（上接B29版）

客服热线：4006662288
网址：www.jhzq.com.cn
47）华西证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市陕西街239号
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼
法定代表人：杨炯洋
联系人：谢国梅
联系电话：010-68716150
传真：028-86150615
客户服务咨询电话 ：400-8888-818
网址：www.hx168.com.cn
48）红塔证券股份有限公司
注册地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人：况雨林
联系人：刘晓明
电话：0871- 3577942
客户服务电话：0871-3577930
网址：www.hongtazq.com
49）长城国瑞证券有限公司
注册地址：福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
办公地址：福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
法定代表人：王勇
电话：0592-5161642
传真：0592-5161140
联系人：卢金文
客户服务热线：0592-5163588
网址：www.xmzq.cn
50）银泰证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道１８号光大银行大厦１８楼
办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道１８号光大银行大厦１８楼
法定代表人：高颂
联系人：林文宇
联系电话：0755-83703759
咨询电话：0755-83710885
公司网址：www.ytzq.net
51）华宝证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人：陈林
联系人：刘闯川
客户服务电话：400-820-9898
网址：www.cnhbstock.com
52）爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：张建华
电话：（021）32229888
传真：（021）68728703
联系人：戴莉丽
客户服务电话：（021）63340678
网址：www.aizq.com
53）国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：刘婧漪
电话：028-86690057
传真：028-86690126
服务热线：4006-600109
公司网站：www.gjzq.com.cn
54）信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9 号院1 号楼信达金融中心
办公地址：北京市西城区闹市口大街9 号院1 号楼信达金融中心
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-63080985
客服热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com
55）华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市东岗路638号财富大厦
法定代表人：李晓安
电话：0931-8888088
传真：0931-4890515
联系人：李昕田
客户服务电话：0931-4890619，4890618，4890100
网址：www.hlzqgs.com
56）民生证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表：余政
联系人：赵明
电话：010－85127622
服务热线：400－619－8888
公司网站：www.mszq.com
57）华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
邮政编码：350003
联系人：张鹏
联系电话：0591-87383623
业务传真：0591-87383610
统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）。
公司网址：www.hfzq.com.cn
58）东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表：徐勇力
联系人：汤漫川
电话：010-66555316
服务热线：4008888993
公司网站：www.dxzq.net
59）国海证券股份有限公司
注册地址：广西南宁市滨湖路46号国海大厦
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3F
法定代表人：张雅锋
联系电话：0755－83709350
传真：0755－83704850
联系人：牛孟宇
网址：www.ghzq.com.cn
60）五矿证券有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
法定代表人：高竹
联系电话：0755-82545555
传真：0755-82545500
联系人：赖君伟
网址：www.wkzq.com.cn
61）西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
联系人：张煜
联系电话：023-63786141
客户服务电话：4008096096
传真：023-63786212
网址：www.swsc.com.cn
62）新时代证券有限责任公司
注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
联系人：马俊杰
电话：010-83561329
传真：010-83561094
邮编：100086
客户服务电话：4006989898
公司网址：www.xsdzq.cn
63）华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：上海市肇嘉浜路750号
法定代表人：俞洋
联系人：陈敏
电话：021-64339000
传真：021-54668802
客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918
网址：www.cfsc.com.cn
64）联讯证券股份有限公司
注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广电大楼三、四层
办公地址：北京市朝阳区红旗营南路天畅园6号楼二层
法定代表人：徐刚
联系人：张悦
电话：010-64408820
