

B072 信息披露 | Disclosure

(上接B071版)

客户服务电话:065-48
网址: <http://9dclitics.com>
(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号上站大楼平面11-B, 名义层1-A, B-14, 9-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: 彭文涛
联系人: 刘雯
客户服务电话: 400-8577-700
网址: www.cfc10.com
2) 中信期货有限公司
注册地址: 广东省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、14层
办公地址: 广东省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、14层
法定代表人: 张皓
联系人: 刘宏莹
客户服务电话: 400-990-8826
网址: www.citit.com
(4) 第三方销售机构
1) 北京百度盈益基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区上地十街10号百度大厦二层
办公地址: 北京市海淀区上地十街10号
法定代表人: 梁志远
联系人: 王笑宇
客户服务电话: 95065
网址: <https://www.baoyingfund.com/>
2) 北京壹卷基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层22207
办公地址: 北京市朝阳区三里SOHO T3A座19层
法定代表人: 钟奕棠
联系人: 戚晓强
客户服务电话: 400-159-9288
网址: danjuanapp.com
3) 北京航天明泽基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区经济技术开发区宏达北路10号5层B122室
办公地址: 北京市海淀区经济技术开发区宏达北路10号5层B122室
法定代表人: 黄永伟
联系人: 侯仁凤
客户服务电话: 400-8980-618
网址: www.chfund.com
4) 北京汇成基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人: 王炜明
联系人: 王璐晓
客户服务电话: 400-619-9069
网址: www.hcjin.com
5) 北京肯瑞德基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区中关村东路96号1号楼22层2903-06
办公地址: 北京市大兴区兴济经济开发区科创十一街18号院京企总部A座17层
法定代表人: 江卉
联系人: 韩朝军
客户服务电话: 95118
网址: fund.jd.com
6) 北京浦领耀华基金销售有限公司
注册地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2楼236室
办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室
法定代表人: 张冠宇
联系人: 王园仕
客户服务电话: 400-819-9888
网址: <http://www.tsfund.com/Index>
7) 北京新鑫合石基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区东北旺镇中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼6层618室
办公地址: 北京市海淀区东北旺镇中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼6层618室
法定代表人: 李昭琛
联系人: 吴昊
客户服务电话: 010-62765309
网址: www.xinso.com
8) 北京恒恒基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
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: 韩爱彬
客户服务电话: 4000-766-123
网址: www.fund123.com
9) 北京苏宁基金销售有限公司
注册地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人: 刘寅涛
联系人: 王隽
客户服务电话: 95177
网址: www.snjfund.com
14) 诺亚正行基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址: 上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人: 汪静波
联系人: 陈杰
客户服务电话: 400-821-5399
网址: www.noah-fund.com
15) 浦领基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区望京园四区13号楼A座9层908室
办公地址: 北京市朝阳区望京浦润中心A座9层04-08法定代表人: 李招弟
客户服务电话: 4008769888
网址: www.zscfund.com
16) 上海长量基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东新区东方路1287号11层
法定代表人: 张驭伟
联系人: 张珺琳
客户服务电话: 400-820-2899
网址: www.erichfund.com
17) 上海好实基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区欧政路196号26楼2楼41号
办公地址: 上海市浦东新区南1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法定代表人: 杨文斌
联系人: 王诗琦
客户服务电话: 400-700-9665
网址: www.howbuy.com
18) 上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址: 上海市西城区金融大街33号通泰大厦B座10层
法定代表人: 李一梅
联系人: 伊秋明
客户服务电话: 400-817-5666
网址: www.amcfund.com
19) 上海惠基基金销售有限公司
注册地址: 上海市崇明县长兴镇潘公桥1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)

