

# 鹏华全球高收益债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

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

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>

6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	40
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	40
7.7 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.....	40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.9 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.....	41
7.10 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.....	41
7.11 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>50</b>
11.1 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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华全球高收益债债券型证券投资基金
基金简称	鹏华全球高收益债（QDII）
场内简称	-
基金主代码	000290
基金交易代码	000290
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月22日
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
报告期末基金份额总额	2,040,941,781.07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	通过分析全球各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，在谨慎投资的前提下，以高收益债券为主要投资标的，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金基于价值投资的理念，将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对各行业的动态跟踪，主要采用买入并持有策略，并通过信用策略选择收益率较高的债券，同时辅以久期策略、收益率曲线策略、债券选择策略、息差策略等积极投资策略，寻找各类债券的投资机会，在谨慎投资的前提下，以高收益债券为主要投资标的，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。本基金将通过主动的外汇投资策略对冲外汇风险并力争获取外汇投资回报。
业绩比较基准	人民币计价的花旗国际高收益公司债指数（Citi USD International High Yield Corporate bond Index in RMB）
风险收益特征	本基金属于债券型基金，主要投资于全球市场的各类高收益债券，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等风险/收益的产品。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
		郭明
		010-66105799
		custody@icbc.com.cn

客户服务电话	4006788999	95588
传真	0755-82021126	010-66105798
注册地址	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	何如	易会满

## 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	-	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation
	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		-	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		-	香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
邮政编码		-	-

注：本基金无境外投资顾问。

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层

### § 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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	75,633,920.93
本期利润	45,587,996.13
加权平均基金份额本期利润	0.0238
本期加权平均净值利润率	3.98%
本期基金份额净值增长率	1.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	31,095,145.33
期末可供分配基金份额利润	0.0152
期末基金资产净值	2,264,950,224.26
期末基金份额净值	1.110
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	44.15%

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）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30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

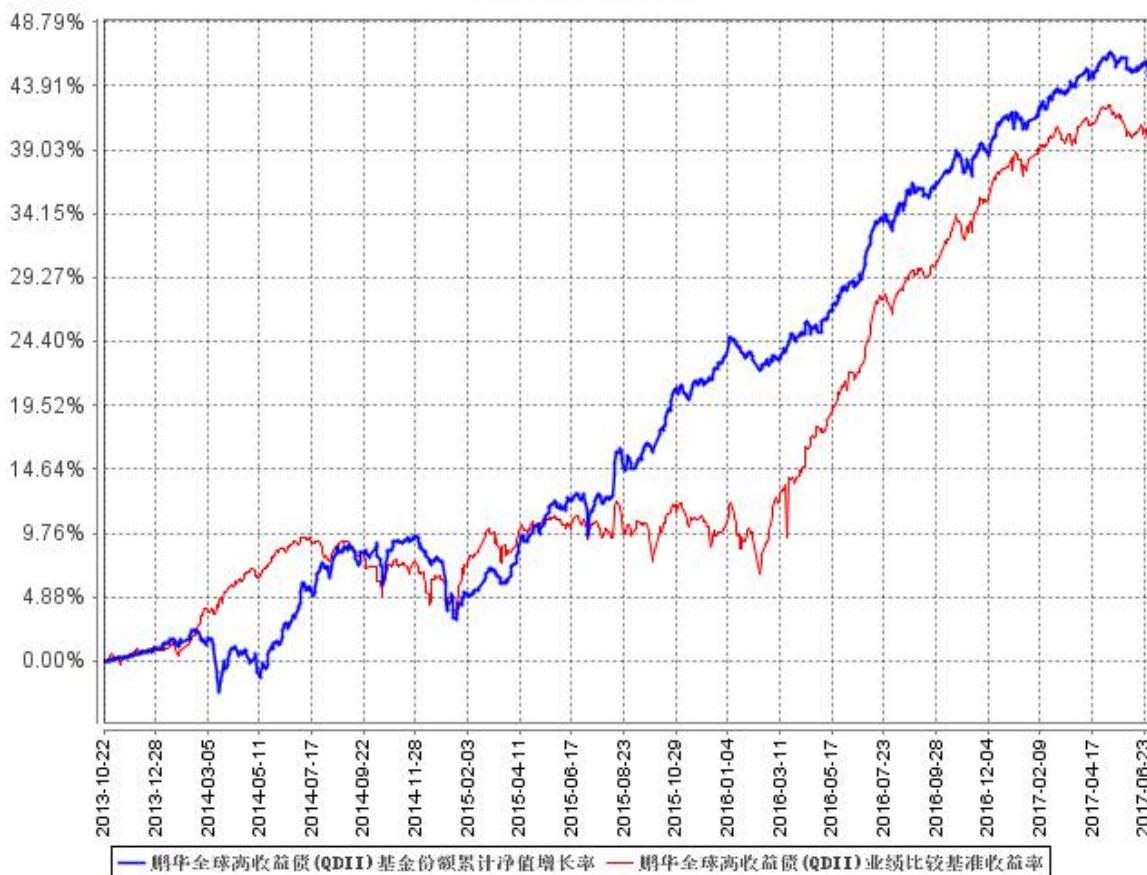
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.33%	0.20%	-0.76%	0.18%	-0.57%	0.02%
过去三个月	-0.36%	0.18%	-0.99%	0.17%	0.63%	0.01%
过去六个月	1.99%	0.22%	1.17%	0.22%	0.82%	0.00%
过去一年	10.16%	0.23%	12.57%	0.22%	-2.41%	0.01%
过去三年	38.61%	0.27%	28.03%	0.36%	10.58%	-0.09%
自基金合同生效起至今	44.15%	0.27%	39.41%	0.33%	4.74%	-0.06%