传真：010-64408834
客户服务电话：95564
网址：www.lxzq.com.cn
65）天风证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人：余磊
联系人：崔成
电话：027-87610052
传真：027-87618863
客户服务电话：4008005000
网址：http://www.tfzq.com
66）中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人：丁学东
电话：010-65051166
传真：010-85679203
联系人：杨涵宇
客户服务电话：400-910-1166
网址：www.ccc.com.cn
67）开源证券股份有限公司
注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
客户服务电话：400-860-8866
联系电话：029-63387256
联系人：黄芳
网址：www.kysec.cn
（3）期货公司销售机构
1）中信建投期货有限公司
注册地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B，名义层11-A，8-B4，9-B、C
办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人：彭文德
客户服务电话：400-8877-780
联系电话：023-86769742
联系人：谭忻
网址：www.cfc108.com
2）中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
客服电话：400-990-8826
联系人：洪波
联系电话：0755-23953913
公司网站：www.citicsf.com
（4）第三方销售机构
1）北京恒天明泽基金销售有限公司
住所：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
法定代表人：黄永伟
联系人：侯仁凤
联系电话：010-57756068
客服电话：400-786-8868
网址：www.chtfund.com
2）北京增财基金销售有限公司
住所：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人：王昌庆
联系人：罗细安
联系电话：010-67000988
客服电话：400-001-8811
网址：www.zcvc.com.cn
3）北京展恒基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人：闫振杰
联系人：马林
传真：010-62020355
客服电话：4008188000
网址：www.myfund.com
4）杭州数米基金销售有限公司
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
客服电话：4000-766-123
传真：0571-26698533
联系人：周嫌旻
网址：www.fund123.cn
5）和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：于扬
联系电话：021-20835888
客服电话：400-920-0022
网址：licaike.hexun.com
6）上海好买基金销售有限公司
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903～906室
住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人：杨文斌
客服电话：400-700-9665
传真：021-50325989
联系人：陶怡
网址：www.ehowbuy.com
7）上海陆金所资产管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：何雪
联系电话：021-20662010
客服电话：4008219031
网址：www.lu.com
8）上海天天基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人：其实
联系人：高莉莉
联系电话：020-87599527
客服电话：4001818188
网址：www.1234567.com.cn
9）上海长量基金销售投资顾问有限公司
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
客服电话：400-089-1289
传真：021-58787698
联系人：刘琼
电话：021-58788678-8201
传真：021—58787698
客服电话：400-089-1289
公司网站：www.erichfund.com
10）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人：马令海
联系人：邓洁
联系电话：010-58321388-1105
客服电话：010-58325327
网址：rjj.xinlande.com.cn
11）深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
客服电话：4006-788-887
传真：0755-82080798
联系人：邓爱萍
网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com
12）天相投资顾问有限公司
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
客服电话：010-66045678
传真：010-66045527
联系人：林爽
网址：www.txsec.com
13）珠海盈米财富管理有限公司
住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
联系电话：020-89629099
客服电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn
（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：崔巍
联系电话：010-59378856
传真：010-59378907
（三）律师事务所与经办律师
名称：北京市德恒律师事务所
注册（办公）地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层
负责人：王丽
电话：（010）66575888
传真：（010）65232181
联系人：苏文静
经办律师：陈静茹、苏文静
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：陈熹
经办注册会计师：单峰、陈熹

