316,148.18 0.59

制药 918,396.70 1.72

资产管理与托管银行 548,265.70 1.03

合计 11,995,929.02 22.47

### 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

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（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

1 58.COM INC-ADR 58 同城网 WUBA US US exchange - 6,600 2,100,542.06

3.93

2 PAYPAL HOLDINGS INC Paypal 控股股份有限公司 PYPL US US exchange -

4,000 1,094,357.86 2.05

3 CHEETAH MOBILE INC - ADR 猎豹移动公司 CCMC US US exchange - 12,000

998,464.66 1.87

- 4 ALIBABA PICTURES GROUP LTD 阿里影业 1060 HK Hongkong Exchange -  
600,000 836,862.84 1.57
- 5 CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL 枫叶教育 1317 HK Hongkong Exchange -  
130,000 800,271.62 1.50
- 6 CHINA VANKE CO LTD-H 万科 2202 HK Hongkong Exchange - 35,000  
605,692.40 1.13
- 7 SHENWAN HONGYUAN HK LTD 申万宏源 218 HK Hongkong Exchange - 160,000  
557,908.56 1.04
- 8 VALUE PARTNERS GROUP LTD 惠理集团 806 HK Hongkong Exchange - 80,000  
548,265.70 1.03
- 9 SINO BIOPHARMACEUTICAL 中国生物制药 1177 HK Hongkong Exchange -  
110,000 493,421.91 0.92
- 10 HONG KONG EXCHANGES & CLEAR 香港交易所 388 HK Hongkong Exchange -  
2,500 438,664.22 0.82

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。

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。

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。

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。

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（人民币元） 占基金资产  
净值比例(%)

1 GUGGENHEIM CHINA SMALL CAP E 股票型 ETF 基金 Guggenheim Funds

Investment Advisors LLC 6,989,252.59 13.09

2 HS H-SHARE ETF 股票型 ETF 基金 Hang Seng Investment Management Ltd

5,548,865.55 10.39

3 PROSHARES SHORT MSCI EMR MKT 股票型 ETF 基金 ProShare Advisors LLC

3,344,576.13 6.26

4 CHINAAMC CSI 300 IDX ETF-HKD 股票型 ETF 基金 China Asset Management Hong Kong Ltd 3,310,429.65 6.20

5 MARKET VECTORS CHINA AMC SME 股票型 ETF 基金 Van Eck Associates Corp 2,175,560.46 4.07

6 KRANESHARES CSI CHINA INTERN 股票型 ETF 基金 Krane Funds Advisors LLC 2,070,952.73 3.88

7 ISHARES CSI CONSUMER STAPLES 股票型 ETF 基金 BlackRock Asset Management North Asia Ltd 1,802,044.65 3.38

8 CSOP SZSE CHINEXT ETF-HKD 股票型 ETF 基金 CSOP Asset Management Ltd 1,746,391.55 3.27

9 DIREXION DAILY CSI 300 CHINA 股票型 ETF 基金 Rafferty Asset Management LLC 1,480,067.59 2.77

10 DIREXION DAILY FTSE CHINA BU 股票型 ETF 基金 Rafferty Asset Management LLC 1,274,792.02 2.39

#### 10 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额 (人民币元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 26,234.45

4 应收利息 29.45

5 应收申购款 14,253.82

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 40,517.72

(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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

(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

### 十三、基金的业绩（未经审计）

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财产，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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示（本报告中所列财务数据未经审计）：