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(Citi USD International High Yield Corporate bond Index in RMB)

### 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

鹏华全球高收益债(QDII)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、本基金基金合同于2013年10月22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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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2017年6月，公司管理资产总规模达到4509.30亿元，管理149只公募基金、10只全国社保投资组合、2只基本养老保险投资组合。经过近19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8月 30日	-	13	尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，13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

注：本基金无境外投资顾问。

#### 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，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。

##### 4.4.2 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

今年上半年我们除了配置亚洲特别是香港高收益债市场，继续投资新兴市场及欧洲国家的高收益债券，并保持了较短的平均久期，分散基金的风险。

回顾今年上半年，美国国债利率整体呈现震荡下行态势，10 年国债始于 2.44，终于 2.30。

第一季度，各主要高收益债债券市场整体呈现了震荡略微向上的走势。新兴市场发行的美元债券走势强劲、供需两旺，总体受益于期间宏观形势的发展。美联储开启了连续加息的模式，并于 3 月份启动今年内首次加息，但同时释放出偏鸽派讯号。由于市场之前已充分消化了该议息结

果，美联储本次加息并未对新兴市场美元债券造成更多负面冲击。欧日央行方面则继续推行量化宽松政策，债券市场表现稳定。美国国债方面同样呈现震荡走势，10 年期国债收益率于一季度多在 2.31%至 2.63%之间波动，仅在 3 月份加息前短暂冲高至 2.63%，随后在美联储偏鸽派的议息结果后重新回落至 2.4%附近。

而在第二季度，美国国债收益率继续呈现震荡格局，10 年期美国国债收益率始于 2.39%，终于 2.30%。期间，4 月份受法国大选、朝鲜半岛局势等地缘政治风险带来的避险需求，加上不及预期的美国一季度经济数据、投资者对特朗普交易降温等多重因素推动，10 年期美国国债收益率在 4 月 18 日下跌 8bps 至 2.17%，创 2016 年 11 月中旬以来的最低值。随后随着美联储 6 月加息概率的升高以及法国大选结束，利率重新升高。然而紧接着在 5 月特朗普政府陷入一系列政治事件（开除联邦调查局局长科米、通俄门等等），10 年期美国国债收益率不仅抹去前期升幅，还进一步下行并在 6 月中下行至 2.13%。直到 6 月底欧洲央行行长德拉吉发言阐释了经济复苏势头正在不断增强，推动发达经济体国债利率全线回升。

