

鹏华环球发现证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 03 月 28 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2019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2018年01月01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)
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	40,704,863.18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	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. 战略资产配置 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。
业绩比较基准	MSCI 明晟世界指数 (MSCI World Index RMB) × 50% + MSCI 明晟新兴市场指数 (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	中文	欧利盛资本资产管理股份公司	道富银行
	英文	Eurizon Capital SGR S.p.A.	State Street Bank and Trust Company
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管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-2,585,476.84	499,442.20	-4,021,178.77
本期利润	-9,800,998.43	3,491,486.74	-2,053,000.34
加权平均基金份额本期利润	-0.1971	0.0756	-0.0393
本期基金	-20.40%	7.63%	-6.91%

份额净值增长率			
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1686	0.0438	-0.0298
期末基金资产净值	33,840,459.66	52,177,085.95	47,516,538.17
期末基金份额净值	0.831	1.044	0.970

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	-17.23	1.32	-10.61	1.02	-6.62	0.30
过去六个月	-18.77	1.03	-5.37	0.81	-13.40	0.22
过去一年	-20.40	1.04	-6.70	0.75	-13.70	0.29
过去三年	-20.25	1.00	32.97	0.71	-53.22	0.29
过去五年	-12.80	1.17	33.10	0.73	-45.90	0.44

自基金成立 起至今	-16.90	0.98	45.93	0.81	-62.83	0.17
--------------	--------	------	-------	------	--------	------

注:业绩比较基准=MSCI 明晟世界指数 (MSCI World Index RMB) ×50%+MSCI 明晟新兴市场指数 (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)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

