

鹏华全球高收益债券型证券投资基金2019年第二季度报告

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 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 基金简称 (Fund Name), 场内简称 (Listed Name), 基金代码 (Fund Code), etc.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 数值 (Value). Includes 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Profit), 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。

基金净值表现

Table with 2 columns: 阶段 (Period) and 净值增长率① (Net Value Growth Rate). Includes 过去三个月 (Last 3 Months), 过去六个月 (Last 6 Months), etc.

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

鹏华全球高收益债（QDII）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 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Tenure), 证券从业年限 (Experience), and 说明 (Remarks).

注：1. 任职日期和离任日期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。

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 4 columns: 姓名 (Name), 在境外投资顾问所任职务 (Position), 证券从业年限 (Experience), and 说明 (Remarks).

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。

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年期收益率一度创下新低。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%。

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

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount), and 占基金总资产的比例 (%) (Percentage).

报告期末按国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

Table with 3 columns: 国家（地区） (Country/Region), 公允价值 (元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

Table with 3 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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

Table with 8 columns: 序号 (No.), 公司名称 (英文名称) (Company Name), 公司名称 (中文) (Company Name), 证券代码 (Securities Code), 所在证券市场 (Market), 所属国家 (地区) (Country/Region), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 债券信用等级 (Bond Credit Rating), 公允价值 (元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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债券投资明细

Table with 7 columns: 序号 (No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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：无。

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

Table with 6 columns: 序号 (No.), 衍生品类别 (Derivative Category), 衍生品名称 (Derivative Name), 公允价值 (元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

注：注：（1）衍生金融资产项下的期货投资净额为：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，期货金融资产项下的期货投资与相关的期货管理款（结算所持仓损益）之间按照销后的净额列示。

（2）截至本报告期末，本基金持有10年期美债1909合约共120张，合约市值折人民币105,569,611.88；本基金持有香港人民币期货1909合约共380张，合约市值折人民币281,318,400.00元；本基金持有新加坡人民币期货1909合约共1379张，合约市值折人民币948,462,410.00元；本基金持有新加坡人民币期货1912合约共130张，合约市值折人民币89,520,600.00元。

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

Table with 6 columns: 序号 (No.), 基金名称 (Fund Name), 基金类型 (Fund Type), 运作方式 (Operation Mode), 管理人 (Manager), 公允价值 (元) (Fair Value), and 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况：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。

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没有超出基金合同规定的备选股票库。

其他资产构成：Table with 2 columns: 序号 (No.) and 名称 (Name).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细：无。

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 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 报告期期初基金份额总额 (Total Shares at Start), 报告期期间基金总申购份额 (Total Subscriptions), etc.

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号 (No.), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Shares), 交易金额 (元) (Amount), and 适用费率 (Applicable Rate).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 6 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额总数 (Initiated Shares), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period).

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 2 columns: 投资者类别 (Investor Category) and 报告期末持有基金份额情况 (Shareholding Situation at End of Report Period).

注：注：无。

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型证券投资基金基金合同》；（二）《鹏华全球高收益债券型证券投资基金托管协议》；（三）《鹏华全球高收益债券型证券投资基金2019年第二季度报告》（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。