6 月份美联储如期加息 25 个基点，基准利率上至 1%-1.25%，同时公布纪要显示整体基调略偏鹰派，仍保持年内共加息 3 次的指引。但 6 月下旬以来，美联储多名官员发表公开讲话，对通胀和加息前景产生明显分歧。由于近期公布的一系列经济数据不及预期，市场对美国经济增长前景的悲观情绪加剧。主要受美国经济和通胀前景驱动的长期国债收益率下跌。美国 10 年期国债收益率也在 6 月底再度上行至 2.30%。

对于我们配置的高收益债仓位，上半年整体来说表现良好，收益率和利差均有所收窄。分析其主要原因，其一是上半年总体一级供给弱于预期，同时叠加部分债券到期或赎回，净增压力有所减轻。其二，从需求层面看，去年底特朗普当选以来的再通胀概念已有所放缓，弱势美元预期下，资金重新流入新兴市场债市，其中则包括香港高收益债市场。

今年以来美元指数保持弱势格局，美元兑人民币境内报价在过去两个月内急速下跌，6 月底更是一度下跌至去年 11 月以来最低点 6.7590。整体来说上半年美元兑人民币贬值了超过 2.4%。截至 6 月 30 日，中国外汇储备达到 30567.9 亿美元，连续 5 个月站稳 3 万亿美元，较 5 月环比上升 32 亿美元，尽管这个数值略低于市场预期，却创下 2014 年 6 月以来的最长储备上涨周期。

我们在上半年继续认真研究调研持仓品种，对信用风险相对较小的高收益债券不断买入，并扩大了投资券种的地域范围和行业范围，我们继续涉足新兴市场和高收益债品种，投资的分散性对减少基金净值的波动产生了积极效果。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏华全球高收益债(QDII)基金份额净值为 1.110 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.99%；同期业绩比较基准收益率为 1.17%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前看美元债收益率能否进一步走低，除了供需关系、资金面以及企业基本面几个方面外，还需要考虑美联储货币政策的实施状况。市场对美联储未来的持续加息已有充分准备，今年再加息至少一次已是一致预期，加息对利率的影响在逐渐减弱，利多包括美元债券在内的避险资产。相较之下，当前应当关注美联储加息不及预期的可能性。美联储发布 6 月政策会议纪要，显示美联储官员对于通胀、下半年加息进程、缩表等问题分歧加大。关于通胀，我们认为短期内美国通胀难以出现扭转性因素，因而持续低迷的通胀或将拖慢美联储加息进程。

下半年主要风险将来自于各主要央行的紧缩性政策。其中市场最关注的当属美联储的缩表进程。美联储公布的缩表计划是在未来 3-5 年内将资产收缩一半左右，其特点将是小步快跑、循序渐进的方式进行，因此短期内对情绪上的影响大于实质。

欧元区方面，随着核心通胀稳中向好，工业和经济增长数据也呈持续改善，欧央行对于未来通胀走势逐渐转乐观，货币政策边际收紧预期加强。欧央行行长德拉吉 6 月底表态偏鹰引发市场对欧央行下半年逐步退出过度宽松的猜想，预计下半年欧央行货币政策态度将较上半年明显收紧，幅度主要取决于经济和通胀数据的变化。欧央行最新发布的货币政策会议纪要显示，如果通胀前景改善，将重新审视资产购买计划上的宽松倾向，同时，多位欧央行货币政策委员也陆续表示要为货币政策正常化做好准备。整体来看，欧央行对欧元区通胀前景一定程度已转乐观，未来欧元区通胀走势值得密切关注，如果欧元区核心通胀延续当前的逐步抬升趋势，我们认为欧央行可能于下半年开始讨论退出 QE 或修正负利率政策的路径。