四、基金的名称

本基金名称：鹏华普天系列开放式证券投资基金。

五、基金的运作方式及类型

（一）本基金运作方式：契约型开放式
（二）本基金类型：
1、普天债券基金（A类、B类）：债券基金
2、普天收益基金：混合基金

六、基金的投资目标

普天债券基金以分享中国经济成长和资本长期稳健增值为宗旨，主要投资于债券及新股配售和增发，在充分控制风险的前提下实现基金财产的长期稳定增值。

普天收益基金以分享中国经济成长和资本长期稳健增值为宗旨，主要投资于连续现金分红股票及债券，通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金财产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本系列基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，普天债券基金投资于债券和参与新股配售和增发；普天收益基金投资于连续分红的股票和债券，对连续分红企业的投资不少于股票资产的80%。

八、基金的投资策略

（一）基金的投资策略
1、普天债券基金投资策略
（1）为保证明确的投资风格，普天债券基金设定了稳定的仓位比例。在正常市场状况下，本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%，股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。
（2）债券投资策略：
①确定债券投资组合的目标久期
利率水平的变化对债券投资的回报会产生巨大的影响，但我们认为没有人能够对其趋势作出持续和精确的预测。鉴于利率预测错误可能增加投资组合的风险从而导致业绩表现恶化，我们不对其作赌注式的投资。为控制风险，我们采用以“目标久期”为中心的资产配置方式。本系列基金以收益率与安全性为导向进行配置。
②确定期限结构配置
各类债券资产在期限结构上的配置是我们所选择的收益率曲线策略在资产配置过程中的具体体现。其做法是，根据我们对收益率曲线形状的变化预期，采用总收益分析法在下述的三种基础类型中进行选择：
a.子弹组合：即使组合的现金流集中在投资期到期日附近；
b.杠铃组合：即使组合的现金流尽量呈两极分布；
c.梯形组合：即使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。
③确定类属配置
债券资产在类属间的配置是收益率利差策略在资产配置过程中的具体体现，系根据国债、金融债、政府保证公司债券、其它高质量的公司债券以及可转换债券之间的相对价值决定。我们考察它们的相对价值以等价税后收益为基础，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类属收益的基本面分析。
④个券选择
由基金小组通过“利率期限结构模型”拟合出市场即期利率曲线和市场预期的远期利率曲线，再根据对宏观经济、替代市场、利差因素以及技术因素等方面的分析预测不同情景下的远期利率曲线，然后对债券进行绝对收益和相对收益分析并归类，最后得出普天债券基金的投资组合。
（3）股票投资方法：
参与新股配售和增发。
2、普天收益基金投资策略
（1）为保持明确的投资风格，普天收益基金设定了稳定的仓位比例。在正常市场状况下，股票投资比例一般情况下为70%，国债投资比例不低于20%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资不低于基金资产净值的5%。
（2）债券投资方法：
普天收益基金债券投资的目的是降低组合总体波动性从而改善组合风险构成。但在债券的投资上，则采取积极主动的投资策略，不对持续期作限制。持续期、期限结构、类属配置以及个券选择的动态调整都将是我们获得超额收益的重要来源。
（3）股票投资方法：
具有以下特点的上市公司是普天收益基金重点关注的对象：
①上市公司注重分红，三年内已有两年分红记录，其中重点选择连续两年分红的公司；
②上市公司所处行业发展状况良好，在本行业内处于领先地位；
③上市公司财务状况良好，盈利能力较强且资产质量较好，业绩真实并且具有持续增长潜力；
④上市公司治理结构规范，管理水平较高，有较强的技术开发和市场拓展能力。
普天收益基金建立了一套收益型公司选择体系，将股票选择分为四个步骤：
①收益型上市公司初选。重点选择在近三年内有两年分红记录的上市公司，总数约为700家。
②财务评级。对第一步选出的收益型上市公司进行财务评级，选出资产质量和赢利能力较好的上市公司进入下一步骤评级。
③综合评判。在此阶段侧重于基本面的考察，由于财务评级更多的是代表公司过去的经营状况，因此通过财务评级筛选出的上市公司还要进行基本面的考察。
④投资组合构建：通过对上市公司财务评级和基本面考察之后就基本选出了基金的股票备选库，总数约为350家左右。基金经理小组再进一步分析其二级市场情况，主要考察P/E/G、市值、价格等因素，最后得出普天收益基金的投资组合，总数约为100家。
普天收益基金主要采用积极管理的投资方式。以鹏华股票池中连续两年分红股票以及三年内有两年分红记录的公司作为投资对象，适当集中投资。所有重点投资股票必须经过基金经理/研究员的实地调研，就企业经营、融资计划、分红能力、绝对价值、相对价值给出全面评估报告。
（二）基金投资决策
1、决策依据
（1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
（2）国内国际宏观经济环境、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、国家产业政策；
（3）各行业发展状况、市场波动和风险特征；
（4）上市公司研究，包括上市公司成长性的研究和市场走势；
（5）证券市场走势。
2、投资决策与交易流程
（1）投资决策委员会：确定本系列基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，由委员会负责人或指定人员召集。如需做出及时重大决策或基金经理小组提议，可临时召开投资决策委员会会议。
（2）研究部：对于宏观经济、行业、上市公司、投资策略、金融工程、可投资股票备选库的建立与完善、投资风险控制与基金绩效评估等与投资决策有关的内容进行全面深入的研究，作为投资决策的依据。
（3）基金管理小组：构建和调整投资组合。构建和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。
（4）集中交易室：基金经理向集中交易室下达投资指令，集中交易室经理向交易员分配指令，交易员执行交易指令。
（5）金融工程师：对开放式基金投资组合进行评估，向基金管理小组提出调整建议。
（6）监察稽核部：对投资程序的合法合规性进行监控。

