

鹏华环球发现证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 30 日

§ 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 2017 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华环球发现(QDII-FOF)
场内简称	-
基金主代码	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	48,975,279.67份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

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>1. 战略资产配置</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>2. 战术资产配置</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，本基金还将使用适当的风险控制措施来监控管理与战术资</p>

	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

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

登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金年度报告备置地点	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-4,021,178.77	3,585,769.61	7,046,123.50
本期利润	-2,053,000.34	-2,558,852.95	8,584,992.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0393	-0.0561	0.1332
本期基金份额净值增长率	-6.91%	-4.75%	14.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0298	0.0418	0.0270
期末基金资产净值	47,516,538.17	47,923,739.69	43,924,977.28
期末基金份额净值	0.970	1.042	1.094

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) 表中的“期末”均指报告期最后一日，即12月31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

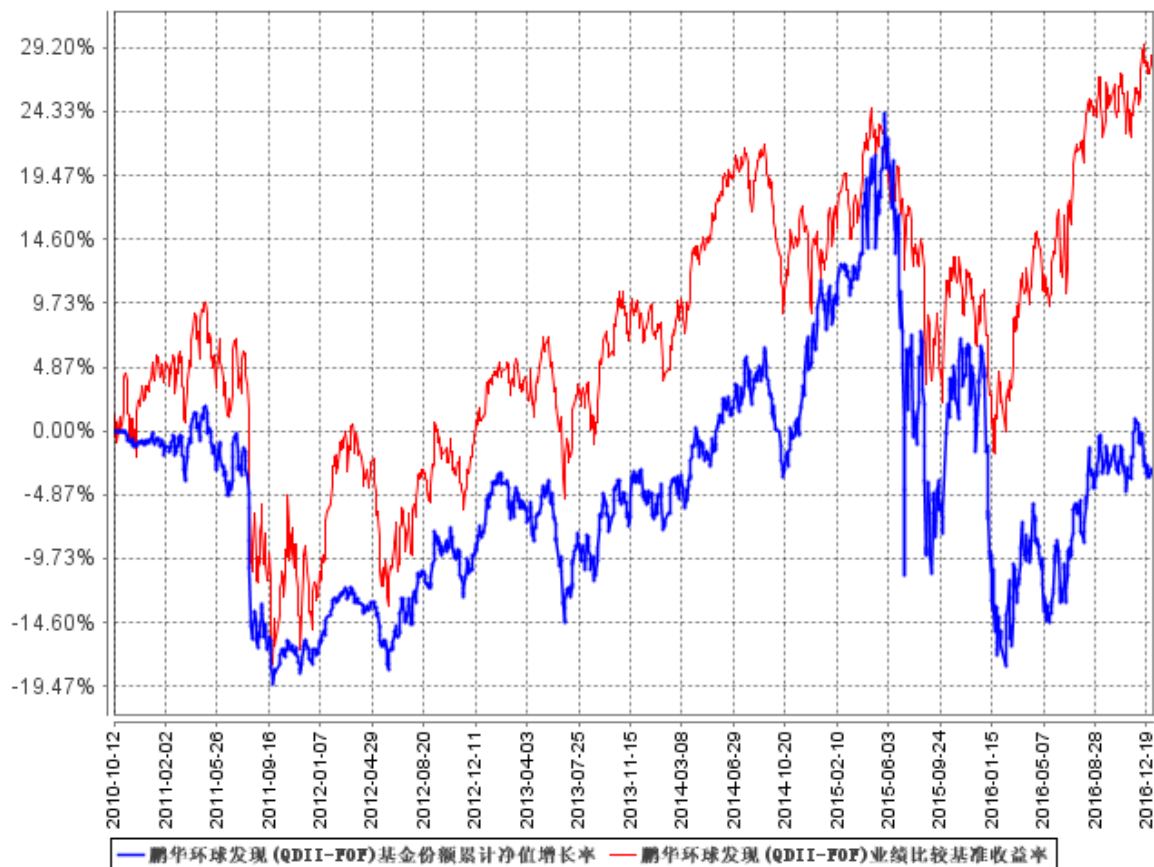
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.41%	0.63%	2.99%	0.59%	-3.40%	0.04%
过去六个月	7.18%	0.71%	10.60%	0.60%	-3.42%	0.11%
过去一年	-6.91%	1.27%	17.23%	0.86%	-24.14%	0.41%
过去三年	1.78%	1.35%	17.34%	0.79%	-15.56%	0.56%
过去五年	16.73%	1.11%	47.14%	0.77%	-30.41%	0.34%
自基金合同生效起至今	-3.00%	1.03%	28.65%	0.86%	-31.65%	0.17%