#### 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，本基金期末可供分配利润为 31,095,145.33 元，期末基金份额净值 1.110 元。

2、本基金的基金管理人于 2017 年 1 月 3 日宣告 2016 年度第 4 次分红，向截至 2017 年 1 月 6 日止在本基金注册登记人鹏华基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份鹏华全球高收益债人民币份额基金份额派发红利人民币 0.60 元，按每 10 份鹏华全球高收益债美元现汇份额基金份额派发红利美元 0.087 元。本基金的基金管理人于 2017 年 2 月 10 日宣告 2017 年度第 1 次分红，向截至 2017 年 2 月 15 日止在本基金注册登记人鹏华基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份鹏华全球高收益债人民币份额基金份额派发红利人民币 0.50 元，按每 10 份鹏华全球高收益债美元现汇份额基金份额派发红利美元 0.073 元。本基金的基金管理人于 2017 年 3 月 28 日宣告 2017 年度第 2 次分红，向截至 2017 年 3 月 31 日止在本基金注册登记人鹏华基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份鹏华全球高收益债人民币份额基金份额派发红利人民币 0.495 元，按每 10 份鹏华全球高收益债美元现汇份额基金份额派发红利美元 0.072 元。

#### 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

无。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对鹏华全球高收益债 QDII 证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，鹏华全球高收益债 QDII 证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华全球高收益债 QDII 证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鹏华全球高收益债 QDII 证券投资基金利润分配总额为人民币 221,253,857.59 元，美元 12,133,604.25 元。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华全球高收益债 QDII 证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华全球高收益债债券型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	321,430,787.43	417,947,028.20
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,927,842,721.31	1,677,736,130.83
其中：股票投资		-	-
基金投资		12,183,080.96	13,257,994.40
债券投资		1,915,659,640.35	1,664,478,136.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	9,669,709.88
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		36,964,640.48	2,830,594.08
应收利息	6.4.7.5	24,987,608.56	28,875,610.76
应收股利		-	-
应收申购款		1,943,424.34	34,148,341.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	29,214.61	4,114,029.33
资产总计		2,313,198,396.73	2,175,321,444.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	7,926,048.00	145,677.00
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,424,825.24
应付赎回款		37,372,275.38	13,980,381.80
应付管理人报酬		1,942,339.32	1,752,036.27
应付托管费		582,701.78	525,610.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-



应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	424,807.99	526,897.28
负债合计		48,248,172.47	24,355,428.48
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,040,941,781.07	1,726,034,703.49
未分配利润	6.4.7.10	224,008,443.19	424,931,313.02
所有者权益合计		2,264,950,224.26	2,150,966,016.51
负债和所有者权益总计		2,313,198,396.73	2,175,321,444.99

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.110 元，基金份额总额 2,040,941,781.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华全球高收益债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017 年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年6月30日
<b>一、收入</b>		60,900,782.08	94,493,065.83
1.利息收入		61,033,821.00	29,924,650.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	228,924.77	287,168.42
债券利息收入		60,804,896.23	29,557,593.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	79,888.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		38,835,645.71	1,500,845.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	156,278.27
债券投资收益	6.4.7.14	31,451,387.35	377,385.47
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	7,384,258.36	-
股利收益	6.4.7.17	-	967,181.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-30,045,924.80	67,341,906.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-9,363,075.61	-4,751,412.25
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	440,315.78	477,075.81
<b>减：二、费用</b>		15,312,785.95	7,348,282.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,618,417.66	5,457,390.20
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,485,525.28	1,637,217.05

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	97.43	76,164.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	208,745.58	177,510.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		45,587,996.13	87,144,783.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		45,587,996.13	87,144,783.59

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华全球高收益债债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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）	1,726,034,703.49	424,931,313.02	2,150,966,016.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	45,587,996.13	45,587,996.13
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）	314,907,077.58	58,465,682.03	373,372,759.61
其中：1.基金申购款	806,363,515.39	126,472,422.80	932,835,938.19
2.基金赎回款	-491,456,437.81	-68,006,740.77	-559,463,178.58
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）	-	-304,976,547.99	-304,976,547.99
五、期末所有者权益（基金净值）	2,040,941,781.07	224,008,443.19	2,264,950,224.26
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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）	194,303,700.44	38,519,073.00	232,822,773.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	87,144,783.59	87,144,783.59
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）	1,429,127,726.40	254,337,375.16	1,683,465,101.56
其中：1.基金申购款	1,686,581,644.29	299,573,871.60	1,986,155,515.89
2.基金赎回款	-257,453,917.89	-45,236,496.44	-302,690,414.33
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）	-	-82,904,176.56	-82,904,176.56
五、期末所有者权益（基金净值）	1,623,431,426.84	297,097,055.19	1,920,528,482.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华全球高收益债债券型证券投资基金(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[2013]第 933 号《关于核准鹏华全球高收益债债券型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《鹏华全球高收益债债券型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 310,797,728.53 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(2013)第 592 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 10 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 310,994,086.08 份基金份额,其中认购资金利息折合 136,357.55 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,基金托管人为中国工商