九、基金的业绩比较基准

1、普天债券基金的业绩比较基准是“中证综合债指数收益率”。
2、普天收益基金业绩比较基准是“沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%”。

十、基金的风险收益特征

普天债券基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金。

普天收益基金属于证券投资基金中的中等风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金，高于指数型基金、纯债券基金和国债。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

本系列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责任。

本系列基金的托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中所列财务数据截至2015年12月31日（未经审计）。

（一）普天债券基金
1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	28,268,000.00	2.56
	其中：股票	28,268,000.00	2.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	731,793,654.20	66.35
	其中：债券	731,793,654.20	66.35
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,845,686.43	2.52
8	其他资产	315,041,383.73	28.56
9	合计	1,102,948,724.36	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,460,000.00	0.49
C	制造业	5,364,000.00	0.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	18,444,000.00	2.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,268,000.00	3.11

3、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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	1,000,000	9,640,000.00	1.06
2	601318	中国平安	200,000	7,200,000.00	0.79
3	603993	洛阳钼业	1,000,000	4,460,000.00	0.49
4	600875	东方电气	300,000	4,089,000.00	0.45
5	601988	中国银行	400,000	1,604,000.00	0.18
6	000425	徐工机械	300,000	1,275,000.00	0.14

注：以上为本基金本报告期末持有的所有股票。
4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	201,129,000.00	22.12
	其中：政策性金融债	201,129,000.00	22.12
4	企业债券	324,358,753.40	35.67
5	企业短期融资券	200,196,000.00	22.02
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,109,900.80	0.67
8	回业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	731,793,654.20	80.48

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	011599826	15厦国资SCP009	800,000	80,088,000.00	8.81
2	011599884	15陕煤化SCP009	800,000	80,000,000.00	8.80
3	150318	15进出18	500,000	50,120,000.00	5.51
4	150202	15国开02	500,000	50,060,000.00	5.51
5	124146	13海发控	395,240	41,591,105.20	4.57

6、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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8、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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
（1）本期国债期货投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
（3）本期国债期货投资评价
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
10、投资组合报告附注
（1）本基金投资的前十名证券之一的12山鹰债的发行主体安徽山鹰纸业股份有限公司（简称“山鹰纸业”）于2015年12月18日发布公告，称公司因违规关联交易事项，于2015年7月1日收到中国证监会安徽监管局下发的行政监管措施决定书。
对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该债券发行人，认为山鹰纸业主营业务经营较为稳定，上述行政监管措施决定书中涉及的问题不会对山鹰纸业的财务状况及经营成果产生实质性影响。本次行政监管措施对该证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。
本基金投资的前十名证券中的其它证券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。
（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。
（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,540.96
2	应收证券清算款	99,227,662.75
3	应收股利	-
4	应收利息	14,567,390.00
5	应收申购款	201,222,790.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	315,041,383.73

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	167,493.60	0.02

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末持有前十名股票不存在流通受限情况。
（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。
（二）普天收益基金
1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	507,019,702.97	68.87
	其中：股票	507,019,702.97	68.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	150,326,000.00	20.42
	其中：债券	150,326,000.00	20.42
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	75,336,858.91	10.23
8	其他资产	3,500,762.74	0.48
9	合计	736,183,324.62	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	565,837.68	0.08
B	采矿业	311,524.00	0.04
C	制造业	249,352,769.71	35.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	236,186.20	0.03
E	建筑业	38,752,447.47	5.50
F	批发和零售业	408,776.09	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	352,363.00	0.05
H	住宿和餐饮业	13,730,615.00	1.95
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,818,876.86	7.79
J	金融业	1,797,798.62	0.26
K	房地产业	76,281,885.20	10.83
L	租赁和商务服务业	237,743.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	24,007.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	624,900.03	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,342,422.26	3.32
R	文化、体育和娱乐业	46,181,550.65	6.56
S	综合	-	-
	合计	507,019,702.97	72.01