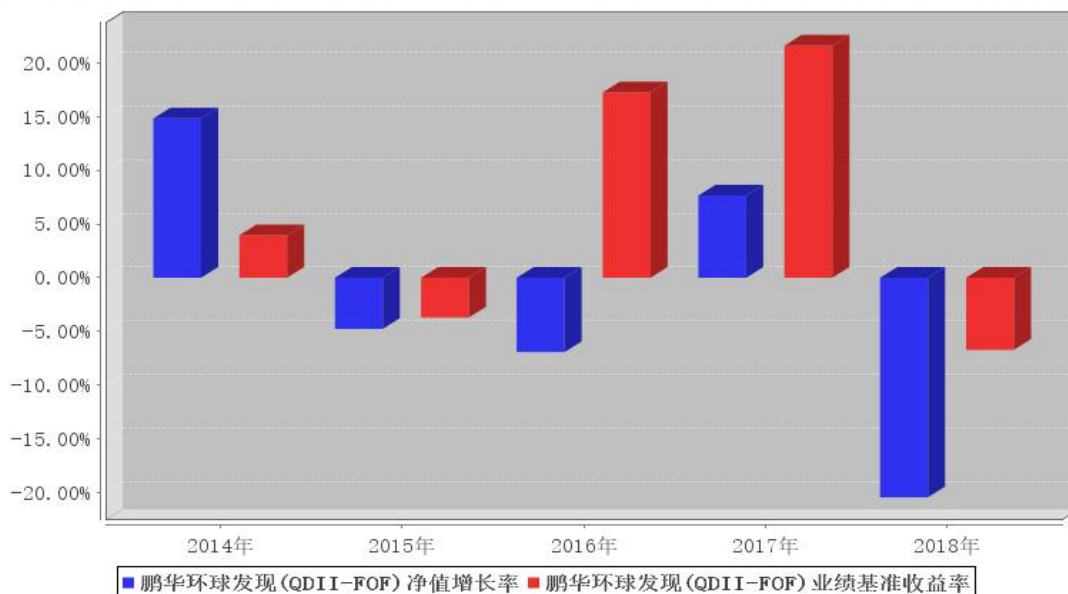


注：1、本基金基金合同于2010年10月12日生效。

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。

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)基金每年净值增长率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。截至2018年12月,公司管理资产总规模达到5,164.62亿元,管理146只公募基金、10只全国社保投资组合、4只基本养老保险投资组合。经过20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	2014-09-13	-	14	尤柏年先生,国籍中国,经济学博士,14年证券基金从业经验。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, 历任国际业务部副总经理, 现担任国际业务部总经理、基金经理。2014年08月担任鹏华全球高收益债基金基金经理, 2014年09月担任鹏华环球发现(QDII-FOF)基金经理, 2015年07月担任鹏华前海万科REITs基金基金经理, 2016年12月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理, 2017年11月担任鹏华港美互联股票(LOF)基金基金经理, 2017年11月担任鹏华香港银行指数(LOF)基金基金经理, 2017年11月担任鹏华香港中小企业指数(LOF)基金基金经理。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务	证券从业年限	说明
Domenico Mignacca	风险管理负责人	21	-
Oreste Auleta	基金甄选部负责人	18	-
Alessandro Solina	首席投资官	26	-
Andrea Conti	策略负责人	15	-

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，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，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》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，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中的公平交易程序，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。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

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

回顾2018年全球主要资产的表现，约9成出现下跌，为历史最差。权益市场来看，标普指数下跌6.24%，纳斯达克指数下跌3.88%，欧洲STOXX50指数下跌13.15%，MSCI新兴市场指数下跌16.64%，沪深300指数下跌25.31%，恒生指数下跌13.61%。总体来看，发达市场在美股的带动下仍好于新兴市场，但在四季度，美国市场同样创下08年金融危机以来最大季度跌幅，前期表现强势的科技股领跌。

本基金主要在18年四季度表现不佳，主要在配置上对中概股ETF和美股科技ETF配置较多，

防御性 ETF 配置较少，同时也配置较多个股。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,鹏华环球发现(QDII-FOF)组合净值增长率-20.40%;鹏华环球发现(QDII-FOF)业绩比较基准增长率-6.70%;

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 2019 年,我们认为全球经济情况仍不容乐观,相对而言仍是美国经济较为强劲,快速回落的概率不大,股市前期大幅回调或已反应经济下行的预期。此外,美股整体估值并未高估,大幅下跌的空间也较为有限。新兴市场中 A 股及港股市场同样由于前期下跌比较充分,导致大幅下跌空间有限,中国政府托底意愿较为强烈,我们对于市场较前期会相对更乐观一些。本基金还是会采取稳健分散的投资策略,防御为主,适时把握市场反弹及个股机会。

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,本基金可供分配利润为-6,864,403.52 元,期末基金份额净值 0.831 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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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,本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形,本基金

管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

§ 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。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款		2,362,926.11	4,308,323.46
结算备付金		-	340,040.18
存出保证金		-	-
交易性金融资产		30,697,208.57	49,844,272.23

其中：股票投资		10,451,412.84	16,087,203.24
基金投资		20,245,795.73	33,757,068.99
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		1,192,494.39	-
应收利息		552.53	224.21
应收股利		3,115.33	75,092.53
应收申购款		2,226.92	4,355.46
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		34,258,523.85	54,572,308.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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		0.01	1,792,414.40
应付赎回款		6,705.84	38,298.77
应付管理人报酬		45,680.74	66,101.08
应付托管费		10,658.85	15,423.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	27,921.61
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		355,018.75	455,062.67
负债合计		418,064.19	2,395,222.12
所有者权益：			
实收基金		40,704,863.18	49,987,819.89
未分配利润		-6,864,403.52	2,189,266.06
所有者权益合计		33,840,459.66	52,177,085.95
负债和所有者权益总计		34,258,523.85	54,572,308.07

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额总额40,704,863.18份，其中鹏华环球发现(QDII-FOF)基金人民币基金份额40,704,863.18份，份额净值人民币0.831元；鹏华环球发现(QDII-FOF)基金美元现汇基金份额0.00份，份额净值美元0.121元。