银行，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

根据鹏华基金管理有限公司《关于鹏华全球高收益债债券型证券投资基金增加美元现汇基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2015 年 9 月 18 日起增设美元现汇基金份额。投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别，并交付对应币种的款项，赎回基金份额时收到对应币种的款项。本基金不同基金份额类别之间暂不得互相转换。

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《鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括债券、债券类基金(包括 ETF)、资产支持证券、货币市场工具、结构性投资产品、信用违约互换(CDS)等金融衍生品以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金不从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具，但本基金持有可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债而产生的权证等原因而持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的 6 个月内卖出。基金的投资组合比例为：对债券的投资比例不低于基金资产的 80%。其中，投资于高收益债券的比例不低于非现金基金资产的 80%。现金或者到期日在 1 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：人民币计价的花旗国际高收益公司债指数(Citi USD International High Yield Corporate bond Indexin RMB)。

#### **6.4.2 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2017 年上半年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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 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**

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。

#### **6.4.5 差错更正的说明**

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	321,430,787.43

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	321,430,787.43

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	OTC 市场	1,822,597,150.46	1,915,659,640.35	93,062,489.89
	合计	1,822,597,150.46	1,915,659,640.35	93,062,489.89
资产支持证券	-	-	-	
基金	13,322,938.54	12,183,080.96	-1,139,857.58	
其他	-	-	-	
合计	1,835,920,089.00	1,927,842,721.31	91,922,632.31	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	108,922,190.40	-	7,926,048.00	
--外汇远期合同	108,922,190.40	-	7,926,048.00	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	108,922,190.40	-	7,926,048.00	

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	5,070.20
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2.05
应收债券利息	24,982,536.31
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	24,987,608.56

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	29,214.61
待摊费用	-
合计	29,214.61

**6.4.7.7 应付交易费用**

注：无。

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16,533.10
预提费用	408,274.89
合计	424,807.99

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,726,034,703.49	1,726,034,703.49
本期申购	806,363,515.39	806,363,515.39
本期赎回(以“-”号填列)	-491,456,437.81	-491,456,437.81
本期末	2,040,941,781.07	2,040,941,781.07

注：申购含红利再投。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	225,967,092.32	198,964,220.70	424,931,313.02
本期利润	75,633,920.93	-30,045,924.80	45,587,996.13
本期基金份额交易产生的变动数	34,470,680.07	23,995,001.96	58,465,682.03
其中：基金申购款	51,404,959.58	75,067,463.22	126,472,422.80
基金赎回款	-16,934,279.51	-51,072,461.26	-68,006,740.77
本期已分配利润	-304,976,547.99	-	-304,976,547.99
本期末	31,095,145.33	192,913,297.86	224,008,443.19

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	224,578.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1.03



其他	4,345.16
合计	228,924.77

注：其他为申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	31,451,387.35
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	31,451,387.35

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	542,042,692.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	503,433,140.58
减：应收利息总额	7,158,164.84
买卖债券差价收入	31,451,387.35

##### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

**6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

注：无。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

**6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

**6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2017年1月1日至2017年6月30日
外汇远期投资收益	7,384,258.36
股指期货-投资收益	-

**6.4.7.17 股利收益**

注：无。

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-12,473,243.37
——股票投资	-
——债券投资	-11,398,329.93
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-1,074,913.44
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-17,572,681.43
合计	-30,045,924.80

注：其他为外汇远期公允价值变动收益。

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	241,228.70
其他	199,087.08
合计	440,315.78

