鹏华环球发现证券投资基金更新的招募说明书摘要

(上接 137 版)

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:叶顺德
联系人:田芳芳
客户服务电话:95399
网址:www.xsdzq.cn
41)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
办公地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
法定代表人:张志刚
联系人:尹旭航
客户服务电话:95321
网址:www.cindasc.com
42)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 268 号
办公地址:上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦
法定代表人:兰荣
联系人:乔琳雪
客户服务电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn
43)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
联系人:林生迎
客户服务电话:95565
网址:www.newone.com.cn
44)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
法定代表人:毕明建(代)
联系人:杨涵宇
客户服务电话:4009101166
网址:www.cicc.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 号盘古大观 40—43 层
办公地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼
法定代表人:何亚刚
联系人:胡创
客户服务电话:40088-05618
网址:www.e5618.com
46)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 2-6 层
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:陈共炎
联系人:辛国政
客户服务电话:4008-888-888 或 95551
网址:www.chinastock.com.cn
47)中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路 86 号
办公地址:上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层
法定代表人:李玮
联系人:许曼华
客户服务电话:95538
网址:www.zts.com.cn
48)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 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:王常青
联系人:刘畅
客户服务电话:95587/4008-888-108
网址:www.csc108.com
49)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座
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:郑慧
客户服务电话:95548
网址:www.cs.ecitic.com
50)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001
办公地址:青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层
法定代表人:姜晓林
联系人:刘晓明
客户服务电话:95548
网址:www.zxwt.com.cn
(3)第三方销售机构
1)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址:北京市朝阳区望京 SOHO T3 A 座 19 层
法定代表人:钟斐斐
联系人:威晓强
客户服务电话:4000-618-518
网址:danjuanapp.com
2)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址: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
客户服务电话:400-786-8868
网址:www.chtfund.com
3)北京虹点基金销售有限公司
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号盈科中心东门 2 层
法定代表人:胡伟
4)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
法定代表人:王伟刚
联系人:熊小满
客户服务电话:010-56282140
网址:www.hcjijin.com
5)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
联系人:熊小满
客户服务电话:010-56282140
网址:www.hcjijin.com
6)北京晨鑫财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06
办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东总部 A 座 17 层
法定代表人:陈超
联系人:江卉
客户服务电话:95118
网址:fund.jd.com
6)北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址: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
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:吴翠
客户服务电话:010-62675369
网址:www.xincai.com
7)北京增财基金销售有限公司
注册地址: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
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zcvc.com.cn
8)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
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
客户服务电话:4008188000
网址:www.myfund.com
9)泛华普益基金销售有限公司
注册地址:四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室
办公地址:四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室
法定代表人:于海锋
联系人:黄飚
客户服务电话:400-8878-566
网址:www.pyfund.cn
10)和讯信息科技有限公司
注册地址: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
客户服务电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com
11)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
12)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人:刘汉青
联系人:王锋
客户服务电话:95177
网址:www.snjijin.com
13)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋
法定代表人:汪静波
联系人:朱了
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
14)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址:上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人:张跃伟
联系人:张佳琳
客户服务电话:400-089-1289
网址:www.erichfund.com/websiteIII/html/index.html
15)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
办公地址:上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室
法定代表人:杨文斌
联系人:王诗玥
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com
16)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室
办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
法定代表人:李一梅
联系人:仲秋玥
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
17)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
办公地址:上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼
法定代表人:李兴春
联系人:陈孜明
客户服务电话:400-921-7755
网址:www.leadfund.com.cn
18)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址: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
客户服务电话:400-821-9031
网址:www.lu.com
19)上海天天基金销售有限公司
注册地址: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
客户服务电话:4001818188
网址:www.1234567.com.cn
20)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址: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
客户服务电话:010-58325327
网址:8.jrj.com.cn
21)深圳腾元基金销售有限公司
注册地址: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:卓紘鼎
联系人:王霓萍
客户服务电话:4006-877-899
网址:www.dowinfund.com
22)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
办公地址: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
联系人:邓爱萍
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn、www.jjmmw.com
23)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
办公地址:北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室
法定代表人:林义相
联系人:谭磊
客户服务电话:010-66045678
网址:www.jjm.com.cn/
24)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址: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 SOHO 现代城 C1809
法定代表人:戎兵
联系人:魏晨
客户服务电话:400-6099-500
网址:www.yixinfund.com
25)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903
办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼
法定代表人:凌顺平
联系人:吴强
客户服务电话:(0571)56768888
网址:www.5ifund.com
26)中期时代基金销售(北京)有限公司
注册地址:北京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
客户服务电话:400-8888-160
网址:www.cifcofund.com
27)众升财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08
法定代表人:李招弟
联系人:李艳
客户服务电话:400-059-8888
网址:www.zscffund.com
28)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址: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
客户服务电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn

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
住所: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
办公室地址:深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
联系电话:(0755)82021106
传真:(0755)82021165
负责人:吴群莉

(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
法定代表人:廖 海
办公室地址: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:021-51150298
传真:021-51150398
联系人:廖 海
经办律师:刘 佳 、张 兰

(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
法定代表人:杨绍信
办公室地址:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:陈嘉
经办会计师:许康玮、陈嘉

