

鹏华全球高收益债券基金2019年第2季度报告

2019-06-30

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-16

重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当勤勉尽责，对基金财产的安全、完整、增值负责。

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预示其未来表现，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。

本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金名称 (鹏华全球高收益债 (QDII)), 基金代码 (000390), 基金运作方式 (契约型开放式), etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30), 单位: 人民币元. Includes 本期已实现收益, 本期利润, etc.

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。

基金净值表现

Table with columns: 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. Includes 过去三个月, 2.09%, 0.22%, 4.31%, 0.40%, -1.72%, -0.21%.

注：业绩比较基准=人民币计价的花旗国际高收益公司债指数 (Citi1 USD International High Yield Corporate bond Index in RMB)

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准的对比



注：1. 本基金基金合同于2013年10月23日生效。2. 截至建仓结束前，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。

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes 尤柏年.

注：1. 任职日期和离任日期均指公告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规定的有关规定。

境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

Table with columns: 姓名, 在境外投资顾问所任职务, 证券从业年限, 说明. Includes 注：无。

报告期内本基金运作遵信情况说明

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。

公平交易专项说明

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。

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。报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易或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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

一季度以来，美股收益率大幅下行，10年期收益率一度向下突破2%，触及2018年以来低点。在低风险利率带动下，海外债市场整体获得平稳上涨，以彭博巴克莱指数衡量，一季度中美元债总体上涨2.27%，而今年以来中美美元债总体上涨了8.68%，成为欧债危机以来最佳半年度表现。

报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

Table with columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Includes 权益投资, 固定收益投资, etc.

Table with columns: 国家 (地区), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 注：无。

Table with columns: 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 能源, 原材料, 工业, etc.

Table with columns: 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 (%). Includes 1. KAISAG 8 1/2 06/30/22, etc.

Table with columns: 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 (%). Includes 1. 外汇远期, etc.

Table with columns: 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 (%). Includes 注：无。

投资调查以及处罚情况

本基金投资的前十名证券中本期没有发生主体被监管部门立案调查，或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

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。

其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额 (元), 单位: 人民币元. Includes 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

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 注：无。

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之和与合计项之间可能存在尾差。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 数值. Includes 报告期期初基金份额总额, 报告期期间基金总申购份额, etc.

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Includes 合计.

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 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. Includes 基金管理人自有资金, etc.

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

Table with columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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. Includes 机构, 个人.

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- (一)《鹏华全球高收益债券基金证券投资基金合同》；(二)《鹏华全球高收益债券基金托管协议》；(三)《鹏华全球高收益债券基金2019年第2季度报告》（原文）。

存放地点

深圳市福田区福华三路68号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。可通过本基金管理人网站 (http://www.phfund.com.cn) 查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4008788899。