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	97.43
银行间市场交易费用	-
合计	97.43

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	470.69
合计	208,745.58

**6.4.7.22 分部报告**

无。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

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。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
香港上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例	回购成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例
国信证券	-	-	300,000,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 基金交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,618,417.66	5,457,390.20
其中：支付销售机构的客户维护费	4,831,976.59	2,322,890.41

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1.00%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30
----	------------------------	--------------------------------

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	3,485,525.28	1,637,217.05

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.30%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

##### 6.4.10.4.2 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本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。

#### 6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
汇丰银行	218,790,653.42	27,388.15	184,997,634.36	-
中国工商银行	102,640,134.01	197,190.43	200,217,718.82	267,127.82

注：本基金的银行存款主要由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

## 鹏华全球高收益债(QDII)

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2017年 1月6日	2017年1月5 日	0.600	35,802,192.56	42,465,338.52	78,267,531.08	
2	2017年 2月15 日	2017年2月14 日	0.500	28,398,200.45	40,287,403.31	68,685,603.76	
3	2017年 3月31 日	2017年3月30 日	0.495	28,664,963.65	45,635,759.10	74,300,722.75	
合计	-	-	1.595	92,865,356.66	128,388,500.93	221,253,857.59	

## 鹏华全球高收益债美元现汇

金额单位：美元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2017年 1月6日	2017年1月5日	0.087	2,462,441.45	1,554,162.58	4,016,604.03	
2	2017年 2月15 日	2017年2月14 日	0.073	2,073,991.63	1,828,414.42	3,902,406.05	
3	2017年 3月31 日	2017年3月30 日	0.072	1,999,959.86	2,214,634.31	4,214,594.17	
合计	-	-	0.232	6,536,392.94	5,597,211.31	12,133,604.25	

## 6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资债券等固定收益类金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人会在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行



中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券占基金净值比 84.58%（2016 年 12 月 31 日：56.50%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%，本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，或通过场外的交易方式变现，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，所有已售出而未回购证券总市值不得超过本基金总资产的 50%。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6 月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	321,430,787.43	-	-	-	321,430,787.43
交易性金融资产	752,959,899.44	520,786,581.85	641,913,159.06	12,183,080.96	1,927,842,721.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	24,987,608.56	24,987,608.56
应收申购款	-	-	-	1,943,424.34	1,943,424.34
应收证券清算款	-	-	-	36,964,640.48	36,964,640.48
其他资产	-	-	-	29,214.61	29,214.61
资产总计	1,074,390,686.87	520,786,581.85	641,913,159.06	76,107,968.95	2,313,198,396.73
负债					
衍生金融负债	-	-	-	7,926,048.00	7,926,048.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	37,372,275.38	37,372,275.38
应付管理人报酬	-	-	-	1,942,339.32	1,942,339.32
应付托管费	-	-	-	582,701.78	582,701.78
其他负债	-	-	-	424,807.99	424,807.99
负债总计	-	-	-	48,248,172.47	48,248,172.47

利率敏感度缺口	1,074,390,686.87	520,786,581.85	641,913,159.06	27,859,796.48	2,264,950,224.26
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	417,947,028.20	-	-	-	417,947,028.20
交易性金融资产	794,377,882.91	643,608,205.51	226,492,048.01	13,257,994.40	1,677,736,130.83
衍生金融资产	-	-	-	9,669,709.88	9,669,709.88
应收利息	-	-	-	28,875,610.76	28,875,610.76
应收申购款	-	-	-	34,148,341.91	34,148,341.91
应收证券清算款	-	-	-	2,830,594.08	2,830,594.08
其他资产	-	-	-	4,114,029.33	4,114,029.33
资产总计	1,212,324,911.11	643,608,205.51	226,492,048.01	92,896,280.36	2,175,321,444.99
负债					
衍生金融负债	-	-	-	145,677.00	145,677.00
应付证券清算款	-	-	-	7,424,825.24	7,424,825.24
应付赎回款	-	-	-	13,980,381.80	13,980,381.80
应付管理人报酬	-	-	-	1,752,036.27	1,752,036.27
应付托管费	-	-	-	525,610.89	525,610.89
其他负债	-	-	-	526,897.28	526,897.28
负债总计	-	-	-	24,355,428.48	24,355,428.48
利率敏感度缺口	1,212,324,911.11	643,608,205.51	226,492,048.01	68,540,851.88	2,150,966,016.51