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

2010年10月12日（基金合同生效日）至

2010年12月31日 -0.60% 0.10% 3.93% 0.77% -4.53% -0.67%

2011年1月1日至

2011年12月31日 -16.40% 0.64% -15.87% 1.25% -0.53% -0.61%

2012年1月1日至

2012年12月31日 11.79% 0.45% 15.98% 0.79% -4.19% -0.34%

2013年1月1日至

2013年12月31日 2.58% 0.68% 8.11% 0.67% -5.53% 0.01%

2014年1月1日至

2014年12月31日 14.80% 0.66% 3.94% 0.56% 10.86% 0.10%

2015年1月1日至

2015年12月31日 -4.75% 1.86% -3.70% 0.92% -1.05% 0.94%

2016年1月1日至

2016年9月30日 -6.53% 1.42% 13.82% 0.93% -20.35% 0.49%

自基金合同生效日至2016年9月30日 -2.60% 1.04% 24.91% 0.87% -27.51%

0.17%

### 十四、基金的费用与税收

#### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费，含境外投资顾问收取的费用；

2. 基金托管人的托管费，含境外托管人收取的费用；
3. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、税务咨询顾问服务费等中介机构费用；
7. 基金的证券交易费用，所投资基金的交易费用和管理费用，及在境外市场的开户、交易、清算和登记等相关的各项费用；
8. 外汇兑换交易的相关费用；
9. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率 } 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率 } 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### （四）申购费用和赎回费用

1. 申购费率：本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金采取金额申购的方式，对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户特定申购费率如下表：

申购金额 M（元） 特定申购费率

M < 50 万 0.6%

50 万 ≤ M < 250 万 0.6%

250 万 ≤ M < 500 万 0.6%

M ≥ 500 万 每笔 1000 元

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率如下表：

申购金额 M（元） 申购费率

M < 50 万 1.5%

50 万 ≤ M < 250 万 1.2%

250 万 ≤ M < 500 万 0.8%

M ≥ 500 万 每笔 1000 元

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

2. 赎回费率：本基金的赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间（Y） 赎回费率

Y < 1 年 0.5%

1 年 ≤ Y < 2 年 0.25%

Y ≥ 2 年 0

赎回费用由赎回申请人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3. 自 2013 年 6 月 28 日起，在基金管理人网上直销系统开通本基金的后端收费模式（包括申购及定期申购业务）。基金管理人直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。

(1) 费率标准

当客户选择后端收费模式申购或定期申购本基金时，在赎回时根据其持有期限的不同，支付相应的后端申购费，费率按持有时间递减。

具体费率如下表：

网上直销后端申购费率

赎回费率

持有时间（Y） 后端申购费率

Y < 1 年 1.8%

1 年 ≤ Y < 3 年 1.0%

Y ≥ 3 年 0

基金管理人对于后端申购费率实施的优惠费率详见基金管理人发布的相关公告。

(2) 申购份额的计算规则（含定期申购）：

申购份额 = 申购金额 / 申购当日基金份额净值。

基金份额的后端申购费在投资者申购基金份额时不收取，在投资者赎回该部分基金份额时收取。

(3) 赎回金额及相关费用的计算规则：

投资者赎回以后端收费模式申购的基金份额时，收取赎回费和后端申购费。其中赎回费率与本基金招募说明书中约定的基金赎回费率一致，后端申购费率按照投资者申购时执行的后端申购费率标准确定。赎回金额的计算方法如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

后端申购费用 = 赎回份额 × 申购当日基金份额净值 × 后端申购费率

赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用 - 后端申购费用

4. 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照有关规定在指定媒体上公告。

5. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关

监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以针对活动对象适当调低上述基金申购费率和基金赎回费率。

6. 本基金申购、赎回的币种为人民币。基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回，并提前公告。

#### (五) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(六) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

#### (七) 基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定，履行纳税义务。

基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

#### 十五、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，本基金管理人对本基金原公告的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“重要提示”部分明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、对“四、基金的投资”部分内容进行了更新。

3、对“五、基金的业绩”的相关内容进行了更新。

4、对“六、基金管理人”部分内容进行了更新。

5、对“十七、基金托管人”部分内容进行了更新。

6、对“十九、相关服务机构”内容进行了更新。

7、对“二十三、其他应披露事项”一章内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2016 年 11 月