3、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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300198	纳川股份	2,580,000	40,583,400.00	5.76
2	000802	北京文化	1,000,000	33,880,000.00	4.81
3	600602	仪电电子	2,500,000	31,975,000.00	4.54
4	600860	京城股份	2,463,209	31,800,028.19	4.52
5	002530	丰东股份	2,000,079	29,981,184.21	4.26
6	000890	法尔胜	1,999,905	27,538,691.85	3.91
7	002368	太极股份	399,991	26,839,396.10	3.81
8	300244	迪安诊断	335,669	23,342,422.26	3.32
9	002543	万和电气	1,162,490	21,168,942.90	3.01
10	600986	科达股份	1,000,000	21,000,000.00	2.98

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	150,326,000.00	21.35
	其中：政策性金融债	150,326,000.00	21.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	回业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	150,326,000.00	21.35

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150416	15农发16	1,100,000	110,253,000.00	15.66
2	150403	15农发03	300,000	30,060,000.00	4.27
3	150215	15国开15	100,000	10,013,000.00	1.42

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。
6、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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8、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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
（2）本基金投资股指期货的投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
（1）本期国债期货投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
（3）本期国债期货投资评价
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
11、投资组合报告附注
（1）组合投资的前十名证券之一的北京文化的发行主体北京京西文化旅游股份有限公司在2015年3月10日收到深圳证券交易所向公司出具的《关于对北京西文化旅游股份有限公司的关注函】（公司部关注函【2015】第95号），对公司在互动易平台上发布的信息与年报披露存在前后矛盾一事表示关注。2015年4月22日，深圳证券交易所向公司出具了《关于对北京京西文化旅游股份有限公司的关注函】（公司部关注函【2015】第172号），对公司已超过十天未在互动易平台上回答投资者的提问一事表示关注。2014年4月28日，深圳证券交易所向公司出具了《关于对北京京西文化旅游开发股份有限公司的年报问询函】（公司部年报问询函【2014】第140号），就公司2013年年报相关问题要求公司予以书面说明。2015年4月28日，深圳证券交易所向公司出具了《关于对北京京西文化旅游股份有限公司的年报问询函】（公司部年报问询函【2015】第99号），就公司2014年年报相关问题要求公司予以书面说明，并进行补充披露。

根据公司公告，最近五年，公司未被证券监管部门采取监管措施，公司被交易所出具监管函2次，关注函6次，年报问询函5次。公司已根相关要求进行答复并作出相应整改。本基金管理人长期跟踪研究该股票，该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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。
（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。
（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	403,518.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,498,567.31
5	应收申购款	598,676.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,500,762.74

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002530	丰东股份	29,981,184.21	4.26	重大事项
2	600986	科达股份	21,000,000.00	2.98	重大事项

（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。

十二、基金的业绩

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财产，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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
1、本系列基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示（本报告中所列财务数据未经审计）：
普天债券基金A类基金份额：

A类	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
2003年7月12日（基金合同生效日）至2003年12月31日	4.39%	0.17%	-1.55%	0.15%	5.94%	0.02%
2004年1月1日至2004年12月31日	-8.44%	0.55%	-3.59%	0.20%	-4.85%	0.35%
2005年1月1日至2005年12月31日	9.26%	0.38%	12.67%	0.13%	-3.41%	0.25%
2006年1月1日至2006年12月31日	8.68%	0.16%	1.99%	0.07%	6.69%	0.09%
2007年1月1日至2007年12月31日	9.55%	0.12%	-0.24%	0.07%	9.79%	0.05%
2008年1月1日至2008年12月31日	7.24%	0.10%	8.38%	0.09%	-1.14%	0.01%
2009年1月1日至2009年12月31日	4.33%	0.11%	0.92%	0.09%	3.41%	0.02%
2010年1月1日至2010年12月31日	5.97%	0.19%	2.56%	0.09%	3.41%	0.10%
2011年1月1日至2011年12月31日	2.75%	0.12%	4.02%	0.09%	-1.27%	0.03%
2012年1月1日至2012年12月31日	5.61%	0.10%	2.99%	0.04%	2.62%	0.06%
2013年1月1日至2013年12月31日	-0.80%	0.11%	0.96%	0.09%	-1.76%	0.02%
2014年1月1日至2