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	市场利率下降25个基点	18,169,316.74	13,381,114.16
市场利率上升25个基点	-18,165,087.72	-13,377,825.92	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	193,817,538.01	26,714.12	36,588,690.36	230,432,942.49
交易性金融资产	1,788,010,510.39	10,873,110.82	118,954,500.10	1,917,838,121.31
应收利息	23,748,360.40	8,968.50	1,224,649.14	24,981,978.04
应收申购款	481,561.61	-	-	481,561.61
应收证券清算款	36,964,640.48	-	-	36,964,640.48
其它资产	29,214.60	-	-	29,214.60
资产合计	2,043,051,825.49	10,908,793.44	156,767,839.60	2,210,728,458.53
以外币计价的负债				
衍生金融负债	7,926,048.00	-	-	7,926,048.00
应付赎回款	1,786,173.40	-	-	1,786,173.40
其它负债	782.10	-	-	782.10
负债合计	9,713,003.50	-	-	9,713,003.50
资产负债表外汇风险敞口净额	2,033,338,821.99	10,908,793.44	156,767,839.60	2,201,015,455.03
项目	上年度末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	389,562,970.96	11,181.38	7,306,800.00	396,880,952.34

交易性金融资产	1,471,026,415.69	1,774,976.19	80,920,069.95	1,553,721,461.83
应收利息	24,245,426.78	4,969.50	2,513,589.25	26,763,985.53
应收申购款	20,072,403.60	-	-	20,072,403.60
应收证券清算款	2,830,594.08	-	-	2,830,594.08
其它资产	4,114,029.33	-	-	4,114,029.33
资产合计	1,911,851,840.44	1,791,127.07	90,740,459.20	2,004,383,426.71
以外币计价的负债				
衍生金融负债	145,677.00	-	-	145,677.00
应付赎回款	850,324.00	-	-	850,324.00
应付证券清算款	7,424,825.24	-	-	7,424,825.24
其它负债	391.52	-	-	391.52
负债合计	8,421,217.76	-	-	8,421,217.76
资产负债表外汇风险敞口净额	1,903,430,622.68	1,791,127.07	90,740,459.20	1,995,962,208.95

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类与权重，并定期进行回顾和动态调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；对高收益债券的投资比例不低于固定收益类资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	12,183,080.96	0.54	13,257,994.40	0.62
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,183,080.96	0.54	13,257,994.40	0.62

注：本基金本期末和上年度末均未持有交易性权益类投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	42,087,628.01	2,602,162.62
	业绩比较基准下降5%	-42,087,628.01	-2,602,162.62

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	12,183,080.96	0.53
3	固定收益投资	1,915,659,640.35	82.81
	其中：债券	1,915,659,640.35	82.81
	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	321,430,787.43	13.90
8	其他各项资产	63,924,887.99	2.76
9	合计	2,313,198,396.73	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：无。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：无。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注：无。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 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

注：无。

### 7.5.2 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

注：无。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：无。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
B+至 B-	388,048,826.70	17.13
BB+至 BB-	627,365,135.05	27.70
BBB+至 BBB-	223,139,752.27	9.85
CCC+至 CCC-	14,211,624.34	0.63
未评级	662,894,301.99	29.27
合计	1,915,659,640.35	84.58

注：上述债券投资组合主要适用标准普尔、穆迪、惠誉等国际权威机构评级。

## 7.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	VW 3 1/2 12/29/49	VOLKSWAGEN INTL FIN NV	160,000	118,954,500.10	5.25
2	KAISAG 6.56 12/31/21	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	138,936	94,272,338.36	4.16
3	BAC 8 07/29/49	BANK OF AMERICA CORP	120,750	84,233,638.17	3.72
4	BACR 6 5/8 06/29/49	BARCLAYS PLC	115,000	79,568,105.50	3.51
5	AGILE 8 1/4 01/29/49	AGILE PROPERTY HLDGS LTD	95,000	65,305,419.23	2.88