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：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
一、收入		-8,328,120.03	4,879,257.92
1. 利息收入		27,127.04	35,641.78
其中：存款利息收入		27,127.04	35,641.78
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-1,745,885.16	2,123,966.22
其中：股票投资收益		-438,216.94	1,538,707.16
基金投资收益		-2,000,567.49	-185,292.80
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		-	9,795.88
股利收益		692,899.27	760,755.98
3. 公允价值变动收益		-7,215,521.59	2,992,044.54
4. 汇兑收益		592,528.47	-337,203.05
5. 其他收入		13,631.21	64,808.43
减：二、费用		1,472,878.40	1,387,771.18
1. 管理人报酬	7.4.7.2.1	739,946.36	701,989.28
2. 托管费	7.4.7.2.2	172,654.22	163,797.51
3. 销售服务费	7.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用		319,435.79	263,504.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		240,842.03	258,479.57
三、利润总额		-9,800,998.43	3,491,486.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-9,800,998.43	3,491,486.74

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：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	49,987,819.89	2,189,266.06	52,177,085.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,800,998.43	-9,800,998.43
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)	-9,282,956.71	747,328.85	-8,535,627.86
其中：1. 基金申购款	5,273,486.63	-7,703.21	5,265,783.42
2. 基金赎回款	-14,556,443.34	755,032.06	-13,801,411.28
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)	40,704,863.18	-6,864,403.52	33,840,459.66
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	48,975,279.67	-1,458,741.50	47,516,538.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,491,486.74	3,491,486.74
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)	1,012,540.22	156,520.82	1,169,061.04
其中：1. 基金申购款	59,644,714.75	917,675.72	60,562,390.47

2. 基金赎回款	-58,632,174.53	-761,154.90	-59,393,329.43
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)	49,987,819.89	2,189,266.06	52,177,085.95

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：

邓召明

苏波

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,经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(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。

根据鹏华基金管理有限公司《关于鹏华环球发现证券投资基金及鹏华美国房地产证券投资基金增设美元现汇基金份额的公告》,本基金自2018年12月4日起增设美元现汇基金份额。投资者申购时可以选择基金份额类别,并交付相应币种的款项,赎回基金份额时收到对应币种的款项。

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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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%。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

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合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年内，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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、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。

7.4.4.3 差错更正的说明

无。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.6 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
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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
国信证券	-	-	19,037,902.60	16.90

7.4.7.1.2 债券交易

注:无。

7.4.7.1.3 债券回购交易

注:无。

7.4.7.1.4 基金交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)
-	0.00	0.00	-	-

注:无。

7.4.7.1.5 权证交易

注:无。

7.4.7.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	19,037.92	68.18	19,037.92	68.18

注:1、佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立)。

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定,上述单位定期或不定期地为鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支

持。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	739,946.36	701,989.28
其中：支付销售机构的客户维护费	73,744.83	167,852.71

注：1、支付基金管理人鹏华基金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。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	172,654.22	163,797.51

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为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。

7.4.7.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017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	-	-
报告期初持有的基金份额	29,547,763.55	20,020,333.33
报告期间申购/买入总份额	-	9,527,430.22
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	29,547,763.55	29,547,763.55
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	72.5903%	59.1099%

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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国建设银行	187,361.79	17,016.91	439,188.98	28,379.23
道富银行	2,175,564.32	9,025.46	3,869,134.48	3,556.06

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.8 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层

次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为30,697,208.57元, 无属于第二层次或第三层次的余额(2017年12月31日: 第一层次49,844,272.23元, 无第二层次或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	10,451,412.84	30.51
	其中：普通股	6,770,594.26	19.76
	存托凭证	3,680,818.58	10.74
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	20,245,795.73	59.10
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	2,362,926.11	6.90
8	其他各项资产	1,198,389.17	3.50
9	合计	34,258,523.85	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(%)
美国	6,181,624.52	18.27
香港	4,269,788.32	12.62
合计	10,451,412.84	30.88

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(%)
半导体产品	354,298.97	1.05
财产与意外伤害保险	1,122,937.92	3.32
互动媒体与服务	2,929,399.01	8.66
互动式家庭娱乐	3,998,433.74	11.82
环境与设施服务	1,104,975.82	3.27
建筑与工程	708,495.32	2.09
投资银行业与经纪业	194,954.50	0.58
综合性银行	37,917.56	0.11
合计	10,451,412.84	30.88