网址: www.huifund.com.cn
21) 上海陆金所基金销售有限公司
注册地址: 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: 陈睿洲
客户服务电话: 400-821-9031
网址: www.lu.com
22) 上海天天基金销售有限公司
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2楼2层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号32层10楼
法定代表人: 其实
联系人: 高莉莉
客户服务电话: 400-1818-188
网址: www.1234567.com.cn
23) 上海挖财基金销售有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02/03室
办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02/03室
法定代表人: 胡洪亮
联系人: 李海峰
客户服务电话: 021-50810673
网址: www.wacaijin.com
24) 上海万得基金销售有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址: 上海市浦东新区浦明路1500万得大厦7楼
法定代表人: 尹丹
联系人: 徐亚男
客户服务电话: 400-799-1888
网址: www.52fund.com.cn
25) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址: 深圳市福田区福田街道福民田路178号华融大厦27层2704
办公地址: 北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人: 马勇
联系人: 文雯
客户服务电话: 400-166-1188
网址: 8.jr.com.cn
26) 深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区梨园岗路物资控股置地大厦8楼
办公地址: 深圳市罗湖区笋岗街道梨园岗路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人: 薛峰
联系人: 邓爱华
客户服务电话: 4006-788-887
网址: www.zlfund.cn; www.jimwm.com
27) 天相投资顾问有限公司
注册地址: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址: 北京市西城区新街口外大街28号C座506室
法定代表人: 林义相
联系人: 邵娟
客户服务电话: 010-66045678
网址: www.txj.com.cn/
28) 宜信泽信(北京)基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区建国路89号9号楼15层1809
办公地址: 北京市朝阳区建国路89号SOHO现代城C1809
法定代表人: 戎兵
联系人: 魏晨
客户服务电话: 400-6099-200
网址: www.yixinfund.com
29) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
办公地址: 杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大厦
法定代表人: 凌顺平
联系人: 吴昊
客户服务电话: 4008773772
网址: www.5ifund.com
30) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号106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: 黄敏娜
客户服务电话: 020-89629066
网址: www.yinqm.com

基金管理人可根据有关法律法规要求, 根据实际, 选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构, 并在基金管理人网站公告。

(二) 注册登记机构
名称: 中国证券登记结算有限责任公司
住所: 北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人: 周明
联系电话: 010-50938782
传真: 010-50938907
负责人: 赵亦清

(三) 律师事务所与经办律师
名称: 北京市德恒律师事务所
住所: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
法定代表人: 王丽
联系电话: 010-65231808
传真: 010-65232181

联系人: 徐芳
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4楼
法定代表人: 李丹
办公地址: 上海市湖滨路200号领展企业广场2楼普华永道中心11楼
联系电话: (021) 23238808
传真: (021) 23238800
联系人: 魏佳亮
经办会计师: 许康祺、陈露

四、基金名称
本基金名称: 鹏华普天系列开放式证券投资基金

五、基金的操作方式和类型
契约型开放式、混合型

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市场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市场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、基金的投资范围
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的上市股票、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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, 对连续分红的企业投资比例不低于股票资产的90%。

八、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%。现金类资产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%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
(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重大的影响, 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, 我们不对利率作趋势性的投资。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到期日附近;
b. 杠铃组合: 即组合的现金流尽量呈两端分布;
c. 梯形组合: 即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率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、其它高质量的债券以及可转换债券之间的相对价值决定。我们考察它们之间的相对价值以及税后收益为基础, 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债券选择
由债券小组通过“利率期限结构模型”拟合出当前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、利率因素以及技术因素等方面的分析, 最后得出市场预期的利率曲线, 然后对债券进行地对收益和相对收益分析并选择。
(3) 股票投资策略:
① 股票配置和增发
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, 股票投资比例一般维持在70%, 国债投资比例不低于20%, 现金类资产在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
(2) 债券投资策略:
普天收益基金投资的目的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, 不对持续性限购。持期限结构、类属配置以及个股选择的动态调整都是我们获得超额收益的重要来源。
(3) 股票投资策略:
具有以下特点上市公司是普天收益基金重点关注的对象:
①上市公司注册在沪, 三年内已有两年分红记录, 且其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个分红记录上市公司。
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, 选出财务质量和盈利能力较好的上市公司进入下一步评级。
③综合评价。在此阶段侧重于基本面的分析, 由于财务评级更多的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基金最佳选出了基金的股票备选库, 总数约为35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、市价、价格等因素, 最后得出普天收益基金的投资组合, 总数约为100-200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个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。