注：本基金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%。

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

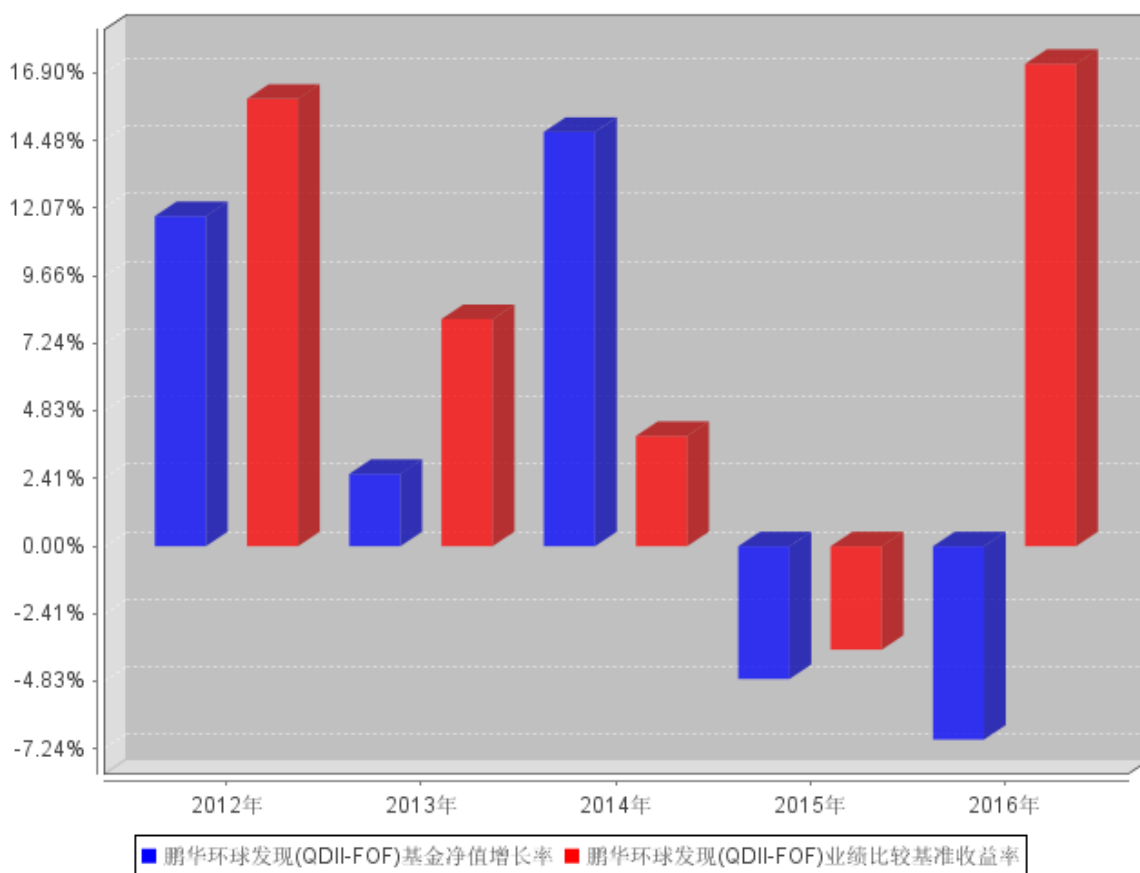


注：1、本基金合同于 2010 年 10 月 12 日生效。

2、截至本基金建仓期结束，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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华环球发现(QDII-FOF)过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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。截止本报告期末，公司管理 129 只基金和 10 只全国社保投资组合，经过 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，2016年12月起兼任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理，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本基金基金合同的约定，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，本基金运作合法合规，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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”

原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.4.2 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。

4.4.3 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并对基金财产造成损失的异常交易行为。

本报告期内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%的交易次数为 3 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

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

回顾 2016 年全球主要资产的表现，以本币计价，标普指数上涨 9.54%，纳斯达克指数上涨了 7.5%，欧洲 STOXX50 指数上涨了 0.7%，MSCI 世界指数上涨了 5.32%，沪深 300 指数下跌了 11.28%，恒生指数上涨了 0.39%。