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	NETEASE INC-ADR	网易公司	NTES US	US exchange	美国	790	1,276,159.19	3.77
2	WEIBO CORP-SPON ADR	新浪微博	WB US	US exchange	美国	3,000	1,203,050.33	3.56
3	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	哔哩哔哩	BILI US	US exchange	美国	12,000	1,201,609.06	3.55
4	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	Take-Two 互动软件股份有限公司	TTWO US	US exchange	美国	1,700	1,201,046.27	3.55

5	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	中国人民财产保险股份有限公司	2328 HK	HongKong exchange	香港	160,000	1,122,937.92	3.32
6	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	HongKong exchange	香港	4,000	1,100,507.20	3.25
7	A-LIVING SERVICES CO LTD-H	雅生活服务	3319 HK	HongKong exchange	香港	80,000	744,419.52	2.20
8	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑国际	3311 HK	HongKong exchange	香港	130,000	708,495.32	2.09
9	SINA CORP	新浪公司	SINA US	US exchange	美国	1,700	625,841.48	1.85
10	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	东江环保	895 HK	HongKong exchange	香港	50,000	360,556.30	1.07

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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.cn> 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 名的股票明细

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	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	8,034,533.51	15.40
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	6,592,621.66	12.64
3	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	3,801,561.30	7.29
4	NVIDIA CORP	NVDA US	3,180,925.71	6.10
5	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	956 HK	2,907,096.60	5.57
6	MOMO INC-SPON ADR	MOMO US	2,668,107.85	5.11
7	ZTE CORP-H	763 HK	2,573,575.44	4.93
8	WEIBO CORP-SPON	WB US	2,498,034.17	4.79

	ADR			
9	ANTON OILFIELD SERVICES GP	3337 HK	2,339,381.01	4.48
10	TAL EDUCATION GROUP-ADR	TAL US	2,175,979.25	4.17
11	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	2,145,009.42	4.11
12	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	2,111,067.10	4.05
13	CHINA CONCH VE NTURE HOLDINGS	586 HK	2,109,369.04	4.04
14	ERICSSON (LM) TEL-SP ADR	ERIC US	2,095,757.44	4.02
15	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	TSM US	1,904,805.57	3.65
16	ACTIVISION BLIZZARD INC	ATVI US	1,678,797.74	3.22
17	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	1,594,727.76	3.06
18	INTEL CORP	INTC US	1,522,757.77	2.92
19	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	TTWO US	1,509,002.82	2.89
20	ALCOA CORP	AA US	1,497,401.50	2.87
21	NETEASE INC-ADR	NTES US	1,353,438.11	2.59
22	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	3998 HK	1,311,768.29	2.51
23	CRRC CORP LTD - H	1766 HK	1,184,115.68	2.27
24	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	1,177,711.69	2.26
25	THE UNITED LABORATORIES INTE	3933 HK	1,154,294.29	2.21
26	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2328 HK	1,137,157.70	2.18
27	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	1317 HK	1,095,806.60	2.10

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。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	BAIDU INC - S	BIDU US	8,975,907.72	17.20

	PON ADR			
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	6,794,187.36	13.02
3	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	6,050,609.99	11.60
4	TAL EDUCATION GROUP-ADR	TAL US	4,686,145.54	8.98
5	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	956 HK	3,679,561.10	7.05
6	MOMO INC-SPON ADR	MOMO US	3,015,848.04	5.78
7	NVIDIA CORP	NVDA US	2,863,750.95	5.49
8	ANTON OILFIELD SERVICES GP	3337 HK	2,223,883.50	4.26
9	ERICSSON (LM) TEL-SP ADR	ERIC US	2,133,919.44	4.09
10	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	TSM US	1,975,624.34	3.79
11	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	1,954,016.54	3.74
12	ZTE CORP-H	763 HK	1,932,297.22	3.70
13	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	1,835,192.48	3.52
14	ALCOA CORP	AA US	1,790,524.10	3.43
15	WEIBO CORP-SPON ADR	WB US	1,764,357.84	3.38
16	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	1,434,551.88	2.75
17	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	1,306,356.92	2.50
18	BOSIDENG INTL HDGS LTD	3998 HK	1,211,594.86	2.32
19	INTEL CORP	INTC US	1,163,650.09	2.23
20	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	1317 HK	1,127,285.24	2.16
21	CRRC CORP LTD - H	1766 HK	1,122,974.89	2.15
22	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	1,117,384.99	2.14
23	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	1,091,286.74	2.09