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+7%”。
2、普天收益基金业绩比较基准是“沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%”。

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大型基金, 高于指数型基金, 纯债类股票型基金。

十一、基金投资组合报告
(一) 普天收益基金
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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年7月15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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	396,362,477.77	70.08
2	其中: 股票	396,362,477.77	70.08
3	固定收益投资	101,250,528.00	18.69
4	其中: 债券	101,250,528.00	18.69
5	资产支持证券	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	18,294,476.17	3.32
8	其他资产	4,250,903.02	0.80
9	合计	519,858,384.96	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农林、牧、渔业	39,248,799.03	7.56
B	采矿业	259,483.76	0.05
C	制造业	271,489,798.46	52.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	23,799,252.02	4.58
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	信息传输、软件和信息技术服务业	16,795,263.26	3.22
I	金融业	7,272,399.69	1.42
J	房地产业	13,547,283.00	2.61
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	国防军工、装备制造业	--	--
P	医药生物	--	--
Q	其他行业	14,579,610.00	2.81
R	文、体、娱乐和休闲业	8,896,135.60	1.71
S	合计	396,362,477.77	77.16

(2) 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
(无)

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
(无)

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)	占基金总资产比例(%)
1	国债	62,564,224.00	12.05
2	国家开发银行	49,296,304.00	9.48
3	金融债	49,296,304.00	9.48
4	企业债	--	--
5	中期票据	--	--
6	地方政府债	--	--
7	可转换(可交换)债	--	--
8	其他	--	--
9	合计	101,250,528.00	19.56

5、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)	占基金总资产比例(%)
1	170009	17国债09	100,000	100,000.00	0.02
2	140213	14国债13	200,000	200,000.00	0.04
3	180032	18国债03	100,000	100,000.00	0.02
4	190031	19国债01	100,000	99,906.00	0.02
5	010107	01国债07	22,300	2,294,244.00	0.45

6、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资产支持证券投资明细
(无)

7、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
(无)

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十名权证投资明细
(无)

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
注: 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) 本期国债期货投资策略
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
(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)
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证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	76,026.06
2	应收证券清算款	2,496,893.96
3	应收股利	--
4	应收利息	1,522,074.21
5	应收申购款	6,999.21
7	待转资产	--
8	其他	--
9	合计	4,250,903.02

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
(无)

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
(无)

(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) 普天债券基金
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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年7月15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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	--	--
2	其中: 股票	--	--
3	固定收益投资	3,396,546,203.14	87.44
4	其中: 债券	3,396,546,203.14	87.34
5	资产支持证券	10,000,000.00	0.26
6	买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	363,100,004.00	9.30
8	其他资产	--	--
9	合计	4,526,116,207.00	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
(无)

(2) 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
(无)

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
(无)

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)	占基金总资产比例(%)
1	国债	62,564,224.00	12.05
2	国家开发银行	49,296,304.00	9.48
3	金融债	49,296,304.00	9.48
4	企业债	--	--
5	中期票据	--	--
6	地方政府债	--	--
7	可转换(可交换)债	--	--
8	其他	--	--
9	合计	101,250,528.00	19.56

5、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)	占基金总资产比例(%)
1	170009	17国债09	100,000	100,000.00	0.02
2	140213	14国债13	200,000	200,000.00	0.04
3	180032	18国债03	100,000	100,000.00	0.02
4	190031	19国债01	100,000	99,906.00	0.02
5	010107	01国债07	22,300	2,294,244.00	0.45

6、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资产支持证券投资明细
(无)

7、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
(无)

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十名权证投资明细
(无)

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
注: 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) 本期国债期货投资策略
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
(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)
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证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	76,026.06
2	应收证券清算款	2,496,893.96
3	应收股利	--
4	应收利息	1,522,074.21
5	应收申购款	6,999.21
7	待转资产	--
8	其他	--
9	合计	4,250,903.02