2016 年初，在 A 股两轮熔断的拖累下，港股也开局不利，一季度经历了较大起落，恒生指数最低跌至 18278.8 点。而随着美元在 5 月份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，资金再次流出导致刚刚企稳的港股再度下挫。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、英国脱欧等事件先后对港股造成不小影响。总体来说，2016 年上半年受诸多消息面影响，整体上呈现大幅震荡的走势，期间对本基金业绩造成的拖累也较大。

进入三季度后，受到美联储加息节奏放缓以及深港通消息提振，港股走出一波小牛行情。本基金在三季度初就积极对持仓进行了调整，逢低布局了一些具有业绩弹性的成长股以及受惠于深港通开通的港股标的，使本基金充分享受到了第三季度港股整体的上涨行情。

在 2016 年四季度美联储时隔一年后终于启动了十年来的第二次加息，然而由于从第三季度开始美国各项数据指标均体现出美国经济强劲复苏的势头，实际上早在第四季度初时市场已对美联储 12 月的加息有了非常充分的预期。港股在基本面及资金面上都明显受外围环境影响，美联储加息预期、意大利修宪公投、美国大选等重大事件均对港股带来不利影响，导致第四季度港股表现在全球市场中排名靠后。

深港通已正式开通，虽然会为港股市场带来一定提振，但毕竟各家机构及托管行搭建后台需要时间，短期内南下资金量有限。另外香港具备新兴市场特征，会更多受到美国货币及财政政策的影响，因此我们于第四季度调低了投资于香港的比例，更关注由特朗普积极的财政政策带来的美股投资机会，因此在第四季度港股普遍下跌的市场环境中规避了很大一部分损失。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年全年本基金份额净值增长率为-6.91%，领先于沪深 300 指数，但落后于 MSCI 世界指数及恒生指数。

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 2017 年，除了港股依然相比 A 股大幅折价外，我们认为港股还有以下利好因素：1) 人

民币企稳，美元短期出现回调；2）春节后各投资机构及托管行对于深港通后台的搭建陆续完毕，大量南下资金蓄势待发；3）中国经济发展总体平稳，其中某些行业，如受益于涨价及供给侧改革的部分原材料、有稳健业绩的科技与消费（汽车等）以及相对落后的金融非银板块，或有盈利提升带来的配置机会。总的来说我们对2017年港股表现比较有信心，在操作上也会积极寻找目前估值较便宜，价格具有弹性的优质行业龙头进行配置。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

（1）日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

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，本基金可供分配利润为-1,458,741.50 元，期末基金份额净值 0.970 元不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款		5,690,943.19	10,692,780.93
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		43,091,731.90	46,342,747.14
其中：股票投资		13,453,101.33	16,389,130.16
基金投资		29,638,630.57	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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	2,114,048.20
应收利息		75.73	731.09
应收股利		12,555.95	27,663.50
应收申购款		5,543.89	21,792.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	7,874,405.00
资产总计		48,800,850.66	67,074,167.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		636,339.54	-
应付赎回款		112,276.88	10,890,697.54
应付管理人报酬		61,137.68	71,145.81
应付托管费		14,265.47	16,600.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		460,292.92	8,171,984.12
负债合计		1,284,312.49	19,150,428.17
所有者权益：			
实收基金		48,975,279.67	46,001,267.86
未分配利润		-1,458,741.50	1,922,471.83
所有者权益合计		47,516,538.17	47,923,739.69
负债和所有者权益总计		48,800,850.66	67,074,167.86

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.970 元，基金份额总额 48,975,279.67 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入		-563,043.98	-982,936.74
1. 利息收入		5,326.05	31,235.48
其中：存款利息收入		5,326.05	30,534.37
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）		-2,962,813.94	4,556,017.42
其中：股票投资收益		-1,394,276.87	-1,525,564.76
基金投资收益		-2,108,573.43	4,521,368.97
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		540,036.36	1,560,213.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,968,178.43	-6,144,622.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		414,523.73	474,901.22
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		11,741.75	99,531.70
减：二、费用		1,489,956.36	1,575,916.21
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	727,717.13	732,699.71

2. 托管费	7.4.8.2.2	169,800.71	170,963.26
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		220,467.32	287,508.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		371,971.20	384,744.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,053,000.34	-2,558,852.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,053,000.34	-2,558,852.95

