

招商全球资源股票型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告

2017-06-30

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2017-07-21

目录全部展开 目录全部收拢

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

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

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

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

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

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

报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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

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

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

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

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

其他资产构成

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

影响投资者决策的其他重要信息

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

备查文件目录

备查文件目录

存放地点

查阅方式

重要提示

基金基本情况

项目

数值

基金简称

招商全球资源股票(QDII)

场内简称

基金主代码

217015

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2010-03-25

报告期末基金份额总额

31,026,883.32

投资目标

本基金在全球范围内精选优质的资源类公司进行投资，通过积极主动的资产配置和组合管理，追求有效风险控制下的长期资本增值。

投资策略

本基金将投资分为两类：核心投资和机会投资。其中，核心投资指投资于股东价值呈现持续增长趋势的上市公司；机会投资指投资于未来具有股东价值改善潜力的上市公司，且这些公司未来股东价值提升空间较大。本基金通过“自下而上”和“自上而下”的分析方法以及数量测算的综合运用，筛选出那些股东价值或股东价值增长潜力被错误判断，且这种误判反映于股价的股票。

业绩比较基准

25%×摩根斯坦利世界能源指数（MSCI World Energy Index）+75%×摩根斯坦利世界材料指数（MSCI World Material Index）

风险收益特征

本基金为主动管理的全球配置型股票基金主要投资方向为能源和材料等资源相关行业，属于具有较高风险和较高收益预期的证券投资基金品种，本基金力争在严格控制风险的前提下为投资人谋求资本的长期增值。

基金管理人

招商基金管理有限公司

基金托管人

中国工商银行股份有限公司

境外资产托管人

英文名称：英文名称：Standard Chartered Bank(Hong Kong)Limited

中文名称：中文名称：渣打银行(香港)有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

报告期（2017-04-01 至 2017-06-30）

本期已实现收益

1,242,845.02

本期利润

318,936.56

加权平均基金份额本期利润

0.0098

期末基金资产净值

31,390,468.45

期末基金份额净值

1.012

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、上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。

基金净值表现

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

1.00 %

0.53 %

-1.72 %

0.65 %

2.72 %

-0.12 %

注：

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

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

白海峰

本基金的基金经理

2016-11-08

-

7

男，硕士。曾任职于新东方教育科技集团；2010年6月加入国泰基金管理有限公司，历任管理培训生、宏观经济研究高级经理、首席经济学家助理、国际业务部负责人；2015年加入招商基金管理有限公司，现任国际业务部总监兼招商资产管理（香港）有限公司执行董事兼总经理、招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)、招商全球资源股票型证券投资基金(QDII)、招商中国信用机会定期开放债券型证券投资基金(QDII)及招商沪港深科技创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日期；后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议做出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名

在境外投资顾问所任职务

证券从业年限

说明

注：本基金无境外投资顾问

报告期内本基金运作合规守信情况说明

基金管理人声明：在本报告期内，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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《招商全球资源股票型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

基金管理人（以下简称“公司”）已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，相关解决方案已经上报证监会。

投资组合报告

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

26,581,022.23

83.57

其中：普通股

24,861,881.05

78.17

存托凭证

1,719,141.18

5.41

2

基金投资

1,417,746.44

4.46

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

2,202,068.31

6.92

8

其他各项资产

1,605,616.03

5.05

9

合计

31,806,453.01

100.00

注：{{BGQMJJZCZHQKBeiZhu_QM)!}}

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

13,197,081.64

42.04

香港

7,680,328.20

24.47

英国

2,045,404.70

6.52

日本

1,540,099.31

4.91

德国

867,172.49

2.76

荷兰

530,646.11

1.69

瑞士

406,930.76

1.30

澳大利亚

313,359.02

1.00

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（%）

能源

5,494,737.35

17.50

原材料

10,905,085.29

34.74

工业

2,344,831.27

7.47

非必需消费品

2,332,222.23

7.43

必需消费品

-

-

医疗保健	
175,915.92	
0.56	
金融	
75,073.90	
0.24	
信息技术	
4,124,534.96	
13.14	
电信服务	
60,407.23	
0.19	
公用事业	
1,068,214.08	
3.40	
房地产	
-	
-	
合计	
26,581,022.23	
84.68	

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD

-

4063 JP

东京证券交易所

日本

2,500

1,540,099.31

4.91

2

TESLA MOTORS INC

-

TSLA US

纳斯达克证券交易所

美国

500

1,224,845.39

3.90

3

HILONG HOLDING LTD

-

1623 HK

香港联合交易所

香港

1,000,000

1,171,692.00

3.73

4

APPLIED MATERIALS INC

-

AMAT US

纳斯达克证券交易所

美国

4,000

1,119,401.86

3.57

5

3M CO

-

MMM US

美国纽约证券交易所

美国

700

987,253.64

3.15

6

SINOPEC ENGINEERING GROUP CO

-

2386 HK

香港联合交易所

香港

140,000

855,421.95

2.73

7

TENCENT HOLDINGS LTD

腾讯控股有限公司

700 HK

香港联合交易所

香港

3,500

848,131.42

2.70

8

EXXON MOBIL CORP

-

XOM US

美国纽约证券交易所

美国

1,500

820,345.97

2.61

9

BASF SE

-

BAS GR

德国证券交易所

德国

1,100

691,256.57

2.20

10

DOW CHEMICAL CO/THE

-

DOW US

美国纽约证券交易所

美国

1,600

683,618.25

2.18

报告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。

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

序号

债券代码

债券名称

数量

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

VANGUARD MATERIALS ETF

ETF

交易型开放式

VANGUARD

988,520.45

3.15

2

ISHARES U.S. ENERGY ETF

ETF

交易型开放式

ISHARES ETF Trust

192,392.96

0.61

3

ALERIAN MLP ETF

ETF

交易型开放式

ALPS ETF Trust

162,043.65

0.52

4

VANECK VECTORS GOLD MINERS E

ETF

交易型开放式

VanEck Vectors ETF Trust

74,789.38

0.24

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本基金本期投资的前十名证券中发行主体未被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的证券。

基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的股票。

其他资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

-

2

应收证券清算款

1,485,239.16

3

应收股利

120,302.93

4

应收利息

73.94

5

应收申购款

-

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

9

其他

-

10

合计

1,605,616.03

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

单位：份

项目

数值

报告期期初基金份额总额

34,295,415.61

报告期期间基金总申购份额

减：报告期期间基金总赎回份额

3,268,532.29

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）

报告期期末基金份额总额

31,026,883.32

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号

交易方式

交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

注：本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-%

-%

基金管理人高级管理人员

-%

-%

基金经理等人员

-%

-%

基金管理人股东

-%

-%

其他

-%

-%

合计

-%

-%

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

投资者类别

报告期内持有基金份额变化情况

报告期末持有基金情况

序号

持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间

期初份额

申购份额

赎回份额

持有份额

份额占比

机构

-

-

-

-

-

-

-

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

-

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商全球资源股票型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商全球资源股票型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商全球资源股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5、《招商全球资源股票型证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