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。

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	79,001,084.20
卖出收入（成交）总额	82,151,200.99

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	KRANESHARES CSI CHINA INTERN	股票型	ETF	Krane Funds Advisors LLC	4,890,030.00	14.45
2	TECHNOLOGY SELECT SECT SPDR	股票型	ETF	SSgA Funds Management Inc	3,828,430.22	11.31
3	CONSUMER STAPLES SPDR	股票型	ETF	SSgA Funds Management Inc	2,788,106.37	8.24
4	GUGGENHEIM CHINA TECHNOLOGY	股票型	ETF	Guggenheim Funds Investment Advisors LLC	1,351,020.92	3.99
5	DEUTSCHE	股	ET	DBX Advisors LLC	1,279,334.	3.78

	X-TRACKER S HARVEST	票 型	F		80	
6	TEUCRIUM SOYBEAN FUND	股 票 型	ET F	Teucrium Trading LLC	1,211,629.19	3.58
7	WISDOMTRE E JAPAN HEDGED EQ	股 票 型	ET F	WisdomTree Asset Management Inc	1,146,181.85	3.39
8	PROSHARES SHORT HIGH YIELD	股 票 型	ET F	ProShare Advisors LLC	1,097,672.76	3.24
9	SPDR S&P CAPITAL MARKETS ETF	股 票 型	ET F	SSgA Funds Management Inc	1,081,921.71	3.20
10	CSOP SZSE CHINEXT ETF-HKD	股 票 型	ET F	CSOP Asset Management Ltd	932,110.32	2.75

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

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	1,192,494.39
3	应收股利	3,115.33
4	应收利息	552.53
5	应收申购款	2,226.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,198,389.17

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

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 (%)
774	52,590.26	34,336,077.73	84.35	6,368,785.45	15.65

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	80,246.68	0.1971

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

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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	49,987,819.89
本报告期基金总申购份额	5,273,486.63
减:本报告期基金总赎回份额	14,556,443.34
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-

本报告期末基金份额总额	40,704,863.18
-------------	---------------

注:总申购份额含红利再投。

§ 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

基金管理人的重大人事变动:报告期内,基金管理人无重大人事变动。

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,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

无

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 55,000.00 元,该审计机构已提供审计服务的年限为 9 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	1	140,552,042.58	87.22%	204,053.38	90.83%	
申万宏源	1	11,649,684.94	7.23%	11,649.69	5.19%	
中金公司	2	8,950,559.89	5.55%	8,950.57	3.98%	
BARCLAY	1					
国信证券	2					
海通国际	1					
海通证券	1	-	-	-	-	
华融证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
平安证券	1	-	-	-	-	
中航证券	1	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投	1	-	-	-	-	
国泰君安	1	-	-	-	-	
国金证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
东方证券	1	-	-	-	-	
安信证券	1	-	-	-	-	
德邦证券	1	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	-	-	-164,088,636.66	100
申万宏源								
中金公司								
BARCLAY								
国信证券								
海通国际								
海通证券								
华融证券								
平安证券								
中航证券								
中泰证券								
中信建投								
国泰君安								
国金证券								
方正证券								
东方证券								
安信证券								
德邦证券								
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								

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	1	20181102~20181231	9,527,430.22	-	-	9,527,430.22	23.41
	2	20180101~20181231	20,020,333.33	-	-	20,020,333.33	49.19
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司

2019年03月28日