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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）	-	-2,053,000.34	-2,053,000.34
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）	2,974,011.81	-1,328,212.99	1,645,798.82
其中：1. 基金申购款	16,818,912.04	-2,064,917.92	14,753,994.12
2. 基金赎回款	-13,844,900.23	736,704.93	-13,108,195.30
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）	48,975,279.67	-1,458,741.50	47,516,538.17
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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)	-	-2,558,852.95	-2,558,852.95
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)	5,838,958.99	718,656.37	6,557,615.36
其中：1. 基金申购款	90,619,568.58	11,096,942.00	101,716,510.58
2. 基金赎回款	-84,780,609.59	-10,378,285.63	-95,158,895.22
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)	46,001,267.86	1,922,471.83	47,923,739.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> </u> 邓召明	<u> </u> 高鹏	<u> </u> 郝文高
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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,业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%。

7.4.2 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(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协会发布的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策变更等说明、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.4.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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政策的补充通知》、

财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税（于 2016 年 5 月 1 日前）或增值税（自 2016 年 5 月 1 日起）且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）	基金管理人的股东、境外投资顾问
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.8.1.1 股票交易**

注：无。

7.4.8.1.2 债券交易

注：无。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.8.1.4 基金交易

注：无。

7.4.8.1.5 权证交易

注：无。

7.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 基金管理费**

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	727,717.13	732,699.71
其中：支付销售机构的客户维护费	189,578.75	208,414.71

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。

7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	169,800.71	170,963.26

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	40.8784%	43.5212%

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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	339,645.87	4,025.79	3,616,602.21
道富银行	5,351,297.32	622.66	7,076,178.72	171.35

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	13,453,101.33	27.57
	其中：普通股	13,453,101.33	27.57
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	29,638,630.57	60.73

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	5,690,943.19	11.66
8	其他各项资产	18,175.57	0.04
9	合计	48,800,850.66	100.00

8.2 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 (%)
香港	8,210,054.30	17.28
美国	5,243,047.03	11.03
合计	13,453,101.33	28.31

8.3 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 (%)
Internet & Direct Marketing Re	529,431.84	1.11
半导体产品	550,659.06	1.16
保健护理机构	106,482.47	0.22
多样化房地产活动	306,816.93	0.65
钢铁	915,961.48	1.93
互联网软件与服务	2,441,631.42	5.14
家庭娱乐软件	423,103.23	0.89
建筑机械与重型卡车	74,199.60	0.16
教育服务	467,276.32	0.98
汽车制造商	1,124,327.51	2.37
数据处理与外包服务	958,311.87	2.02
特殊消费者服务	205,290.05	0.43
通信设备	602,899.74	1.27
投资银行业与经纪业	1,101,463.83	2.32
系统软件	397,906.32	0.84

纸制品	643,242.14	1.35
制药	2,604,097.52	5.48
合计	13,453,101.33	28.31

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

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	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦制药	3933 HK	Hongkong Exchange	-	300,000	1,416,903.84	2.98
2	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	2238 HK	Hongkong Exchange	-	134,000	1,124,327.51	2.37
3	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	Hongkong Exchange	-	6,000	1,018,131.28	2.14
4	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYPL US	US exchange	-	3,500	958,311.87	2.02
5	UNITED STATES STEEL CORP	美国钢铁	X US	US exchange	-	4,000	915,961.48	1.93
6	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药	1177 HK	Hongkong Exchange	-	160,000	781,443.94	1.64
7	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	US exchange	-	1,200	730,965.56	1.54
8	SHANDONG CHENMING PAPER-H	晨鸣纸业	1812 HK	Hongkong Exchange	-	90,000	643,242.14	1.35
9	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	Hongkong Exchange	-	50,000	602,899.74	1.27
10	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	US exchange	-	7,000	550,659.06	1.16

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com> 的年度报告正文。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	FANG HOLDINGS LTD - ADR	SFUN US	3,841,918.00	8.02
2	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	3,108,063.35	6.49
3	58.COM INC-ADR	WUBA US	2,392,408.02	4.99
4	THE UNITED LABORATORIES INTE	3933 HK	1,339,369.23	2.79
5	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	1,287,132.28	2.69
6	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	1317 HK	1,202,978.05	2.51
7	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	1,173,440.36	2.45
8	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	1,169,446.59	2.44
9	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	1,121,241.24	2.34
10	SANDS CHINA LTD	1928 HK	1,098,899.91	2.29
11	CHEETAH MOBILE INC - ADR	CMCM US	1,072,318.15	2.24
12	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	1,007,935.11	2.10
13	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	1,000,594.50	2.09
14	CHANGYOU.COM LTD-ADR	CYOU US	990,275.93	2.07
15	VALUE PARTNERS GROUP LTD	806 HK	939,055.06	1.96
16	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	777 HK	899,310.37	1.88
17	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	732,280.56	1.53
18	JOY CITY PROPERTY LTD	207 HK	690,763.52	1.44
19	TESLA INC	TSLA US	683,350.96	1.43