六、基金的名称

本基金名称:鹏华环球发现证券投资基金

七、基金运作方式及类型

本基金为股票型证券投资基金

八、基金的投资目标

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。

九、基金的投资方向

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。

十、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。

十一、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	58.86%		中国	29.55%
日本	8.64%		韩国	14.97%
英国	6.68%		台湾地区	11.51%
法国	4.04%		印度	8.41%
德国	3.66%		巴西	7.56%
加拿大	3.63%		南非	6.37%
瑞士	3.09%		墨西哥	3.46%
澳大利亚	2.56%		俄罗斯	3.41%
荷兰	1.40%		马来西亚	2.28%
西班牙	1.30%		印度尼西亚	2.27%
香港特别行政区	1.30%		泰国	2.22%
瑞典	1.10%		波兰	1.31%
意大利	0.93%		智利	1.26%
丹麦	0.70%		菲律宾	1.13%
新加坡	0.48%		土耳其	1.11%
比利时	0.44%		阿拉伯联合酋长国	0.71%
芬兰	0.38%		卡塔尔	0.58%
挪威	0.26%		哥伦比亚	0.44%
以色列	0.18%		秘鲁	0.39%
爱尔兰	0.17%		匈牙利	0.33%
奥地利	0.10%		希腊	0.32%
新西兰	0.06%		捷克	0.18%
葡萄牙	0.06%		埃及	0.12%
			巴基斯坦	0.10%

数据来源:MSCI 明晟公司,数据截至 2017 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。

十二、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。

十三、基金的投资组合报告

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 2017 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

1.1 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	10,082,730.31	23.46
	其中:普通股	5,340,578.97	12.43
	优先股	-	-
	存托凭证	4,742,151.34	11.04
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	17,279,871.61	40.21
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	15,605,065.16	36.31
8	其他资产	4,458.05	0.01
9	合计	42,972,125.13	100.00

1.2 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(%)
美国	6,934,213.23	22.80
香港	3,148,517.08	10.35
合计	10,082,730.31	33.15

1.3 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(%)
Internet&DirectMarketingRe	2,281,766.22	7.50
电脑与外围设备	613,727.42	2.02
房地产开发	545,906.55	1.79
互联网软件与服务	1,984,777.25	6.53
家庭娱乐软件	856,292.84	2.82
建筑机械与重型卡车	87,005.18	0.29
教育服务	2,439,681.92	8.02
汽车制造商	861,879.99	2.83
数据处理与外包服务	382,464.64	1.26
应用软件	29,228.30	0.10
合计	10,082,730.31	33.15

注:本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准(GICS)。

1.4 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	JD.COM INC-ADR	京东	JD US	US exchange	美国	9,000	2,281,766.22	7.50
2	TAL EDUCATION GROUP- ADR	学而思教育集团	TAL US	US exchange	美国	4,500	1,006,784.55	3.31
3	腾讯控股	腾讯控股有限公司	700 HK	HongKong exchange	香港	3,500	999,794.92	3.29
4	WEIBO CORP-SPON ADR	新浪微博	WB US	US exchange	美国	1,500	984,982.33	3.24
5	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	HongKong exchange	香港	130,000	964,279.13	3.17
6	ACTIVISION BLIZZARD INC	动视暴雪股份有限公司	ATVI US	US exchange	美国	2,000	856,292.84	2.82
7	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	US exchange	美国	600	613,727.42	2.02
8	万科	万科	2202 HK	HongKong exchange	香港	25,000	545,906.55	1.79
9	广汽集团	广汽集团	2238 HK	HongKong exchange	香港	34,000	522,303.00	1.72
10	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	新东方教育科技集团	EDU US	US exchange	美国	800	468,618.24	1.54

1.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注:无。

1.6 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

注:无。

1.7 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

注:无。

1.8 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

注:无。

1.9 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	KRANESHARES CSI CHINA INTERN	股票型	ETF	KraneFundsAdvisorsLLC	3,399,951.13	11.18
2	GLOBAL X LITHIUM & BATTERY T	股票型	ETF	GlobalXManagementCoLLC	2,433,207.00	8.00
3	ISHARES MSCI MALAYSIA	股票型	ETF	BlackRockFundAdvisors	1,504,784.34	4.95
4	WISDOMTREE EUROPE HEDGED EQU	股票型	ETF	WisdomTreeAssetManagementInc	1,502,926.01	4.94
5	SPDR S&P CAPITAL MARKETS ETF	股票型	ETF	SSgAFundsManagementInc	1,390,828.76	4.57
6	ISHARES MSCI GERMANY INDEX	股票型	ETF	BlackRockFundAdvisors	1,291,408.00	4.25
7	WISDOMTREE JAPAN HEDGED EQ	股票型	ETF	WisdomTreeAssetManagementInc	1,270,634.51	4.18
8	ISHARES MSCI SOUTH KOREA IND	股票型	ETF	BlackRockFundAdvisors	1,145,860.79	3.77
9	VANECK VECTORS VIETNAM ETF	股票型	ETF	VanEckAssociatesCorp	989,561.79	3.25
10	ISHARES MSCI EUROPE FINANCIA	股票型	ETF	BlackRockFundAdvisors	935,006.47	3.07

1.10 投资组合报告附注

1.10.1

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。

1.10.2

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。

1.10.3 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	-
4	应收利息	950.71
5	应收申购款	3,507.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,458.05

1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

1.10.6 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,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。

十四、基金的业绩

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%	0.46%	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 12 月 31 日	-6.91%	1.27%	17.23%	0.86%	-24.14%	0.41%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 30 日	6.70%	0.58%	16.46%	0.47%	-9.76%	0.11%
自基金合同生效日至 2017 年 9 月 30 日	3.50%	0.99%	49.82%	0.83%	-46.32%	0.16%

十五、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,合境外投资顾问收取的费用;
2.基金托管人的托管费,合境外托管人收取的费用;
3.基金财产拨划支付的银行费用;
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×年管理费率 1.5%÷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×年托管费率 0.35%÷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基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。如将来出现经养老基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人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语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