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。



**7.9 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**

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	远期投资	1年远期(EUR兑USD)	-7,926,048.00	-0.35

**7.10 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	PROSHARES SHORT 20+ TREASURY	债券型	ETF 基金	Proshares Trust	12,183,080.96	0.54

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1**

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。

**7.11.2**

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。

**7.11.3 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	36,964,640.48
3	应收股利	-
4	应收利息	24,987,608.56
5	应收申购款	1,943,424.34
6	其他应收款	29,214.61
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,924,887.99

#### **7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：无。

#### **7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：无。

#### **7.11.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
85,460	23,881.84	138,103,509.71	6.77%	1,902,838,271.36	93.23%

### 8.2 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	3,010,468.73	0.1475%

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。

### 8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
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	合计	50~100
基金基金经理持有本开放式基金	合计	0

注：（1）截至本报告期末，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。

（2）截至本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 10 月 22 日）基金份额总额	310,994,086.08
本报告期期初基金份额总额	1,726,034,703.49
本报告期基金总申购份额	806,363,515.39
减：本报告期基金总赎回份额	491,456,437.81
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	2,040,941,781.07

注：总申购份额含红利再投份额，本基金份额变动含鹏华全球高收益债（QDII）人民币、美元现汇份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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，经公司董事会审议通过，公司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。

基金托管人的重大人事变动：

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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

注：1、本基金本报告期未通过券商交易单元进行股票交易、权证交易、基金交易。

2、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。

### 10.7.2 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
UBS	93,033,727.80	7.15%	-	-	-	-	-	-
BARCLAY	109,553,312.67	8.42%	-	-	-	-	-	-
JPM	103,662,956.39	7.97%	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch International	149,259,970.88	11.47%	-	-	-	-	-	-
CS	22,480,029.00	1.73%	-	-	-	-	-	-
海通国际	10,469,543.40	0.80%	-	-	-	-	-	-
CITI	184,096,702.14	14.15%	-	-	-	-	-	-
虚拟券商	300,950,870.79	23.13%	-	-	-	-	-	-

MS	100,415,465.40	7.72%	-	-	-	-	-	-
SC Lowy	6,705,909.60	0.52%	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	114,898,393.73	8.83%	-	-	-	-	-	-
gt.ja	8,251,324.60	0.63%	-	-	-	-	-	-
GS	97,106,730.06	7.46%	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与张家港农村商业银行柜面和电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月3日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行“2017倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月3日
3	鹏华基金管理有限公司关于鹏华全球高收益债债券型证券投资基金2016年第4次分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月3日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京肯特瑞财富投资管理有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月10日
5	鹏华基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月10日
6	鹏华基金管理有限公司关于鹏华全球高收益债债券型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月12日
7	鹏华基金管理有限公司关于增加广州农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月16日
8	2016年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月19日
9	鹏华基金管理有限公司关于鹏华全球高收益债债券型证券投资基金2017年第1次分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年2月10日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2017年2月23日

	部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	海证券报》、《证券时报》	
11	鹏华基金管理有限公司关于增加民生证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月1日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月20日
13	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月23日
14	鹏华基金管理有限公司关于鹏华全球高收益债债券型证券投资基金2017年第2次分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月28日
15	鹏华基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月30日
16	2016年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月30日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与张家港农村商业银行柜面和电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月31日
18	鹏华基金管理有限公司关于鹏华全球高收益债债券型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月12日
19	鹏华基金管理有限公司关于增加中国农业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月18日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月22日
21	2017年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月24日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广州农村商业银行基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月29日



23	鹏华基金管理有限公司关于鹏华全球高收益债债券型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年5月24日
24	鹏华基金管理有限公司关于调整鹏华全球高收益债债券型证券投资基金美元现汇份额单笔最低申购金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年5月25日
25	鹏华全球高收益债债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年6月1日
26	关于鹏华全球高收益债债券型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年6月20日
27	鹏华基金管理有限公司关于网上直销交易系统升级切换及启用新版网上直销交易系统的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年6月27日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华全球高收益债债券型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华全球高收益债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告》（原文）。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 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

### 12.3 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，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com>）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：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日