

# 鹏华全球高收益债债券型证券投资基金

## 2015] 第四季度报告

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:2016年1月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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法律责任。

基金托管人的董事会及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法律责任。

基金销售机构承诺以诚实信用、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未来表现。投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

报告期间内财务资料未经审计。

报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华全球高收益债(ODDI)
场内简称	-
基金主代码	000230
交易代码	000230
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年10月22日
报告期末基金份额总额	194,303,700.44份

投资目标

通过分析全球各地区的宏观经济情况以及各经济体的微观基本面，通过精选的资产配置，力争获取较高的投资回报。

投资策略

根据对不同国家和地区的宏观经济情况，通过分析其宏观经济指标，力争获取较高的投资回报。

业绩比较基准

人民币计价的高收益债指数(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，预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金。

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

境外投资顾问

英文名称: The Hongkong and Shanghai Banking Corporation

中文名称: 香港上海汇丰银行有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期( 2015年10月1日 - 2015年12月31日 )

1本期实现收益 2,796,107.41

2本期利润 7,072,971.33

3加权平均基金份额本期利润率 61.04%

4期末基金资产净值 232,822,773.44

5期末基金份额净值 1.196

注:1.本期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的利息收入、本期公允价值变动收益。

2.所本基金业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)，计算后实际收益水平要低于所列示数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告期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

鹏华全球高收益债(ODDI)

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 6.21% 0.26% 2.63% 0.36% 3.65% -0.13%

注:业绩比较基准是以人民币计价的花旗国际高收益债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:1.鹏华全球高收益债基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同于2013年1月22日正式生效，2015年9月18日鹏华全球高收益债美元现份额成立。

2.截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达本基金合同中规定的各项比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

尤柏洋 基金基金经理 2014年8月30日 - 11

注:1.在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;由任新成立基金基金经理的,任职日期即为基金成立之日。

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 独立投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:无。

4.3 报告期内本基金运作合规声明

报告期内,本基金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 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生过因异常交易行为而对基金财产造成损失的异常交易行为。

4.5 报告期内基金运作费用情况说明

报告期内,本基金运作费用严格按照基金合同的规定,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.6 报告期内基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:2.鹏华全球高收益债基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

2.所本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告期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

鹏华全球高收益债(ODDI)

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.27% 1.61% 18.95% 1.62% -1.28% -0.01%

注:业绩比较基准=上证民营企业50指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:3.鹏华全球高收益债基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

2.所本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告期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

鹏华全球高收益债(ODDI)

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.27% 1.61% 18.95% 1.62% -1.28% -0.01%

注:业绩比较基准=上证民营企业50指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:4.鹏华全球高收益债基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

2.所本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告期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

鹏华全球高收益债(ODDI)

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.27% 1.61% 18.95% 1.62% -1.28% -0.01%

注:业绩比较基准=上证民营企业50指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:5.鹏华全球高收益债基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

2.所本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告期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

鹏华全球高收益债(ODDI)

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.27% 1.61% 18.95% 1.62% -1.28% -0.01%

注:业绩比较基准=上证民营企业50指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:6.鹏华全球高收益债基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

2.所本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告期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

鹏华全球高收益债(ODDI)

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.27% 1.61% 18.95% 1.62% -1.28% -0.01%

注:业绩比较基准=上证民营企业50指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:7.鹏华全球高收益债基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

2.所本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告期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

鹏华全球高收益债(ODDI)

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.27% 1.61% 18.95% 1.62% -1.28% -0.01%

注:业绩比较基准=上证民营企业50指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:8.鹏华全球高收益债基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

2.所本基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告期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

鹏华全球高收益债(ODDI)

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 17.27% 1.61% 18.95% 1.62% -1.28% -0.01%

注:业绩比较基准=上证民营企业50指数

3.2.2 自基金合同生效以来基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:9.鹏华全球高收益债基金业指标与同期业绩比较基准收益率变动的比较