20	SHANDONG CHENMING PAPER-H	1812 HK	676,466.48	1.41
----	------------------------------	---------	------------	------

注：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。

8.5.2 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	FANG HOLDINGS LTD - ADR	SFUN US	4,084,189.87	8.52
2	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	3,149,596.94	6.57
3	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	665 HK	2,804,219.12	5.85
4	58.COM INC-ADR	WUBA US	1,695,699.01	3.54
5	VALUE PARTNERS GROUP LTD	806 HK	1,621,604.48	3.38
6	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	1,477,627.61	3.08
7	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2357 HK	1,466,926.12	3.06
8	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	1,189,434.05	2.48
9	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	1,147,649.62	2.39
10	SANDS CHINA LTD	1928 HK	1,100,102.00	2.30
11	CHANGYOU.COM LTD-ADR	CYOU US	1,034,209.20	2.16
12	FIRST SHANGHAI INVESTMENTS	227 HK	1,005,860.09	2.10
13	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	2039 HK	932,480.19	1.95
14	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1060 HK	916,530.30	1.91
15	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	1317 HK	837,902.56	1.75
16	HARMONICARE	1509 HK	761,195.20	1.59

	MEDICAL HOLDINGS			
17	BBMG CORP-H	2009 HK	741,421.63	1.55
18	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	1448 HK	716,405.93	1.49
19	AMBARELLA INC	AMBA US	625,857.43	1.31
20	LEJU HOLDINGS LTD-ADR	LEJU US	614,670.85	1.28

注：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。

8.5.3 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	39,263,533.36
卖出收入（成交）总额	40,814,729.48

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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：无。

8.7 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：无。

8.8 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。

8.9 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：无。

8.10 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	Guggenheim Funds Investment Advisors LLC	4,159,432.14	8.75
2	PROSHARES SHORT MSCI EMR MKT	股票型	ETF 基金	ProShare Advisors LLC	3,116,655.36	6.56

3	ISHARES INDIA 50 ETF	股票型	ETF 基金	BlackRock Fund Advisors	2,844,863.70	5.99
4	ISHARES CSI CONSUMER STAPLES	股票型	ETF 基金	BlackRock Asset Management North Asia Ltd	2,303,810.51	4.85
5	PROSHARES SHORT 20+ TREASURY	股票型	ETF 基金	ProShare Advisors LLC	1,988,699.16	4.19
6	SPDR S&P CAPITAL MARKETS ETF	股票型	ETF 基金	SSgA Funds Management Inc	1,867,995.36	3.93
7	KRANESHARES CSI CHINA INTERN	股票型	ETF 基金	Krane Funds Advisors LLC	1,806,915.08	3.80
8	MARKET VECTORS CHINA AMC SME	股票型	ETF 基金	Van Eck Associates Corp	1,600,565.69	3.37
9	HS H-SHARE ETF	股票型	ETF 基金	Hang Seng Investment Management Ltd	1,266,626.16	2.67
10	WISDOMTREE JAPAN HEDGED EQ	股票型	ETF 基金	WisdomTree Asset Management Inc	1,202,806.43	2.53

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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	12,555.95
4	应收利息	75.73
5	应收申购款	5,543.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,175.57

8.11.4 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处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
790	61,994.02	29,225,166.47	59.67%	19,750,113.2	40.33%

9.2 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	76,197.47	0.1556%

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。

9.3 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：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 10 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	16,818,912.04
减：本报告期基金总赎回份额	13,844,900.23
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	48,975,279.67

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

报告期内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。

经公司董事会审议通过，公司同意聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 60,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 7 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	-	54,350,671.88	67.87%	126,323.06	78.64%	-
BARCLAY	-	25,727,591.01	32.13%	34,306.66	21.36%	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际(香港)	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-
NOMURA	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-
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) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 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；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 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。

11.7.2 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	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期权	成交金额	占当期基

		债券 成交总 额的比例		回购 成交总额的 比例		证 成交总额 的比例		金 成交总额 的比例
DAIWA	-	-	-	-	-	-	50,478,126.28	54.07%
BARCLAY	-	-	-	-	-	-	42,885,149.37	45.93%
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际 (香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-
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。

鹏华基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日